

# 华宝中证 1000 指数证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 03 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料已经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</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
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	14
4.10 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	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>17</b>
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	21
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>44</b>
8.1 期末基金资产组合情况	44

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	44
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	70
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	71
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	72
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	72
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	72
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	72
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	72
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	72
8.12 投资组合报告附注.....	72
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>73</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	73
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	74
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	74
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	74
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>74</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>74</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	74
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	74
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	74
11.4 基金投资策略的改变.....	74
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	74
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	75
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	75
11.8 其他重大事件.....	77
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>79</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	79
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	79
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>79</b>
13.1 备查文件目录.....	79
13.2 存放地点.....	79
13.3 查阅方式.....	79

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华宝中证 1000 指数证券投资基金
基金简称	华宝中证 1000 指数
场内简称	中证 1000 基金
基金主代码	162413
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 11 月 19 日
基金管理人	华宝基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	44,943,274.25 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，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周雷	李申
	联系电话	021-38505888	021-60637102
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050	021-60637111

传真	021-38505777	021-60635778
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	XIAOYI HELEN HUANG	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年 11 月 19 日（基金合同生效日）-2020 年 12 月 31 日
本期已实现收益	1,340,210.55	-806,024.66
本期利润	8,324,188.13	-257,707.12
加权平均基金份额本期利润	0.2030	-0.0063
本期加权平均净值利润率	19.13%	-0.64%
本期基金份额净值增长率	20.70%	-0.59%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	-74,658,360.33	-65,673,713.72
期末可供分配基金份额利润	-1.6612	-1.6914
期末基金资产	53,699,706.39	38,436,006.14

净值		
期末基金份额净值	1.1948	0.9899
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	19.98%	-0.59%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.49%	0.99%	7.77%	1.00%	-0.28%	-0.01%
过去六个月	12.62%	1.17%	12.45%	1.19%	0.17%	-0.02%
过去一年	20.70%	1.12%	19.52%	1.15%	1.18%	-0.03%
自基金合同生效起至今	19.98%	1.11%	18.93%	1.13%	1.05%	-0.02%

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

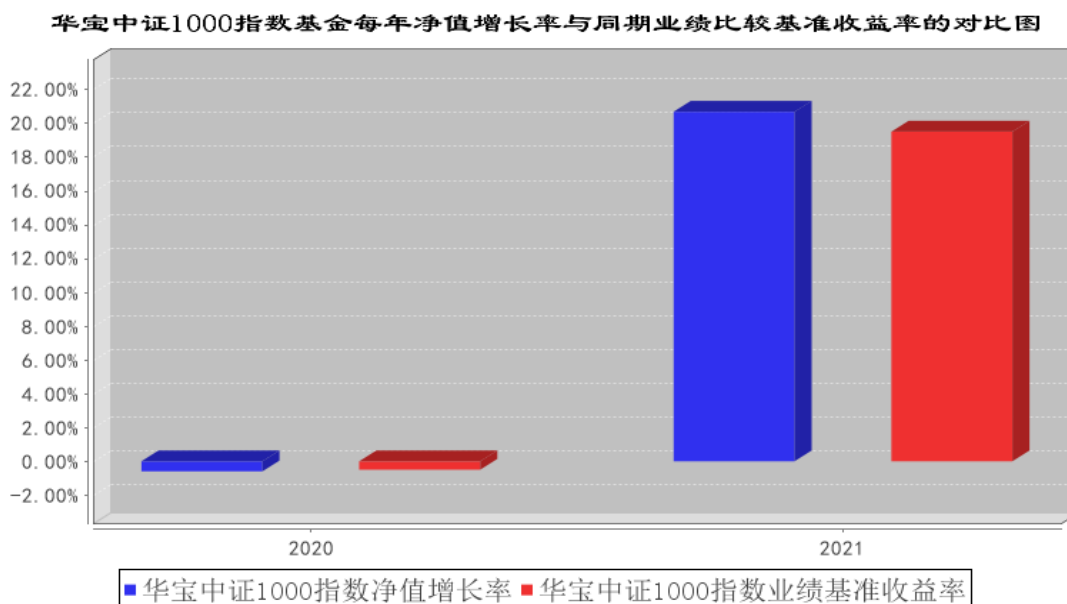
（2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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



注：按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至 2021 年 05 月 19 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金成立未满五年，基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金成立于2020年11月19日，成立至今未进行利润分配。



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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 12 月 31 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 125 只基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

丰晨成	本基金基金经理	2020-11-19	-	13 年	硕士。2009 年 7 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任助理产品经理、数量分析师、投资经理助理、投资经理等职务。2015 年 11 月起任上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2016 年 8 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2018 年 4 月至 2021 年 1 月任华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2018 年 6 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2018 年 8 月至 2020 年 11 月任华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金经理，2020 年 11 月起任华宝中证 1000 指数证券投资基金基金经理，2022 年 2 月起任华宝中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
-----	---------	------------	---	------	---

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《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遵规守信情况的说明

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、《华宝基金管理有限公司华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》及《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 公平交易制度和控制方法

基金管理人从研究分析、授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节出发制定了公司内部的公平交易制度以确保公司所有投资组合在各个环节得到公平的对待。公平交易制度和控制方法适用公司管理所有投资组合（包括公募基金、特定客户资产管理组合），对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

研究分析方面，公司使用统一的投资研究管理系统，并规定所有与投资业务相关的研究报告和股票入库信息必须在该系统中发表和存档。同时，该系统对所有投资组合经理设置相同的使用权限。

授权和投资决策方面，投资组合经理在其权限范围内的投资决策保持独立，并对其投资决策的结果负责。通过各个系统的权限设置使投资组合经理仅能看到自己的组合情况。

交易执行方面，所有投资组合的投资指令必须通过交易系统分发和执行。对于交易所公开竞价交易，交易系统内置公平交易执行程序。公司内部制度规定此类交易指令需执行公平交易程序，由交易部负责人负责执行。针对其他不能通过系统执行公平交易程序且必须以公司名义统一进行交易的指令，公司内部制定相关制度流程以确保此类交易的公允分配。同时，公司根据法规要求在交易系统中设置一系列投资禁止与限制指标对公平交易的执行进行事前控制，主要包括限制公司旗下组合自身及组合间反向交易、对敲交易、银行间关联方交易等。

事后监督，公司的风险管理部作为独立第三方对所有投资行为进行事后监督，主要监督的事项包括以下内容。

1) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析。

2) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合所有交易所二级市场交易进行 1 日、3 日、5 日同向交易价差分析。

3) 对公司管理的不同投资组合的所有银行间债券买卖和回购交易进行分析。监督的内容包括以下几点，同一投资组合短期内对同一债券的反向交易，债券买卖到期收益率与中债登估价收益率之间的差异，回购利率与当日市场平均利率之间的差异。对上述监督内容存在异常的情况要求投资组合经理进行合理性解释。

4) 对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程的公允性进行监督。

#### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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

回顾 2021 年，在百年变局和世纪疫情下，我国经济发展和疫情防控保持全球领先地位，国家战略科技力量加快壮大，产业链韧性得到提升，改革开放向纵深推进，新发展格局迈出新步伐，高质量发展取得新成效，实现了“十四五”良好开局。以上证综指计，A 股市场 1994 年以来首次年线三连阳。2021 年 A 股经历了半牛半熊的结构市：疫后持续的货币宽松、盈利恢复与商品涨价潮，新能源、新能源汽车、周期资源品板块全年表现最好，消费、医药、金融板块表现落后，年初开始机构抱团股持续杀估值，小盘股表现相对优于大盘股。作为 A 股市场小盘股的典型代表，中证 1000 指数从 3 月开始逐步走强，在货币流动性助推的一波向上，全年表现领涨所有宽基指数。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 20.70%，业绩比较基准收益率为 19.52%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年，疫情对经济活动的制约有望持续下降，外紧内松，美联储超常规政策的退坡将对全球流动性形成制约，国内存在宽松契机，货币政策迎来宽松时间窗口，新一轮宽信用周期将至。宏观经济处于疫后修复的余波中，2021 年的市场主要由盈利驱动，企业盈利增速在 2022 年逐级下台阶，全球错位复苏红利消失，亟需一轮政策放松对冲经济下行压力，宽货币或是途径明年有可能对政策放松构成制约的通胀也不再是问题。PPI 降温明显，CPI 最早在下半年温和回升。无风险利率延续下行趋势，宽货币带来估值扩张，政策基调偏宽尚未充分反映到估值中。2021 年年末中证 1000 指数的 PE (TTM) 估值 37 倍左右，从历史回顾来看，大盘股和中小盘股的相对强弱具有周期性，从 2021 年 3 月开始的中小盘股相对强势的市场风格有可能会在 2022 年延续，中证 1000 指数表征的小盘股在 2022 年的相对表现仍然值得期待。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

公司自 2003 年 3 月成立以来始终注重合规性和业务风险控制。加强对基金运作的内部操作风

风险控制、保障基金份额持有人的利益始终是公司制定各项内部制度、流程的指导思想。公司监察稽核部门对公司遵守各项法规和管理制度及公司所管理的各基金履行合同义务的情况进行核查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向监管部门、公司管理层及上级公司出具相关报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

（一）规范员工行为操守，加强职业道德教育和风险教育。公司通过对新员工集中组织岗前培训、签署《个人声明书》等形式，明确员工的行为准则，防范道德风险。并在具体工作中坚持加强法规培训，努力培养员工的风险意识、合法合规意识。

（二）完善公司制度体系。公司一方面坚持制度的刚性，不轻易改变、简化已确立的流程。要求从一般员工、部门经理到业务总监，每个人都必须清楚自己的权力和职责，承担相应责任。另一方面，伴随市场变革和产品创新，公司的业务和管理方式也发生着变化。在长期的业务实践中，公司借鉴和吸收海外股东、国内同行经验，在符合公司基本制度的前提下，根据业务的发展不时调整。允许各级员工在职责范围内设计和调整自己的业务流程，涉及其它部门或领域的，由相应级别的负责人在符合公司已有制度的基础上协调和批准。公司根据法律法规的变化、监管要求和业务情况不断调整和细化市场、营运、投资研究各方面的分工和业务规则，并根据内部控制委员会和监察稽核部门提出的意见、建议调整或改善了前、中、后台的业务流程。

（三）有重点地全面开展内部审计稽核工作。2021 年，合规审计部门按计划对公司营运、投资、市场部门进行了业务审计、依据各项监管规定对公司相关内部流程进行了评估、根据监管要求开展了涉及投研、运营、销售等方面的专项自查；并与相关部门进行沟通，形成后续跟踪和业务上相互促进的良性循环，不断提高工作质量。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，完善内控制度，提高工作水平，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无

#### 4.10 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

截至本报告期末，本基金基金资产净值存在连续超过六十个工作日低于五千万元的情形。根据相关规定，本基金管理人已拟定了相应的解决方案，并将方案报告监管机构。

## § 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本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 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2022）审字第 61471289_B28 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华宝中证 1000 指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了华宝中证 1000 指数证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的华宝中证 1000 指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华宝中证 1000 指数证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华宝中证 1000 指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	华宝中证 1000 指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

	<p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估华宝中证 1000 指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督华宝中证 1000 指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华宝中证 1000 指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华宝中证 1000 指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，</p>



	并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	许培菁	张亚旒
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2022 年 03 月 25 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	3,800,753.80	2,464,173.25
结算备付金		-	-
存出保证金		2,607.64	3,665.20
交易性金融资产	7.4.7.2	50,537,217.70	36,383,719.57
其中：股票投资		50,537,217.70	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		135,171.17	197,770.00
应收利息	7.4.7.5	391.78	265.12
应收股利		-	-
应收申购款		32,474.18	9,974.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		54,508,616.27	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 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		-	-
应付赎回款		585,600.26	426,114.79
应付管理人报酬		22,632.13	10,000.89
应付托管费		4,526.40	1,726.71
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	28,962.98	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	7.4.7.8	167,188.11	161,362.52
负债合计		808,909.88	623,561.22
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	107,408,959.29	92,794,990.81
未分配利润	7.4.7.10	-53,709,252.90	-54,358,984.67
所有者权益合计		53,699,706.39	38,436,006.14
负债和所有者权益总计		54,508,616.27	39,059,567.36

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1948 元，基金份额总额 44,943,274.25。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 11 月 19 日（基金 合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		8,977,101.00	-150,247.95
1. 利息收入		10,495.11	1,073.83
其中：存款利息收入	7.4.7.11	10,495.11	1,073.83
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）		1,968,388.60	-701,255.58
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,635,631.63	-699,849.99
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收	7.4.7.13.5	-	-

益			
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	332,756.97	-1,405.59
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	6,983,977.58	548,317.54
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	14,239.71	1,616.26
减：二、费用		652,912.87	107,459.17
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	216,938.71	23,675.01
2. 托管费	7.4.10.2.2	43,387.75	4,735.00
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	76,812.03	22,193.23
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	7.4.7.20	315,774.38	56,855.93
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,324,188.13	-257,707.12
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,324,188.13	-257,707.12

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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)	-	8,324,188.13	8,324,188.13
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	14,613,968.48	-7,674,456.36	6,939,512.12

(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	55,177,901.10	-30,433,973.51	24,743,927.59
2. 基金赎回款	-40,563,932.62	22,759,517.15	-17,804,415.47
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)	107,408,959.29	-53,709,252.90	53,699,706.39
项目	上年度可比期间 2020年11月19日(基金合同生效日)至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	100,098,448.68	-58,387,898.42	41,710,550.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-257,707.12	-257,707.12
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)	-7,303,457.87	4,286,620.87	-3,016,837.00
其中: 1. 基金申购款	825,039.77	-485,476.08	339,563.69
2. 基金赎回款	-8,128,497.64	4,772,096.95	-3,356,400.69
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)	92,794,990.81	-54,358,984.67	38,436,006.14

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

黄小慧

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、存托凭证和其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持

机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以按照法律法规和监管部门的有关规定进行融资以及参与转融通证券出借等相关业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金投资于中证 1000 指数成份股及其备选成份股的市值不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5% 的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券。

本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。

本财务报表已于 2022 年 3 月 25 日经本基金的基金管理人批准。

#### 7.4.2 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 7.4.4 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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。（1）金融资产分类 本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资等。（2）金融负债分类 本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。

本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回



基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；(5) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时计入转融通证券出借业务利息收入；(6) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；(7) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；(8) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；(9) 股指/国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；(10) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；(11) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；(12) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；(13) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法

差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金在符合有关基金分红条件的前提下可进行收益分配，每次收益分配比例等具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告；(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；红利再投资方式免收再投资的费用；如投资人在不同销售机构选择的分红方式不同，登记机构将以投资人最后一次选择的分红方式为准。登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，参照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。具体权益分配程序等有关事项参照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；(4) 每一基金份额享有同等分配权；(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

(1) 印花税 经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3% 调整为 1%； 经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变； 根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。(2) 增值税 根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入； 根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入； 根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人； 根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。(3) 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加 根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。(4) 企业所得税 根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税； 根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	3,800,753.80	2,464,173.25
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	3,800,753.80	2,464,173.25

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	44,475,693.23	50,537,217.70	6,061,524.47
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	44,475,693.23	50,537,217.70	6,061,524.47
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	37,306,172.68	36,383,719.57	-922,453.11
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	37,306,172.68	36,383,719.57	-922,453.11

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	390.27	263.24
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	-	-
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	0.19	0.01
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	1.32	1.87
合计	391.78	265.12

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	28,962.98	24,356.31
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	28,962.98	24,356.31

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,988.11	1,362.52
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	115,200.00	110,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	167,188.11	161,362.52

#### 7.4.7.9 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 12 月 31 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	23,088,152.31	55,177,901.10
本期赎回（以“-”号填列）	-16,973,386.64	-40,563,932.62
- 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	44,943,274.25	107,408,959.29

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-65,673,713.72	11,314,729.05	-54,358,984.67
本期利润	1,340,210.55	6,983,977.58	8,324,188.13
本期基金份额交易产生的变动数	-10,324,857.16	2,650,400.80	-7,674,456.36
其中：基金申购款	-38,990,210.20	8,556,236.69	-30,433,973.51
基金赎回款	28,665,353.04	-5,905,835.89	22,759,517.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-74,658,360.33	20,949,107.43	-53,709,252.90

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年11月19日（基金合同生效日）至2020年12月31日
活期存款利息收入	10,118.06	1,054.48
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	320.92	12.39
其他	56.13	6.96
合计	10,495.11	1,073.83

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年11月19日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,635,631.63	-699,849.99
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	1,635,631.63	-699,849.99

##### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年11月19日（基金合同

	日	生效日) 至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	23,943,009.99	8,384,921.05
减: 卖出股票成本总额	22,307,378.36	9,084,771.04
买卖股票差价收入	1,635,631.63	-699,849.99

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

##### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

#### 7.4.7.16 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 11 月 19 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	332,756.97	-1,405.59
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	332,756.97	-1,405.59

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 11 月 19 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日



	月 31 日	合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	6,983,977.58	548,317.54
股票投资	6,983,977.58	548,317.54
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	6,983,977.58	548,317.54

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 11 月 19 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	14,239.71	1,616.26
合计	14,239.71	1,616.26

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。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 11 月 19 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	76,812.03	22,193.23
银行间市场交易费用	-	-
合计	76,812.03	22,193.23

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 11 月 19 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	35,200.00	2,351.28
信息披露费	80,000.00	5,874.97
证券出借违约金	-	-
银行费用	574.38	205.00

指数使用费	200,000.00	48,424.68
合计	315,774.38	56,855.93

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华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
宝武集团财务有限责任公司(“宝武财务”)	受宝武集团控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年11月19日(基金合同生效日)至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	216,938.71	23,675.01
其中：支付销售机构的客户维护费	84,742.15	10,236.73

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 11 月 19 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	43,387.75	4,735.00

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

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

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

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 11 月 19 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	3,800,753.80	10,118.06	2,464,173.25	1,054.48

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末(2021年12月31日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年01月11日	新股流通受限	16.53	16.53	240	3,967.20	3,967.20	-

注：（1）根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

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

（3）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。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600072	中船科技	2021年12月29日	重大事项停牌	14.65	2022年01月13日	16.12	3,200	40,665.00	46,880.00	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 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。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪中证 1000 指数。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“以实现与跟踪指数相同”的风险收益目标。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司经营管理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。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。 本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款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（上年度末：同）。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

##### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(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)。

本基金所持证券均在证券交易所上市，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。本基金所持证券均在证券交易所上市，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。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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、结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					



银行存款	3,800,753.80	-	-	-	3,800,753.80
存出保证金	2,607.64	-	-	-	2,607.64
交易性金融资产	-	-	-	50,537,217.70	50,537,217.70
应收利息	-	-	-	391.78	391.78
应收申购款	1,153.90	-	-	31,320.28	32,474.18
应收证券清算款	-	-	-	135,171.17	135,171.17
资产总计	3,804,515.34	-	-	50,704,100.93	54,508,616.27
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	585,600.26	585,600.26
应付管理人报酬	-	-	-	22,632.13	22,632.13
应付托管费	-	-	-	4,526.40	4,526.40
应付交易费用	-	-	-	28,962.98	28,962.98
其他负债	-	-	-	167,188.11	167,188.11
负债总计	-	-	-	808,909.88	808,909.88
利率敏感度缺口	3,804,515.34	-	-	49,895,191.05	53,699,706.39
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	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。

#### 7.4.13.4.1.2 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)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金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。本基金投资于中证 1000 指数成份股及其备选成份股的市值不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5% 的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券。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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		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	50,537,217.70	94.11	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	50,537,217.70	94.11	36,383,719.57	94.66

#### 7.4.13.4.3.2 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	对资产负债表日基金资产净值的

	动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	1. 业绩比较基准上升 5%	2,633,242.18	-
	2. 业绩比较基准下降 5%	-2,633,242.18	-

注：于上年度末，本基金转型尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### （1）公允价值

##### （a）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银行存款、结算备付金、存出保证金、应收证  
券清算款、应收利息以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### （b）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  
层次的余额为人民币 50,486,370.50 元，属于第二层次的余额为人民币 50,847.20 元，无划分为  
第三层次余额（于上年度末，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人民币 36,361,795.57 元，属于第二层次的余额为人民币 21,924.00 元，  
无划分为第三层次余额）。

##### （ii）公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情  
况，本基金分别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不将相关证券等的  
公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

##### （iii）第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期未发  
生变动。

##### （2）承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

### (3) 其他事项

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号-金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号-金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号-套期会计》和《企业会计准则第 37 号-金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”）相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

除上述事项外，截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	50,537,217.70	92.71
	其中：股票	50,537,217.70	92.71
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	3,800,753.80	6.97
8	其他各项资产	170,644.77	0.31
9	合计	54,508,616.27	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	355,337.00	0.66
B	采矿业	1,394,324.32	2.60
C	制造业	36,155,691.88	67.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,327,580.72	2.47
E	建筑业	755,799.96	1.41

F	批发和零售业	1,283,015.60	2.39
G	交通运输、仓储和邮政业	797,508.50	1.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,427,229.45	8.24
J	金融业	738,817.70	1.38
K	房地产业	864,324.61	1.61
L	租赁和商务服务业	324,712.74	0.60
M	科学研究和技术服务业	761,208.52	1.42
N	水利、环境和公共设施管理业	733,587.90	1.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	6,300.00	0.01
Q	卫生和社会工作	167,308.00	0.31
R	文化、体育和娱乐业	358,890.40	0.67
S	综合	43,146.00	0.08
	合计	50,494,783.30	94.03

### 8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	16,712.40	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	25,722.00	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	42,434.40	0.08

### 8.2.3 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。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300012	华测检测	11,500	309,005.00	0.58
2	002176	江特电机	11,700	242,892.00	0.45
3	002240	盛新锂能	4,100	237,595.00	0.44
4	002497	雅化集团	7,800	223,548.00	0.42
5	600499	科达制造	9,000	223,380.00	0.42
6	002326	永太科技	4,296	219,998.16	0.41
7	603026	石大胜华	1,100	217,789.00	0.41
8	601058	赛轮轮胎	14,440	213,567.60	0.40
9	688598	金博股份	600	213,024.00	0.40
10	688116	天奈科技	1,400	209,006.00	0.39
11	300073	当升科技	2,400	208,488.00	0.39
12	002756	永兴材料	1,400	207,228.00	0.39
13	002625	光启技术	8,400	201,684.00	0.38
14	300568	星源材质	5,366	197,093.18	0.37
15	300769	德方纳米	400	196,464.00	0.37
16	300390	天华超净	2,400	194,400.00	0.36
17	688122	西部超导	2,000	193,880.00	0.36
18	002407	多氟多	4,200	188,958.00	0.35
19	002192	融捷股份	1,400	182,210.00	0.34
20	002036	联创电子	7,323	177,655.98	0.33
21	002402	和而泰	6,450	176,923.50	0.33
22	601677	明泰铝业	3,800	167,542.00	0.31
23	600711	盛屯矿业	15,300	164,169.00	0.31
24	002245	蔚蓝锂芯	5,900	162,309.00	0.30

25	000591	太阳能	14,460	161,952.00	0.30
26	002850	科达利	1,000	160,340.00	0.30
27	000831	五矿稀土	4,100	159,982.00	0.30
28	002025	航天电器	1,900	159,505.00	0.30
29	600110	诺德股份	9,900	157,905.00	0.29
30	300118	东方日升	4,800	155,856.00	0.29
31	002463	沪电股份	9,400	155,852.00	0.29
32	300725	药石科技	1,076	152,974.92	0.28
33	688388	嘉元科技	1,200	150,660.00	0.28
34	600096	云天化	7,600	149,112.00	0.28
35	002436	兴森科技	10,600	148,400.00	0.28
36	600771	广誉远	3,400	146,404.00	0.27
37	000423	东阿阿胶	3,000	146,250.00	0.27
38	002610	爱康科技	30,800	144,760.00	0.27
39	000762	西藏矿业	2,700	143,451.00	0.27
40	603606	东方电缆	2,800	143,248.00	0.27
41	000860	顺鑫农业	3,700	141,266.00	0.26
42	000818	航锦科技	3,800	141,018.00	0.26
43	603678	火炬电子	1,850	139,952.50	0.26
44	600338	西藏珠峰	3,700	139,342.00	0.26
45	688390	固德威	300	137,874.00	0.26
46	600559	老白干酒	4,905	137,045.70	0.26
47	300604	长川科技	2,380	136,850.00	0.25
48	600456	宝钛股份	1,900	136,382.00	0.25
49	000155	川能动力	5,100	135,303.00	0.25
50	600641	万业企业	4,040	134,410.80	0.25
51	002585	双星新材	4,890	132,421.20	0.25
52	002456	欧菲光	13,600	131,920.00	0.25
53	002139	拓邦股份	7,025	131,297.25	0.24
54	603236	移远通信	628	128,049.20	0.24
55	300373	扬杰科技	1,900	127,642.00	0.24
56	300339	润和软件	5,600	127,512.00	0.24
57	002312	川发龙蟒	9,700	126,876.00	0.24
58	000683	远兴能源	17,340	126,582.00	0.24
59	300850	新强联	700	124,957.00	0.23
60	300395	菲利华	1,900	124,906.00	0.23
61	603005	晶方科技	2,260	124,503.40	0.23
62	000516	国际医学	11,200	123,536.00	0.23
63	002597	金禾实业	2,400	123,240.00	0.23
64	600882	妙可蓝多	2,200	123,200.00	0.23
65	002738	中矿资源	1,700	119,612.00	0.22
66	601222	林洋能源	9,808	118,971.04	0.22

67	002617	露笑科技	7,799	118,544.80	0.22
68	300777	中简科技	1,900	117,572.00	0.22
69	002389	航天彩虹	4,200	116,760.00	0.22
70	300327	中颖电子	1,718	116,652.20	0.22
71	300458	全志科技	1,806	114,283.68	0.21
72	002531	天顺风能	5,880	114,013.20	0.21
73	300054	鼎龙股份	4,640	112,937.60	0.21
74	600873	梅花生物	14,700	112,749.00	0.21
75	002558	巨人网络	9,400	112,518.00	0.21
76	600596	新安股份	4,500	112,455.00	0.21
77	300346	南大光电	2,400	111,456.00	0.21
78	300672	国科微	600	111,300.00	0.21
79	300726	宏达电子	1,100	110,066.00	0.20
80	605117	德业股份	400	109,516.00	0.20
81	300035	中科电气	3,600	108,900.00	0.20
82	300679	电连技术	2,045	107,362.50	0.20
83	600416	湘电股份	4,900	107,261.00	0.20
84	002145	中核钛白	8,500	107,015.00	0.20
85	605111	新洁能	600	106,860.00	0.20
86	300502	新易盛	2,725	106,765.50	0.20
87	688408	中信博	600	105,906.00	0.20
88	000875	吉电股份	11,600	105,444.00	0.20
89	300748	金力永磁	2,320	104,144.80	0.19
90	000933	神火股份	11,400	103,626.00	0.19
91	300476	胜宏科技	3,420	103,455.00	0.19
92	300083	创世纪	7,200	102,816.00	0.19
93	300775	三角防务	2,100	102,669.00	0.19
94	688200	华峰测控	200	102,380.00	0.19
95	300567	精测电子	1,400	101,402.00	0.19
96	300682	朗新科技	2,700	99,981.00	0.19
97	688139	海尔生物	1,100	99,902.00	0.19
98	688016	心脉医疗	400	99,496.00	0.19
99	688301	奕瑞科技	200	99,380.00	0.19
100	600100	同方股份	16,400	98,892.00	0.18
101	002151	北斗星通	2,500	98,125.00	0.18
102	603596	伯特利	1,400	97,440.00	0.18
103	688202	美迪西	200	97,118.00	0.18
104	600151	航天机电	7,000	96,950.00	0.18
105	300438	鹏辉能源	2,050	96,842.00	0.18
106	300034	钢研高纳	1,679	96,710.40	0.18
107	002541	鸿路钢构	1,800	96,372.00	0.18
108	002484	江海股份	3,516	96,057.12	0.18



109	002747	埃斯顿	3,700	96,015.00	0.18
110	300623	捷捷微电	3,030	95,323.80	0.18
111	600179	安通控股	25,000	95,250.00	0.18
112	601258	庞大集团	57,700	94,628.00	0.18
113	300379	东方通	3,200	94,496.00	0.18
114	601908	京运通	10,200	93,534.00	0.17
115	002091	江苏国泰	6,760	92,814.80	0.17
116	000829	天音控股	5,000	92,200.00	0.17
116	688298	东方生物	400	92,200.00	0.17
117	002643	万润股份	3,900	92,196.00	0.17
118	600378	昊华科技	1,900	91,580.00	0.17
119	300432	富临精工	3,100	91,140.00	0.17
120	300171	东富龙	1,800	90,972.00	0.17
121	601678	滨化股份	11,400	90,858.00	0.17
122	600773	西藏城投	3,200	90,432.00	0.17
123	603588	高能环境	5,110	89,782.70	0.17
124	300671	富满微	1,100	89,155.00	0.17
125	300079	数码视讯	9,900	87,417.00	0.16
126	600330	天通股份	5,380	87,317.40	0.16
127	603129	春风动力	500	86,500.00	0.16
128	002706	良信股份	4,850	86,427.00	0.16
129	600577	精达股份	11,600	86,304.00	0.16
130	002810	山东赫达	1,400	86,198.00	0.16
131	300151	昌红科技	2,100	85,890.00	0.16
132	002318	久立特材	4,800	85,824.00	0.16
133	300767	震安科技	820	85,567.00	0.16
134	000503	国新健康	5,000	84,500.00	0.16
135	688050	爱博医疗	400	84,092.00	0.16
136	300747	锐科激光	1,412	83,463.32	0.16
137	600273	嘉化能源	7,200	83,304.00	0.16
138	300393	中来股份	4,327	82,386.08	0.15
139	601375	中原证券	16,700	81,997.00	0.15
140	300776	帝尔激光	320	81,888.00	0.15
141	600777	新潮能源	35,700	81,396.00	0.15
142	300773	拉卡拉	2,800	81,256.00	0.15
143	688339	亿华通	300	81,255.00	0.15
144	300036	超图软件	2,700	81,135.00	0.15
145	300451	创业慧康	7,257	81,133.26	0.15
146	601399	国机重装	20,500	80,975.00	0.15
147	300457	赢合科技	2,625	80,640.00	0.15
148	300685	艾德生物	1,060	80,040.60	0.15
149	601777	力帆科技	12,900	79,851.00	0.15

150	300185	通裕重工	22,100	79,560.00	0.15
151	300409	道氏技术	3,260	79,055.00	0.15
152	300294	博雅生物	2,050	78,617.50	0.15
153	601208	东材科技	4,500	78,075.00	0.15
154	600210	紫江企业	8,500	78,030.00	0.15
155	000902	新洋丰	4,600	77,694.00	0.14
156	600363	联创光电	2,500	77,600.00	0.14
157	600277	亿利洁能	14,720	77,574.40	0.14
158	603690	至纯科技	1,600	77,040.00	0.14
159	002727	一心堂	2,000	77,020.00	0.14
160	601567	三星医疗	4,700	76,657.00	0.14
161	601311	骆驼股份	5,000	76,650.00	0.14
162	603308	应流股份	3,400	75,888.00	0.14
163	603688	石英股份	1,200	75,732.00	0.14
164	002123	梦网科技	4,400	75,680.00	0.14
165	002851	麦格米特	2,350	75,247.00	0.14
166	603027	千禾味业	3,124	75,225.92	0.14
167	688023	安恒信息	300	75,222.00	0.14
168	002063	远光软件	7,508	74,629.52	0.14
169	000035	中国天楹	12,400	74,524.00	0.14
170	002171	楚江新材	5,600	74,256.00	0.14
171	002258	利尔化学	2,200	74,206.00	0.14
172	603599	广信股份	1,900	74,100.00	0.14
173	603906	龙蟠科技	2,000	74,080.00	0.14
174	300638	广和通	1,354	73,793.00	0.14
175	600323	瀚蓝环境	3,500	73,430.00	0.14
176	002182	云海金属	3,200	73,408.00	0.14
177	603128	华贸物流	5,340	73,051.20	0.14
178	002335	科华数据	2,000	72,720.00	0.14
179	002332	仙琚制药	5,500	72,600.00	0.14
180	600583	海油工程	15,700	72,377.00	0.13
181	600459	贵研铂业	2,835	72,150.75	0.13
182	002960	青鸟消防	1,479	71,805.45	0.13
183	600850	电科数字	2,100	71,673.00	0.13
184	603520	司太立	1,100	71,500.00	0.13
185	600055	万东医疗	3,000	71,430.00	0.13
186	601126	四方股份	3,400	71,060.00	0.13
187	002675	东诚药业	4,500	71,010.00	0.13
188	000403	派林生物	2,533	70,999.99	0.13
189	600587	新华医疗	2,200	70,840.00	0.13
190	600252	中恒集团	18,300	70,638.00	0.13
191	002126	银轮股份	5,600	70,336.00	0.13

192	600812	华北制药	5,900	70,328.00	0.13
193	600986	浙文互联	8,340	70,306.20	0.13
194	000049	德赛电池	1,205	70,275.60	0.13
195	603008	喜临门	1,800	70,254.00	0.13
196	601666	平煤股份	8,300	69,471.00	0.13
197	688033	天宜上佳	2,100	69,405.00	0.13
198	603179	新泉股份	1,600	69,248.00	0.13
199	002413	雷科防务	9,300	69,099.00	0.13
200	300487	蓝晓科技	700	68,845.00	0.13
201	600206	有研新材	4,200	68,796.00	0.13
202	300188	美亚柏科	4,000	68,760.00	0.13
203	300101	振芯科技	3,100	68,758.00	0.13
204	300298	三诺生物	2,280	68,194.80	0.13
205	300068	南都电源	4,800	67,968.00	0.13
206	603489	八方股份	300	67,680.00	0.13
207	000917	电广传媒	10,000	67,600.00	0.13
208	600586	金晶科技	7,300	67,598.00	0.13
209	603713	密尔克卫	500	67,390.00	0.13
210	300803	指南针	1,700	67,269.00	0.13
211	002214	大立科技	3,400	67,116.00	0.12
212	000650	仁和药业	7,200	67,104.00	0.12
213	000951	中国重汽	3,960	66,884.40	0.12
214	300087	荃银高科	2,200	66,880.00	0.12
215	002254	泰和新材	3,400	66,674.00	0.12
216	600977	中国电影	5,200	66,612.00	0.12
217	002544	杰赛科技	2,800	66,472.00	0.12
218	300674	宇信科技	2,780	66,442.00	0.12
219	601137	博威合金	2,800	66,080.00	0.12
220	002626	金达威	2,100	65,793.00	0.12
221	600877	声光电科	4,200	65,772.00	0.12
222	603098	森特股份	1,400	65,758.00	0.12
223	600305	恒顺醋业	4,116	65,650.20	0.12
224	600685	中船防务	2,800	65,324.00	0.12
225	300055	万邦达	5,000	65,100.00	0.12
226	300203	聚光科技	2,300	64,998.00	0.12
227	603279	景津装备	1,400	64,932.00	0.12
228	002041	登海种业	2,500	64,475.00	0.12
229	603583	捷昌驱动	1,292	64,121.96	0.12
230	002984	森麒麟	1,800	64,026.00	0.12
231	300233	金城医药	2,200	63,998.00	0.12
232	688333	铂力特	300	63,900.00	0.12
233	002291	星期六	3,200	63,872.00	0.12

234	601369	陕鼓动力	4,900	63,798.00	0.12
235	601212	白银有色	20,900	63,745.00	0.12
236	600483	福能股份	3,900	63,492.00	0.12
237	002099	海翔药业	7,700	63,448.00	0.12
238	300369	绿盟科技	4,000	63,440.00	0.12
239	300737	科顺股份	3,900	63,375.00	0.12
240	300031	宝通科技	2,300	63,365.00	0.12
241	600057	厦门象屿	7,426	63,046.74	0.12
242	600688	上海石化	15,100	62,967.00	0.12
243	600116	三峡水利	5,400	62,964.00	0.12
244	002015	协鑫能科	3,800	62,548.00	0.12
245	300861	美畅股份	800	62,216.00	0.12
246	600366	宁波韵升	4,700	62,087.00	0.12
247	300348	长亮科技	3,950	61,896.50	0.12
248	603039	泛微网络	887	61,885.99	0.12
249	300323	华灿光电	5,100	61,506.00	0.11
250	600063	皖维高新	10,000	61,300.00	0.11
251	300131	英唐智控	7,500	61,050.00	0.11
252	600963	岳阳林纸	7,730	60,912.40	0.11
253	000657	中钨高新	3,780	60,782.40	0.11
254	603876	鼎胜新材	1,600	60,240.00	0.11
255	300027	华谊兄弟	15,200	60,192.00	0.11
256	688516	奥特维	244	59,955.68	0.11
257	600246	万通发展	5,600	59,696.00	0.11
258	002216	三全食品	2,950	59,619.50	0.11
259	600562	国睿科技	3,232	59,404.16	0.11
260	002839	张家港行	10,300	59,328.00	0.11
261	002807	江阴银行	15,400	59,290.00	0.11
262	600075	新疆天业	7,180	59,019.60	0.11
263	002097	山河智能	6,100	58,987.00	0.11
264	688266	泽璟制药	1,000	58,800.00	0.11
265	600267	海正药业	4,200	58,758.00	0.11
266	002130	沃尔核材	7,100	58,575.00	0.11
266	002261	拓维信息	7,100	58,575.00	0.11
267	002023	海特高新	4,300	58,523.00	0.11
268	688106	金宏气体	2,100	58,401.00	0.11
269	002539	云图控股	4,400	58,388.00	0.11
270	600481	双良节能	5,800	58,348.00	0.11
271	000672	上峰水泥	2,900	58,203.00	0.11
272	688066	航天宏图	800	58,160.00	0.11
273	688508	芯朋微	500	57,930.00	0.11
274	600966	博汇纸业	5,600	57,904.00	0.11

275	601001	晋控煤业	6,000	57,660.00	0.11
276	600328	中盐化工	3,500	57,435.00	0.11
277	600740	山西焦化	9,236	57,355.56	0.11
278	000727	冠捷科技	19,000	57,190.00	0.11
279	603733	仙鹤股份	1,400	57,134.00	0.11
280	688018	乐鑫科技	300	57,012.00	0.11
281	002239	奥特佳	15,600	56,940.00	0.11
281	603187	海容冷链	1,200	56,940.00	0.11
282	600185	格力地产	8,180	56,523.80	0.11
283	002639	雪人股份	3,800	56,506.00	0.11
284	002832	比音勒芬	2,220	56,499.00	0.11
285	300398	飞凯材料	2,320	56,051.20	0.10
286	000893	亚钾国际	2,100	55,965.00	0.10
287	000426	兴业矿业	7,700	55,748.00	0.10
288	300224	正海磁材	3,250	55,510.00	0.10
289	002859	洁美科技	1,480	55,056.00	0.10
290	002906	华阳集团	1,000	54,960.00	0.10
291	300573	兴齐眼药	400	54,720.00	0.10
292	600993	马应龙	1,900	54,644.00	0.10
293	688019	安集科技	200	54,640.00	0.10
294	002108	沧州明珠	6,942	54,286.44	0.10
295	600197	伊力特	2,000	54,240.00	0.10
296	600682	南京新百	4,600	54,096.00	0.10
297	600490	鹏欣资源	11,100	54,057.00	0.10
298	002079	苏州固锝	4,000	54,000.00	0.10
299	603565	中谷物流	1,900	53,941.00	0.10
300	600129	太极集团	2,400	53,904.00	0.10
301	002262	恩华药业	3,436	53,773.40	0.10
302	000969	安泰科技	5,000	53,550.00	0.10
302	300319	麦捷科技	3,500	53,550.00	0.10
303	600320	振华重工	14,200	53,534.00	0.10
304	002022	科华生物	3,600	53,424.00	0.10
305	002217	合力泰	15,300	53,397.00	0.10
306	601028	玉龙股份	2,800	53,312.00	0.10
307	002773	康弘药业	2,600	52,910.00	0.10
308	300973	立高食品	400	52,832.00	0.10
309	688017	绿的谐波	300	52,368.00	0.10
310	000034	神州数码	3,300	52,239.00	0.10
311	300326	凯利泰	4,900	52,234.00	0.10
312	300613	富瀚微	320	52,176.00	0.10
313	300377	赢时胜	4,200	51,954.00	0.10
314	600635	大众公用	13,700	51,923.00	0.10

315	000016	深康佳 A	7,900	51,745.00	0.10
316	002163	海南发展	4,400	51,700.00	0.10
317	600552	凯盛科技	4,400	51,568.00	0.10
318	688007	光峰科技	1,500	51,525.00	0.10
319	688166	博瑞医药	1,400	51,394.00	0.10
320	600621	华鑫股份	3,700	51,208.00	0.10
321	300236	上海新阳	1,250	51,062.50	0.10
322	002283	天润工业	5,400	50,976.00	0.09
323	002425	凯撒文化	5,280	50,899.20	0.09
324	300287	飞利信	8,300	50,879.00	0.09
325	002135	东南网架	4,400	50,864.00	0.09
326	688198	佰仁医疗	200	50,860.00	0.09
327	601519	大智慧	6,900	50,853.00	0.09
328	002612	朗姿股份	1,600	50,736.00	0.09
329	002534	杭锅股份	1,600	50,704.00	0.09
330	688037	芯源微	300	50,640.00	0.09
331	002206	海利得	5,700	50,616.00	0.09
332	300352	北信源	8,275	50,477.50	0.09
333	002567	唐人神	6,750	50,422.50	0.09
334	002400	省广集团	9,800	50,274.00	0.09
335	603979	金诚信	2,334	50,134.32	0.09
336	000612	焦作万方	6,500	50,115.00	0.09
337	601918	新集能源	11,000	49,940.00	0.09
338	002759	天际股份	1,700	49,810.00	0.09
339	300662	科锐国际	800	49,768.00	0.09
340	600295	鄂尔多斯	2,100	49,539.00	0.09
341	002274	华昌化工	3,900	49,413.00	0.09
342	000976	华铁股份	8,900	49,395.00	0.09
343	300855	图南股份	700	49,343.00	0.09
344	000767	晋控电力	13,100	49,256.00	0.09
345	002100	天康生物	4,600	49,220.00	0.09
346	300065	海兰信	3,225	49,213.50	0.09
347	300470	中密控股	1,100	49,137.00	0.09
348	002837	英维克	1,200	49,068.00	0.09
349	600360	华微电子	5,400	49,032.00	0.09
350	600496	精工钢构	11,500	48,990.00	0.09
351	600285	羚锐制药	3,100	48,980.00	0.09
352	000712	锦龙股份	3,100	48,825.00	0.09
352	000848	承德露露	4,500	48,825.00	0.09
353	300497	富祥药业	2,988	48,794.04	0.09
354	000059	华锦股份	6,700	48,776.00	0.09
355	603919	金徽酒	1,260	48,648.60	0.09

356	300075	数字政通	2,700	48,600.00	0.09
357	000811	冰轮环境	3,150	48,478.50	0.09
358	601965	中国汽研	2,600	48,386.00	0.09
359	000546	金圆股份	3,600	48,348.00	0.09
360	600797	浙大网新	7,100	48,280.00	0.09
361	600578	京能电力	14,300	48,048.00	0.09
362	002649	博彦科技	4,100	47,888.00	0.09
363	688158	优刻得	1,800	47,736.00	0.09
364	300663	科蓝软件	2,250	47,722.50	0.09
365	300456	赛微电子	1,940	47,646.40	0.09
366	002556	辉隆股份	3,700	47,619.00	0.09
367	300821	东岳硅材	2,600	47,528.00	0.09
368	603997	继峰股份	2,950	47,436.00	0.09
369	300666	江丰电子	900	47,322.00	0.09
370	603113	金能科技	2,900	47,270.00	0.09
371	002498	汉缆股份	9,100	47,047.00	0.09
372	300355	蒙草生态	8,700	46,980.00	0.09
373	000921	海信家电	3,100	46,965.00	0.09
374	002698	博实股份	3,600	46,944.00	0.09
375	600072	中船科技	3,200	46,880.00	0.09
376	600123	兰花科创	5,000	46,850.00	0.09
377	002237	恒邦股份	4,000	46,760.00	0.09
378	300696	爱乐达	900	46,746.00	0.09
379	000582	北部湾港	5,800	46,632.00	0.09
380	002324	普利特	3,300	46,596.00	0.09
381	000735	罗牛山	6,500	46,345.00	0.09
382	002726	龙大肉食	4,424	46,275.04	0.09
383	300394	天孚通信	1,260	46,116.00	0.09
384	000627	天茂集团	13,900	46,009.00	0.09
385	300627	华测导航	1,000	46,000.00	0.09
386	002276	万马股份	5,100	45,951.00	0.09
387	002467	二六三	9,530	45,934.60	0.09
388	600984	建设机械	4,100	45,920.00	0.09
389	600720	祁连山	4,400	45,760.00	0.09
390	000682	东方电子	5,400	45,738.00	0.09
391	300184	力源信息	6,540	45,387.60	0.08
392	300659	中孚信息	1,000	45,350.00	0.08
393	300007	汉威科技	1,500	45,330.00	0.08
394	600059	古越龙山	3,700	45,251.00	0.08
395	601952	苏垦农发	3,790	45,138.90	0.08
396	300222	科大智能	3,820	45,114.20	0.08
397	600223	鲁商发展	3,400	45,050.00	0.08

398	601619	嘉泽新能	8,700	44,892.00	0.08
398	603305	旭升股份	900	44,892.00	0.08
399	002106	莱宝高科	3,900	44,889.00	0.08
400	300263	隆华科技	4,400	44,880.00	0.08
401	002581	未名医药	2,100	44,835.00	0.08
402	600391	航发科技	1,600	44,800.00	0.08
403	300598	诚迈科技	700	44,793.00	0.08
404	300633	开立医疗	1,400	44,702.00	0.08
405	688277	天智航	1,700	44,625.00	0.08
406	000543	皖能电力	8,000	44,480.00	0.08
407	002928	华夏航空	3,525	44,415.00	0.08
408	000923	河钢资源	3,100	44,330.00	0.08
409	002481	双塔食品	5,200	44,304.00	0.08
410	300180	华峰超纤	8,800	44,264.00	0.08
411	603393	新天然气	1,784	43,939.92	0.08
412	002226	江南化工	7,360	43,792.00	0.08
413	600761	安徽合力	3,500	43,785.00	0.08
414	300143	盈康生命	3,100	43,772.00	0.08
415	300303	聚飞光电	7,240	43,729.60	0.08
416	688133	泰坦科技	200	43,640.00	0.08
417	603881	数据港	1,180	43,565.60	0.08
418	000927	中国铁物	12,300	43,542.00	0.08
419	300702	天宇股份	900	43,515.00	0.08
420	300525	博思软件	1,860	43,486.80	0.08
421	300219	鸿利智汇	2,750	43,477.50	0.08
422	600491	龙元建设	6,300	43,407.00	0.08
423	603323	苏农银行	8,910	43,391.70	0.08
424	600864	哈投股份	7,100	43,381.00	0.08
425	601011	宝泰隆	8,200	43,378.00	0.08
426	002967	广电计量	1,600	43,328.00	0.08
427	002428	云南锗业	3,600	43,200.00	0.08
427	300770	新媒股份	720	43,200.00	0.08
428	300102	乾照光电	4,800	43,152.00	0.08
429	600770	综艺股份	5,400	43,146.00	0.08
430	600742	一汽富维	3,596	43,008.16	0.08
431	000928	中钢国际	4,620	42,966.00	0.08
432	300170	汉得信息	5,000	42,950.00	0.08
433	601890	亚星锚链	4,600	42,734.00	0.08
434	002222	福晶科技	2,250	42,592.50	0.08
435	002020	京新药业	4,460	42,414.60	0.08
436	300226	上海钢联	1,043	42,397.95	0.08
437	688027	国盾量子	244	42,309.60	0.08



438	600452	涪陵电力	2,100	42,294.00	0.08
439	300267	尔康制药	8,900	42,186.00	0.08
440	300123	亚光科技	4,640	42,084.80	0.08
441	605376	博迁新材	500	42,015.00	0.08
442	000555	神州信息	3,300	41,976.00	0.08
443	300602	飞荣达	1,669	41,908.59	0.08
444	000795	英洛华	4,900	41,895.00	0.08
445	002421	达实智能	10,800	41,688.00	0.08
446	002201	正威新材	1,980	41,619.60	0.08
447	603936	博敏电子	2,400	41,280.00	0.08
448	600612	老凤祥	900	41,265.00	0.08
449	000676	智度股份	5,300	41,181.00	0.08
450	000793	华闻集团	14,000	41,160.00	0.08
451	600389	江山股份	1,000	41,120.00	0.08
452	603301	振德医疗	800	41,096.00	0.08
453	603718	海利生物	2,685	41,080.50	0.08
454	603686	福龙马	2,860	41,069.60	0.08
455	600169	太原重工	14,300	41,041.00	0.08
456	000789	万年青	3,350	40,937.00	0.08
457	603348	文灿股份	700	40,887.00	0.08
458	600422	昆药集团	3,700	40,885.00	0.08
459	603766	隆鑫通用	7,400	40,774.00	0.08
460	002190	成飞集成	1,200	40,524.00	0.08
461	000966	长源电力	5,500	40,315.00	0.08
462	002930	宏川智慧	1,558	40,274.30	0.07
463	603612	索通发展	1,960	40,219.20	0.07
464	002293	罗莱生活	2,800	40,124.00	0.07
465	603018	华设集团	4,788	40,027.68	0.07
466	603960	克来机电	1,100	40,018.00	0.07
467	600105	永鼎股份	7,440	39,952.80	0.07
468	002488	金固股份	4,550	39,949.00	0.07
469	002158	汉钟精机	1,500	39,945.00	0.07
470	300639	凯普生物	1,353	39,927.03	0.07
471	002611	东方精工	7,140	39,841.20	0.07
472	600211	西藏药业	760	39,793.60	0.07
473	603298	杭叉集团	2,320	39,788.00	0.07
474	300232	洲明科技	4,448	39,765.12	0.07
475	603429	集友股份	1,520	39,672.00	0.07
476	002310	东方园林	13,300	39,634.00	0.07
477	002518	科士达	1,575	39,532.50	0.07
478	000539	粤电力 A	6,400	39,360.00	0.07
479	000801	四川九洲	4,100	39,319.00	0.07

479	600990	四创电子	700	39,319.00	0.07
480	300158	振东制药	4,800	39,312.00	0.07
481	002777	久远银海	1,420	39,263.00	0.07
482	300091	金通灵	6,220	39,248.20	0.07
483	002913	奥士康	500	39,210.00	0.07
484	000901	航天科技	3,793	39,181.69	0.07
485	002635	安洁科技	2,300	39,169.00	0.07
486	603915	国茂股份	1,000	38,900.00	0.07
487	300401	花园生物	2,700	38,826.00	0.07
488	000915	华特达因	1,270	38,684.20	0.07
489	300735	光弘科技	2,566	38,669.62	0.07
490	300149	睿智医药	2,800	38,668.00	0.07
491	002614	奥佳华	3,000	38,640.00	0.07
492	300119	瑞普生物	1,600	38,592.00	0.07
493	603989	艾华集团	930	38,502.00	0.07
494	300177	中海达	4,050	38,313.00	0.07
495	300085	银之杰	2,500	38,300.00	0.07
496	603826	坤彩科技	1,000	38,280.00	0.07
497	002446	盛路通信	6,320	38,236.00	0.07
498	601015	陕西黑猫	5,900	38,232.00	0.07
499	600108	亚盛集团	10,800	38,124.00	0.07
500	300053	欧比特	3,745	38,086.65	0.07
501	603108	润达医疗	2,840	38,084.40	0.07
502	002055	得润电子	2,600	37,986.00	0.07
503	600751	海航科技	12,700	37,846.00	0.07
504	600428	中远海特	7,500	37,800.00	0.07
505	688366	昊海生科	300	37,767.00	0.07
506	000688	国城矿业	2,700	37,746.00	0.07
507	000615	奥园美谷	3,500	37,730.00	0.07
508	300406	九强生物	1,900	37,658.00	0.07
509	603916	苏博特	1,460	37,609.60	0.07
510	603068	博通集成	700	37,492.00	0.07
511	600477	杭萧钢构	9,070	37,459.10	0.07
512	600458	时代新材	2,700	37,395.00	0.07
513	600420	国药现代	3,600	37,332.00	0.07
514	002833	弘亚数控	1,160	37,328.80	0.07
515	688586	江航装备	1,100	37,290.00	0.07
516	603601	再升科技	3,000	37,230.00	0.07
517	300045	华力创通	3,200	37,216.00	0.07
518	600073	上海梅林	4,600	37,214.00	0.07
519	601609	金田铜业	4,300	37,195.00	0.07
520	300768	迪普科技	900	37,125.00	0.07

521	000030	富奥股份	5,000	37,100.00	0.07
522	600217	中再资环	4,900	37,093.00	0.07
523	300755	华致酒行	740	37,059.20	0.07
524	600789	鲁抗医药	4,940	37,000.60	0.07
525	600810	神马股份	2,960	36,852.00	0.07
526	300109	新开源	1,674	36,493.20	0.07
527	000603	盛达资源	2,900	36,482.00	0.07
528	000935	四川双马	1,500	36,450.00	0.07
529	600503	华丽家族	11,300	36,386.00	0.07
530	002043	兔宝宝	3,000	36,240.00	0.07
531	300762	上海瀚讯	1,320	36,194.40	0.07
532	600114	东睦股份	3,080	36,190.00	0.07
533	600531	豫光金铅	6,000	36,180.00	0.07
534	002803	吉宏股份	1,700	36,091.00	0.07
535	688268	华特气体	400	36,080.00	0.07
536	300657	弘信电子	2,180	35,991.80	0.07
537	300709	精研科技	600	35,970.00	0.07
538	600308	华泰股份	5,800	35,902.00	0.07
539	600343	航天动力	2,600	35,880.00	0.07
540	300596	利安隆	800	35,808.00	0.07
541	002351	漫步者	3,050	35,746.00	0.07
542	002646	青青稞酒	1,700	35,683.00	0.07
543	000903	云内动力	9,800	35,672.00	0.07
544	002741	光华科技	1,700	35,666.00	0.07
545	002232	启明信息	1,600	35,616.00	0.07
546	600502	安徽建工	8,556	35,507.40	0.07
547	000823	超声电子	2,600	35,412.00	0.07
548	300624	万兴科技	640	35,270.40	0.07
549	300477	合纵科技	4,360	35,098.00	0.07
550	000592	平潭发展	11,100	35,076.00	0.07
551	688520	神州细胞	600	35,070.00	0.07
552	000710	贝瑞基因	1,800	34,920.00	0.07
553	001696	宗申动力	4,800	34,896.00	0.06
554	600512	腾达建设	10,700	34,882.00	0.06
555	002449	国星光电	3,230	34,819.40	0.06
556	300194	福安药业	6,800	34,816.00	0.06
557	300378	鼎捷软件	1,450	34,800.00	0.06
557	301035	润丰股份	600	34,800.00	0.06
557	603896	寿仙谷	600	34,800.00	0.06
558	600581	八一钢铁	5,600	34,776.00	0.06
559	600933	爱柯迪	1,800	34,704.00	0.06
560	300322	硕贝德	2,500	34,700.00	0.06

561	002537	海联金汇	4,880	34,648.00	0.06
562	603043	广州酒家	1,440	34,646.40	0.06
563	300738	奥飞数据	1,520	34,504.00	0.06
564	000560	我爱我家	10,980	34,477.20	0.06
565	300114	中航电测	1,950	34,476.00	0.06
566	688100	威胜信息	1,000	34,430.00	0.06
567	600662	外服控股	4,800	34,368.00	0.06
568	300792	壹网壹创	700	34,300.00	0.06
569	002847	盐津铺子	400	34,240.00	0.06
570	600395	盘江股份	4,700	34,169.00	0.06
571	300134	大富科技	2,700	34,128.00	0.06
572	300078	思创医惠	4,624	34,125.12	0.06
573	300761	立华股份	900	34,029.00	0.06
574	000088	盐田港	6,400	33,920.00	0.06
575	300132	青松股份	3,000	33,870.00	0.06
576	002218	拓日新能	5,000	33,800.00	0.06
577	605168	三人行	200	33,798.00	0.06
578	002746	仙坛股份	3,215	33,725.35	0.06
579	603368	柳药股份	1,770	33,700.80	0.06
580	603033	三维股份	1,300	33,618.00	0.06
581	600326	西藏天路	5,200	33,540.00	0.06
582	600750	江中药业	2,320	33,524.00	0.06
583	002918	蒙娜丽莎	1,170	33,497.10	0.06
584	300653	正海生物	500	33,385.00	0.06
585	002285	世联行	8,500	33,320.00	0.06
586	600876	洛阳玻璃	900	33,201.00	0.06
587	600523	贵航股份	1,360	33,184.00	0.06
588	600331	宏达股份	10,400	33,176.00	0.06
589	300867	圣元环保	1,200	33,084.00	0.06
590	300208	青岛中程	3,050	33,062.00	0.06
591	600557	康缘药业	2,700	33,048.00	0.06
592	000851	高鸿股份	5,500	32,890.00	0.06
593	600997	开滦股份	4,600	32,752.00	0.06
594	300020	银江技术	3,700	32,745.00	0.06
595	300429	强力新材	2,703	32,706.30	0.06
596	601929	吉视传媒	14,500	32,625.00	0.06
597	603118	共进股份	3,400	32,504.00	0.06
598	601606	长城军工	2,500	32,475.00	0.06
599	603959	百利科技	2,056	32,402.56	0.06
600	600103	青山纸业	11,470	32,345.40	0.06
601	002292	奥飞娱乐	5,100	32,283.00	0.06
602	600604	市北高新	6,000	32,220.00	0.06

603	601827	三峰环境	3,600	32,112.00	0.06
604	002895	川恒股份	1,300	32,097.00	0.06
605	688368	晶丰明源	100	32,010.00	0.06
606	300981	中红医疗	400	31,976.00	0.06
607	002545	东方铁塔	3,500	31,920.00	0.06
608	300841	康华生物	150	31,908.00	0.06
609	000652	泰达股份	7,400	31,894.00	0.06
610	603920	世运电路	1,430	31,889.00	0.06
611	603060	国检集团	1,652	31,883.60	0.06
612	002605	姚记科技	1,400	31,822.00	0.06
613	300397	天和防务	2,080	31,803.20	0.06
614	002516	旷达科技	4,900	31,801.00	0.06
615	000881	中广核技	3,300	31,779.00	0.06
616	000036	华联控股	7,310	31,725.40	0.06
617	002437	誉衡药业	10,900	31,719.00	0.06
618	603025	大豪科技	1,200	31,668.00	0.06
619	000900	现代投资	7,500	31,650.00	0.06
620	688568	中科星图	400	31,592.00	0.06
621	300428	立中集团	1,200	31,560.00	0.06
622	603466	风语筑	1,160	31,552.00	0.06
623	600480	凌云股份	3,180	31,513.80	0.06
624	600125	铁龙物流	6,100	31,476.00	0.06
625	002737	葵花药业	1,900	31,274.00	0.06
626	002733	雄韬股份	1,350	31,225.50	0.06
627	300783	三只松鼠	800	31,176.00	0.06
628	002376	新北洋	3,300	31,119.00	0.06
629	300229	拓尔思	3,000	31,050.00	0.06
630	002647	仁东控股	3,200	30,912.00	0.06
631	600017	日照港	11,000	30,910.00	0.06
632	000910	大亚圣象	2,300	30,843.00	0.06
633	300266	兴源环境	7,900	30,810.00	0.06
634	300145	中金环境	9,440	30,774.40	0.06
635	600098	广州发展	3,800	30,704.00	0.06
636	603533	掌阅科技	1,200	30,612.00	0.06
637	300423	昇辉科技	2,100	30,471.00	0.06
638	002550	千红制药	6,300	30,429.00	0.06
639	002017	东信和平	2,000	30,340.00	0.06
640	600284	浦东建设	4,800	30,336.00	0.06
641	600715	文投控股	9,100	30,303.00	0.06
642	300366	创意信息	2,500	30,300.00	0.06
643	300006	莱美药业	4,438	30,267.16	0.06
644	002891	中宠股份	1,000	30,240.00	0.06

645	002677	浙江美大	1,740	30,189.00	0.06
646	601163	三角轮胎	2,200	30,162.00	0.06
647	002636	金安国纪	2,000	30,100.00	0.06
648	000061	农产品	4,700	30,033.00	0.06
649	300441	鲍斯股份	2,660	30,031.40	0.06
650	002697	红旗连锁	5,640	30,004.80	0.06
651	300130	新国都	2,040	29,947.20	0.06
652	300292	吴通控股	7,500	29,925.00	0.06
653	603105	芯能科技	1,800	29,916.00	0.06
654	000006	深振业 A	6,700	29,882.00	0.06
655	000597	东北制药	4,800	29,856.00	0.06
656	300439	美康生物	1,400	29,834.00	0.06
657	000507	珠海港	4,600	29,716.00	0.06
658	300311	任子行	3,631	29,665.27	0.06
659	000828	东莞控股	2,900	29,522.00	0.05
660	002035	华帝股份	4,630	29,446.80	0.05
661	300205	天喻信息	2,200	29,436.00	0.05
662	000989	九芝堂	2,705	29,376.30	0.05
663	600846	同济科技	3,600	29,376.00	0.05
664	600694	大商股份	1,500	29,265.00	0.05
665	600602	云赛智联	4,500	29,250.00	0.05
666	601330	绿色动力	2,800	29,232.00	0.05
667	300183	东软载波	1,600	29,168.00	0.05
668	002573	清新环境	4,000	29,120.00	0.05
669	002309	中利集团	4,300	29,068.00	0.05
670	002042	华孚时尚	6,350	29,019.50	0.05
671	603387	基蛋生物	1,444	28,966.64	0.05
672	000566	海南海药	5,500	28,875.00	0.05
673	600184	光电股份	1,800	28,854.00	0.05
674	600590	泰豪科技	3,460	28,614.20	0.05
675	000810	创维数字	2,900	28,565.00	0.05
676	603801	志邦家居	936	28,473.12	0.05
677	603693	江苏新能	1,000	28,460.00	0.05
678	603728	鸣志电器	1,200	28,452.00	0.05
679	000697	炼石航空	3,300	28,446.00	0.05
680	000931	中关村	3,700	28,379.00	0.05
681	000667	美好置业	16,300	28,362.00	0.05
682	300284	苏交科	4,452	28,359.24	0.05
683	300191	潜能恒信	1,100	28,336.00	0.05
684	002589	瑞康医药	7,200	28,296.00	0.05
685	601588	北辰实业	11,400	28,272.00	0.05
686	002461	珠江啤酒	3,100	28,210.00	0.05

687	300799	左江科技	300	28,200.00	0.05
688	300204	舒泰神	1,600	28,080.00	0.05
689	603212	赛伍技术	900	28,017.00	0.05
690	300365	恒华科技	2,600	27,950.00	0.05
691	002979	雷赛智能	1,080	27,939.60	0.05
692	603877	太平鸟	1,000	27,880.00	0.05
693	300047	天源迪科	3,545	27,863.70	0.05
694	600775	南京熊猫	2,800	27,860.00	0.05
695	300238	冠昊生物	1,500	27,795.00	0.05
696	002664	长鹰信质	1,400	27,790.00	0.05
697	002651	利君股份	2,100	27,783.00	0.05
698	600971	恒源煤电	4,300	27,778.00	0.05
699	300607	拓斯达	1,736	27,776.00	0.05
699	600335	国机汽车	3,200	27,776.00	0.05
700	002522	浙江众成	3,900	27,690.00	0.05
701	301029	怡合达	300	27,636.00	0.05
702	688095	福昕软件	200	27,602.00	0.05
703	002320	海峡股份	4,600	27,600.00	0.05
704	688526	科前生物	1,000	27,530.00	0.05
705	688399	硕世生物	200	27,500.00	0.05
706	300510	金冠股份	4,179	27,456.03	0.05
707	300386	飞天诚信	1,500	27,435.00	0.05
708	002061	浙江交科	4,900	27,342.00	0.05
708	603529	爱玛科技	600	27,342.00	0.05
709	688788	科思科技	200	27,340.00	0.05
710	300455	康拓红外	2,500	27,175.00	0.05
711	600783	鲁信创投	2,100	27,132.00	0.05
712	300039	上海凯宝	4,400	27,104.00	0.05
713	300215	电科院	2,700	27,081.00	0.05
714	603313	梦百合	1,561	27,020.91	0.05
715	300740	水羊股份	1,700	27,013.00	0.05
716	000913	钱江摩托	1,900	26,961.00	0.05
717	601515	东风股份	3,300	26,829.00	0.05
718	000791	甘肃电投	3,920	26,812.80	0.05
719	002489	浙江永强	7,500	26,775.00	0.05
720	300080	易成新能	4,600	26,772.00	0.05
721	300307	慈星股份	3,400	26,758.00	0.05
722	300206	理邦仪器	1,900	26,752.00	0.05
723	300368	汇金股份	2,600	26,702.00	0.05
724	300276	三丰智能	6,080	26,691.20	0.05
725	300872	天阳科技	800	26,688.00	0.05
726	603609	禾丰股份	2,600	26,624.00	0.05

727	300616	尚品宅配	620	26,591.80	0.05
728	002298	中电兴发	3,500	26,565.00	0.05
729	603566	普莱柯	1,200	26,520.00	0.05
730	002367	康力电梯	3,300	26,499.00	0.05
731	600575	淮河能源	11,000	26,400.00	0.05
732	300684	中石科技	1,200	26,328.00	0.05
733	600748	上实发展	6,500	26,325.00	0.05
734	300527	中船应急	2,543	26,294.62	0.05
735	601158	重庆水务	4,100	26,281.00	0.05
736	600855	航天长峰	1,500	26,070.00	0.05
737	000813	德展健康	6,400	26,048.00	0.05
738	603363	傲农生物	2,050	26,035.00	0.05
739	002194	武汉凡谷	2,400	26,016.00	0.05
739	300255	常山药业	3,200	26,016.00	0.05
740	600337	美克家居	7,400	25,974.00	0.05
741	002243	力合科创	2,300	25,967.00	0.05
742	000600	建投能源	5,100	25,959.00	0.05
743	002301	齐心集团	3,100	25,947.00	0.05
744	002034	旺能环境	1,500	25,905.00	0.05
745	000070	特发信息	3,980	25,870.00	0.05
746	002515	金字火腿	4,720	25,865.60	0.05
747	600550	保变电气	4,600	25,714.00	0.05
748	002215	诺普信	4,000	25,520.00	0.05
749	000950	重药控股	5,000	25,500.00	0.05
749	000958	东方能源	5,000	25,500.00	0.05
750	002755	奥赛康	2,000	25,460.00	0.05
751	300860	锋尚文化	300	25,428.00	0.05
752	002547	春兴精工	5,600	25,424.00	0.05
753	002978	安宁股份	600	25,368.00	0.05
754	300349	金卡智能	2,100	25,305.00	0.05
755	688389	普门科技	1,100	25,300.00	0.05
756	688127	蓝特光学	1,100	25,289.00	0.05
757	000968	蓝焰控股	2,700	25,245.00	0.05
757	300016	北陆药业	2,750	25,245.00	0.05
758	002251	步步高	3,700	25,234.00	0.05
759	000567	海德股份	1,400	24,990.00	0.05
760	600261	阳光照明	5,700	24,966.00	0.05
761	000032	深桑达 A	1,200	24,888.00	0.05
762	600569	安阳钢铁	8,300	24,817.00	0.05
763	600565	迪马股份	10,100	24,644.00	0.05
764	002961	瑞达期货	1,000	24,640.00	0.05
765	300664	鹏鹞环保	3,600	24,480.00	0.05



766	002717	岭南股份	7,080	24,426.00	0.05
767	002479	富春环保	4,100	24,354.00	0.05
768	300579	数字认证	600	24,300.00	0.05
769	000882	华联股份	12,700	24,257.00	0.05
770	300590	移为通信	840	24,234.00	0.05
771	600710	苏美达	3,700	24,198.00	0.05
772	300552	万集科技	600	24,174.00	0.05
773	600449	宁夏建材	2,000	24,060.00	0.04
774	601963	重庆银行	2,700	24,030.00	0.04
775	300842	帝科股份	300	24,000.00	0.04
776	300910	瑞丰新材	300	23,955.00	0.04
777	603626	科森科技	1,980	23,938.20	0.04
778	300448	浩云科技	3,400	23,936.00	0.04
779	002204	大连重工	5,500	23,925.00	0.04
780	002383	合众思壮	3,300	23,892.00	0.04
781	000936	华西股份	3,800	23,826.00	0.04
782	603416	信捷电气	500	23,805.00	0.04
783	300190	维尔利	3,900	23,790.00	0.04
784	300829	金丹科技	520	23,764.00	0.04
785	603169	兰石重装	2,600	23,686.00	0.04
786	300110	华仁药业	4,920	23,616.00	0.04
787	002267	陕天然气	3,200	23,584.00	0.04
788	300388	节能国祯	3,000	23,550.00	0.04
789	600894	广日股份	3,100	23,374.00	0.04
790	002768	国恩股份	900	23,274.00	0.04
791	002782	可立克	1,300	23,231.00	0.04
792	600032	浙江新能	1,500	23,190.00	0.04
793	002912	中新赛克	700	23,163.00	0.04
794	000557	西部创业	5,500	23,155.00	0.04
795	603666	亿嘉和	308	23,136.96	0.04
796	600975	新五丰	3,400	23,086.00	0.04
797	600624	复旦复华	3,330	23,076.90	0.04
798	300723	一品红	640	22,976.00	0.04
799	300520	科大国创	1,200	22,944.00	0.04
800	300328	宜安科技	2,920	22,922.00	0.04
801	000550	江铃汽车	1,400	22,834.00	0.04
801	002695	煌上煌	1,400	22,834.00	0.04
802	002277	友阿股份	7,000	22,820.00	0.04
803	603337	杰克股份	972	22,793.40	0.04
804	300318	博晖创新	2,300	22,793.00	0.04
805	601949	中国出版	3,900	22,776.00	0.04
806	002562	兄弟科技	4,560	22,754.40	0.04

807	603590	康辰药业	700	22,743.00	0.04
808	300846	首都在线	1,500	22,680.00	0.04
809	002435	长江健康	4,300	22,661.00	0.04
810	603610	麒盛科技	875	22,627.50	0.04
811	002987	京北方	720	22,622.40	0.04
812	603229	奥翔药业	620	22,574.20	0.04
813	002542	中化岩土	7,650	22,567.50	0.04
814	000601	韶能股份	4,400	22,528.00	0.04
815	300531	优博讯	1,100	22,473.00	0.04
816	600510	黑牡丹	3,000	22,440.00	0.04
817	603328	依顿电子	2,800	22,400.00	0.04
818	603636	南威软件	2,500	22,350.00	0.04
819	002798	帝欧家居	1,500	22,305.00	0.04
820	000761	本钢板材	5,300	22,260.00	0.04
821	601069	西部黄金	1,800	22,122.00	0.04
822	300523	辰安科技	1,000	22,100.00	0.04
823	300066	三川智慧	4,400	22,088.00	0.04
824	603222	济民医疗	1,200	22,080.00	0.04
825	603359	东珠生态	1,544	22,079.20	0.04
826	002344	海宁皮城	4,500	22,050.00	0.04
827	600874	创业环保	3,100	21,917.00	0.04
828	002596	海南瑞泽	5,800	21,866.00	0.04
829	605388	均瑶健康	1,200	21,828.00	0.04
830	601886	江河集团	3,300	21,747.00	0.04
831	300831	派瑞股份	1,100	21,725.00	0.04
832	002929	润建股份	600	21,684.00	0.04
833	002378	章源钨业	2,600	21,632.00	0.04
834	603383	顶点软件	600	21,540.00	0.04
835	601700	风范股份	3,500	21,525.00	0.04
836	002609	捷顺科技	2,200	21,450.00	0.04
837	603730	岱美股份	919	21,431.08	0.04
838	002672	东江环保	2,900	21,344.00	0.04
839	688505	复旦张江	1,500	21,150.00	0.04
840	605090	九丰能源	600	21,102.00	0.04
841	603299	苏盐井神	2,200	21,032.00	0.04
842	603258	电魂网络	700	21,000.00	0.04
843	600548	深高速	2,100	20,958.00	0.04
844	300252	金信诺	2,340	20,872.80	0.04
845	300572	安车检测	1,000	20,650.00	0.04
846	000796	凯撒旅业	2,700	20,601.00	0.04
847	002234	民和股份	1,200	20,592.00	0.04
848	002970	锐明技术	500	20,580.00	0.04

849	688278	特宝生物	700	20,496.00	0.04
850	002950	奥美医疗	1,250	20,437.50	0.04
851	600636	国新文化	1,900	20,406.00	0.04
852	000498	山东路桥	3,300	20,394.00	0.04
853	600007	中国国贸	1,400	20,160.00	0.04
854	605339	南侨食品	600	19,992.00	0.04
855	300302	同有科技	1,940	19,962.60	0.04
856	605199	葫芦娃	800	19,936.00	0.04
857	600800	渤海化学	4,200	19,866.00	0.04
858	600618	氯碱化工	1,600	19,856.00	0.04
859	688086	紫晶存储	900	19,800.00	0.04
860	002993	奥海科技	500	19,690.00	0.04
861	002662	京威股份	4,600	19,596.00	0.04
862	600929	雪天盐业	2,600	19,396.00	0.04
863	603595	东尼电子	524	19,351.32	0.04
864	002641	永高股份	3,500	19,180.00	0.04
865	002959	小熊电器	300	19,161.00	0.04
866	002582	好想你	2,200	19,140.00	0.04
867	000885	城发环境	1,800	19,080.00	0.04
868	002975	博杰股份	300	19,056.00	0.04
869	000048	京基智农	1,100	19,041.00	0.04
870	002303	美盈森	5,300	19,027.00	0.04
871	002228	合兴包装	5,200	18,980.00	0.04
872	300856	科思股份	300	18,951.00	0.04
873	603208	江山欧派	300	18,924.00	0.04
874	000639	西王食品	3,724	18,917.92	0.04
875	688222	成都先导	800	18,792.00	0.03
876	603378	亚士创能	725	18,654.25	0.03
877	003009	中天火箭	300	18,531.00	0.03
878	688085	三友医疗	600	18,522.00	0.03
879	300485	赛升药业	1,400	18,466.00	0.03
880	600622	光大嘉宝	6,320	18,454.40	0.03
881	300673	佩蒂股份	900	18,432.00	0.03
882	603587	地素时尚	960	18,393.60	0.03
883	300815	玉禾田	600	18,348.00	0.03
884	000065	北方国际	2,125	18,232.50	0.03
885	688020	方邦股份	200	18,230.00	0.03
886	002314	南山控股	5,800	18,096.00	0.03
887	688177	百奥泰	700	18,081.00	0.03
888	002838	道恩股份	1,100	18,040.00	0.03
889	603869	新智认知	1,800	18,036.00	0.03
890	600916	中国黄金	1,300	17,849.00	0.03

891	300127	银河磁体	700	17,675.00	0.03
892	603093	南华期货	1,300	17,654.00	0.03
893	000544	中原环保	2,750	17,600.00	0.03
894	600054	黄山旅游	1,800	17,586.00	0.03
895	000011	深物业 A	1,500	17,490.00	0.03
896	600825	新华传媒	3,700	17,464.00	0.03
897	300857	协创数据	600	17,376.00	0.03
898	603439	贵州三力	1,100	17,358.00	0.03
899	300634	彩讯股份	1,000	17,330.00	0.03
900	002530	金财互联	2,620	17,292.00	0.03
901	002990	盛视科技	500	17,255.00	0.03
902	603508	思维列控	740	17,005.20	0.03
903	002941	新疆交建	1,400	16,926.00	0.03
904	002792	通宇通讯	1,050	16,800.00	0.03
905	300805	电声股份	1,200	16,752.00	0.03
906	600996	贵广网络	3,000	16,710.00	0.03
907	300791	仙乐健康	400	16,680.00	0.03
908	300548	博创科技	500	16,520.00	0.03
909	605009	豪悦护理	300	16,497.00	0.03
910	000025	特力 A	1,100	16,456.00	0.03
911	601921	浙版传媒	1,700	16,371.00	0.03
912	002977	火箭科技	200	16,012.00	0.03
913	000019	深粮控股	2,300	16,008.00	0.03
914	300800	力合科技	550	15,939.00	0.03
915	003040	楚天龙	600	15,792.00	0.03
916	688055	龙腾光电	2,300	15,755.00	0.03
917	600686	金龙汽车	2,500	15,700.00	0.03
918	300765	新诺威	1,018	15,616.12	0.03
919	605222	起帆电缆	600	15,594.00	0.03
920	002793	罗欣药业	1,500	15,555.00	0.03
921	003039	顺控发展	500	15,515.00	0.03
922	002287	奇正藏药	500	15,280.00	0.03
923	002991	甘源食品	200	15,260.00	0.03
924	688318	财富趋势	100	15,220.00	0.03
925	301031	中熔电气	100	15,212.00	0.03
926	603887	城地香江	1,860	15,103.20	0.03
927	003012	东鹏控股	1,100	15,092.00	0.03
927	603180	金牌厨柜	392	15,092.00	0.03
928	601858	中国科传	1,700	14,994.00	0.03
929	002307	北新路桥	3,500	14,945.00	0.03
930	002955	鸿合科技	680	14,837.60	0.03
931	688030	山石网科	500	14,830.00	0.03

932	300894	火星人	300	14,751.00	0.03
933	603283	赛腾股份	500	14,700.00	0.03
934	002982	湘佳股份	300	14,637.00	0.03
935	605136	丽人丽妆	600	14,610.00	0.03
936	603808	歌力思	1,000	14,590.00	0.03
937	000797	中国武夷	5,541	14,462.01	0.03
938	300785	值得买	199	14,276.26	0.03
939	000058	深赛格	2,100	14,133.00	0.03
940	301039	中集车辆	1,100	14,113.00	0.03
941	605338	巴比食品	400	13,936.00	0.03
942	601595	上海电影	1,280	13,849.60	0.03
943	600746	江苏索普	1,000	13,800.00	0.03
944	300900	广联航空	400	13,740.00	0.03
945	002973	侨银股份	900	13,599.00	0.03
946	002880	卫光生物	420	13,515.60	0.03
947	603053	成都燃气	1,300	13,507.00	0.03
948	600738	丽尚国潮	2,200	13,376.00	0.02
949	605008	长鸿高科	900	13,293.00	0.02
950	002616	长青集团	2,100	12,768.00	0.02
951	300526	中潜股份	580	12,678.80	0.02
952	688365	光云科技	900	12,474.00	0.02
953	000918	嘉凯城	5,000	12,450.00	0.02
954	601528	瑞丰银行	1,100	12,408.00	0.02
955	605296	神农集团	300	12,093.00	0.02
956	300788	中信出版	400	11,848.00	0.02
957	600248	陕西建工	2,400	11,520.00	0.02
958	002969	嘉美包装	2,000	11,380.00	0.02
959	000517	荣安地产	4,600	11,316.00	0.02
960	601686	友发集团	1,100	10,780.00	0.02
961	688001	华兴源创	300	10,761.00	0.02
962	605099	共创草坪	300	10,605.00	0.02
963	603171	税友股份	300	10,560.00	0.02
963	603327	福蓉科技	600	10,560.00	0.02
964	603815	交建股份	1,300	10,361.00	0.02
965	603976	正川股份	300	10,236.00	0.02
966	002911	佛燃能源	880	9,856.00	0.02
967	002980	华盛昌	300	9,123.00	0.02
968	601279	英利汽车	1,200	9,108.00	0.02
969	301015	百洋医药	300	9,090.00	0.02
970	300942	易瑞生物	300	8,658.00	0.02
971	603013	亚普股份	500	8,360.00	0.02
972	002989	中天精装	300	7,587.00	0.01

973	603956	威派格	400	7,120.00	0.01
974	603511	爱慕股份	300	7,116.00	0.01
975	605007	五洲特纸	300	6,903.00	0.01
976	603711	香飘飘	400	6,560.00	0.01
977	603103	横店影视	480	6,340.80	0.01
978	003032	传智教育	300	6,300.00	0.01
979	603530	神马电力	300	5,757.00	0.01
980	605365	立达信	300	5,751.00	0.01
981	003006	百亚股份	300	5,379.00	0.01
982	605118	力鼎光电	300	4,980.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	001317	三羊马	300	25,722.00	0.05
2	001296	长江材料	215	12,745.20	0.02
3	001234	泰慕士	240	3,967.20	0.01

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300769	德方纳米	511,687.00	1.33
2	300012	华测检测	447,773.00	1.16
3	300496	中科创达	356,884.00	0.93
4	002176	江特电机	262,310.00	0.68
5	002568	百润股份	255,435.38	0.66
6	603345	安井食品	252,477.00	0.66
7	688598	金博股份	230,443.99	0.60
8	002625	光启技术	217,002.00	0.56
9	002920	德赛西威	189,476.00	0.49
10	002192	融捷股份	188,733.00	0.49
11	000860	顺鑫农业	143,386.00	0.37
12	000762	西藏矿业	143,057.00	0.37
13	002463	沪电股份	142,652.00	0.37
14	300390	天华超净	137,136.00	0.36
15	688390	固德威	136,782.00	0.36
16	002738	中矿资源	135,342.00	0.35
17	300035	中科电气	131,977.00	0.34
18	688408	中信博	128,862.00	0.34
19	605117	德业股份	127,993.34	0.33

20	600100	同方股份	125,943.00	0.33
----	--------	------	------------	------

注：买入金额不包括相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000799	酒鬼酒	426,489.00	1.11
2	000733	振华科技	382,051.00	0.99
3	300496	中科创达	372,249.00	0.97
4	300751	迈为股份	329,667.80	0.86
5	688005	容百科技	298,753.52	0.78
6	300363	博腾股份	258,477.00	0.67
7	603613	国联股份	245,673.27	0.64
8	002920	德赛西威	237,572.00	0.62
9	002568	百润股份	226,230.00	0.59
10	603345	安井食品	225,406.00	0.59
11	300769	德方纳米	223,313.00	0.58
12	603456	九洲药业	223,096.00	0.58
13	300724	捷佳伟创	221,871.00	0.58
14	603267	鸿远电子	221,570.00	0.58
15	601636	旗滨集团	210,525.00	0.55
16	002409	雅克科技	204,047.00	0.53
17	300763	锦浪科技	203,103.10	0.53
18	300677	英科医疗	192,686.00	0.50
19	603127	昭衍新药	188,034.76	0.49
20	300037	新宙邦	178,862.00	0.47

注：卖出金额不包括相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	29,476,898.91
卖出股票收入（成交）总额	23,943,009.99

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

#### 8.5 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。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

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

华宝中证 1000 指数基金截至 2021 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的天奈科技(688116)的发行人江苏天奈科技股份有限公司因存在补充流动资金的 15,000 万元实际上并未用于生产经营,而是全部用于购买银行理财产品,实际用途与公司公告不符,信息披露不真实的违规行为,于 2021 年 12 月 8 日收到江苏证监局采取责令改正的行政监管措施,并记入证券期货市场诚信档案。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和视为,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。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。



## 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,607.64
2	应收证券清算款	135,171.17
3	应收股利	-
4	应收利息	391.78
5	应收申购款	32,474.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	170,644.77

## 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

## 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

## 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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。

## 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	001234	泰慕士	3,967.20	0.01	新股流通受限

## 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

## § 9 基金份额持有人信息

## 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
3,879	11,586.30	9,784,626.52	21.77	35,158,647.73	78.23

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

## 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

## § 10 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	23,087,869.31
减：本报告期基金总赎回份额	16,973,103.64
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	44,943,274.25

## § 11 重大事件揭示

## 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

## 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

## 1、基金管理人的重大人事变动

2021年8月25日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，李慧勇不再担任公司副总经理。

## 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

## 11.4 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。

## 11.5 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在本报告期的审计报酬为 35,200.00 元人民币。

目前该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。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	13,932,246.93	26.38%	12,696.49	26.35%	-
国信证券	1	9,686,859.61	18.34%	9,021.32	18.72%	-
长江证券	1	6,958,167.71	13.18%	6,480.33	13.45%	-
国金证券	1	4,525,029.04	8.57%	4,214.09	8.75%	-
申港证券	1	3,281,532.68	6.21%	2,399.70	4.98%	-
东吴证券	1	2,277,652.33	4.31%	2,121.29	4.40%	-
国泰君安	2	2,190,554.56	4.15%	2,013.97	4.18%	-
东方证券	2	1,724,515.00	3.27%	1,605.96	3.33%	-
中信证券	2	1,494,596.20	2.83%	1,392.07	2.89%	-
光大证券	1	1,019,182.00	1.93%	949.24	1.97%	-
信达证券	1	850,515.75	1.61%	792.41	1.64%	-
开源证券	1	793,753.00	1.50%	723.35	1.50%	-
安信证券	1	640,724.85	1.21%	596.80	1.24%	-
湘财证券	2	525,447.45	1.00%	489.43	1.02%	-
广发证券	2	453,878.74	0.86%	422.73	0.88%	-
申万宏源	3	451,191.40	0.85%	420.32	0.87%	-
中泰证券	2	401,962.60	0.76%	366.60	0.76%	-

太平洋证 券	2	300,260.72	0.57%	273.63	0.57%	-
方正证券	2	271,639.14	0.51%	253.00	0.53%	-
中金国际	1	243,050.00	0.46%	226.41	0.47%	-
银河证券	1	186,068.00	0.35%	173.32	0.36%	-
东莞证券	1	185,701.00	0.35%	169.23	0.35%	-
瑞银证券	1	176,401.30	0.33%	164.27	0.34%	-
天风证券	2	110,813.51	0.21%	103.23	0.21%	-
兴业证券	2	49,954.41	0.09%	45.52	0.09%	-
海通证券	1	40,764.25	0.08%	37.95	0.08%	-
中金财富	1	32,132.33	0.06%	29.94	0.06%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	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	-	-	-	-	-
申万宏源 西部	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准： 资质雄厚，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、本报告期租用的证券公司交易单元新增的有：宏信证券、东莞证券、申港证券、湘财证券。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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。

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华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
2	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
3	华宝中证 1000 指数证券投资基金基	基金管理人网站	2021-3-31

	金产品资料概要（更新）		
4	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
5	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
6	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
7	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
8	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
9	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
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
12	华宝中证 1000 指数证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	基金管理人网站	2021-7-21
13	华宝基金关于旗下部分开放式基金新增国金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	2021-8-11
14	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	2021-8-13
15	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	2021-8-13
16	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加利得基金为代销机构及费率优惠的公告	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	2021-8-18
17	华宝基金关于旗下深交所基金新增扩位简称的公告	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	2021-8-21
18	华宝中证 1000 指数证券投资基金 2021 年中期报告	基金管理人网站	2021-8-27
19	华宝基金关于旗下部分开放式基金新增招商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	2021-8-30
20	华宝基金管理有限公司关于旗下部	基金管理人网站, 上海	2021-9-6

	分开放式基金参加建设银行财富季申购及定期定额申购费率优惠活动的公告	证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	
21	华宝基金关于旗下部分开放式基金新增招商银行为代销机构的公告	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	2021-9-30
22	华宝中证 1000 指数证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	基金管理人网站	2021-10-27
23	华宝基金关于旗下部分基金新增宁波银行股份有限公司为代销机构的公告	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	2021-12-23

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于 2021 年 03 月 31 日发布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，具体内容详见公司公告，请投资者予以关注。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

### 13.2 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。

### 13.3 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项

种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2022 年 3 月 31 日