

华宝中证 1000 指数证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 月 30 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 2024 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|-----------------------------------------|-----------|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| § 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 5 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| § 4 管理人报告 | 9 |
| 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 | 11 |
| 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 | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 12 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 12 |
| § 5 托管人报告 | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 12 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 12 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见 | 13 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 13 |
| 6.1 资产负债表 | 13 |
| 6.2 利润表 | 14 |
| 6.3 净资产变动表 | 15 |
| 6.4 报表附注 | 17 |
| § 7 投资组合报告 | 35 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 35 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 36 |
| 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 | 37 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 61 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 62 |
| 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 | 62 |

| | |
|---------------------------------------------|-----------|
| 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 | 62 |
| 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 | 62 |
| 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 | 62 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 62 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 62 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 63 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 64 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 64 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 64 |
| 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 | 64 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 65 |
| § 10 重大事件揭示 | 65 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 65 |
| 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 | 65 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 65 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 65 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 65 |
| 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 | 66 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 66 |
| 10.8 其他重大事件 | 68 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 68 |
| 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 | 68 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 69 |
| § 12 备查文件目录 | 69 |
| 12.1 备查文件目录 | 69 |
| 12.2 存放地点 | 69 |
| 12.3 查阅方式 | 69 |

§ 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 | 47,828,934.57 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华宝中证 1000 指数 | 华宝中证 1000 指数 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 162413 | 016033 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 37,666,710.71 份 | 10,162,223.86 份 |

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|--------------|--------------|
| 名称 | | 华宝基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 周雷 | 王小飞 |
| | 联系电话 | 021-38505888 | 021-60637103 |

| | | |
|--------|--------------------------------------|------------------------|
| 电子邮箱 | xxpl@fsfund.com | wangxiaofei.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | 400-700-5588、400-820-5050 | 021-60637228 |
| 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 | 黄孔威 | 张金良 |

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|----------------------|-------------------------------------------------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司、基金管理人 | 北京市西城区太平桥大街 17 号、中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数 据和指标 | 报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日) | |
|-------------------|-------------------------------------|----------------|
| | 华宝中证 1000 指数 | 华宝中证 1000 指数 C |
| 本期已实现收益 | -1,421,920.21 | -445,589.87 |
| 本期利润 | -5,433,011.51 | -1,352,464.60 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1426 | -0.1120 |
| 本期加权平均净值利润率 | -17.67% | -13.95% |
| 本期基金份额净值增长率 | -15.42% | -15.54% |
| 3.1.2 期末数 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日) | |

| 据和指标 | | |
|--------------|------------------|----------------|
| 期末可供分配利润 | -68,295,654.40 | -18,480,686.98 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -1.8132 | -1.8186 |
| 期末基金资产净值 | 28,223,643.21 | 7,569,612.88 |
| 期末基金份额净值 | 0.7493 | 0.7449 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2024年6月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | -24.75% | -30.32% |

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润等于本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宝中证 1000 指数

| 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 | -7.70% | 1.34% | -8.15% | 1.36% | 0.45% | -0.02% |
| 过去三个月 | -8.81% | 1.40% | -9.51% | 1.42% | 0.70% | -0.02% |
| 过去六个月 | -15.42% | 1.85% | -15.97% | 1.87% | 0.55% | -0.02% |
| 过去一年 | -24.23% | 1.45% | -24.61% | 1.47% | 0.38% | -0.02% |
| 过去三年 | -29.37% | 1.34% | -29.31% | 1.36% | -0.06% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | -24.75% | 1.29% | -25.23% | 1.31% | 0.48% | -0.02% |

华宝中证 1000 指数 C

| 阶段 | 份额净 | 份额净值 | 业绩比较基 | 业绩比较基准 | ①-③ | ②-④ |
|----|-----|------|-------|--------|-----|-----|
|----|-----|------|-------|--------|-----|-----|

| | 值增长率① | 增长率标准差② | 准收益率③ | 收益率标准差④ | | |
|------------|---------|---------|---------|---------|--------|--------|
| 过去一个月 | -7.72% | 1.35% | -8.15% | 1.36% | 0.43% | -0.01% |
| 过去三个月 | -8.88% | 1.40% | -9.51% | 1.42% | 0.63% | -0.02% |
| 过去六个月 | -15.54% | 1.85% | -15.97% | 1.87% | 0.43% | -0.02% |
| 过去一年 | -24.47% | 1.45% | -24.61% | 1.47% | 0.14% | -0.02% |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | -30.32% | 1.26% | -29.35% | 1.28% | -0.97% | -0.02% |

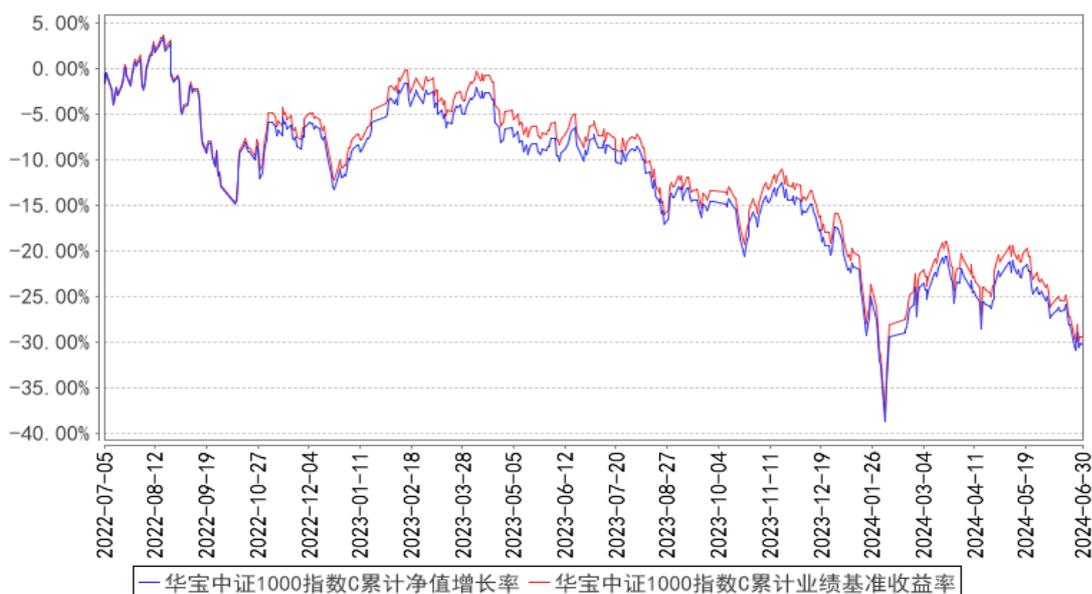
注：（1）基金业绩基准：中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%；
 （2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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

华宝中证1000指数累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华宝中证1000指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华宝基金管理有限公司（公司原名“华宝兴业基金管理有限公司”）于 2003 年 2 月 12 日经中国证监会批准设立，2003 年 3 月 7 日在国家工商总局注册登记并正式开业，是国内首批中外合资基金管理公司。成立之初，公司注册资本为 1 亿元人民币，2007 年经中国证监会批准，公司注册资本增加至 1.5 亿元人民币。2017 年公司名称变更为“华宝基金管理有限公司”。目前公司股东为华宝信托有限责任公司、美国华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.）和江苏省铁路集团有限公司，持有股权占比分别为 51%、29%、20%。公司在北京和深圳设有分公司。截至本报告期末（2024 年 06 月 30 日），本公司正在管理运作的公开募集证券投资基金共 141 只，涵盖股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金、FOF 等。

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 | - | 15 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 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | | | | | <p>师、投资经理助理、投资经理等职务。2015 年 11 月起任华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，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，2022 年 9 月至 2023 年 3 月任华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，2022 年 12 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发起式联接基金基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定

和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本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

2024 年上半年，外部环境变化带来的不利影响增多，国内有效需求不足，经济运行出现分化，新旧动能转换存在阵痛。A 股市场 1 月受资金面影响市场明显下行，中小市值指数领跌，拖累上证指数 2 月初一度跌破 2700 点，形成短期杀跌行情，2 月 6 日开始市场中小市值宽基指数成分股显现资金流入迹象，市场在一系列稳增长政策、资本市场政策和“国家队”入市的支撑下反弹，投资者情绪逐渐修复，之前跌幅明显的中证 1000 指数在反弹过程中涨幅也多于大中市值的宽基指数。5 月两市成交持续走弱，地缘局势持续发酵，反弹告一段落，6 月伊始，随着国内经济数据显示我国增长修复仍需稳增长政策加码，A 股换手率下行，受汇率及北向流出影响，沪深 300 指数和上证指数连续 6 周回落，市场风险偏好低迷。在资本市场严监管背景下，小盘微盘股波动放大。

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 A 类净值增长率为-15.42%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为-15.54%；同期业绩比较基准收益率为-15.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年中央要求宏观政策要持续用力、更加给力，及早储备并适时推出一批增量政策举措。因地制宜发展新质生产力，不断增强新动能新优势，深入挖掘内需潜力，以提振消费为重点扩大国内需求。在美联储降息周期的可见度提高下，国内再次降息降准的可能性增加，而市场无风险利率持续走低，中证 1000 为代表的中小盘指数对于市场的风险偏好及流动性边际变化反应敏感，在海外和宏观资金面因素改善的背景下，作为弹性品种有望受益于 A 股风险偏好提升。

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、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。参与估值的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值各方之间不存在重大利益冲突。

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账务处理；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。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期亏损，未有应分未分的利润。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝中证 1000 指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 2,278,942.51 | 3,348,279.85 |
| 结算备付金 | | 3,920.82 | 3,334.71 |
| 存出保证金 | | 1,882.11 | 2,080.80 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 33,656,499.40 | 42,615,179.57 |
| 其中：股票投资 | | 33,656,499.40 | 42,615,179.57 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 债权投资 | | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | | - | - |
| 其他权益工具投资 | | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 79,034.08 | 191,309.45 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 36,020,278.92 | 46,160,184.38 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |

| | | | |
|-------------|---------|----------------|----------------|
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | - | 491,590.17 |
| 应付赎回款 | | 85,314.69 | 356,514.66 |
| 应付管理人报酬 | | 15,289.21 | 19,121.21 |
| 应付托管费 | | 3,057.83 | 3,824.25 |
| 应付销售服务费 | | 1,951.39 | 2,552.31 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 121,409.71 | 215,597.64 |
| 负债合计 | | 227,022.83 | 1,089,200.24 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 114,309,449.75 | 121,713,014.12 |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | -78,516,193.66 | -76,642,029.98 |
| 净资产合计 | | 35,793,256.09 | 45,070,984.14 |
| 负债和净资产总计 | | 36,020,278.92 | 46,160,184.38 |

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 47,828,934.57 份，其中华宝中证 1000 指数基金份额总额 37,666,710.71 份，基金份额净值 0.7493 元；华宝中证 1000 指数 C 基金份额总额 10,162,223.86 份，基金份额净值 0.7449 元。

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|-------------------|----------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 一、营业总收入 | | -6,508,003.89 | 3,388,907.91 |
| 1. 利息收入 | | 7,032.05 | 10,257.03 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 7,032.05 | 10,257.03 |
| 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 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -1,603,194.63 | 901,615.23 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | -1,967,676.91 | 401,653.36 |
| 基金投资收益 | | - | - |

| | | | |
|---------------------------------|------------|---------------|--------------|
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 资产支持证券投资 收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | 135,262.85 |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | 364,482.28 | 364,699.02 |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | -4,917,966.03 | 2,460,881.23 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-” 号填列） | 6.4.7.17 | 6,124.72 | 16,154.42 |
| 减：二、营业总支出 | | 277,472.22 | 334,352.06 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 100,202.27 | 139,925.01 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 20,040.45 | 27,984.99 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 14,379.96 | 21,252.32 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产 支出 | | - | - |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.18 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | - | 488.76 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.19 | 142,849.54 | 144,700.98 |
| 三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列） | | -6,785,476.11 | 3,054,555.85 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-” 号填列） | | -6,785,476.11 | 3,054,555.85 |
| 五、其他综合收益的税后 净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -6,785,476.11 | 3,054,555.85 |

6.3 净资产变动表

会计主体：华宝中证 1000 指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | | |
|---------------|---------------------------------------|--------|----------------|---------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净 资产 | 121,713,014.12 | - | -76,642,029.98 | 45,070,984.14 |

| | | | | |
|------------------------------------------|--------------------------------------------|--------|----------------|----------------|
| 二、本期期初净资产 | 121,713,014.12 | - | -76,642,029.98 | 45,070,984.14 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -7,403,564.37 | - | -1,874,163.68 | -9,277,728.05 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | -6,785,476.11 | -6,785,476.11 |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列) | -7,403,564.37 | - | 4,911,312.43 | -2,492,251.94 |
| 其中：1. 基金申购款 | 115,461,779.71 | - | -76,575,174.27 | 38,886,605.44 |
| 2. 基金赎回款 | -122,865,344.08 | - | 81,486,486.70 | -41,378,857.38 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 114,309,449.75 | - | -78,516,193.66 | 35,793,256.09 |
| 项目 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 123,117,970.14 | - | -74,478,908.54 | 48,639,061.60 |
| 二、本期期初净资产 | 123,117,970.14 | - | -74,478,908.54 | 48,639,061.60 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 660,332.87 | - | 1,878,625.56 | 2,538,958.43 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 3,054,555.85 | 3,054,555.85 |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列) | 660,332.87 | - | -1,175,930.29 | -515,597.42 |
| 其中：1. 基金申购款 | 143,611,090.68 | - | -82,840,261.47 | 60,770,829.21 |

| | | | | |
|------------------------------------------|-----------------|---|----------------|----------------|
| 2. 基金赎回款 | -142,950,757.81 | - | 81,664,331.18 | -61,286,426.63 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 123,778,303.01 | - | -72,600,282.98 | 51,178,020.03 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|-----------|-----------|------------|
| <u>向辉</u> | <u>向辉</u> | <u>张幸骏</u> |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝中证 1000 指数证券投资基金(原名为华宝中证 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基金合同注册的批复》准予注册,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,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 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《关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金转型后基金名称、基金简称变更的公告》,华宝中证 1000 指数分级证券投资基金于 2020 年 11 月 19 日起更名为华宝中证 1000 指数证券投资

基金。

根据本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2022 年 6 月 24 日发布的《华宝基金管理有限公司关于华宝中证 1000 指数证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》以及更新后的《华宝中证 1000 指数证券投资基金基金合同》的有关规定，自 2022 年 7 月 1 日起，本基金增设 C 类基金份额。本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，且不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝中证 1000 指数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、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，投资于中证 1000 指数成份股和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）或者到期日在一年以内的政府债券。本基金力争控制本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的绝对值不超过 0.35%、年跟踪误差不超过 4%，本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×95%+银行同业存款收益率×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 2024 年 8 月 30 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝中证 1000 指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国

基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对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

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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 2,278,942.51 |
| 等于：本金 | 2,278,727.43 |
| 加：应计利息 | 215.08 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 2,278,942.51 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | | | |
|---------------|------------------------|------|---------------|----------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 43,773,789.10 | - | 33,656,499.40 | -10,117,289.70 |
| 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 | 43,773,789.10 | - | 33,656,499.40 | -10,117,289.70 |

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 12.97 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 28,632.20 |
| 其中：交易所市场 | 28,632.20 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 42,764.54 |
| 应付指数使用费 | 50,000.00 |
| 合计 | 121,409.71 |

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华宝中证 1000 指数

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 39,344,143.11 | 94,029,375.15 |
| 本期申购 | 5,757,525.30 | 13,760,318.54 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -7,434,957.70 | -17,768,836.48 |
| 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 | 37,666,710.71 | 90,020,857.21 |

华宝中证 1000 指数 C

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 11,582,445.66 | 27,683,638.97 |
| 本期申购 | 42,549,068.52 | 101,701,461.17 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -43,969,290.32 | -105,096,507.60 |
| 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 | 10,162,223.86 | 24,288,592.54 |

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。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

华宝中证 1000 指数

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 上年度末 | -69,855,166.45 | 10,680,783.08 | -59,174,383.37 |
| 本期期初 | -69,855,166.45 | 10,680,783.08 | -59,174,383.37 |
| 本期利润 | -1,421,920.21 | -4,011,091.30 | -5,433,011.51 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 2,981,432.26 | -171,251.38 | 2,810,180.88 |
| 其中：基金申购款 | -10,300,062.05 | 1,145,362.72 | -9,154,699.33 |
| 基金赎回款 | 13,281,494.31 | -1,316,614.10 | 11,964,880.21 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -68,295,654.40 | 6,498,440.40 | -61,797,214.00 |

华宝中证 1000 指数 C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----|-------|-------|---------|
|----|-------|-------|---------|

| | | | |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 上年度末 | -20,616,030.65 | 3,148,384.04 | -17,467,646.61 |
| 本期期初 | -20,616,030.65 | 3,148,384.04 | -17,467,646.61 |
| 本期利润 | -445,589.87 | -906,874.73 | -1,352,464.60 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 2,580,933.54 | -479,801.99 | 2,101,131.55 |
| 其中：基金申购款 | -76,231,066.31 | 8,810,591.37 | -67,420,474.94 |
| 基金赎回款 | 78,811,999.85 | -9,290,393.36 | 69,521,606.49 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -18,480,686.98 | 1,761,707.32 | -16,718,979.66 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|-----------|---------------------------------|--|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | |
| 活期存款利息收入 | 6,281.53 | |
| 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 | 103.35 | |
| 其他 | 647.17 | |
| 合计 | 7,032.05 | |

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|------------|---------------------------------|--|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | |
| 卖出股票成交总额 | 9,202,860.06 | |
| 减：卖出股票成本总额 | 11,149,545.98 | |
| 减：交易费用 | 20,990.99 | |
| 买卖股票差价收入 | -1,967,676.91 | |

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

6.4.7.11.2 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。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 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。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------------|---------------------------------|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 364,482.28 |
| 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 | 364,482.28 |

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------------------|---------------------------------|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产 | -4,917,966.03 |
| 股票投资 | -4,917,966.03 |
| 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 | -4,917,966.03 |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|---------------------------------|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
| 基金赎回费收入 | 5,712.94 |
| 基金转换费收入 | 411.78 |
| 合计 | 6,124.72 |

注：1. 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。
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 17,901.52 |
| 信息披露费 | 24,863.02 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行费用 | 85.00 |
| 指数使用费 | 100,000.00 |
| 合计 | 142,849.54 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

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 |
| 江苏省铁路集团有限公司(“江苏铁集”) | 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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 100,202.27 | 139,925.01 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 38,811.15 | 42,092.21 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 61,391.12 | 97,832.80 |

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 20,040.45 | 27,984.99 |

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 | | |
|----------------|---------------------------------|----------------|--------|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 华宝中证 1000 指数 | 华宝中证 1000 指数 C | 合计 |
| 华宝基金 | - | 427.55 | 427.55 |
| 合计 | - | 427.55 | 427.55 |
| 获得销售服务费的各关联方 | 上年度可比期间 | | |
| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | |

| 方名称 | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
|------|------------------|----------------|----------|
| | 华宝中证 1000 指数 | 华宝中证 1000 指数 C | 合计 |
| 华宝基金 | - | 9,859.00 | 9,859.00 |
| 合计 | - | 9,859.00 | 9,859.00 |

注：销售服务费每日计提，按月支付。A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.3% 年费率计提。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下： $H=E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$ ，H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费 E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | |
|--------|---------------------------------------|----------|--------------------------------------------|----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国建设银行 | 2,278,942.51 | 6,281.53 | 2,875,712.37 | 7,705.58 |

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘价 | 数量（股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|-------|------------------|--------|--------|----------------|-------|--------|-----------|-----------|----|
| 300630 | 普利制药 | 2024 年 05 月 06 日 | 重大事项停牌 | 12.35 | 2024 年 7 月 8 日 | 9.88 | 2,100 | 43,686.91 | 25,935.00 | - |
| 002610 | ST 爱康 | 2024 年 06 月 19 日 | 重大事项停牌 | 0.37 | - | - | 29,700 | 86,391.61 | 10,989.00 | - |
| 000982 | 中银绒业 | 2024 年 06 月 24 日 | 重大事项停牌 | 0.18 | - | - | 27,900 | 52,239.78 | 5,022.00 | - |

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪中证 1000 指数。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制限定在限定的范围之内，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大型股份制商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应

的信用风险。

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于本报告期末，除附注中列示的卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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货币资金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|--------------------------|--------------|-------|-------|---------------|---------------|
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 2,278,942.51 | - | - | - | 2,278,942.51 |
| 结算备付金 | 3,920.82 | - | - | - | 3,920.82 |
| 存出保证金 | 1,882.11 | - | - | - | 1,882.11 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 33,656,499.40 | 33,656,499.40 |
| 应收申购款 | 0.01 | - | - | 79,034.07 | 79,034.08 |
| 资产总计 | 2,284,745.45 | - | - | 33,735,533.47 | 36,020,278.92 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 85,314.69 | 85,314.69 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 15,289.21 | 15,289.21 |
| 应付托管费 | - | - | - | 3,057.83 | 3,057.83 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 1,951.39 | 1,951.39 |
| 其他负债 | - | - | - | 121,409.71 | 121,409.71 |
| 负债总计 | - | - | - | 227,022.83 | 227,022.83 |
| 利率敏感度缺口 | 2,284,745.45 | - | - | 33,508,510.64 | 35,793,256.09 |
| 上年度末 2023 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 3,348,279.85 | - | - | - | 3,348,279.85 |
| 结算备付金 | 3,334.71 | - | - | - | 3,334.71 |
| 存出保证金 | 2,080.80 | - | - | - | 2,080.80 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 42,615,179.57 | 42,615,179.57 |
| 应收申购款 | 199.87 | - | - | 191,109.58 | 191,309.45 |
| 资产总计 | 3,353,895.23 | - | - | 42,806,289.15 | 46,160,184.38 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 356,514.66 | 356,514.66 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 19,121.21 | 19,121.21 |
| 应付托管费 | - | - | - | 3,824.25 | 3,824.25 |
| 应付清算款 | - | - | - | 491,590.17 | 491,590.17 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 2,552.31 | 2,552.31 |
| 其他负债 | - | - | - | 215,597.64 | 215,597.64 |
| 负债总计 | - | - | - | 1,089,200.24 | 1,089,200.24 |
| 利率敏感度缺口 | 3,353,895.23 | - | - | 41,717,088.91 | 45,070,984.14 |

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 2024 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2023 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 | 33,656,499.40 | 94.03 | 42,615,179.57 | 94.55 |
| 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 | 33,656,499.40 | 94.03 | 42,615,179.57 | 94.55 |

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 | |
| 分析 | 相关风险变量的变 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |

| | 动 | 本期末 (2024 年 6 月 30 日) | 上年度末 (2023 年 12 月 31 日) |
|----------------|----------------|-----------------------|-------------------------|
| | 1. 业绩比较基准上升 5% | | 1,763,547.18 |
| 2. 业绩比较基准下降 5% | | -1,763,547.18 | -2,226,356.08 |

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

| | | | |
|----|--------------------|-----------------------|-------------------------|
| 假设 | - | | |
| | - | | |
| | - | | |
| 分析 | 风险价值 (单位: 人民币元) | 本期末 (2024 年 6 月 30 日) | 上年度末 (2023 年 12 月 31 日) |
| | 合计 | - | 0.00 |

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次, 由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定: 第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价; 第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值; 第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位: 人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 33,614,553.40 | 42,512,543.65 |
| 第二层次 | 41,946.00 | 102,635.92 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 33,656,499.40 | 42,615,179.57 |

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 33,656,499.40 | 93.44 |
| | 其中：股票 | 33,656,499.40 | 93.44 |
| 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 | 2,282,863.33 | 6.34 |
| 8 | 其他各项资产 | 80,916.19 | 0.22 |
| 9 | 合计 | 36,020,278.92 | 100.00 |

注：本基金本报告期末“固定收益投资”、“买入返售金融资产”、“银行存款和结算备付金合计”等项目的列报金额已包含对应的“应计利息”和“减值准备”（若有），“其他资产”中的“应收利息”指本基金截至本报告期末已过付息期但尚未收到的利息金额（下同）。

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 | 224,679.40 | 0.63 |
| B | 采矿业 | 1,232,985.04 | 3.44 |
| C | 制造业 | 21,712,438.16 | 60.66 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,099,508.12 | 3.07 |
| E | 建筑业 | 552,115.80 | 1.54 |
| F | 批发和零售业 | 1,168,568.24 | 3.26 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,027,697.28 | 2.87 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 3,535,429.28 | 9.88 |
| J | 金融业 | 962,636.35 | 2.69 |
| K | 房地产业 | 512,961.00 | 1.43 |
| L | 租赁和商务服务业 | 550,573.73 | 1.54 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 258,248.92 | 0.72 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 290,809.96 | 0.81 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 115,713.10 | 0.32 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 375,211.02 | 1.05 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 33,619,575.40 | 93.93 |

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 | 36,924.00 | 0.10 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |

| | | | |
|---|-----------------|-----------|------|
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 36,924.00 | 0.10 |

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 | 002456 | 欧菲光 | 21,400 | 167,134.00 | 0.47 |
| 2 | 601099 | 太平洋 | 44,700 | 136,335.00 | 0.38 |
| 3 | 300573 | 兴齐眼药 | 796 | 130,544.00 | 0.36 |
| 4 | 300476 | 胜宏科技 | 3,920 | 126,459.20 | 0.35 |
| 5 | 000426 | 兴业银锡 | 8,400 | 114,072.00 | 0.32 |
| 6 | 002085 | 万丰奥威 | 8,400 | 111,216.00 | 0.31 |
| 7 | 300339 | 润和软件 | 5,200 | 107,484.00 | 0.30 |
| 8 | 002318 | 久立特材 | 4,500 | 104,985.00 | 0.29 |
| 9 | 600312 | 平高电气 | 5,300 | 103,085.00 | 0.29 |
| 10 | 300346 | 南大光电 | 3,570 | 102,066.30 | 0.29 |
| 11 | 000766 | 通化金马 | 6,300 | 101,997.00 | 0.28 |
| 12 | 000528 | 柳工 | 9,000 | 100,710.00 | 0.28 |
| 13 | 601918 | 新集能源 | 10,200 | 99,450.00 | 0.28 |
| 14 | 002405 | 四维图新 | 15,600 | 97,032.00 | 0.27 |
| 15 | 688578 | 艾力斯 | 1,497 | 95,418.78 | 0.27 |
| 16 | 601677 | 明泰铝业 | 8,200 | 94,792.00 | 0.26 |
| 17 | 605111 | 新洁能 | 3,052 | 93,360.68 | 0.26 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|-----------|------|
| 18 | 002130 | 沃尔核材 | 6,600 | 93,192.00 | 0.26 |
| 19 | 688235 | 百济神州 | 800 | 92,672.00 | 0.26 |
| 20 | 002126 | 银轮股份 | 5,300 | 92,273.00 | 0.26 |
| 21 | 601975 | 招商南油 | 25,500 | 91,545.00 | 0.26 |
| 22 | 002176 | 江特电机 | 11,200 | 91,280.00 | 0.26 |
| 23 | 601001 | 晋控煤业 | 5,500 | 90,860.00 | 0.25 |
| 24 | 605589 | 圣泉集团 | 4,400 | 89,276.00 | 0.25 |
| 25 | 600559 | 老白干酒 | 4,805 | 87,354.90 | 0.24 |
| 26 | 002139 | 拓邦股份 | 8,225 | 87,349.50 | 0.24 |
| 27 | 603005 | 晶方科技 | 4,276 | 87,144.88 | 0.24 |
| 28 | 300049 | 福瑞股份 | 1,700 | 85,578.00 | 0.24 |
| 29 | 603129 | 春风动力 | 600 | 85,404.00 | 0.24 |
| 30 | 688019 | 安集科技 | 642 | 80,763.60 | 0.23 |
| 31 | 600100 | 同方股份 | 15,400 | 78,386.00 | 0.22 |
| 32 | 000403 | 派林生物 | 2,933 | 78,193.78 | 0.22 |
| 33 | 688676 | 金盘科技 | 1,499 | 78,172.85 | 0.22 |
| 34 | 600761 | 安徽合力 | 3,600 | 77,904.00 | 0.22 |
| 35 | 002270 | 华明装备 | 3,500 | 77,840.00 | 0.22 |
| 36 | 300775 | 三角防务 | 2,500 | 76,500.00 | 0.21 |
| 37 | 301308 | 江波龙 | 800 | 75,792.00 | 0.21 |
| 38 | 300315 | 掌趣科技 | 18,100 | 75,477.00 | 0.21 |
| 39 | 600685 | 中船防务 | 2,700 | 75,330.00 | 0.21 |
| 40 | 600711 | 盛屯矿业 | 20,500 | 75,235.00 | 0.21 |
| 41 | 300762 | 上海瀚讯 | 4,092 | 73,287.72 | 0.20 |
| 42 | 688608 | 恒玄科技 | 500 | 73,190.00 | 0.20 |
| 43 | 000690 | 宝新能源 | 14,300 | 72,930.00 | 0.20 |
| 44 | 002182 | 宝武镁业 | 6,440 | 72,643.20 | 0.20 |
| 45 | 600285 | 羚锐制药 | 3,000 | 72,630.00 | 0.20 |
| 46 | 000415 | 渤海租赁 | 28,400 | 72,420.00 | 0.20 |
| 47 | 601333 | 广深铁路 | 22,200 | 71,928.00 | 0.20 |
| 48 | 000034 | 神州数码 | 3,100 | 70,959.00 | 0.20 |
| 49 | 300458 | 全志科技 | 2,961 | 69,613.11 | 0.19 |
| 50 | 688166 | 博瑞医药 | 1,961 | 68,635.00 | 0.19 |
| 51 | 000875 | 吉电股份 | 12,800 | 68,224.00 | 0.19 |
| 52 | 300083 | 创世纪 | 11,100 | 68,043.00 | 0.19 |
| 53 | 600323 | 瀚蓝环境 | 3,200 | 66,880.00 | 0.19 |
| 54 | 000422 | 湖北宜化 | 5,600 | 66,752.00 | 0.19 |
| 55 | 002312 | 川发龙蟒 | 9,900 | 66,627.00 | 0.19 |
| 56 | 300679 | 电连技术 | 1,645 | 66,178.35 | 0.18 |
| 57 | 600363 | 联创光电 | 2,400 | 66,048.00 | 0.18 |
| 58 | 688050 | 爱博医疗 | 900 | 65,988.00 | 0.18 |
| 59 | 300115 | 长盈精密 | 5,500 | 65,945.00 | 0.18 |
| 60 | 002402 | 和而泰 | 6,150 | 65,866.50 | 0.18 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 61 | 688076 | 诺泰生物 | 839 | 65,676.92 | 0.18 |
| 62 | 000543 | 皖能电力 | 7,400 | 65,490.00 | 0.18 |
| 63 | 300294 | 博雅生物 | 1,950 | 64,350.00 | 0.18 |
| 64 | 002389 | 航天彩虹 | 4,600 | 63,894.00 | 0.18 |
| 65 | 601126 | 四方股份 | 3,300 | 63,426.00 | 0.18 |
| 66 | 300627 | 华测导航 | 2,120 | 63,282.00 | 0.18 |
| 67 | 300459 | 汤姆猫 | 18,500 | 62,715.00 | 0.18 |
| 68 | 002837 | 英维克 | 2,929 | 62,651.31 | 0.18 |
| 69 | 600422 | 昆药集团 | 3,500 | 62,405.00 | 0.17 |
| 70 | 688327 | 云从科技 | 5,500 | 62,205.00 | 0.17 |
| 71 | 000581 | 威孚高科 | 3,800 | 61,864.00 | 0.17 |
| 72 | 601375 | 中原证券 | 18,100 | 61,721.00 | 0.17 |
| 73 | 688037 | 芯源微 | 688 | 61,232.00 | 0.17 |
| 74 | 603283 | 赛腾股份 | 800 | 61,120.00 | 0.17 |
| 75 | 605090 | 九丰能源 | 2,100 | 60,900.00 | 0.17 |
| 76 | 603556 | 海兴电力 | 1,300 | 60,879.00 | 0.17 |
| 77 | 002851 | 麦格米特 | 2,350 | 60,724.00 | 0.17 |
| 78 | 002807 | 江阴银行 | 16,100 | 60,697.00 | 0.17 |
| 79 | 688266 | 泽璟制药 | 1,118 | 60,617.96 | 0.17 |
| 80 | 002151 | 北斗星通 | 2,500 | 60,450.00 | 0.17 |
| 81 | 600771 | 广誉远 | 3,200 | 60,256.00 | 0.17 |
| 82 | 600908 | 无锡银行 | 11,300 | 60,116.00 | 0.17 |
| 83 | 601222 | 林洋能源 | 9,508 | 59,615.16 | 0.17 |
| 84 | 002332 | 仙琚制药 | 5,200 | 59,332.00 | 0.17 |
| 85 | 688568 | 中科星图 | 1,243 | 59,291.10 | 0.17 |
| 86 | 002245 | 蔚蓝锂芯 | 7,600 | 58,900.00 | 0.16 |
| 87 | 000682 | 东方电子 | 5,300 | 58,512.00 | 0.16 |
| 88 | 603393 | 新天然气 | 1,684 | 58,502.16 | 0.16 |
| 89 | 002145 | 中核钛白 | 17,805 | 58,400.40 | 0.16 |
| 90 | 600750 | 江中药业 | 2,520 | 58,237.20 | 0.16 |
| 91 | 688408 | 中信博 | 632 | 58,194.56 | 0.16 |
| 92 | 603083 | 剑桥科技 | 1,800 | 58,104.00 | 0.16 |
| 93 | 300666 | 江丰电子 | 1,200 | 57,072.00 | 0.16 |
| 94 | 300857 | 协创数据 | 1,000 | 57,000.00 | 0.16 |
| 95 | 000860 | 顺鑫农业 | 3,400 | 56,916.00 | 0.16 |
| 96 | 603505 | 金石资源 | 2,028 | 56,642.04 | 0.16 |
| 97 | 603300 | 华铁应急 | 10,360 | 56,565.60 | 0.16 |
| 98 | 688333 | 铂力特 | 1,165 | 56,444.25 | 0.16 |
| 99 | 301301 | 川宁生物 | 4,400 | 56,232.00 | 0.16 |
| 100 | 688278 | 特宝生物 | 1,047 | 56,066.85 | 0.16 |
| 101 | 688088 | 虹软科技 | 1,941 | 56,017.26 | 0.16 |
| 102 | 002222 | 福晶科技 | 2,475 | 55,761.75 | 0.16 |
| 103 | 600461 | 洪城环境 | 4,800 | 55,584.00 | 0.16 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 104 | 600338 | 西藏珠峰 | 6,000 | 55,440.00 | 0.15 |
| 105 | 300735 | 光弘科技 | 2,566 | 55,425.60 | 0.15 |
| 106 | 300633 | 开立医疗 | 1,400 | 55,412.00 | 0.15 |
| 107 | 600667 | 太极实业 | 9,700 | 55,387.00 | 0.15 |
| 108 | 002400 | 省广集团 | 11,400 | 55,290.00 | 0.15 |
| 109 | 000951 | 中国重汽 | 3,860 | 55,275.20 | 0.15 |
| 110 | 300298 | 三诺生物 | 2,180 | 55,241.20 | 0.15 |
| 111 | 603236 | 移远通信 | 1,180 | 55,141.40 | 0.15 |
| 112 | 600330 | 天通股份 | 8,080 | 54,944.00 | 0.15 |
| 113 | 002745 | 木林森 | 6,800 | 54,808.00 | 0.15 |
| 114 | 600452 | 涪陵电力 | 4,300 | 54,481.00 | 0.15 |
| 115 | 600821 | 金开新能 | 10,500 | 53,970.00 | 0.15 |
| 116 | 600331 | 宏达股份 | 9,300 | 53,847.00 | 0.15 |
| 117 | 002832 | 比音勒芬 | 2,220 | 53,657.40 | 0.15 |
| 118 | 300133 | 华策影视 | 8,700 | 53,418.00 | 0.15 |
| 119 | 600993 | 马应龙 | 2,000 | 53,340.00 | 0.15 |
| 120 | 000628 | 高新发展 | 1,200 | 53,244.00 | 0.15 |
| 121 | 300475 | 香农芯创 | 1,800 | 53,226.00 | 0.15 |
| 122 | 300456 | 赛微电子 | 3,340 | 53,005.80 | 0.15 |
| 123 | 300045 | 华力创通 | 3,000 | 52,950.00 | 0.15 |
| 124 | 600718 | 东软集团 | 6,400 | 52,928.00 | 0.15 |
| 125 | 600916 | 中国黄金 | 5,500 | 52,910.00 | 0.15 |
| 126 | 300672 | 国科微 | 1,000 | 52,840.00 | 0.15 |
| 127 | 688789 | 宏华数科 | 490 | 52,822.00 | 0.15 |
| 128 | 600572 | 康恩贝 | 11,800 | 52,746.00 | 0.15 |
| 129 | 002675 | 东诚药业 | 4,300 | 52,718.00 | 0.15 |
| 130 | 600201 | 生物股份 | 7,300 | 52,633.00 | 0.15 |
| 131 | 000035 | 中国天楹 | 11,600 | 52,548.00 | 0.15 |
| 132 | 002063 | 远光软件 | 10,008 | 52,441.92 | 0.15 |
| 133 | 300757 | 罗博特科 | 600 | 52,410.00 | 0.15 |
| 134 | 600728 | 佳都科技 | 14,100 | 52,311.00 | 0.15 |
| 135 | 002249 | 大洋电机 | 11,000 | 52,030.00 | 0.15 |
| 136 | 002773 | 康弘药业 | 2,400 | 51,960.00 | 0.15 |
| 137 | 300624 | 万兴科技 | 979 | 51,955.53 | 0.15 |
| 138 | 688027 | 国盾量子 | 344 | 51,944.00 | 0.15 |
| 139 | 300182 | 捷成股份 | 14,000 | 51,940.00 | 0.15 |
| 140 | 600123 | 兰花科创 | 5,800 | 51,910.00 | 0.15 |
| 141 | 002484 | 江海股份 | 3,916 | 51,887.00 | 0.14 |
| 142 | 000923 | 河钢资源 | 3,000 | 51,660.00 | 0.14 |
| 143 | 300738 | 奥飞数据 | 5,091 | 51,520.92 | 0.14 |
| 144 | 002317 | 众生药业 | 4,500 | 51,435.00 | 0.14 |
| 145 | 688498 | 源杰科技 | 392 | 51,348.08 | 0.14 |
| 146 | 000686 | 东北证券 | 9,200 | 51,336.00 | 0.14 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 147 | 300638 | 广和通 | 2,997 | 51,248.70 | 0.14 |
| 148 | 002015 | 协鑫能科 | 6,400 | 50,944.00 | 0.14 |
| 149 | 002221 | 东华能源 | 6,200 | 50,902.00 | 0.14 |
| 150 | 600587 | 新华医疗 | 3,230 | 50,840.20 | 0.14 |
| 151 | 300705 | 九典制药 | 1,900 | 50,806.00 | 0.14 |
| 152 | 300623 | 捷捷微电 | 2,930 | 50,689.00 | 0.14 |
| 153 | 600057 | 厦门象屿 | 7,426 | 50,496.80 | 0.14 |
| 154 | 002544 | 普天科技 | 2,700 | 50,463.00 | 0.14 |
| 155 | 603588 | 高能环境 | 8,032 | 50,440.96 | 0.14 |
| 156 | 300811 | 铂科新材 | 1,148 | 50,397.20 | 0.14 |
| 157 | 300525 | 博思软件 | 3,968 | 50,393.60 | 0.14 |
| 158 | 600877 | 电科芯片 | 4,700 | 50,384.00 | 0.14 |
| 159 | 002567 | 唐人神 | 9,350 | 50,116.00 | 0.14 |
| 160 | 600641 | 万业企业 | 4,240 | 49,820.00 | 0.14 |
| 161 | 300761 | 立华股份 | 2,200 | 49,808.00 | 0.14 |
| 162 | 300229 | 拓尔思 | 3,700 | 49,691.00 | 0.14 |
| 163 | 300777 | 中简科技 | 2,300 | 49,450.00 | 0.14 |
| 164 | 002100 | 天康生物 | 7,100 | 49,203.00 | 0.14 |
| 165 | 600601 | 方正科技 | 16,400 | 49,200.00 | 0.14 |
| 166 | 002701 | 奥瑞金 | 11,800 | 49,088.00 | 0.14 |
| 167 | 600850 | 电科数字 | 2,710 | 49,051.00 | 0.14 |
| 168 | 000970 | 中科三环 | 6,400 | 48,960.00 | 0.14 |
| 169 | 000762 | 西藏矿业 | 2,700 | 48,816.00 | 0.14 |
| 170 | 603477 | 巨星农牧 | 1,700 | 48,790.00 | 0.14 |
| 171 | 000902 | 新洋丰 | 4,100 | 48,667.00 | 0.14 |
| 172 | 603279 | 景津装备 | 2,240 | 48,585.60 | 0.14 |
| 173 | 600456 | 宝钛股份 | 1,900 | 48,507.00 | 0.14 |
| 174 | 002617 | 露笑科技 | 10,099 | 48,475.20 | 0.14 |
| 175 | 300075 | 数字政通 | 3,280 | 48,380.00 | 0.14 |
| 176 | 002747 | 埃斯顿 | 3,400 | 48,348.00 | 0.14 |
| 177 | 600216 | 浙江医药 | 4,400 | 48,312.00 | 0.13 |
| 178 | 603565 | 中谷物流 | 5,517 | 48,218.58 | 0.13 |
| 179 | 688639 | 华恒生物 | 631 | 48,202.09 | 0.13 |
| 180 | 300034 | 钢研高纳 | 3,026 | 48,083.14 | 0.13 |
| 181 | 601860 | 紫金银行 | 19,200 | 48,000.00 | 0.13 |
| 182 | 600064 | 南京高科 | 7,900 | 47,953.00 | 0.13 |
| 183 | 001696 | 宗申动力 | 4,500 | 47,880.00 | 0.13 |
| 184 | 002003 | 伟星股份 | 3,800 | 47,690.00 | 0.13 |
| 185 | 600269 | 赣粤高速 | 9,200 | 47,564.00 | 0.13 |
| 186 | 600596 | 新安股份 | 6,240 | 47,424.00 | 0.13 |
| 187 | 002036 | 联创电子 | 7,023 | 47,405.25 | 0.13 |
| 188 | 688016 | 心脉医疗 | 483 | 47,358.15 | 0.13 |
| 189 | 601137 | 博威合金 | 3,100 | 47,244.00 | 0.13 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 190 | 600552 | 凯盛科技 | 5,000 | 47,150.00 | 0.13 |
| 191 | 000927 | 中国铁物 | 19,800 | 47,124.00 | 0.13 |
| 192 | 688139 | 海尔生物 | 1,265 | 47,058.00 | 0.13 |
| 193 | 600420 | 国药现代 | 4,400 | 46,992.00 | 0.13 |
| 194 | 601678 | 滨化股份 | 13,500 | 46,980.00 | 0.13 |
| 195 | 000917 | 电广传媒 | 9,300 | 46,965.00 | 0.13 |
| 196 | 000758 | 中色股份 | 9,200 | 46,736.00 | 0.13 |
| 197 | 002541 | 鸿路钢构 | 2,750 | 46,667.50 | 0.13 |
| 198 | 600971 | 恒源煤电 | 3,900 | 46,566.00 | 0.13 |
| 199 | 601187 | 厦门银行 | 8,700 | 46,371.00 | 0.13 |
| 200 | 300068 | 南都电源 | 5,600 | 46,368.00 | 0.13 |
| 200 | 600602 | 云赛智联 | 4,200 | 46,368.00 | 0.13 |
| 201 | 300482 | 万孚生物 | 1,900 | 46,360.00 | 0.13 |
| 202 | 601777 | 力帆科技 | 12,000 | 46,080.00 | 0.13 |
| 203 | 002839 | 张家港行 | 11,400 | 45,828.00 | 0.13 |
| 204 | 600595 | 中孚实业 | 18,400 | 45,816.00 | 0.13 |
| 205 | 603323 | 苏农银行 | 9,510 | 45,743.10 | 0.13 |
| 206 | 300415 | 伊之密 | 2,200 | 45,716.00 | 0.13 |
| 207 | 600273 | 嘉化能源 | 6,400 | 45,696.00 | 0.13 |
| 208 | 603678 | 火炬电子 | 1,850 | 45,676.50 | 0.13 |
| 209 | 688062 | 迈威生物 | 1,573 | 45,522.62 | 0.13 |
| 210 | 603766 | 隆鑫通用 | 6,700 | 45,426.00 | 0.13 |
| 211 | 000012 | 南玻 A | 9,000 | 45,360.00 | 0.13 |
| 212 | 600179 | 安通控股 | 19,400 | 45,202.00 | 0.13 |
| 213 | 300236 | 上海新阳 | 1,450 | 45,153.00 | 0.13 |
| 214 | 600246 | 万通发展 | 6,700 | 45,024.00 | 0.13 |
| 215 | 300457 | 赢合科技 | 2,525 | 45,020.75 | 0.13 |
| 216 | 600320 | 振华重工 | 13,100 | 44,802.00 | 0.13 |
| 217 | 600120 | 浙江东方 | 13,400 | 44,756.00 | 0.13 |
| 218 | 300036 | 超图软件 | 3,200 | 44,672.00 | 0.12 |
| 219 | 603871 | 嘉友国际 | 2,520 | 44,578.80 | 0.12 |
| 220 | 603027 | 千禾味业 | 3,349 | 44,541.70 | 0.12 |
| 221 | 002737 | 葵花药业 | 1,900 | 44,422.00 | 0.12 |
| 222 | 002335 | 科华数据 | 2,100 | 44,373.00 | 0.12 |
| 223 | 300101 | 振芯科技 | 3,000 | 44,310.00 | 0.12 |
| 224 | 600562 | 国睿科技 | 3,232 | 44,149.12 | 0.12 |
| 225 | 600633 | 浙数文化 | 5,000 | 44,050.00 | 0.12 |
| 226 | 688596 | 正帆科技 | 1,334 | 44,022.00 | 0.12 |
| 227 | 688575 | 亚辉龙 | 1,883 | 43,911.56 | 0.12 |
| 228 | 603599 | 广信股份 | 3,620 | 43,910.60 | 0.12 |
| 229 | 300327 | 中颖电子 | 2,230 | 43,886.40 | 0.12 |
| 230 | 002597 | 金禾实业 | 2,200 | 43,758.00 | 0.12 |
| 231 | 002237 | 恒邦股份 | 3,800 | 43,738.00 | 0.12 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 232 | 688318 | 财富趋势 | 554 | 43,716.14 | 0.12 |
| 233 | 000737 | 北方铜业 | 4,700 | 43,616.00 | 0.12 |
| 234 | 600116 | 三峡水利 | 6,300 | 43,470.00 | 0.12 |
| 235 | 002416 | 爱施德 | 4,900 | 43,365.00 | 0.12 |
| 236 | 002075 | 沙钢股份 | 11,500 | 43,355.00 | 0.12 |
| 237 | 002091 | 江苏国泰 | 6,360 | 43,311.60 | 0.12 |
| 238 | 600577 | 精达股份 | 10,900 | 43,273.00 | 0.12 |
| 239 | 001309 | 德明利 | 500 | 43,200.00 | 0.12 |
| 240 | 000650 | 仁和药业 | 7,300 | 43,070.00 | 0.12 |
| 241 | 300303 | 聚飞光电 | 8,840 | 42,962.40 | 0.12 |
| 242 | 688208 | 道通科技 | 1,779 | 42,945.06 | 0.12 |
| 243 | 600621 | 华鑫股份 | 3,500 | 42,910.00 | 0.12 |
| 244 | 600428 | 中远海特 | 7,000 | 42,840.00 | 0.12 |
| 245 | 600446 | 金证股份 | 4,300 | 42,699.00 | 0.12 |
| 246 | 000829 | 天音控股 | 4,700 | 42,676.00 | 0.12 |
| 247 | 600395 | 盘江股份 | 7,100 | 42,671.00 | 0.12 |
| 248 | 601778 | 晶科科技 | 18,700 | 42,636.00 | 0.12 |
| 249 | 600210 | 紫江企业 | 8,000 | 42,560.00 | 0.12 |
| 250 | 603997 | 继峰股份 | 4,150 | 42,454.50 | 0.12 |
| 251 | 300130 | 新国都 | 2,540 | 42,265.60 | 0.12 |
| 252 | 300026 | 红日药业 | 13,800 | 42,090.00 | 0.12 |
| 253 | 000657 | 中钨高新 | 4,604 | 42,080.56 | 0.12 |
| 254 | 002192 | 融捷股份 | 1,400 | 42,028.00 | 0.12 |
| 255 | 300319 | 麦捷科技 | 4,500 | 41,985.00 | 0.12 |
| 256 | 000685 | 中山公用 | 5,800 | 41,818.00 | 0.12 |
| 257 | 688116 | 天奈科技 | 1,808 | 41,728.64 | 0.12 |
| 258 | 002698 | 博实股份 | 3,400 | 41,718.00 | 0.12 |
| 259 | 300674 | 宇信科技 | 3,748 | 41,527.84 | 0.12 |
| 260 | 002020 | 京新药业 | 3,960 | 41,461.20 | 0.12 |
| 261 | 688018 | 乐鑫科技 | 420 | 41,445.60 | 0.12 |
| 262 | 002048 | 宁波华翔 | 3,200 | 41,408.00 | 0.12 |
| 263 | 002011 | 盾安环境 | 4,200 | 41,286.00 | 0.12 |
| 264 | 301039 | 中集车辆 | 4,800 | 41,280.00 | 0.12 |
| 265 | 600782 | 新钢股份 | 12,400 | 41,168.00 | 0.12 |
| 266 | 300910 | 瑞丰新材 | 940 | 41,096.80 | 0.11 |
| 267 | 002396 | 星网锐捷 | 3,100 | 40,951.00 | 0.11 |
| 268 | 600986 | 浙文互联 | 9,740 | 40,908.00 | 0.11 |
| 269 | 000420 | 吉林化纤 | 12,900 | 40,764.00 | 0.11 |
| 270 | 603220 | 中贝通信 | 1,500 | 40,740.00 | 0.11 |
| 271 | 688289 | 圣湘生物 | 2,316 | 40,715.28 | 0.11 |
| 272 | 000676 | 智度股份 | 6,700 | 40,669.00 | 0.11 |
| 273 | 600409 | 三友化工 | 8,100 | 40,662.00 | 0.11 |
| 274 | 600717 | 天津港 | 9,500 | 40,565.00 | 0.11 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 275 | 600072 | 中船科技 | 3,000 | 40,560.00 | 0.11 |
| 276 | 600459 | 贵研铂业 | 2,996 | 40,475.96 | 0.11 |
| 277 | 600976 | 健民集团 | 800 | 40,400.00 | 0.11 |
| 278 | 300747 | 锐科激光 | 2,276 | 40,399.00 | 0.11 |
| 279 | 603358 | 华达科技 | 1,400 | 40,390.00 | 0.11 |
| 280 | 688110 | 东芯股份 | 2,114 | 40,313.98 | 0.11 |
| 281 | 600645 | 中源协和 | 2,500 | 40,250.00 | 0.11 |
| 282 | 002171 | 楚江新材 | 6,100 | 40,199.00 | 0.11 |
| 283 | 002706 | 良信股份 | 5,850 | 40,131.00 | 0.11 |
| 284 | 603690 | 至纯科技 | 1,740 | 40,037.40 | 0.11 |
| 285 | 300284 | 苏交科 | 4,952 | 40,012.16 | 0.11 |
| 286 | 000801 | 四川九洲 | 4,000 | 40,000.00 | 0.11 |
| 287 | 300035 | 中科电气 | 4,700 | 39,997.00 | 0.11 |
| 288 | 603108 | 润达医疗 | 2,640 | 39,969.60 | 0.11 |
| 289 | 600328 | 中盐化工 | 5,790 | 39,719.40 | 0.11 |
| 290 | 600575 | 淮河能源 | 10,200 | 39,678.00 | 0.11 |
| 291 | 000028 | 国药一致 | 1,230 | 39,642.90 | 0.11 |
| 292 | 300244 | 迪安诊断 | 3,300 | 39,600.00 | 0.11 |
| 293 | 688123 | 聚辰股份 | 650 | 39,539.50 | 0.11 |
| 294 | 002004 | 华邦健康 | 10,400 | 39,520.00 | 0.11 |
| 295 | 300170 | 汉得信息 | 6,400 | 39,296.00 | 0.11 |
| 296 | 600252 | 中恒集团 | 18,100 | 39,277.00 | 0.11 |
| 297 | 002539 | 云图控股 | 5,500 | 39,215.00 | 0.11 |
| 298 | 002948 | 青岛银行 | 11,600 | 39,092.00 | 0.11 |
| 299 | 600295 | 鄂尔多斯 | 3,928 | 38,965.76 | 0.11 |
| 300 | 600864 | 哈投股份 | 8,200 | 38,950.00 | 0.11 |
| 301 | 001301 | 尚太科技 | 900 | 38,898.00 | 0.11 |
| 302 | 002351 | 漫步者 | 2,950 | 38,792.50 | 0.11 |
| 303 | 601028 | 玉龙股份 | 3,100 | 38,750.00 | 0.11 |
| 303 | 601963 | 重庆银行 | 5,000 | 38,750.00 | 0.11 |
| 304 | 688518 | 联赢激光 | 2,315 | 38,660.50 | 0.11 |
| 305 | 600267 | 海正药业 | 5,500 | 38,610.00 | 0.11 |
| 306 | 300773 | 拉卡拉 | 3,100 | 38,533.00 | 0.11 |
| 307 | 301050 | 雷电微力 | 800 | 38,528.00 | 0.11 |
| 308 | 603308 | 应流股份 | 3,100 | 38,502.00 | 0.11 |
| 309 | 600158 | 中体产业 | 5,000 | 38,450.00 | 0.11 |
| 310 | 000915 | 华特达因 | 1,270 | 38,303.20 | 0.11 |
| 311 | 600586 | 金晶科技 | 6,600 | 38,280.00 | 0.11 |
| 312 | 600037 | 歌华有线 | 6,400 | 38,272.00 | 0.11 |
| 313 | 300079 | 数码视讯 | 9,400 | 38,164.00 | 0.11 |
| 314 | 000969 | 安泰科技 | 4,800 | 38,064.00 | 0.11 |
| 315 | 002212 | 天融信 | 7,800 | 37,986.00 | 0.11 |
| 316 | 002099 | 海翔药业 | 7,400 | 37,814.00 | 0.11 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 317 | 300188 | 国投智能 | 3,400 | 37,774.00 | 0.11 |
| 318 | 002324 | 普利特 | 4,400 | 37,620.00 | 0.11 |
| 319 | 600688 | 上海石化 | 14,400 | 37,584.00 | 0.11 |
| 320 | 688409 | 富创精密 | 1,017 | 37,567.98 | 0.10 |
| 321 | 603267 | 鸿远电子 | 1,100 | 37,510.00 | 0.10 |
| 322 | 600888 | 新疆众和 | 5,300 | 37,471.00 | 0.10 |
| 323 | 002906 | 华阳集团 | 1,400 | 37,464.00 | 0.10 |
| 324 | 002061 | 浙江交科 | 10,260 | 37,449.00 | 0.10 |
| 325 | 000821 | 京山轻机 | 3,300 | 37,389.00 | 0.10 |
| 326 | 002123 | 梦网科技 | 5,300 | 37,259.00 | 0.10 |
| 327 | 300470 | 中密控股 | 1,100 | 37,191.00 | 0.10 |
| 328 | 603026 | 石大胜华 | 1,100 | 37,180.00 | 0.10 |
| 329 | 300678 | 中科信息 | 1,400 | 37,128.00 | 0.10 |
| 330 | 300618 | 寒锐钴业 | 1,400 | 37,030.00 | 0.10 |
| 331 | 002643 | 万润股份 | 3,700 | 37,000.00 | 0.10 |
| 332 | 600933 | 爱柯迪 | 2,500 | 36,975.00 | 0.10 |
| 333 | 002428 | 云南锗业 | 3,400 | 36,924.00 | 0.10 |
| 334 | 601311 | 骆驼股份 | 4,600 | 36,892.00 | 0.10 |
| 335 | 000681 | 视觉中国 | 3,200 | 36,800.00 | 0.10 |
| 336 | 688100 | 威胜信息 | 964 | 36,776.60 | 0.10 |
| 337 | 300166 | 东方国信 | 6,000 | 36,720.00 | 0.10 |
| 338 | 600138 | 中青旅 | 3,800 | 36,708.00 | 0.10 |
| 339 | 000727 | 冠捷科技 | 17,800 | 36,668.00 | 0.10 |
| 340 | 300576 | 容大感光 | 1,000 | 36,530.00 | 0.10 |
| 341 | 601702 | 华峰铝业 | 2,000 | 36,520.00 | 0.10 |
| 342 | 600720 | 中交设计 | 4,100 | 36,490.00 | 0.10 |
| 343 | 002154 | 报喜鸟 | 6,700 | 36,448.00 | 0.10 |
| 344 | 000552 | 甘肃能化 | 10,500 | 36,435.00 | 0.10 |
| 345 | 002174 | 游族网络 | 4,800 | 36,432.00 | 0.10 |
| 346 | 000555 | 神州信息 | 3,900 | 36,348.00 | 0.10 |
| 347 | 600480 | 凌云股份 | 3,680 | 36,174.40 | 0.10 |
| 348 | 300685 | 艾德生物 | 2,048 | 36,126.72 | 0.10 |
| 349 | 600557 | 康缘药业 | 2,300 | 36,110.00 | 0.10 |
| 350 | 601369 | 陕鼓动力 | 4,500 | 36,090.00 | 0.10 |
| 351 | 300109 | 新开源 | 3,111 | 36,025.38 | 0.10 |
| 352 | 600248 | 陕建股份 | 9,900 | 35,937.00 | 0.10 |
| 353 | 600125 | 铁龙物流 | 6,000 | 35,820.00 | 0.10 |
| 354 | 002079 | 苏州固锴 | 4,200 | 35,784.00 | 0.10 |
| 355 | 601718 | 际华集团 | 14,400 | 35,712.00 | 0.10 |
| 356 | 300343 | 联创股份 | 7,500 | 35,700.00 | 0.10 |
| 357 | 002023 | 海特高新 | 3,900 | 35,685.00 | 0.10 |
| 358 | 600259 | 广晟有色 | 1,300 | 35,542.00 | 0.10 |
| 359 | 002254 | 泰和新材 | 4,000 | 35,400.00 | 0.10 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 360 | 000429 | 粤高速 A | 3,400 | 35,394.00 | 0.10 |
| 361 | 000049 | 德赛电池 | 1,505 | 35,292.25 | 0.10 |
| 362 | 300185 | 通裕重工 | 20,500 | 35,260.00 | 0.10 |
| 363 | 603063 | 禾望电气 | 2,300 | 35,259.00 | 0.10 |
| 364 | 300655 | 晶瑞电材 | 4,880 | 35,136.00 | 0.10 |
| 365 | 300783 | 三只松鼠 | 1,600 | 34,992.00 | 0.10 |
| 366 | 002214 | 大立科技 | 3,100 | 34,968.00 | 0.10 |
| 367 | 600597 | 光明乳业 | 4,500 | 34,965.00 | 0.10 |
| 368 | 002010 | 传化智联 | 9,100 | 34,944.00 | 0.10 |
| 369 | 601101 | 昊华能源 | 3,800 | 34,922.00 | 0.10 |
| 370 | 600063 | 皖维高新 | 9,900 | 34,848.00 | 0.10 |
| 371 | 600509 | 天富能源 | 6,300 | 34,713.00 | 0.10 |
| 372 | 600206 | 有研新材 | 3,900 | 34,710.00 | 0.10 |
| 373 | 002727 | 一心堂 | 2,300 | 34,707.00 | 0.10 |
| 374 | 300398 | 飞凯材料 | 2,820 | 34,686.00 | 0.10 |
| 375 | 002292 | 奥飞娱乐 | 5,800 | 34,684.00 | 0.10 |
| 376 | 002038 | 双鹭药业 | 4,700 | 34,639.00 | 0.10 |
| 377 | 600055 | 万东医疗 | 2,800 | 34,580.00 | 0.10 |
| 378 | 000090 | 天健集团 | 8,600 | 34,572.00 | 0.10 |
| 379 | 002276 | 万马股份 | 4,800 | 34,416.00 | 0.10 |
| 380 | 600507 | 方大特钢 | 9,200 | 34,408.00 | 0.10 |
| 381 | 002233 | 塔牌集团 | 4,700 | 34,357.00 | 0.10 |
| 382 | 002215 | 诺普信 | 4,600 | 34,270.00 | 0.10 |
| 382 | 002239 | 奥特佳 | 14,900 | 34,270.00 | 0.10 |
| 383 | 000811 | 冰轮环境 | 3,550 | 34,257.50 | 0.10 |
| 384 | 603699 | 纽威股份 | 2,000 | 34,240.00 | 0.10 |
| 385 | 002043 | 兔宝宝 | 3,300 | 34,221.00 | 0.10 |
| 386 | 603920 | 世运电路 | 1,730 | 34,150.20 | 0.10 |
| 387 | 688007 | 光峰科技 | 2,119 | 34,115.90 | 0.10 |
| 388 | 300077 | 国民技术 | 3,900 | 34,047.00 | 0.10 |
| 389 | 600635 | 大众公用 | 12,700 | 34,036.00 | 0.10 |
| 390 | 002446 | 盛路通信 | 6,020 | 34,013.00 | 0.10 |
| 391 | 002635 | 安洁科技 | 2,200 | 33,968.00 | 0.09 |
| 392 | 600197 | 伊力特 | 1,900 | 33,839.00 | 0.09 |
| 393 | 002183 | 怡亚通 | 11,900 | 33,796.00 | 0.09 |
| 394 | 600502 | 安徽建工 | 7,856 | 33,780.80 | 0.09 |
| 395 | 002815 | 崇达技术 | 3,600 | 33,768.00 | 0.09 |
| 396 | 603281 | 江瀚新材 | 1,500 | 33,675.00 | 0.09 |
| 397 | 000065 | 北方国际 | 3,242 | 33,619.54 | 0.09 |
| 398 | 688279 | 峰昭科技 | 303 | 33,602.70 | 0.09 |
| 399 | 688556 | 高测股份 | 2,826 | 33,601.14 | 0.09 |
| 400 | 002468 | 申通快递 | 4,000 | 33,600.00 | 0.09 |
| 401 | 688106 | 金宏气体 | 1,917 | 33,585.84 | 0.09 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 402 | 002761 | 浙江建投 | 4,300 | 33,583.00 | 0.09 |
| 403 | 600729 | 重庆百货 | 1,500 | 33,540.00 | 0.09 |
| 404 | 300693 | 盛弘股份 | 1,600 | 33,504.00 | 0.09 |
| 405 | 000582 | 北部湾港 | 4,500 | 33,480.00 | 0.09 |
| 406 | 688739 | 成大生物 | 1,381 | 33,475.44 | 0.09 |
| 407 | 600059 | 古越龙山 | 4,200 | 33,348.00 | 0.09 |
| 408 | 600266 | 城建发展 | 8,900 | 33,286.00 | 0.09 |
| 409 | 600006 | 东风股份 | 5,200 | 33,228.00 | 0.09 |
| 410 | 300151 | 昌红科技 | 2,100 | 33,222.00 | 0.09 |
| 411 | 688321 | 微芯生物 | 1,887 | 33,211.20 | 0.09 |
| 412 | 002840 | 华统股份 | 2,000 | 33,180.00 | 0.09 |
| 413 | 600211 | 西藏药业 | 1,018 | 33,166.44 | 0.09 |
| 414 | 000913 | 钱江摩托 | 2,100 | 33,096.00 | 0.09 |
| 415 | 300348 | 长亮科技 | 4,850 | 33,077.00 | 0.09 |
| 416 | 300855 | 图南股份 | 1,250 | 33,050.00 | 0.09 |
| 417 | 600961 | 株冶集团 | 3,500 | 33,040.00 | 0.09 |
| 418 | 002895 | 川恒股份 | 1,800 | 32,958.00 | 0.09 |
| 419 | 300598 | 诚迈科技 | 1,170 | 32,853.60 | 0.09 |
| 420 | 600478 | 科力远 | 8,700 | 32,799.00 | 0.09 |
| 421 | 300113 | 顺网科技 | 3,200 | 32,768.00 | 0.09 |
| 422 | 603368 | 柳药集团 | 1,870 | 32,725.00 | 0.09 |
| 423 | 600740 | 山西焦化 | 8,336 | 32,677.12 | 0.09 |
| 424 | 300570 | 太辰光 | 1,000 | 32,660.00 | 0.09 |
| 425 | 000810 | 创维数字 | 3,800 | 32,604.00 | 0.09 |
| 426 | 002354 | 天娱数科 | 10,900 | 32,591.00 | 0.09 |
| 427 | 688403 | 汇成股份 | 3,833 | 32,503.84 | 0.09 |
| 428 | 300180 | 华峰超纤 | 9,200 | 32,476.00 | 0.09 |
| 429 | 002421 | 达实智能 | 13,900 | 32,387.00 | 0.09 |
| 430 | 601952 | 苏垦农发 | 3,590 | 32,381.80 | 0.09 |
| 431 | 002315 | 焦点科技 | 1,200 | 32,352.00 | 0.09 |
| 432 | 000901 | 航天科技 | 3,693 | 32,350.68 | 0.09 |
| 433 | 600017 | 日照港 | 12,100 | 32,307.00 | 0.09 |
| 434 | 002726 | 龙大美食 | 4,924 | 32,301.44 | 0.09 |
| 435 | 600757 | 长江传媒 | 4,000 | 32,240.00 | 0.09 |
| 436 | 000848 | 承德露露 | 4,100 | 32,226.00 | 0.09 |
| 437 | 002006 | 精工科技 | 2,400 | 32,208.00 | 0.09 |
| 438 | 600531 | 豫光金铅 | 5,000 | 32,200.00 | 0.09 |
| 439 | 600012 | 皖通高速 | 2,300 | 32,131.00 | 0.09 |
| 440 | 603713 | 密尔克卫 | 600 | 32,112.00 | 0.09 |
| 441 | 600773 | 西藏城投 | 3,100 | 31,992.00 | 0.09 |
| 442 | 601163 | 三角轮胎 | 2,100 | 31,962.00 | 0.09 |
| 443 | 000603 | 盛达资源 | 2,700 | 31,941.00 | 0.09 |
| 444 | 600305 | 恒顺醋业 | 4,416 | 31,927.68 | 0.09 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 445 | 300463 | 迈克生物 | 2,800 | 31,864.00 | 0.09 |
| 446 | 002081 | 金螳螂 | 10,500 | 31,815.00 | 0.09 |
| 447 | 000966 | 长源电力 | 7,200 | 31,752.00 | 0.09 |
| 448 | 688183 | 生益电子 | 1,637 | 31,725.06 | 0.09 |
| 449 | 688798 | 艾为电子 | 560 | 31,707.20 | 0.09 |
| 450 | 000567 | 海德股份 | 5,645 | 31,668.45 | 0.09 |
| 451 | 300031 | 宝通科技 | 2,200 | 31,614.00 | 0.09 |
| 452 | 688083 | 中望软件 | 434 | 31,517.08 | 0.09 |
| 453 | 603197 | 保隆科技 | 1,000 | 31,500.00 | 0.09 |
| 454 | 603033 | 三维股份 | 2,690 | 31,473.00 | 0.09 |
| 455 | 601200 | 上海环境 | 3,700 | 31,450.00 | 0.09 |
| 456 | 603612 | 索通发展 | 2,460 | 31,389.60 | 0.09 |
| 457 | 600185 | 格力地产 | 7,380 | 31,365.00 | 0.09 |
| 458 | 300123 | 亚光科技 | 6,740 | 31,273.60 | 0.09 |
| 459 | 600550 | 保变电气 | 6,000 | 31,260.00 | 0.09 |
| 460 | 300432 | 富临精工 | 4,850 | 31,234.00 | 0.09 |
| 461 | 300065 | 海兰信 | 4,725 | 31,232.25 | 0.09 |
| 462 | 688503 | 聚和材料 | 1,111 | 31,219.10 | 0.09 |
| 463 | 603008 | 喜临门 | 1,800 | 31,194.00 | 0.09 |
| 464 | 000928 | 中钢国际 | 5,620 | 31,191.00 | 0.09 |
| 465 | 002226 | 江南化工 | 6,960 | 31,180.80 | 0.09 |
| 466 | 301035 | 润丰股份 | 700 | 31,178.00 | 0.09 |
| 467 | 002458 | 益生股份 | 3,600 | 31,176.00 | 0.09 |
| 468 | 000488 | 晨鸣纸业 | 9,000 | 31,140.00 | 0.09 |
| 469 | 002649 | 博彦科技 | 3,900 | 31,044.00 | 0.09 |
| 470 | 600797 | 浙大网新 | 6,700 | 31,021.00 | 0.09 |
| 471 | 601890 | 亚星锚链 | 4,400 | 31,020.00 | 0.09 |
| 472 | 002705 | 新宝股份 | 2,200 | 30,954.00 | 0.09 |
| 473 | 688192 | 迪哲医药 | 836 | 30,798.24 | 0.09 |
| 474 | 600996 | 贵广网络 | 4,000 | 30,720.00 | 0.09 |
| 475 | 603306 | 华懋科技 | 1,700 | 30,719.00 | 0.09 |
| 476 | 300770 | 新媒股份 | 920 | 30,709.60 | 0.09 |
| 477 | 300827 | 上能电气 | 1,372 | 30,677.92 | 0.09 |
| 478 | 603100 | 川仪股份 | 1,300 | 30,563.00 | 0.09 |
| 479 | 002467 | 二六三 | 9,130 | 30,494.20 | 0.09 |
| 480 | 601208 | 东材科技 | 4,200 | 30,492.00 | 0.09 |
| 481 | 600776 | 东方通信 | 3,100 | 30,473.00 | 0.09 |
| 482 | 002511 | 中顺洁柔 | 4,400 | 30,448.00 | 0.09 |
| 483 | 601528 | 瑞丰银行 | 6,440 | 30,396.80 | 0.08 |
| 484 | 000550 | 江铃汽车 | 1,400 | 30,394.00 | 0.08 |
| 485 | 600869 | 远东股份 | 8,700 | 30,363.00 | 0.08 |
| 486 | 002681 | 奋达科技 | 8,300 | 30,295.00 | 0.08 |
| 487 | 300634 | 彩讯股份 | 1,800 | 30,294.00 | 0.08 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 488 | 002960 | 青鸟消防 | 2,395 | 30,272.80 | 0.08 |
| 489 | 603128 | 华贸物流 | 5,240 | 30,234.80 | 0.08 |
| 490 | 300027 | 华谊兄弟 | 18,200 | 30,212.00 | 0.08 |
| 491 | 603919 | 金徽酒 | 1,660 | 30,162.20 | 0.08 |
| 492 | 002097 | 山河智能 | 5,000 | 30,150.00 | 0.08 |
| 492 | 600033 | 福建高速 | 9,000 | 30,150.00 | 0.08 |
| 493 | 603888 | 新华网 | 1,400 | 30,114.00 | 0.08 |
| 494 | 300224 | 正海磁材 | 3,250 | 30,095.00 | 0.08 |
| 495 | 000503 | 国新健康 | 4,500 | 30,015.00 | 0.08 |
| 496 | 300232 | 洲明科技 | 5,748 | 30,004.56 | 0.08 |
| 497 | 002847 | 盐津铺子 | 700 | 29,939.00 | 0.08 |
| 498 | 300379 | 东方通 | 3,700 | 29,896.00 | 0.08 |
| 499 | 300596 | 利安隆 | 1,100 | 29,843.00 | 0.08 |
| 500 | 300233 | 金城医药 | 2,000 | 29,840.00 | 0.08 |
| 501 | 600151 | 航天机电 | 6,600 | 29,832.00 | 0.08 |
| 502 | 601326 | 秦港股份 | 9,400 | 29,798.00 | 0.08 |
| 503 | 000990 | 诚志股份 | 4,000 | 29,760.00 | 0.08 |
| 504 | 300428 | 立中集团 | 1,600 | 29,744.00 | 0.08 |
| 505 | 300171 | 东富龙 | 2,500 | 29,725.00 | 0.08 |
| 506 | 300455 | 航天智装 | 2,400 | 29,664.00 | 0.08 |
| 507 | 600675 | 中华企业 | 12,000 | 29,640.00 | 0.08 |
| 508 | 603881 | 数据港 | 2,330 | 29,614.30 | 0.08 |
| 509 | 000600 | 建投能源 | 4,700 | 29,610.00 | 0.08 |
| 510 | 688559 | 海目星 | 900 | 29,601.00 | 0.08 |
| 511 | 300416 | 苏试试验 | 2,300 | 29,578.00 | 0.08 |
| 512 | 601519 | 大智慧 | 5,300 | 29,468.00 | 0.08 |
| 513 | 000837 | 秦川机床 | 4,000 | 29,440.00 | 0.08 |
| 514 | 300620 | 光库科技 | 800 | 29,424.00 | 0.08 |
| 515 | 002127 | 南极电商 | 11,300 | 29,380.00 | 0.08 |
| 516 | 300129 | 泰胜风能 | 4,300 | 29,326.00 | 0.08 |
| 517 | 300406 | 九强生物 | 1,900 | 29,222.00 | 0.08 |
| 518 | 688322 | 奥比中光 | 1,093 | 29,194.03 | 0.08 |
| 519 | 300841 | 康华生物 | 575 | 29,118.00 | 0.08 |
| 520 | 300352 | 北信源 | 7,575 | 29,088.00 | 0.08 |
| 520 | 601619 | 嘉泽新能 | 9,600 | 29,088.00 | 0.08 |
| 521 | 300393 | 中来股份 | 5,027 | 29,005.79 | 0.08 |
| 522 | 300366 | 创意信息 | 4,000 | 28,960.00 | 0.08 |
| 523 | 002626 | 金达威 | 2,000 | 28,900.00 | 0.08 |
| 523 | 600623 | 华谊集团 | 5,000 | 28,900.00 | 0.08 |
| 524 | 002583 | 海能达 | 7,100 | 28,897.00 | 0.08 |
| 525 | 600997 | 开滦股份 | 4,200 | 28,812.00 | 0.08 |
| 526 | 300856 | 科思股份 | 900 | 28,809.00 | 0.08 |
| 527 | 300725 | 药石科技 | 1,076 | 28,804.52 | 0.08 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 528 | 301095 | 广立微 | 700 | 28,784.00 | 0.08 |
| 529 | 301219 | 腾远钴业 | 750 | 28,695.00 | 0.08 |
| 530 | 002498 | 汉缆股份 | 8,700 | 28,623.00 | 0.08 |
| 531 | 003021 | 兆威机电 | 620 | 28,613.00 | 0.08 |
| 532 | 002605 | 姚记科技 | 1,400 | 28,588.00 | 0.08 |
| 533 | 603039 | 泛微网络 | 900 | 28,584.00 | 0.08 |
| 534 | 600007 | 中国国贸 | 1,300 | 28,548.00 | 0.08 |
| 535 | 300593 | 新雷能 | 2,860 | 28,428.40 | 0.08 |
| 536 | 688141 | 杰华特 | 1,759 | 28,425.44 | 0.08 |
| 537 | 688262 | 国芯科技 | 1,559 | 28,389.39 | 0.08 |
| 538 | 002777 | 久远银海 | 1,886 | 28,271.14 | 0.08 |
| 539 | 300602 | 飞荣达 | 1,869 | 28,240.59 | 0.08 |
| 540 | 300451 | 创业慧康 | 8,157 | 28,223.22 | 0.08 |
| 541 | 600389 | 江山股份 | 2,000 | 28,220.00 | 0.08 |
| 542 | 000767 | 晋控电力 | 12,100 | 28,193.00 | 0.08 |
| 543 | 688630 | 芯碁微装 | 449 | 28,093.93 | 0.08 |
| 544 | 600110 | 诺德股份 | 9,200 | 28,060.00 | 0.08 |
| 545 | 300260 | 新莱应材 | 1,340 | 28,059.60 | 0.08 |
| 546 | 001914 | 招商积余 | 2,800 | 28,056.00 | 0.08 |
| 547 | 600313 | 农发种业 | 5,000 | 27,950.00 | 0.08 |
| 548 | 301171 | 易点天下 | 1,900 | 27,930.00 | 0.08 |
| 549 | 002545 | 东方铁塔 | 4,100 | 27,921.00 | 0.08 |
| 550 | 002537 | 海联金汇 | 5,380 | 27,814.60 | 0.08 |
| 551 | 000950 | 重药控股 | 5,700 | 27,759.00 | 0.08 |
| 552 | 603936 | 博敏电子 | 3,300 | 27,720.00 | 0.08 |
| 553 | 002859 | 洁美科技 | 1,380 | 27,710.40 | 0.08 |
| 554 | 600710 | 苏美达 | 3,400 | 27,710.00 | 0.08 |
| 555 | 600649 | 城投控股 | 8,300 | 27,556.00 | 0.08 |
| 556 | 000756 | 新华制药 | 1,900 | 27,512.00 | 0.08 |
| 557 | 002274 | 华昌化工 | 3,700 | 27,454.00 | 0.08 |
| 558 | 600787 | 中储股份 | 5,700 | 27,417.00 | 0.08 |
| 559 | 002077 | 大港股份 | 2,300 | 27,416.00 | 0.08 |
| 560 | 000719 | 中原传媒 | 2,700 | 27,297.00 | 0.08 |
| 561 | 600458 | 时代新材 | 2,700 | 27,270.00 | 0.08 |
| 562 | 603876 | 鼎胜新材 | 2,940 | 27,253.80 | 0.08 |
| 563 | 688439 | 振华风光 | 410 | 27,244.50 | 0.08 |
| 564 | 301071 | 力量钻石 | 980 | 27,155.80 | 0.08 |
| 565 | 600496 | 精工钢构 | 10,600 | 27,136.00 | 0.08 |
| 566 | 300087 | 荃银高科 | 4,380 | 27,068.40 | 0.08 |
| 567 | 601801 | 皖新传媒 | 3,900 | 27,027.00 | 0.08 |
| 568 | 002550 | 千红制药 | 5,000 | 26,950.00 | 0.08 |
| 569 | 600508 | 上海能源 | 1,900 | 26,885.00 | 0.08 |
| 570 | 300772 | 运达股份 | 2,800 | 26,880.00 | 0.08 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 571 | 002928 | 华夏航空 | 4,225 | 26,786.50 | 0.07 |
| 572 | 002108 | 沧州明珠 | 8,742 | 26,750.52 | 0.07 |
| 573 | 600366 | 宁波韵升 | 5,100 | 26,622.00 | 0.07 |
| 574 | 600490 | 鹏欣资源 | 10,200 | 26,520.00 | 0.07 |
| 575 | 300687 | 赛意信息 | 1,900 | 26,448.00 | 0.07 |
| 576 | 000059 | 华锦股份 | 6,300 | 26,397.00 | 0.07 |
| 577 | 603866 | 桃李面包 | 5,200 | 26,364.00 | 0.07 |
| 578 | 688658 | 悦康药业 | 1,476 | 26,331.84 | 0.07 |
| 579 | 603583 | 捷昌驱动 | 1,292 | 26,330.96 | 0.07 |
| 580 | 603567 | 珍宝岛 | 2,500 | 26,325.00 | 0.07 |
| 581 | 300263 | 隆华科技 | 4,700 | 26,320.00 | 0.07 |
| 582 | 300257 | 开山股份 | 2,600 | 26,260.00 | 0.07 |
| 583 | 002929 | 润建股份 | 900 | 26,199.00 | 0.07 |
| 584 | 600751 | 海航科技 | 11,800 | 26,196.00 | 0.07 |
| 585 | 300409 | 道氏技术 | 3,060 | 26,193.60 | 0.07 |
| 586 | 600963 | 岳阳林纸 | 7,130 | 26,167.10 | 0.07 |
| 587 | 603533 | 掌阅科技 | 1,400 | 26,138.00 | 0.07 |
| 588 | 688598 | 金博股份 | 923 | 26,120.90 | 0.07 |
| 589 | 003006 | 百亚股份 | 1,100 | 26,070.00 | 0.07 |
| 590 | 002993 | 奥海科技 | 700 | 26,040.00 | 0.07 |
| 591 | 688362 | 甬矽电子 | 1,337 | 26,018.02 | 0.07 |
| 592 | 000735 | 罗牛山 | 6,000 | 25,980.00 | 0.07 |
| 593 | 603328 | 依顿电子 | 3,300 | 25,938.00 | 0.07 |
| 594 | 688366 | 昊海生科 | 420 | 25,905.60 | 0.07 |
| 595 | 600556 | 天下秀 | 7,100 | 25,844.00 | 0.07 |
| 596 | 002216 | 三全食品 | 2,350 | 25,803.00 | 0.07 |
| 597 | 603383 | 顶点软件 | 800 | 25,656.00 | 0.07 |
| 598 | 002390 | 信邦制药 | 7,700 | 25,487.00 | 0.07 |
| 599 | 002434 | 万里扬 | 5,200 | 25,480.00 | 0.07 |
| 600 | 605599 | 菜百股份 | 2,000 | 25,460.00 | 0.07 |
| 601 | 300671 | 富满微 | 1,000 | 25,420.00 | 0.07 |
| 602 | 688066 | 航天宏图 | 1,427 | 25,400.60 | 0.07 |
| 603 | 000088 | 盐田港 | 5,600 | 25,368.00 | 0.07 |
| 604 | 601969 | 海南矿业 | 4,000 | 25,360.00 | 0.07 |
| 605 | 300226 | 上海钢联 | 1,496 | 25,342.24 | 0.07 |
| 606 | 002925 | 盈趣科技 | 2,000 | 25,340.00 | 0.07 |
| 607 | 600966 | 博汇纸业 | 5,300 | 25,334.00 | 0.07 |
| 608 | 600477 | 杭萧钢构 | 10,870 | 25,327.10 | 0.07 |
| 609 | 002060 | 广东建工 | 7,400 | 25,308.00 | 0.07 |
| 610 | 688700 | 东威科技 | 962 | 25,214.02 | 0.07 |
| 611 | 688127 | 蓝特光学 | 1,371 | 25,212.69 | 0.07 |
| 612 | 300363 | 博腾股份 | 2,100 | 25,095.00 | 0.07 |
| 613 | 300726 | 宏达电子 | 1,100 | 25,080.00 | 0.07 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 614 | 605333 | 沪光股份 | 900 | 25,065.00 | 0.07 |
| 615 | 002258 | 利尔化学 | 3,120 | 25,022.40 | 0.07 |
| 616 | 605507 | 国邦医药 | 1,500 | 24,975.00 | 0.07 |
| 617 | 000795 | 英洛华 | 4,500 | 24,930.00 | 0.07 |
| 618 | 002219 | 新里程 | 13,400 | 24,924.00 | 0.07 |
| 619 | 603348 | 文灿股份 | 900 | 24,921.00 | 0.07 |
| 620 | 688158 | 优刻得 | 2,427 | 24,828.21 | 0.07 |
| 621 | 001270 | 铖昌科技 | 676 | 24,822.72 | 0.07 |
| 622 | 600775 | 南京熊猫 | 3,100 | 24,800.00 | 0.07 |
| 623 | 001287 | 中电港 | 1,500 | 24,795.00 | 0.07 |
| 624 | 002697 | 红旗连锁 | 5,340 | 24,724.20 | 0.07 |
| 625 | 600195 | 中牧股份 | 3,300 | 24,717.00 | 0.07 |
| 626 | 301031 | 中熔电气 | 300 | 24,660.00 | 0.07 |
| 627 | 603733 | 仙鹤股份 | 1,400 | 24,612.00 | 0.07 |
| 628 | 603043 | 广州酒家 | 1,540 | 24,593.80 | 0.07 |
| 629 | 300119 | 瑞普生物 | 1,800 | 24,516.00 | 0.07 |
| 630 | 600861 | 北京人力 | 1,500 | 24,480.00 | 0.07 |
| 631 | 300332 | 天壕能源 | 4,600 | 24,426.00 | 0.07 |
| 632 | 688239 | 航宇科技 | 700 | 24,360.00 | 0.07 |
| 633 | 600169 | 太原重工 | 13,300 | 24,339.00 | 0.07 |
| 634 | 000828 | 东莞控股 | 2,700 | 24,327.00 | 0.07 |
| 635 | 002125 | 湘潭电化 | 2,500 | 24,325.00 | 0.07 |
| 636 | 002349 | 精华制药 | 3,700 | 24,272.00 | 0.07 |
| 637 | 002985 | 北摩高科 | 1,100 | 24,233.00 | 0.07 |
| 638 | 300203 | 聚光科技 | 2,400 | 24,216.00 | 0.07 |
| 639 | 002191 | 劲嘉股份 | 6,700 | 24,187.00 | 0.07 |
| 640 | 300663 | 科蓝软件 | 2,450 | 24,181.50 | 0.07 |
| 641 | 600835 | 上海机电 | 2,100 | 24,171.00 | 0.07 |
| 642 | 301155 | 海力风电 | 600 | 24,138.00 | 0.07 |
| 643 | 600163 | 中闽能源 | 5,000 | 24,100.00 | 0.07 |
| 644 | 601908 | 京运通 | 9,500 | 24,035.00 | 0.07 |
| 645 | 000935 | 四川双马 | 2,000 | 24,020.00 | 0.07 |
| 646 | 688270 | 臻镭科技 | 920 | 24,012.00 | 0.07 |
| 647 | 301047 | 义翘神州 | 400 | 23,980.00 | 0.07 |
| 648 | 603638 | 艾迪精密 | 1,700 | 23,851.00 | 0.07 |
| 649 | 601595 | 上海电影 | 1,200 | 23,736.00 | 0.07 |
| 650 | 301087 | 可孚医疗 | 700 | 23,730.00 | 0.07 |
| 651 | 600073 | 光明肉业 | 4,300 | 23,693.00 | 0.07 |
| 652 | 300820 | 英杰电气 | 600 | 23,604.00 | 0.07 |
| 653 | 301015 | 百洋医药 | 1,000 | 23,530.00 | 0.07 |
| 654 | 002158 | 汉钟精机 | 1,400 | 23,408.00 | 0.07 |
| 655 | 600223 | 福瑞达 | 3,300 | 23,331.00 | 0.07 |
| 656 | 300261 | 雅本化学 | 4,400 | 23,320.00 | 0.07 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 656 | 600929 | 雪天盐业 | 4,400 | 23,320.00 | 0.07 |
| 657 | 300613 | 富瀚微 | 708 | 23,300.28 | 0.07 |
| 658 | 000048 | 京基智农 | 1,700 | 23,273.00 | 0.07 |
| 659 | 688368 | 晶丰明源 | 420 | 23,268.00 | 0.07 |
| 660 | 300587 | 天铁股份 | 5,757 | 23,258.28 | 0.06 |
| 661 | 301363 | 美好医疗 | 800 | 23,200.00 | 0.06 |
| 662 | 688696 | 极米科技 | 300 | 23,172.00 | 0.06 |
| 663 | 002101 | 广东鸿图 | 2,200 | 23,166.00 | 0.06 |
| 664 | 600812 | 华北制药 | 5,600 | 23,072.00 | 0.06 |
| 665 | 300323 | 华灿光电 | 5,300 | 23,055.00 | 0.06 |
| 666 | 600075 | 新疆天业 | 6,680 | 23,046.00 | 0.06 |
| 667 | 002250 | 联化科技 | 4,800 | 23,040.00 | 0.06 |
| 668 | 688690 | 纳微科技 | 1,325 | 23,015.25 | 0.06 |
| 669 | 300443 | 金雷股份 | 1,500 | 22,995.00 | 0.06 |
| 670 | 601606 | 长城军工 | 2,400 | 22,944.00 | 0.06 |
| 671 | 001213 | 中铁特货 | 5,800 | 22,910.00 | 0.06 |
| 671 | 601882 | 海天精工 | 1,000 | 22,910.00 | 0.06 |
| 672 | 600391 | 航发科技 | 1,500 | 22,875.00 | 0.06 |
| 673 | 688389 | 普门科技 | 1,404 | 22,829.04 | 0.06 |
| 674 | 688326 | 经纬恒润 | 398 | 22,817.34 | 0.06 |
| 675 | 300723 | 一品红 | 1,160 | 22,794.00 | 0.06 |
| 676 | 000627 | 天茂集团 | 13,000 | 22,750.00 | 0.06 |
| 677 | 002320 | 海峡股份 | 4,400 | 22,704.00 | 0.06 |
| 678 | 688388 | 嘉元科技 | 2,328 | 22,698.00 | 0.06 |
| 679 | 300085 | 银之杰 | 2,800 | 22,624.00 | 0.06 |
| 680 | 601107 | 四川成渝 | 4,300 | 22,575.00 | 0.06 |
| 681 | 605376 | 博迁新材 | 1,000 | 22,570.00 | 0.06 |
| 682 | 600335 | 国机汽车 | 3,900 | 22,503.00 | 0.06 |
| 683 | 605123 | 派克新材 | 400 | 22,472.00 | 0.06 |
| 684 | 600639 | 浦东金桥 | 2,200 | 22,462.00 | 0.06 |
| 685 | 002967 | 广电计量 | 1,900 | 22,420.00 | 0.06 |
| 685 | 600780 | 通宝能源 | 3,800 | 22,420.00 | 0.06 |
| 686 | 688190 | 云路股份 | 300 | 22,413.00 | 0.06 |
| 687 | 600874 | 创业环保 | 4,000 | 22,360.00 | 0.06 |
| 688 | 688298 | 东方生物 | 823 | 22,344.45 | 0.06 |
| 689 | 600449 | 宁夏建材 | 1,900 | 22,325.00 | 0.06 |
| 690 | 002283 | 天润工业 | 5,200 | 22,308.00 | 0.06 |
| 691 | 603896 | 寿仙谷 | 950 | 22,296.50 | 0.06 |
| 692 | 002051 | 中工国际 | 3,200 | 22,272.00 | 0.06 |
| 693 | 002585 | 双星新材 | 4,490 | 22,270.40 | 0.06 |
| 694 | 601921 | 浙版传媒 | 2,900 | 22,156.00 | 0.06 |
| 695 | 600648 | 外高桥 | 2,500 | 22,150.00 | 0.06 |
| 696 | 601038 | 一拖股份 | 1,400 | 22,134.00 | 0.06 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 697 | 002243 | 力合科创 | 4,000 | 22,120.00 | 0.06 |
| 698 | 601609 | 金田股份 | 3,900 | 22,074.00 | 0.06 |
| 699 | 688167 | 炬光科技 | 400 | 22,000.00 | 0.06 |
| 700 | 601515 | 东峰集团 | 6,020 | 21,973.00 | 0.06 |
| 701 | 600682 | 南京新百 | 4,400 | 21,956.00 | 0.06 |
| 702 | 300039 | 上海凯宝 | 4,100 | 21,935.00 | 0.06 |
| 703 | 002267 | 陕天然气 | 2,900 | 21,924.00 | 0.06 |
| 704 | 000061 | 农产品 | 4,500 | 21,870.00 | 0.06 |
| 705 | 601949 | 中国出版 | 3,700 | 21,867.00 | 0.06 |
| 706 | 603398 | 沐邦高科 | 1,400 | 21,854.00 | 0.06 |
| 707 | 603801 | 志邦家居 | 1,670 | 21,843.60 | 0.06 |
| 708 | 002204 | 大连重工 | 5,100 | 21,777.00 | 0.06 |
| 709 | 002053 | 云南能投 | 1,800 | 21,762.00 | 0.06 |
| 710 | 000712 | 锦龙股份 | 2,900 | 21,750.00 | 0.06 |
| 711 | 002194 | 武汉凡谷 | 2,700 | 21,735.00 | 0.06 |
| 712 | 603566 | 普莱柯 | 1,600 | 21,728.00 | 0.06 |
| 713 | 603730 | 岱美股份 | 2,181 | 21,679.14 | 0.06 |
| 714 | 601096 | 宏盛华源 | 5,300 | 21,677.00 | 0.06 |
| 715 | 603171 | 税友股份 | 800 | 21,632.00 | 0.06 |
| 716 | 002461 | 珠江啤酒 | 2,900 | 21,518.00 | 0.06 |
| 717 | 000498 | 山东路桥 | 4,100 | 21,443.00 | 0.06 |
| 718 | 000557 | 西部创业 | 5,700 | 21,432.00 | 0.06 |
| 719 | 002163 | 海南发展 | 3,900 | 21,372.00 | 0.06 |
| 720 | 002581 | 未名医药 | 2,200 | 21,230.00 | 0.06 |
| 721 | 300821 | 东岳硅材 | 3,100 | 21,204.00 | 0.06 |
| 722 | 600882 | 妙可蓝多 | 1,700 | 21,199.00 | 0.06 |
| 723 | 002987 | 京北方 | 2,009 | 21,154.77 | 0.06 |
| 724 | 688400 | 凌云光 | 1,266 | 21,116.88 | 0.06 |
| 725 | 301175 | 中科环保 | 4,800 | 21,072.00 | 0.06 |
| 726 | 002291 | 遥望科技 | 4,900 | 21,070.00 | 0.06 |
| 727 | 002242 | 九阳股份 | 2,000 | 20,960.00 | 0.06 |
| 728 | 002941 | 新疆交建 | 2,100 | 20,958.00 | 0.06 |
| 728 | 301238 | 瑞泰新材 | 1,400 | 20,958.00 | 0.06 |
| 729 | 000688 | 国城矿业 | 2,200 | 20,944.00 | 0.06 |
| 730 | 601069 | 西部黄金 | 1,800 | 20,934.00 | 0.06 |
| 731 | 002891 | 中宠股份 | 1,000 | 20,870.00 | 0.06 |
| 732 | 603118 | 共进股份 | 3,100 | 20,770.00 | 0.06 |
| 733 | 603187 | 海容冷链 | 1,780 | 20,754.80 | 0.06 |
| 734 | 002612 | 朗姿股份 | 1,500 | 20,730.00 | 0.06 |
| 735 | 000885 | 城发环境 | 1,700 | 20,689.00 | 0.06 |
| 736 | 600217 | 中再资环 | 5,500 | 20,680.00 | 0.06 |
| 737 | 688268 | 华特气体 | 400 | 20,644.00 | 0.06 |
| 738 | 002068 | 黑猫股份 | 2,900 | 20,590.00 | 0.06 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 739 | 000736 | 中交地产 | 2,300 | 20,424.00 | 0.06 |
| 740 | 300660 | 江苏雷利 | 800 | 20,416.00 | 0.06 |
| 741 | 688351 | 微电生理 | 926 | 20,409.04 | 0.06 |
| 742 | 000968 | 蓝焰控股 | 3,200 | 20,352.00 | 0.06 |
| 743 | 300527 | 中船应急 | 3,143 | 20,335.21 | 0.06 |
| 744 | 603466 | 风语筑 | 2,363 | 20,180.02 | 0.06 |
| 745 | 603025 | 大豪科技 | 1,460 | 20,177.20 | 0.06 |
| 746 | 300358 | 楚天科技 | 2,700 | 20,088.00 | 0.06 |
| 747 | 688339 | 亿华通 | 668 | 20,026.64 | 0.06 |
| 748 | 600643 | 爱建集团 | 5,300 | 19,981.00 | 0.06 |
| 749 | 002488 | 金固股份 | 4,550 | 19,974.50 | 0.06 |
| 750 | 000881 | 中广核技 | 3,100 | 19,964.00 | 0.06 |
| 751 | 688343 | 云天励飞 | 699 | 19,956.45 | 0.06 |
| 752 | 603299 | 苏盐井神 | 2,100 | 19,950.00 | 0.06 |
| 753 | 301153 | 中科江南 | 700 | 19,782.00 | 0.06 |
| 754 | 300737 | 科顺股份 | 4,600 | 19,780.00 | 0.06 |
| 755 | 688800 | 瑞可达 | 700 | 19,656.00 | 0.05 |
| 756 | 002746 | 仙坛股份 | 3,415 | 19,567.95 | 0.05 |
| 757 | 605020 | 永和股份 | 1,020 | 19,563.60 | 0.05 |
| 758 | 688707 | 振华新材 | 2,002 | 19,499.48 | 0.05 |
| 759 | 600225 | 卓朗科技 | 11,200 | 19,488.00 | 0.05 |
| 760 | 688586 | 江航装备 | 2,094 | 19,474.20 | 0.05 |
| 761 | 688097 | 博众精工 | 915 | 19,471.20 | 0.05 |
| 762 | 601869 | 长飞光纤 | 800 | 19,464.00 | 0.05 |
| 763 | 002646 | 天佑德酒 | 1,900 | 19,437.00 | 0.05 |
| 764 | 601033 | 永兴股份 | 1,200 | 19,428.00 | 0.05 |
| 765 | 603169 | 兰石重装 | 4,300 | 19,350.00 | 0.05 |
| 766 | 000672 | 上峰水泥 | 3,160 | 19,339.20 | 0.05 |
| 767 | 000791 | 甘肃能源 | 3,120 | 19,250.40 | 0.05 |
| 768 | 000869 | 张裕 A | 900 | 19,215.00 | 0.05 |
| 769 | 600491 | 龙元建设 | 7,000 | 19,180.00 | 0.05 |
| 770 | 688508 | 芯朋微 | 527 | 19,166.99 | 0.05 |
| 771 | 000029 | 深深房 A | 1,800 | 19,134.00 | 0.05 |
| 772 | 301316 | 慧博云通 | 1,300 | 19,084.00 | 0.05 |
| 773 | 603229 | 奥翔药业 | 1,895 | 19,044.75 | 0.05 |
| 774 | 002096 | 易普力 | 1,600 | 19,040.00 | 0.05 |
| 775 | 603595 | 东尼电子 | 924 | 19,025.16 | 0.05 |
| 776 | 301216 | 万凯新材 | 1,700 | 19,023.00 | 0.05 |
| 777 | 003012 | 东鹏控股 | 3,100 | 18,941.00 | 0.05 |
| 778 | 300369 | 绿盟科技 | 3,700 | 18,907.00 | 0.05 |
| 779 | 300143 | 盈康生命 | 2,500 | 18,825.00 | 0.05 |
| 779 | 301205 | 联特科技 | 300 | 18,825.00 | 0.05 |
| 780 | 603301 | 振德医疗 | 900 | 18,774.00 | 0.05 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 781 | 603212 | 赛伍技术 | 1,700 | 18,768.00 | 0.05 |
| 782 | 688048 | 长光华芯 | 600 | 18,744.00 | 0.05 |
| 783 | 000062 | 深圳华强 | 2,100 | 18,690.00 | 0.05 |
| 784 | 600783 | 鲁信创投 | 2,000 | 18,660.00 | 0.05 |
| 785 | 688502 | 茂莱光学 | 200 | 18,602.00 | 0.05 |
| 786 | 002041 | 登海种业 | 2,300 | 18,584.00 | 0.05 |
| 787 | 001337 | 四川黄金 | 800 | 18,568.00 | 0.05 |
| 788 | 600058 | 五矿发展 | 2,800 | 18,480.00 | 0.05 |
| 789 | 003040 | 楚天龙 | 1,500 | 18,450.00 | 0.05 |
| 790 | 603327 | 福蓉科技 | 1,430 | 18,432.70 | 0.05 |
| 791 | 600297 | 广汇汽车 | 26,600 | 18,354.00 | 0.05 |
| 792 | 603055 | 台华新材 | 1,800 | 18,234.00 | 0.05 |
| 793 | 301078 | 孩子王 | 3,600 | 18,216.00 | 0.05 |
| 793 | 600651 | 飞乐音响 | 6,600 | 18,216.00 | 0.05 |
| 794 | 002034 | 旺能环境 | 1,400 | 18,214.00 | 0.05 |
| 795 | 000597 | 东北制药 | 4,700 | 18,189.00 | 0.05 |
| 796 | 603297 | 永新光学 | 300 | 18,147.00 | 0.05 |
| 797 | 600662 | 外服控股 | 4,500 | 18,045.00 | 0.05 |
| 798 | 301291 | 明阳电气 | 600 | 18,030.00 | 0.05 |
| 799 | 300850 | 新强联 | 1,200 | 18,024.00 | 0.05 |
| 800 | 002378 | 章源钨业 | 3,140 | 18,023.60 | 0.05 |
| 801 | 688033 | 天宜上佳 | 2,982 | 17,892.00 | 0.05 |
| 802 | 002135 | 东南网架 | 4,500 | 17,820.00 | 0.05 |
| 803 | 688232 | 新点软件 | 900 | 17,748.00 | 0.05 |
| 804 | 605168 | 三人行 | 673 | 17,720.09 | 0.05 |
| 805 | 603636 | 南威软件 | 2,300 | 17,710.00 | 0.05 |
| 806 | 603915 | 国茂股份 | 1,720 | 17,698.80 | 0.05 |
| 807 | 301239 | 普瑞眼科 | 500 | 17,665.00 | 0.05 |
| 808 | 688091 | 上海谊众 | 780 | 17,620.20 | 0.05 |
| 809 | 603105 | 芯能科技 | 2,000 | 17,600.00 | 0.05 |
| 810 | 301080 | 百普赛斯 | 500 | 17,500.00 | 0.05 |
| 811 | 688031 | 星环科技 | 476 | 17,473.96 | 0.05 |
| 812 | 000025 | 特力A | 1,300 | 17,472.00 | 0.05 |
| 812 | 002516 | 旷达科技 | 4,800 | 17,472.00 | 0.05 |
| 813 | 300183 | 东软载波 | 1,500 | 17,370.00 | 0.05 |
| 814 | 688711 | 宏微科技 | 1,078 | 17,312.68 | 0.05 |
| 815 | 002265 | 建设工业 | 2,000 | 17,260.00 | 0.05 |
| 816 | 688177 | 百奥泰 | 815 | 17,212.80 | 0.05 |
| 817 | 002302 | 西部建设 | 3,300 | 17,160.00 | 0.05 |
| 818 | 603906 | 龙蟠科技 | 2,200 | 17,138.00 | 0.05 |
| 819 | 600810 | 神马股份 | 2,760 | 17,112.00 | 0.05 |
| 820 | 600657 | 信达地产 | 5,600 | 17,080.00 | 0.05 |
| 821 | 300134 | 大富科技 | 2,500 | 17,050.00 | 0.05 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 822 | 688372 | 伟测科技 | 432 | 16,990.56 | 0.05 |
| 823 | 002190 | 成飞集成 | 1,200 | 16,944.00 | 0.05 |
| 824 | 000517 | 荣安地产 | 6,300 | 16,884.00 | 0.05 |
| 825 | 300267 | 尔康制药 | 8,100 | 16,848.00 | 0.05 |
| 826 | 002489 | 浙江永强 | 7,100 | 16,827.00 | 0.05 |
| 827 | 000718 | 苏宁环球 | 10,000 | 16,800.00 | 0.05 |
| 828 | 603162 | 海通发展 | 1,792 | 16,665.60 | 0.05 |
| 829 | 603985 | 恒润股份 | 1,400 | 16,660.00 | 0.05 |
| 830 | 300579 | 数字认证 | 850 | 16,575.00 | 0.05 |
| 831 | 600475 | 华光环能 | 1,900 | 16,549.00 | 0.05 |
| 832 | 688336 | 三生国健 | 809 | 16,463.15 | 0.05 |
| 833 | 600340 | 华夏幸福 | 15,400 | 16,324.00 | 0.05 |
| 834 | 300206 | 理邦仪器 | 1,900 | 16,321.00 | 0.05 |
| 835 | 300953 | 震裕科技 | 300 | 16,260.00 | 0.05 |
| 836 | 000030 | 富奥股份 | 3,300 | 16,203.00 | 0.05 |
| 837 | 600301 | 华锡有色 | 800 | 16,176.00 | 0.05 |
| 838 | 301498 | 乖宝宠物 | 300 | 16,140.00 | 0.05 |
| 839 | 688381 | 帝奥微 | 828 | 16,129.44 | 0.05 |
| 840 | 002913 | 奥士康 | 600 | 16,086.00 | 0.04 |
| 841 | 300702 | 天宇股份 | 900 | 16,047.00 | 0.04 |
| 842 | 688131 | 皓元医药 | 837 | 16,011.81 | 0.04 |
| 843 | 688023 | 安恒信息 | 400 | 16,004.00 | 0.04 |
| 844 | 600604 | 市北高新 | 4,600 | 15,916.00 | 0.04 |
| 845 | 301339 | 通行宝 | 800 | 15,912.00 | 0.04 |
| 846 | 603530 | 神马电力 | 600 | 15,894.00 | 0.04 |
| 847 | 002453 | 华软科技 | 3,700 | 15,873.00 | 0.04 |
| 848 | 688432 | 有研硅 | 1,637 | 15,862.53 | 0.04 |
| 849 | 605009 | 豪悦护理 | 400 | 15,776.00 | 0.04 |
| 850 | 688105 | 诺唯赞 | 787 | 15,747.87 | 0.04 |
| 851 | 002088 | 鲁阳节能 | 1,300 | 15,717.00 | 0.04 |
| 852 | 603609 | 禾丰股份 | 2,400 | 15,696.00 | 0.04 |
| 853 | 001338 | 永顺泰 | 1,600 | 15,680.00 | 0.04 |
| 854 | 301268 | 铭利达 | 1,000 | 15,550.00 | 0.04 |
| 855 | 000016 | 深康佳 A | 7,300 | 15,549.00 | 0.04 |
| 856 | 688776 | 国光电气 | 280 | 15,512.00 | 0.04 |
| 857 | 003009 | 中天火箭 | 400 | 15,472.00 | 0.04 |
| 858 | 603123 | 翠微股份 | 2,600 | 15,444.00 | 0.04 |
| 859 | 688686 | 奥普特 | 241 | 15,431.23 | 0.04 |
| 860 | 688202 | 美迪西 | 592 | 15,421.60 | 0.04 |
| 861 | 301217 | 铜冠铜箔 | 1,600 | 15,360.00 | 0.04 |
| 862 | 603113 | 金能科技 | 2,800 | 15,316.00 | 0.04 |
| 863 | 688515 | 裕太微 | 262 | 15,196.00 | 0.04 |
| 864 | 601015 | 陕西黑猫 | 5,400 | 15,120.00 | 0.04 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 865 | 002534 | 西子洁能 | 1,500 | 15,015.00 | 0.04 |
| 866 | 688147 | 微导纳米 | 600 | 14,940.00 | 0.04 |
| 867 | 301367 | 怡和嘉业 | 240 | 14,928.00 | 0.04 |
| 868 | 002275 | 桂林三金 | 1,200 | 14,892.00 | 0.04 |
| 869 | 300768 | 迪普科技 | 1,250 | 14,812.50 | 0.04 |
| 870 | 301246 | 宏源药业 | 1,100 | 14,806.00 | 0.04 |
| 871 | 300382 | 斯莱克 | 2,500 | 14,775.00 | 0.04 |
| 872 | 000813 | 德展健康 | 7,100 | 14,768.00 | 0.04 |
| 873 | 301293 | 三博脑科 | 390 | 14,699.10 | 0.04 |
| 874 | 002314 | 南山控股 | 7,100 | 14,697.00 | 0.04 |
| 875 | 601886 | 江河集团 | 3,000 | 14,640.00 | 0.04 |
| 876 | 603989 | 艾华集团 | 1,030 | 14,481.80 | 0.04 |
| 877 | 002959 | 小熊电器 | 300 | 14,433.00 | 0.04 |
| 878 | 688484 | 南芯科技 | 389 | 14,431.90 | 0.04 |
| 879 | 002782 | 可立克 | 1,300 | 14,404.00 | 0.04 |
| 880 | 688261 | 东微半导 | 280 | 14,386.40 | 0.04 |
| 881 | 001323 | 慕思股份 | 500 | 14,385.00 | 0.04 |
| 882 | 300869 | 康泰医学 | 1,100 | 14,377.00 | 0.04 |
| 883 | 600903 | 贵州燃气 | 2,300 | 14,352.00 | 0.04 |
| 884 | 300080 | 易成新能 | 4,900 | 14,112.00 | 0.04 |
| 885 | 300894 | 火星人 | 1,100 | 14,102.00 | 0.04 |
| 886 | 601011 | 宝泰隆 | 8,800 | 14,080.00 | 0.04 |
| 887 | 603439 | 贵州三力 | 1,100 | 14,036.00 | 0.04 |
| 888 | 002978 | 安宁股份 | 500 | 13,930.00 | 0.04 |
| 889 | 688209 | 英集芯 | 1,115 | 13,837.15 | 0.04 |
| 890 | 603071 | 物产环能 | 1,100 | 13,783.00 | 0.04 |
| 891 | 603983 | 丸美股份 | 500 | 13,765.00 | 0.04 |
| 892 | 688380 | 中微半导 | 820 | 13,710.40 | 0.04 |
| 893 | 688001 | 华兴源创 | 604 | 13,638.32 | 0.04 |
| 894 | 603693 | 江苏新能 | 1,170 | 13,595.40 | 0.04 |
| 895 | 603718 | 海利生物 | 2,185 | 13,481.45 | 0.04 |
| 896 | 603013 | 亚普股份 | 1,000 | 13,470.00 | 0.04 |
| 897 | 688146 | 中船特气 | 451 | 13,462.35 | 0.04 |
| 898 | 688206 | 概伦电子 | 900 | 13,365.00 | 0.04 |
| 899 | 600691 | 阳煤化工 | 7,800 | 13,338.00 | 0.04 |
| 900 | 688392 | 骄成超声 | 314 | 13,326.16 | 0.04 |
| 901 | 301207 | 华兰疫苗 | 750 | 13,252.50 | 0.04 |
| 902 | 600618 | 氯碱化工 | 1,500 | 13,170.00 | 0.04 |
| 903 | 600610 | 中毅达 | 3,300 | 13,134.00 | 0.04 |
| 904 | 300446 | 航天智造 | 1,100 | 13,090.00 | 0.04 |
| 905 | 600400 | 红豆股份 | 6,000 | 13,020.00 | 0.04 |
| 906 | 688526 | 科前生物 | 883 | 12,971.27 | 0.04 |
| 907 | 002901 | 大博医疗 | 500 | 12,915.00 | 0.04 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 908 | 688185 | 康希诺 | 314 | 12,902.26 | 0.04 |
| 909 | 603719 | 良品铺子 | 1,100 | 12,837.00 | 0.04 |
| 910 | 603666 | 亿嘉和 | 808 | 12,750.24 | 0.04 |
| 911 | 000019 | 深粮控股 | 2,200 | 12,628.00 | 0.04 |
| 912 | 001258 | 立新能源 | 1,800 | 12,474.00 | 0.03 |
| 913 | 688352 | 颀中科技 | 1,092 | 12,459.72 | 0.03 |
| 914 | 601083 | 锦江航运 | 1,300 | 12,428.00 | 0.03 |
| 915 | 603877 | 太平鸟 | 900 | 12,357.00 | 0.03 |
| 916 | 688173 | 希荻微 | 1,118 | 12,331.54 | 0.03 |
| 917 | 301526 | 国际复材 | 3,700 | 12,321.00 | 0.03 |
| 918 | 000761 | 本钢板材 | 4,900 | 12,299.00 | 0.03 |
| 919 | 605222 | 起帆电缆 | 800 | 12,272.00 | 0.03 |
| 920 | 603995 | 甬金股份 | 700 | 12,264.00 | 0.03 |
| 921 | 300741 | 华宝股份 | 800 | 12,192.00 | 0.03 |
| 922 | 301348 | 蓝箭电子 | 400 | 12,156.00 | 0.03 |
| 923 | 002991 | 甘源食品 | 200 | 12,130.00 | 0.03 |
| 924 | 603938 | 三孚股份 | 1,020 | 11,985.00 | 0.03 |
| 925 | 603170 | 宝立食品 | 1,000 | 11,880.00 | 0.03 |
| 926 | 301089 | 拓新药业 | 400 | 11,868.00 | 0.03 |
| 927 | 002549 | 凯美特气 | 2,300 | 11,753.00 | 0.03 |
| 928 | 001308 | 康冠科技 | 520 | 11,700.00 | 0.03 |
| 929 | 300755 | 华致酒行 | 840 | 11,474.40 | 0.03 |
| 930 | 301327 | 华宝新能 | 200 | 11,460.00 | 0.03 |
| 931 | 688046 | 药康生物 | 1,120 | 11,446.40 | 0.03 |
| 932 | 300973 | 立高食品 | 400 | 11,236.00 | 0.03 |
| 933 | 601811 | 新华文轩 | 800 | 11,208.00 | 0.03 |
| 934 | 600811 | 东方集团 | 16,800 | 11,088.00 | 0.03 |
| 935 | 603098 | 森特股份 | 1,400 | 11,004.00 | 0.03 |
| 936 | 002651 | 利君股份 | 2,000 | 10,980.00 | 0.03 |
| 937 | 300140 | 节能环境 | 1,800 | 10,746.00 | 0.03 |
| 938 | 300887 | 谱尼测试 | 1,420 | 10,508.00 | 0.03 |
| 939 | 301069 | 凯盛新材 | 800 | 10,488.00 | 0.03 |
| 940 | 688383 | 新益昌 | 200 | 10,422.00 | 0.03 |
| 941 | 603093 | 南华期货 | 1,200 | 10,392.00 | 0.03 |
| 942 | 301487 | 盟固利 | 400 | 10,344.00 | 0.03 |
| 943 | 688128 | 中国电研 | 600 | 10,326.00 | 0.03 |
| 944 | 000058 | 深赛格 | 1,900 | 10,203.00 | 0.03 |
| 945 | 301325 | 曼恩斯特 | 240 | 10,180.80 | 0.03 |
| 946 | 001311 | 多利科技 | 420 | 10,155.60 | 0.03 |
| 947 | 688337 | 普源精电 | 400 | 10,088.00 | 0.03 |
| 948 | 002990 | 盛视科技 | 500 | 10,065.00 | 0.03 |
| 949 | 003039 | 顺控发展 | 800 | 10,024.00 | 0.03 |
| 950 | 001269 | 欧晶科技 | 360 | 10,008.00 | 0.03 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|----------|------|
| 951 | 002961 | 瑞达期货 | 900 | 9,855.00 | 0.03 |
| 952 | 688315 | 诺禾致源 | 900 | 9,828.00 | 0.03 |
| 953 | 002287 | 奇正藏药 | 500 | 9,790.00 | 0.03 |
| 954 | 002946 | 新乳业 | 1,100 | 9,636.00 | 0.03 |
| 955 | 603132 | 金徽股份 | 700 | 9,632.00 | 0.03 |
| 956 | 002911 | 佛燃能源 | 1,044 | 9,542.16 | 0.03 |
| 957 | 001322 | 箭牌家居 | 1,300 | 9,503.00 | 0.03 |
| 958 | 301371 | 敷尔佳 | 300 | 9,318.00 | 0.03 |
| 959 | 688531 | 日联科技 | 200 | 9,232.00 | 0.03 |
| 960 | 301511 | 德福科技 | 600 | 8,856.00 | 0.02 |
| 961 | 300860 | 锋尚文化 | 420 | 8,836.80 | 0.02 |
| 962 | 301559 | 中集环科 | 600 | 8,742.00 | 0.02 |
| 963 | 603489 | 八方股份 | 320 | 8,633.60 | 0.02 |
| 964 | 688680 | 海优新材 | 300 | 8,622.00 | 0.02 |
| 965 | 601068 | 中铝国际 | 2,000 | 8,420.00 | 0.02 |
| 966 | 301558 | 三态股份 | 1,000 | 8,390.00 | 0.02 |
| 967 | 301510 | 固高科技 | 300 | 8,325.00 | 0.02 |
| 968 | 600403 | 大有能源 | 3,100 | 7,998.00 | 0.02 |
| 969 | 601022 | 宁波远洋 | 900 | 7,938.00 | 0.02 |
| 970 | 688161 | 威高骨科 | 400 | 7,928.00 | 0.02 |
| 971 | 688152 | 麒麟信安 | 200 | 7,744.00 | 0.02 |
| 972 | 603057 | 紫燕食品 | 500 | 7,660.00 | 0.02 |
| 973 | 605011 | 杭州热电 | 300 | 7,299.00 | 0.02 |
| 974 | 301090 | 华润材料 | 1,100 | 7,238.00 | 0.02 |
| 975 | 001236 | 弘业期货 | 1,000 | 7,110.00 | 0.02 |
| 976 | 301262 | 海看股份 | 300 | 6,765.00 | 0.02 |
| 977 | 603103 | 横店影视 | 480 | 6,643.20 | 0.02 |
| 978 | 605365 | 立达信 | 400 | 6,348.00 | 0.02 |
| 979 | 301180 | 万祥科技 | 400 | 6,256.00 | 0.02 |
| 980 | 001376 | 百通能源 | 300 | 5,586.00 | 0.02 |
| 981 | 301177 | 迪阿股份 | 300 | 5,580.00 | 0.02 |
| 982 | 603075 | 热威股份 | 300 | 5,295.00 | 0.01 |
| 983 | 601279 | 英利汽车 | 1,400 | 5,222.00 | 0.01 |
| 984 | 688433 | 华曙高科 | 245 | 5,110.70 | 0.01 |
| 985 | 000982 | 中银绒业 | 27,900 | 5,022.00 | 0.01 |
| 986 | 301381 | 赛维时代 | 200 | 4,546.00 | 0.01 |
| 987 | 301376 | 致欧科技 | 200 | 4,234.00 | 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 | 300630 | 普利制药 | 2,100 | 25,935.00 | 0.07 |
| 2 | 002610 | ST 爱康 | 29,700 | 10,989.00 | 0.03 |

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 | 000766 | 通化金马 | 110,313.00 | 0.24 |
| 2 | 300049 | 福瑞股份 | 93,537.00 | 0.21 |
| 3 | 002270 | 华明装备 | 73,360.00 | 0.16 |
| 4 | 000581 | 威孚高科 | 66,462.00 | 0.15 |
| 5 | 603283 | 赛腾股份 | 64,206.00 | 0.14 |
| 6 | 300115 | 长盈精密 | 61,832.00 | 0.14 |
| 7 | 300857 | 协创数据 | 59,600.00 | 0.13 |
| 8 | 600461 | 洪城环境 | 58,745.00 | 0.13 |
| 9 | 688498 | 源杰科技 | 55,424.88 | 0.12 |
| 10 | 300045 | 华力创通 | 54,960.00 | 0.12 |
| 11 | 000628 | 高新发展 | 54,612.00 | 0.12 |
| 12 | 300757 | 罗博特科 | 53,807.00 | 0.12 |
| 13 | 688076 | 诺泰生物 | 52,584.15 | 0.12 |
| 14 | 688062 | 迈威生物 | 51,374.18 | 0.11 |
| 15 | 300415 | 伊之密 | 50,490.00 | 0.11 |
| 16 | 300705 | 九典制药 | 49,802.00 | 0.11 |
| 17 | 000970 | 中科三环 | 49,637.00 | 0.11 |
| 18 | 601778 | 晶科科技 | 48,807.00 | 0.11 |
| 19 | 688333 | 铂力特 | 48,496.00 | 0.11 |
| 20 | 002456 | 欧菲光 | 48,232.00 | 0.11 |

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 | 601567 | 三星医疗 | 187,258.00 | 0.42 |
| 2 | 688617 | 惠泰医疗 | 178,910.00 | 0.40 |
| 3 | 002436 | 兴森科技 | 146,170.00 | 0.32 |
| 4 | 603979 | 金诚信 | 145,980.86 | 0.32 |
| 5 | 300002 | 神州泰岳 | 139,915.00 | 0.31 |
| 6 | 000921 | 海信家电 | 133,799.00 | 0.30 |
| 7 | 300054 | 鼎龙股份 | 131,591.40 | 0.29 |
| 8 | 600872 | 中炬高新 | 129,392.00 | 0.29 |
| 9 | 000818 | 航锦科技 | 108,799.00 | 0.24 |
| 10 | 603179 | 新泉股份 | 108,707.20 | 0.24 |
| 11 | 603087 | 甘李药业 | 103,823.00 | 0.23 |
| 12 | 600777 | ST 新潮 | 100,773.00 | 0.22 |

| | | | | |
|----|--------|------|-----------|------|
| 13 | 300765 | 新诺威 | 96,666.86 | 0.21 |
| 14 | 300567 | 精测电子 | 92,873.00 | 0.21 |
| 15 | 002261 | 拓维信息 | 91,983.00 | 0.20 |
| 16 | 600483 | 福能股份 | 86,151.78 | 0.19 |
| 17 | 300803 | 指南针 | 85,029.00 | 0.19 |
| 18 | 603298 | 杭叉集团 | 83,434.96 | 0.19 |
| 19 | 002984 | 森麒麟 | 81,517.40 | 0.18 |
| 20 | 600612 | 老凤祥 | 79,462.00 | 0.18 |

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 | 7,108,831.84 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 9,202,860.06 |

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

华宝中证 1000 指数截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 欧菲光集团股份有限公司因内幕交易, 内部制度不完善; 于 2023 年 12 月 29 日收到深圳证监局监管谈话、谈话提醒的处罚措施。

华宝中证 1000 指数截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 浙江万丰奥威汽轮股份有限公司因公司在答复投资者提问时, 存在误导性陈述; 于 2024 年 04 月 19 日收到浙江证监局警示, 记入诚信档案的处罚措施。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位: 人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|-------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | 1,882.11 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 79,034.08 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 80,916.19 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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 | 300630 | 普利制药 | 25,935.00 | 0.07 | 重大事项停牌 |
| 2 | 002610 | ST 爱康 | 10,989.00 | 0.03 | 重大事项停牌 |

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

| 份额级别 | 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 (%) |
| 华宝中证 1000 指数 | 3,427 | 10,991.16 | 0.00 | 0.00 | 37,666,710.71 | 100.00 |
| 华宝中证 1000 指数 C | 1,461 | 6,955.66 | 54,650.78 | 0.54 | 10,107,573.08 | 99.46 |
| 合计 | 4,888 | 9,784.97 | 54,650.78 | 0.11 | 47,774,283.79 | 99.89 |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 (%) |
|------------------|----------------|------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 华宝中证 1000 指数 | 1.09 | 0.0000 |
| | 华宝中证 1000 指数 C | 55,586.23 | 0.5470 |
| | 合计 | 55,587.32 | 0.1162 |

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 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|------------------------------|----------------|--------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金 | 华宝中证 1000 指数 | 0 |
| | 华宝中证 1000 指数 C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有 | 华宝中证 1000 指数 | 0 |

| | | |
|--------|----------------|------|
| 本开放式基金 | 华宝中证 1000 指数 C | 0~10 |
| | 合计 | 0~10 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 华宝中证 1000 指数 | 华宝中证 1000 指数 C |
|--------------------------------------|---------------|----------------|
| 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 | 39,344,143.11 | 11,582,445.66 |
| 本报告期基金总申购份额 | 5,757,525.30 | 42,549,068.52 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 7,434,957.70 | 43,969,290.32 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 37,666,710.71 | 10,162,223.86 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动

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

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门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、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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：自 2022 年 12 月 23 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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

10.6.2 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，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|----------|--------|---------------|------------------|-----------|----------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | |
| 财通证券 | 2 | 15,971,970.90 | 97.92 | 15,024.61 | 97.93 | - |
| 招商证券 | 2 | 339,721.00 | 2.08 | 317.90 | 2.07 | - |
| 长城证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 大和证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 第一创业 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东亚前海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东莞证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 高盛（中国）证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国投证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|-------|---|---|---|---|---|---|
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华宝证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华福证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华鑫证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 开源证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 山西证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 申港证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 2 | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 万联证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 湘财证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 粤开证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中金财富 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金国际 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中山证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中邮证券 | 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：华福证券；退租交易单元：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

本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

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 | 华宝基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告 | 上海证券报，证券日报，证券时报，中国证券报 | 2024-01-19 |
| 2 | 华宝基金关于旗下部分基金新增上海大智慧基金销售有限公司为代销机构的通知 | 基金管理人网站 | 2024-02-29 |
| 3 | 华宝基金管理有限公司旗下部分基金年度报告提示性公告 | 上海证券报，证券日报，证券时报，中国证券报 | 2024-03-29 |
| 4 | 华宝中证 1000 指数证券投资基金 2023 年年度报告 | 基金管理人网站 | 2024-03-29 |
| 5 | 华宝基金关于华宝中证 1000 指数证券投资基金 C 类新增华泰证券股份有限公司为代销机构的公告 | 基金管理人网站，证券日报 | 2024-04-18 |
| 6 | 华宝基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告 | 上海证券报，证券日报，证券时报，中国证券报 | 2024-04-19 |
| 7 | 华宝中证 1000 指数证券投资基金 2024 年第 1 季度报告 | 基金管理人网站 | 2024-04-19 |
| 8 | 华宝基金关于旗下部分基金新增华福证券有限责任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 | 2024-05-20 |
| 9 | 华宝基金关于旗下部分基金新增湘财证券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 | 2024-06-21 |
| 10 | 华宝中证 1000 指数证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要（更新） | 基金管理人网站 | 2024-06-28 |
| 11 | 华宝中证 1000 指数证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要（更新） | 基金管理人网站 | 2024-06-28 |

§ 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

12.3 查阅方式

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

华宝基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日