

华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 25 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	55
7.1 期末基金资产组合情况.....	55
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	55
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.....	57
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	83
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	85
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.....	85
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.....	85
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.....	85
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.....	85
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	85
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	86
7.12 投资组合报告附注.....	86
§8 基金份额持有人信息.....	88
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	88
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	88
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	89
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	89
§9 开放式基金份额变动.....	91
§10 重大事件揭示.....	92
10.1 基金份额持有人大会决议.....	92
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.....	92
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	92
10.4 基金投资策略的改变.....	92
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	92
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.....	92
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	92
10.8 其他重大事件.....	96
§11 备查文件目录.....	98

11.1 备查文件目录.....	98
11.2 存放地点.....	98
11.3 查阅方式.....	98

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金		
基金简称	华宝兴业中证 1000 指数分级		
场内简称	1000 分级		
基金主代码	162413		
交易代码	162413		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 6 月 4 日		
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司		
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	115,245,905.82 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2015-06-16		
下属分级基金的基金简称	1000A	1000B	华宝兴业中证 1000 指数分级
下属分级基金场内简称:	1000A	1000B	1000 分级
下属分级基金的交易代码	150263	150264	162413
报告期末下属分级基金份额总额	7,727,250.00 份	7,727,250.00 份	99,791,405.82 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	<p>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。</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%

风险收益特征	本基金为股票型指数基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。		
下属分级基金的风险收益特征	华宝中证 1000A 份额具有较低风险、收益相对稳定的特征。	华宝中证 1000B 份额具有较高风险、较高预期收益的特征。	本基金为股票型指数基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝兴业基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	田青
	联系电话	021-38505888	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、 021-38924558	010—67595096
传真		021-38505777	010-66275853
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		郑安国	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金半年度报告备置地点	本基金半年报置备地点包括基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-2,070,606.67
本期利润	-8,806,504.06
加权平均基金份额本期利润	-0.0701
本期加权平均净值利润率	-8.95%
本期基金份额净值增长率	-8.81%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	-104,649,618.07
期末可供分配基金份额利润	-0.9081
期末基金资产净值	85,060,569.37
期末基金份额净值	0.7381
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-55.03%

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

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.58%	1.03%	3.34%	1.03%	0.24%	0.00%
过去三个月	-9.06%	1.10%	-9.96%	1.10%	0.90%	0.00%
过去六个月	-8.81%	1.00%	-11.47%	1.01%	2.66%	-0.01%
过去一年	-9.76%	0.98%	-13.84%	1.00%	4.08%	-0.02%
自基金合同	-55.03%	2.23%	-45.87%	2.26%	-9.16%	-0.03%

生效日起至 今						
------------	--	--	--	--	--	--

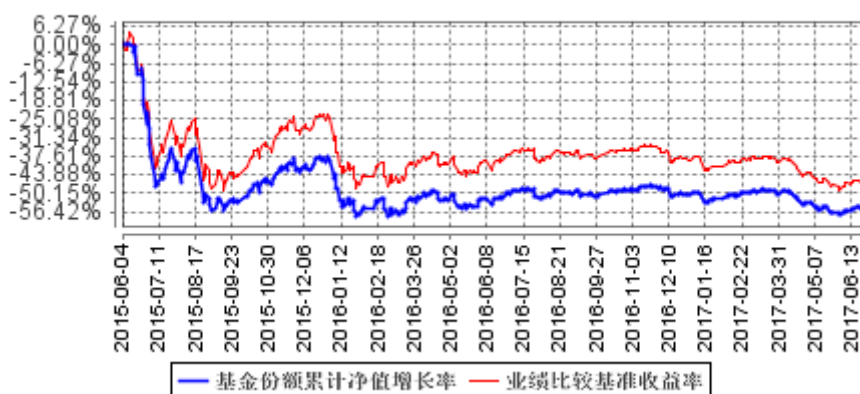
注：1、本基金业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。

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

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

（2015 年 6 月 4 日至 2017 年 6 月 30 日）

基金份额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：按照基金合同的规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至 2015 年 12 月 4 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§ 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

基金管理人是在 2003 年 3 月 7 日正式成立的合资基金管理公司，截至本报告期末（2017 年 6 月 30 日），所管理的证券投资基金包括宝康系列基金、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、海外中国成长基金、大盘精选基金、增强收益基金、中证 100 基金、上证 180 价值 ETF、上证 180 价值 ETF 联接基金、新兴产业基金、可转债基金、上证 180 成长 ETF、上证 180 成长 ETF 联接基金、华宝油气基金、中国互联网基金、华宝兴业医药生物基金、华宝兴业资源优选基金、华宝添益基金、华宝兴业服务优选基金、华宝兴业创新优选基金、华宝兴业生态中国基金、华宝兴业量化对冲基金、华宝兴业高端制造基金、华宝兴业品质生活基金、华宝兴业稳健回报基金、华宝兴业事件驱动基金、华宝兴业国策导向、华宝兴业新价值、华宝兴业新机遇、华宝兴业医疗分级、华宝兴业 1000 分级、华宝兴业万物互联、华宝兴业转型升级基金、核心优势基金、美国消费基金、宝鑫纯债基金、香港中小盘基金、中证全指证券公司 ETF、中证军工 ETF、新活力基金、沪深 300 指数增强基金、未来产业主导基金、新起点基金、红利基金、新动力基金、新飞跃基金、新回报基金、新优选基金、香港大盘基金、智慧产业基金、第三产业基金及新优享基金，所管理的证券投资基金资产净值合计 122,557,514,320.78 元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡洁	本基金基金经理、上证 180 成长 ETF、华宝兴业上证 180 成长 ETF 联接、华宝兴业中	2015 年 6 月 4 日	-	11 年	金融学硕士，量化投资部总经理助理。2006 年 6 月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后在交易部、产品开发部和量化投资部工作，2012 年 10 月起任华宝兴业上证 180 成长交易型开放式指数证券投

	证医疗指数分级、华宝兴业中证军工 ETF、华宝兴业标普中国 A 股红利机会指数 (LOF) 基金经理				资基金、华宝兴业上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2015 年 5 月起任华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金基金经理，2015 年 6 月起任华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金经理。2016 年 8 月起兼任华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2017 年 1 月兼任华宝兴业标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。
张奇	本基金基金经理助理、上证 180 价值 ETF、华宝兴业上证 180 价值 ETF 联接、上证 180 成长 ETF、华宝兴业上证 180 成长 ETF 联接、华宝兴业中证医疗指数分级、华宝兴业中证军工 ETF 基金经理助理	2017 年 4 月 6 日	-	7 年	本科。曾先后在毕博管理咨询有限公司、德邦证券从事咨询顾问及董事副总经理的工作。2014 年 10 月加入华宝兴业基金管理有限公司担任高级数量分析师的职务。2015 年 4 月起兼任华宝兴业上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理，2015 年 5 月起兼任上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理，2017 年 4 月起任华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金、华宝兴业中证 1000 指数分级证券投

					资基金、华宝兴业中证 军工交易型开放式指 数证券投资基金基金 经理助理
--	--	--	--	--	--

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年上半年，中国经济增长强劲。从需求端来看，基建投资维持强劲增速、房地产投资处于高位、制造业投资温和反弹、出口增速显著复苏；从生产端来看，供给侧结构性改革推动的工业品价格上升助推了企业的补库存周期。6 月 A 股成功进入 MSCI 指数打通了未来海外资金直接投资中国 A 股的渠道，将为 A 股市场注入新鲜血液，提升 A 股长期配置价值。从市场表现来看，今年上半年 A 股在家电、食品饮料、银行、保险等一线白马板块的带动下稳健上涨，大盘蓝筹股势头强劲，小市值股票表现则相对较差，沪市股票整体强于深市。指数方面，市场风格继续分化，以中证 100 指数和沪深 300 指数为代表的大盘蓝筹股表现较好，分别上涨了 15.13% 和 10.78%；而以创业板指和中证 1000 指数为代表的中小盘股表现较弱，分别下跌了 7.34% 和 12.07%。

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

截至本报告期末，本报告期内基金份额净值增长率为-8.81%，同期业绩比较基准收益率为-11.47%，基金表现领先比较基准 2.66%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年下半年，中国经济增速可能或适度放缓，压力来自去库存、房地产调控、金融去杠杆等因素。但总体库存水平不高，地产投资仍可能超预期，加之外围经济复苏对出口的带动，制造业总体情况平稳，全年完成经济增长目标的压力不大。十九大前后，国内将进入结构性改革的时间窗口，政府有望加快实体改革的步伐。在此市场环境下，我们认为资本市场未来将继续维持结构性行情，当下注重上市公司盈利能力和盈利质量和的投资风格有望延续，行业龙头股和优质白马股有望进一步受到资金的追捧和青睐，投资者可以更多关注资产长期配置价值以及估值修复带来的机会。中证 1000 指数是小市值股票组合的代表，其成份股为中证 800 指数样本股之外综合考虑规模和流动性选取 1000 只股票，全面覆盖了计算机、医药生物、机械设备、化工、电子、房地产、有色金属等 28 个行业。2017 年上半年 A 股市场延续风格分化行情，但分化的程度随着估值的有效纠偏而有所收敛，小市值公司经历了大幅调整后风险得到一定的释放，部分股票有望在下

半年或将迎来阶段性的修复行情，投资者可以通过投资中证 1000 指数在大小盘风格轮动的过程中把握小盘股的投资机会。

本基金为分级基金，为不同风险偏好的投资者提供了不同风险收益特征的投资工具。作为指数基金的管理人，我们将严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，积极应对成份股调整和基金申购赎回，严格控制基金相对目标指数的跟踪误差，实现对中证 1000 指数的有效跟踪。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金管理人在报告期内对旗下基金估值过程中，公司内部参与估值流程的各方职责分工如下：

（一）、基金会计：根据《基金会计核算业务指引》对基金日常交易进行记账核算，并对基金投资品种进行估值。

（二）、量化投资部：对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况下，根据估值委员会对停牌股票或异常交易股票估值调整的方法（比如：指数收益法）进行估值，并在估值时兼顾考虑行业研究员提供的根据上市公司估值模型计算的结果所提出的建议或意见。

（三）、估值委员会：定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况后及时修订估值方法。基金在采用新投资策略或投资新品种时，评价现有估值政策和程序的适用性。

（四）、必要时基金经理就估值模型及估值方法的确定提出建议和意见，但由估值委员会做最终决策。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期亏损，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，本基金不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，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人，基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	5,080,602.31	6,424,942.83
结算备付金		-	2,637.42
存出保证金		2,717.98	16,128.15
交易性金融资产	6.4.7.2	80,679,350.32	99,470,723.98
其中：股票投资		80,679,350.32	99,470,723.98
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	30,915.98
应收利息	6.4.7.5	1,117.13	1,415.86
应收股利		-	-
应收申购款		8,410.10	6,987.15
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		85,772,197.84	105,953,751.37
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 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		-	-
应付证券清算款		-	279,606.56
应付赎回款		85,865.06	38,276.78
应付管理人报酬		71,953.05	91,342.86
应付托管费		15,829.65	20,095.45
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	203,538.88	207,679.76

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	334,441.83	340,120.62
负债合计		711,628.47	977,122.03
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	189,145,351.32	212,869,103.61
未分配利润	6.4.7.10	-104,084,781.95	-107,892,474.27
所有者权益合计		85,060,569.37	104,976,629.34
负债和所有者权益总计		85,772,197.84	105,953,751.37

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7381 元，基金份额总额 115,245,905.82 份。

6.2 利润表

会计主体：华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		-7,953,840.33	-27,473,304.20
1.利息收入		22,169.81	46,186.32
其中：存款利息收入	6.4.7.11	22,169.81	46,186.32
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）		-1,253,874.89	-25,174,829.54
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,596,223.96	-25,548,631.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	342,349.07	373,801.88
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-6,735,897.39	-2,466,047.07
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	13,762.14	121,386.09

减：二、费用		852,663.73	1,363,539.20
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	488,355.17	696,980.33
2. 托管费	6.4.10.2.2	107,438.10	153,335.73
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	61,802.72	308,105.70
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	195,067.74	205,117.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,806,504.06	-28,836,843.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-8,806,504.06	-28,836,843.40

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	212,869,103.61	-107,892,474.27	104,976,629.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-8,806,504.06	-8,806,504.06
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-23,723,752.29	12,614,196.38	-11,109,555.91
其中：1.基金申购款	5,024,169.42	-2,651,383.39	2,372,786.03
2.基金赎回款	-28,747,921.71	15,265,579.77	-13,482,341.94
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	189,145,351.32	-104,084,781.95	85,060,569.37
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	295,270,982.70	-115,081,010.81	180,189,971.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-28,836,843.40	-28,836,843.40
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-52,588,259.66	22,190,412.09	-30,397,847.57
其中：1.基金申购款	147,415,790.60	-80,536,137.39	66,879,653.21
2.基金赎回款	-200,004,050.26	102,726,549.48	-97,277,500.78
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	242,682,723.04	-121,727,442.12	120,955,280.92

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 黄小薏	_____ 向辉	_____ 张幸骏
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]第 664 号《关于准予华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金注册的批复》核准,由华宝兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集 330,638,859.16 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 673 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 4 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 330,711,104.54 份基金份额,其中认购资金

利息折合 72,245.38 份基金份额。本基金通过场内、场外两种方式公开发售，按照每份基金份额 1.00 元计算，本基金募集期间含本息共募集 330,711,104.54 份基金份额，其中场外认购的基金份额为 271,827,940.54 份、场内认购的基金份额为 58,883,164.00 份。本基金的基金管理人为华宝兴业基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

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

金份额参考净值。

本基金进行定期份额折算。在本基金存续期内每年 12 月 15 日(若该日为非工作日,则提前至该日之前的最后一个工作日),本基金将进行基金的定期份额折算:定期份额折算后华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值调整为 1.0000 元,基金份额折算基准日折算前华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值超出 1.0000 元的部分将折算为场内华宝中证 1000 基础份额分配给华宝中证 1000A 份额持有人。华宝中证 1000 基础份额持有人持有的每 2 份华宝中证 1000 基础份额将按 1 份华宝中证 1000A 份额获得新增华宝中证 1000 基础份额的分配。持有场外华宝中证 1000 基础份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外华宝中证 1000 基础份额的分配;持有场内华宝中证 1000 基础份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内华宝中证 1000 基础份额的分配。经过上述份额折算后,华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后,华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。华宝中证 1000B 份额不参与定期份额折算,每次定期份额折算不改变华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

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

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2015]第 272 号文审核同意,本基金华宝中证 1000A 份额 29,441,582.00 份基金份额与华宝中证 1000B 份额 29,441,582.00 份基金份额于 2015 年 6 月 16 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的华宝中证 1000 基础份额,基金份额持有

人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额即可上市流通；对于托管在场外的华宝中证 1000 基础份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深交所场内后分拆为华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、资产支持证券、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 90%，投资于中证 1000 指数成份股及其备选成份股的市值不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率 \times 95%+同期银行活期存款利率（税后） \times 5%。

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》、各项具体会计准则及相关规定（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〈年度报告和半年度报告〉》、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》、《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

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

(3)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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25%计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	5,080,602.31
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	5,080,602.31

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	98,900,175.45	80,679,350.32	-18,220,825.13
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	98,900,175.45	80,679,350.32	-18,220,825.13
----	---------------	---------------	----------------

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	1,113.74
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	2.19
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.20
合计	1,117.13

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	203,538.88
银行间市场应付交易费用	-
合计	203,538.88

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	224.09
预提费用	284,217.74
应付指数使用费	50,000.00
合计	334,441.83

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	129,700,950.59	212,869,103.61
本期申购	3,061,239.39	5,024,169.42
本期赎回(以“-”号填列)	-17,516,284.16	-28,747,921.71
本期末	115,245,905.82	189,145,351.32

注：本基金的基金份额包括华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额。本期申购含申购的华宝中证 1000 基础份额和配对转入的华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额，本期赎回含赎回的华宝中证 1000 基础份额和配对转出的华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-115,486,611.86	7,594,137.59	-107,892,474.27
本期利润	-2,070,606.67	-6,735,897.39	-8,806,504.06
本期基金份额交易产生的变动数	12,907,600.46	-293,404.08	12,614,196.38
其中：基金申购款	-2,701,082.99	49,699.60	-2,651,383.39
基金赎回款	15,608,683.45	-343,103.68	15,265,579.77
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-104,649,618.07	564,836.12	-104,084,781.95
-----	-----------------	------------	-----------------

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	21,912.24
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	204.55
其他	53.02
合计	22,169.81

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	24,393,068.07
减：卖出股票成本总额	25,989,292.03
买卖股票差价收入	-1,596,223.96

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	342,349.07
基金投资产生的股利收益	-
合计	342,349.07

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-6,735,897.39
——股票投资	-6,735,897.39
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-6,735,897.39

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	13,762.14
合计	13,762.14

注：本基金场外的赎回费率按持有期间递减；场内的赎回费率为 0.5%，不低于赎回费总额的 25% 计入基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	61,802.72
银行间市场交易费用	-
合计	61,802.72

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	44,629.17
基金上市费	29,752.78
银行汇划费用	850.00
指数使用费	100,000.00
合计	195,067.74

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华宝兴业基金管理有限公司（“华宝兴业”）	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
领先资产管理有限公司 (Lyxor Asset Management S.A.)	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
华宝证券有限责任公司（“华宝证券”）	受宝武集团控制的公司
华宝投资有限公司（“华宝投资”）	受宝武集团控制的公司
宝钢集团财务有限责任公司（“宝钢财务”）	受宝武集团控制的公司

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。

根据中国证监会于 2017 年 7 月 21 日发布的《关于核准华宝兴业基金管理有限公司变更股权的批复》（证监许可（2017）1321 号），中国证监会已核准“领先资产管理有限公司”将持有的我公司 49% 的股权转让给 Warburg Pincus Asset Management, L.P.。我公司及相关股东目前正在办理后续的工商变更登记等相关事宜，敬请投资者知悉。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
华宝证券	192,771.74	0.52%	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华宝证券	179.55	0.53%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
-	-	-	-	-

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
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	488,355.17	696,980.33
其中：支付销售机构的客户维护费	178,727.56	231,558.16

注：支付基金管理人华宝兴业的管理人报酬按前一日基金资产净值 1%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 X 1% / 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
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	107,438.10	153,335.73

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.22%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×0.22%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 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	5,080,602.31	21,912.24	7,874,902.11	44,551.00

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 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（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
--------	------	----------------	----------------	--------	-------	-------	-------	-----------	-----------	---

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000029	深深房 A	2016 年 9 月 14 日	重大事件停牌	11.17	-	-	6,200	81,266.58	69,254.00	-
000034	神州数码	2017 年 3 月 21 日	重大事件停牌	24.45	2017 年 7 月 18 日	22.01	7,000	185,876.62	171,150.00	-
000038	深大通	2017 年 5 月 12 日	重大事件停牌	31.74	-	-	800	41,710.00	25,392.00	-
000409	山东地矿	2017 年 6 月 29 日	重大事件停牌	9.83	2017 年 7 月 6 日	9.01	6,686	74,603.11	65,723.38	-
000506	中润资源	2017 年 4 月 25 日	重大事件停	8.75	-	-	11,800	98,875.67	103,250.00	-

			牌							
000571	新大洲 A	2017 年 5 月 15 日	重大事件停牌	8.11	2017 年 8 月 14 日	8.41	13,800	131,423.02	111,918.00	-
000673	当代东方	2017 年 1 月 18 日	重大事件停牌	13.53	-	-	8,500	130,307.85	115,005.00	-
000682	东方电子	2016 年 10 月 10 日	重大事件停牌	5.20	2017 年 8 月 7 日	5.60	22,500	136,149.74	117,000.00	-
000700	模塑科技	2017 年 6 月 28 日	重大事件停牌	8.09	2017 年 8 月 16 日	8.00	9,400	93,345.03	76,046.00	-
000836	鑫茂科技	2017 年 5 月 24 日	重大事件停牌	6.05	-	-	25,600	200,317.55	154,880.00	-
000838	财信发展	2017 年 5 月 2 日	重大事件停牌	6.59	-	-	9,300	107,711.31	61,287.00	-
000885	同力水泥	2017 年 5 月 8 日	重大事件停牌	19.29	2017 年 7 月 20 日	21.22	2,000	36,160.00	38,580.00	-
000889	茂业	2017	重	16.71	-	-	5,300	68,505.35	88,563.00	-

	通信	年 4 月 14 日	大事项停牌							
002070	*ST 众和	2017 年 5 月 2 日	重大事项停牌	10.17	-	-	10,700	239,410.64	108,819.00	-
002141	贤丰控股	2017 年 5 月 2 日	重大事项停牌	7.15	-	-	12,000	133,628.86	85,800.00	-
002162	悦心健康	2016 年 12 月 22 日	重大事项停牌	6.61	2017 年 7 月 5 日	6.80	9,000	79,791.24	59,490.00	-
002255	海陆重工	2017 年 3 月 6 日	重大事项停牌	10.06	2017 年 7 月 21 日	9.05	9,300	93,818.07	93,558.00	-
002256	兆新股份	2017 年 6 月 5 日	重大事项停牌	4.39	-	-	19,900	121,773.78	87,361.00	-
002260	德奥通航	2016 年 12 月 5 日	重大事项停牌	23.10	-	-	4,700	165,417.58	108,570.00	-
002263	大东南	2017 年 4 月 24 日	重大事	3.28	-	-	27,800	134,622.34	91,184.00	-

		日	项 停 牌							
002331	皖通科技	2017年5月2日	重大 事 项 停 牌	14.16	-	-	5,880	138,780.91	83,260.80	-
002348	高乐股份	2017年5月11日	重大 事 项 停 牌	7.01	2017年7月27日	6.70	10,000	89,524.73	70,100.00	-
002356	赫美集团	2017年6月14日	重大 事 项 停 牌	25.41	-	-	1,900	50,080.01	48,279.00	-
002418	康盛股份	2017年3月20日	重大 事 项 停 牌	9.31	2017年7月10日	9.30	12,100	108,411.04	112,651.00	-
002427	尤夫股份	2017年5月22日	重大 事 项 停 牌	25.11	2017年7月21日	23.00	5,100	109,699.04	128,061.00	-
002447	壹桥股份	2017年5月2日	重大 事 项 停 牌	9.00	-	-	14,100	156,163.45	126,900.00	-
002464	金利科技	2017年1月23日	重大 事 项 停	43.13	2017年7月26日	38.82	3,040	124,050.11	131,115.20	-

			牌							
002499	科林环保	2017年4月20日	重大 事项 停牌	28.92	2017年7月11日	26.03	2,400	54,347.80	69,408.00	-
002504	*ST弘高	2017年5月2日	重大 事项 停牌	8.10	-	-	10,798	113,517.53	87,463.80	-
002509	天广中茂	2017年6月12日	重大 事项 停牌	9.20	-	-	34,704	232,918.30	319,276.80	-
002547	春兴精工	2017年2月20日	重大 事项 停牌	10.89	2017年8月18日	9.80	13,000	132,724.74	141,570.00	-
002567	唐人神	2017年6月5日	重大 事项 停牌	9.70	2017年8月14日	9.54	6,750	61,656.15	65,475.00	-
002586	围海股份	2017年4月18日	重大 事项 停牌	9.87	-	-	6,600	60,643.11	65,142.00	-
002596	海南瑞泽	2017年5月22日	重大 事项 停牌	8.29	-	-	10,200	92,024.56	84,558.00	-
002600	江粉	2017	重	11.46	2017	6.25	12,600	125,648.71	144,396.00	-

	磁材	年 2 月 27 日	大事项停牌		年 8 月 9 日					
002606	大连电瓷	2017 年 3 月 2 日	重大事项停牌	20.87	-	-	7,000	54,647.67	146,090.00	-
002610	爱康科技	2017 年 5 月 12 日	重大事项停牌	2.44	2017 年 8 月 2 日	2.44	47,500	161,450.90	115,900.00	-
002619	巨龙管业	2017 年 5 月 24 日	重大事项停牌	6.37			9,180	110,197.27	58,476.60	-
002622	融钰集团	2017 年 4 月 20 日	重大事项停牌	12.30			14,200	201,920.01	174,660.00	-
002625	龙生股份	2017 年 4 月 13 日	重大事项停牌	36.36			3,800	182,008.42	138,168.00	-
002638	勤上股份	2017 年 4 月 26 日	重大事项停牌	8.14			16,350	138,724.52	133,089.00	-
002650	加加食品	2017 年 4 月 20 日	重大事	5.88			14,600	104,109.12	85,848.00	-

		日	项 停 牌							
002675	东诚 药业	2017 年1 月3 日	重 大 事 项 停 牌	14.26	2017 年7 月17 日	12.84	6,000	93,540.00	85,560.00	-
002684	猛狮 科技	2017 年4 月20 日	重 大 事 项 停 牌	21.22	-	-	4,800	100,880.56	101,856.00	-
002711	欧浦 智网	2017 年6 月26 日	重 大 事 项 停 牌	18.79	2017 年7 月17 日	11.94	4,980	83,322.76	93,574.20	-
002756	永兴 特钢	2017 年6 月30 日	重 大 事 项 停 牌	28.20	-	-	3,400	90,193.35	95,880.00	-
002781	奇信 股份	2017 年5 月31 日	重 大 事 项 停 牌	29.44	-	-	1,000	43,865.00	29,440.00	-
300030	阳普 医疗	2017 年5 月16 日	重 大 事 项 停 牌	11.62	2017 年8 月15 日	11.62	4,600	105,222.79	53,452.00	-
300065	海兰 信	2016 年12 月8 日	重 大 事 项 停	24.47	2017 年7 月6 日	23.07	6,450	151,400.58	157,831.50	-

			牌							
300075	数字政通	2017年6月29日	重大事项停牌	20.94	2017年7月17日	18.86	4,400	145,746.70	92,136.00	-
300085	银之杰	2017年6月30日	重大事项停牌	18.50	2017年7月7日	18.88	5,100	90,130.91	94,350.00	-
300098	高新兴	2017年6月22日	重大事项停牌	12.90	2017年7月3日	13.18	8,220	117,069.37	106,038.00	-
300100	双林股份	2017年4月5日	重大事项停牌	25.96	-	-	2,500	73,983.32	64,900.00	-
300109	新开源	2017年3月27日	重大事项停牌	46.46	-	-	1,400	79,325.16	65,044.00	-
300145	中金环境	2017年6月28日	重大事项停牌	16.92	-	-	13,500	217,383.06	228,420.00	-
300148	天舟文化	2017年1月25日	重大事项停牌	15.57	2017年8月1日	14.01	9,100	143,615.64	141,687.00	-
300149	量子	2016	重	19.37	-	-	6,300	118,635.93	122,031.00	-

	高科	2017年12月15日	重大事项停牌							
300151	昌红科技	2017年4月11日	重大事项停牌	11.53	2017年8月18日	10.38	5,300	67,919.50	61,109.00	-
300152	科融环境	2017年5月12日	重大事项停牌	7.89	2017年7月12日	7.41	12,100	114,779.85	95,469.00	-
300198	纳川股份	2017年4月20日	重大事项停牌	5.75	-	-	10,880	72,422.96	62,560.00	-
300209	天泽信息	2017年2月10日	重大事项停牌	27.72	-	-	2,500	71,855.11	69,300.00	-
300252	金信诺	2017年4月27日	重大事项停牌	21.65	2017年7月27日	19.49	3,800	137,671.32	82,270.00	-
300271	华宇软件	2017年6月22日	重大事项停牌	16.59	2017年7月4日	16.80	9,880	219,642.60	163,909.20	-
300276	三丰智能	2017年6月29日	重大事	16.50	2017年7月7日	16.95	2,800	64,052.49	46,200.00	-

		日	项 停 牌		日					
300278	华昌 达	2017 年 4 月 26 日	重 大 事 项 停 牌	16.59	2017 年 8 月 10 日	15.90	4,600	79,283.08	76,314.00	-
300298	三诺 生物	2017 年 5 月 17 日	重 大 事 项 停 牌	16.27	2017 年 7 月 17 日	16.09	3,420	73,322.36	55,643.40	-
300322	硕贝 德	2017 年 2 月 23 日	重 大 事 项 停 牌	17.02	2017 年 8 月 7 日	15.32	6,100	107,053.92	103,822.00	-
300364	中文 在线	2017 年 2 月 13 日	重 大 事 项 停 牌	37.28	-	-	3,006	171,353.62	112,063.68	-
300367	东方 网力	2016 年 12 月 15 日	重 大 事 项 停 牌	20.00	2017 年 7 月 3 日	18.01	9,150	253,787.05	183,000.00	-
300388	国祯 环保	2017 年 6 月 26 日	重 大 事 项 停 牌	21.15	2017 年 7 月 10 日	21.06	2,300	51,098.69	48,645.00	-
300413	快乐 购	2017 年 4 月 5 日	重 大 事 项 停	20.29	-	-	4,200	129,359.13	85,218.00	-

			牌							
300440	运达科技	2017年2月20日	重大 事项 停牌	13.12	-	-	4,800	85,388.22	62,976.00	-
300459	金科娱乐	2017年6月30日	重大 事项 停牌	12.40	-	-	8,900	98,759.39	110,360.00	-
300518	盛讯达	2016年12月13日	重大 事项 停牌	113.30	2017年7月10日	101.97	600	76,314.00	67,980.00	-
600057	象屿股份	2017年6月27日	重大 事项 停牌	10.17	2017年7月4日	10.17	10,900	119,907.97	110,853.00	-
600136	当代明诚	2017年2月14日	重大 事项 停牌	15.07	-	-	4,200	103,646.82	63,294.00	-
600165	新日恒力	2017年4月10日	重大 事项 停牌	16.84	2017年7月20日	15.16	8,650	97,660.21	145,666.00	-
600172	黄河旋风	2017年6月30日	重大 事项 停牌	8.23	2017年7月14日	8.00	18,660	192,637.58	153,571.80	-
600193	创兴	2017	重	6.77	-	-	6,300	105,313.74	42,651.00	-

	资源	年 6 月 1 日	大事项停牌							
600239	云南城投	2017 年 6 月 26 日	重大事项停牌	5.22	-	-	21,000	98,566.79	109,620.00	-
600255	鑫科材料	2017 年 6 月 26 日	重大事项停牌	4.04	-	-	33,100	195,360.61	133,724.00	-
600318	新力金融	2017 年 4 月 27 日	重大事项停牌	10.73	2017 年 8 月 8 日	11.50	7,200	97,324.58	77,256.00	-
600490	鹏欣资源	2017 年 2 月 21 日	重大事项停牌	7.91	-	-	28,800	238,364.06	227,808.00	-
600559	老白干酒	2017 年 1 月 23 日	重大事项停牌	22.69	-	-	5,672	131,098.82	128,697.68	-
600568	中珠医疗	2017 年 4 月 25 日	重大事项停牌	19.16	2017 年 7 月 27 日	6.15	7,500	149,698.18	143,700.00	-
600577	精达股份	2017 年 6 月 26 日	重大事	4.80	2017 年 7 月 10 日	4.50	21,900	144,740.01	105,120.00	-

		日	项 停 牌		日						
600602	云赛 智联	2017 年6 月22 日	重 大 事 项 停 牌	7.51	2017 年7 月4 日	7.80	11,500	117,372.67	86,365.00	-	
600634	富控 互动	2017 年4 月19 日	重 大 事 项 停 牌	18.03	2017 年7 月17 日	17.21	8,500	189,629.30	153,255.00	-	
600653	申华 控股	2017 年5 月8 日	重 大 事 项 停 牌	3.26	-	-	32,900	215,114.28	107,254.00	-	
600764	中电 广通	2017 年6 月29 日	重 大 事 项 停 牌	33.25	2017 年7 月7 日	33.98	3,100	98,422.18	103,075.00	-	
601028	玉龙 股份	2017 年6 月23 日	重 大 事 项 停 牌	8.40	-	-	7,300	70,459.05	61,320.00	-	
601069	西部 黄金	2017 年4 月17 日	重 大 事 项 停 牌	26.26	-	-	4,000	79,202.57	105,040.00	-	
603126	中材 节能	2017 年6 月27 日	重 大 事 项 停 牌	16.46	-	-	4,600	59,331.01	75,716.00	-	

			牌							
603299	井神股份	2017年5月31日	重大事件停牌	10.47	-	-	2,400	41,082.14	25,128.00	-
603861	白云电器	2017年6月15日	重大事件停牌	24.27	-	-	1,600	49,300.00	38,832.00	-

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只指数型的分级证券投资基金，华宝中证 1000A 份额具有较低风险、收益相对稳定的特征；华宝中证 1000B 份额具有较高风险、较高预期收益的特征。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券及权证等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现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、副总经理、督察长、监察稽核部、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。副总经理总管公司的内控事务。督察长向董事会负责，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。风险管理部在副总经理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；监察稽核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监察稽核部对各岗位、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，并对风险管理部和监察稽核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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，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，因此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，通过对投资品种的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 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2016 年 12 月 31 日：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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券在证券交易所上市，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量(2016 年 12 月 31 日:同)。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面

临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,080,602.31	-	-	-	5,080,602.31
存出保证金	2,717.98	-	-	-	2,717.98
交易性金融资产	-	-	-	-80,679,350.32	80,679,350.32
应收利息	-	-	-	1,117.13	1,117.13
应收申购款	1,148.81	-	-	7,261.29	8,410.10
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,084,469.10	-	-	-80,687,728.74	85,772,197.84
负债					
应付赎回款	-	-	-	85,865.06	85,865.06
应付管理人报酬	-	-	-	71,953.05	71,953.05
应付托管费	-	-	-	15,829.65	15,829.65
应付交易费用	-	-	-	203,538.88	203,538.88
其他负债	-	-	-	334,441.83	334,441.83
负债总计	-	-	-	711,628.47	711,628.47
利率敏感度缺口	5,084,469.10	-	-	-79,976,100.27	85,060,569.37
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,424,942.83	-	-	-	6,424,942.83
结算备付金	2,637.42	-	-	-	2,637.42
存出保证金	16,128.15	-	-	-	16,128.15
交易性金融资产	-	-	-	-99,470,723.98	99,470,723.98
应收证券清算款	-	-	-	30,915.98	30,915.98
应收利息	-	-	-	1,415.86	1,415.86

应收申购款	1,148.81	-	-	5,838.34	6,987.15
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,444,857.21	-	-	99,508,894.16	105,953,751.37
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	279,606.56	279,606.56
应付赎回款	-	-	-	38,276.78	38,276.78
应付管理人报酬	-	-	-	91,342.86	91,342.86
应付托管费	-	-	-	20,095.45	20,095.45
应付销售服务费	-	-	-	50,000.00	50,000.00
应付交易费用	-	-	-	207,679.76	207,679.76
其他负债	-	-	-	290,120.62	290,120.62
负债总计	-	-	-	977,122.03	977,122.03
利率敏感度缺口	6,444,857.21	-	-	-98,531,772.13	104,976,629.34

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 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2016 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市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。本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于中证 1000 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 80%。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 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	80,679,350.32	94.85	99,470,723.98	94.76
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	80,679,350.32	94.85	99,470,723.98	94.76

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	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	4,195,437.36	5,151,891.32
	业绩比较基准下降 5%	-4,195,437.36	-5,151,891.32

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 71,052,325.76 元，属于第二层次的余额为 9,627,024.56 元，无属于第三层次的余额（2016 年 12 月 31 日：第一层次 90,728,184.34 元，第二层次 8,742,539.64 元，无第三层次）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	80,679,350.32	94.06
	其中：股票	80,679,350.32	94.06
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	5,080,602.31	5.92
7	其他各项资产	12,245.21	0.01
8	合计	85,772,197.84	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	907,314.00	1.07
B	采矿业	1,480,830.60	1.74
C	制造业	51,071,143.72	60.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,172,072.40	2.55
E	建筑业	2,766,268.92	3.25
F	批发和零售业	3,169,164.00	3.73
G	交通运输、仓储和邮政业	2,416,822.40	2.84
H	住宿和餐饮业	45,513.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,994,526.46	8.22
J	金融业	141,256.00	0.17

K	房地产业	3,319,096.10	3.90
L	租赁和商务服务业	1,186,805.30	1.40
M	科学研究和技术服务业	622,895.50	0.73
N	水利、环境和公共设施管理业	957,426.80	1.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	327,778.00	0.39
R	文化、体育和娱乐业	1,527,135.68	1.80
S	综合	894,227.78	1.05
	合计	80,000,276.66	94.05

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	522,487.86	0.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	87,463.80	0.10
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	69,122.00	0.08
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	679,073.66	0.80

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	占基金资产净值比例（%）
1	002509	天广中茂	34,704	319,276.80	0.38
2	600110	诺德股份	21,500	302,935.00	0.36
3	600004	白云机场	16,000	295,360.00	0.35
4	300142	沃森生物	20,100	248,436.00	0.29
5	002185	华天科技	31,900	230,956.00	0.27
6	300145	中金环境	13,500	228,420.00	0.27
7	000820	神雾节能	6,000	227,880.00	0.27
8	600490	鹏欣资源	28,800	227,808.00	0.27
9	300197	铁汉生态	17,080	226,822.40	0.27
10	002035	华帝股份	8,720	211,024.00	0.25
11	600252	中恒集团	51,900	209,676.00	0.25
12	600885	宏发股份	5,000	199,450.00	0.23
13	300450	先导智能	3,800	196,726.00	0.23
14	300355	蒙草生态	18,000	193,320.00	0.23
15	002108	沧州明珠	14,240	190,104.00	0.22
16	002359	齐星铁塔	4,800	188,400.00	0.22
17	300090	盛运环保	19,700	186,559.00	0.22
18	601588	北辰实业	29,800	184,760.00	0.22
19	002138	顺络电子	9,900	183,942.00	0.22
20	300367	东方网力	9,150	183,000.00	0.22
21	600567	山鹰纸业	51,000	182,580.00	0.21
22	002343	慈文传媒	4,750	179,835.00	0.21
23	000059	华锦股份	17,900	179,179.00	0.21
24	300285	国瓷材料	8,900	175,330.00	0.21
25	002622	融钰集团	14,200	174,660.00	0.21
26	300014	亿纬锂能	9,581	173,895.15	0.20
27	600777	新潮能源	45,400	173,428.00	0.20
28	600868	梅雁吉祥	35,500	173,240.00	0.20

29	002383	合众思壮	11,000	172,370.00	0.20
30	000034	神州数码	7,000	171,150.00	0.20
31	300207	欣旺达	14,500	170,955.00	0.20
32	600797	浙大网新	13,700	169,743.00	0.20
33	600856	中天能源	14,800	166,648.00	0.20
34	300203	聚光科技	5,900	165,908.00	0.20
35	002647	民盛金科	4,220	164,580.00	0.19
36	000516	国际医学	29,500	164,315.00	0.19
37	300271	华宇软件	9,880	163,909.20	0.19
38	600622	嘉宝集团	10,010	162,962.80	0.19
39	002434	万里扬	10,100	160,792.00	0.19
40	600320	振华重工	31,000	160,580.00	0.19
41	300208	恒顺众昇	10,050	160,498.50	0.19
42	600771	广誉远	4,000	159,800.00	0.19
43	300065	海兰信	6,450	157,831.50	0.19
44	600779	水井坊	6,400	157,312.00	0.18
45	000836	鑫茂科技	25,600	154,880.00	0.18
46	002501	利源精制	13,600	154,632.00	0.18
47	600550	保变电气	14,300	153,868.00	0.18
48	600172	黄河旋风	18,660	153,571.80	0.18
49	600634	富控互动	8,500	153,255.00	0.18
50	000088	盐田港	14,500	152,395.00	0.18
51	300137	先河环保	6,400	152,320.00	0.18
52	600477	杭萧钢构	9,910	151,226.60	0.18
53	300079	数码视讯	25,700	150,345.00	0.18
54	000910	大亚圣象	6,000	149,040.00	0.18
55	300083	劲胜精密	16,100	148,764.00	0.17
56	600711	盛屯矿业	22,400	148,736.00	0.17
57	300068	南都电源	8,800	148,192.00	0.17
58	600486	扬农化工	3,500	147,735.00	0.17
59	000518	四环生物	19,200	146,880.00	0.17
60	601058	赛轮金宇	42,840	146,512.80	0.17
61	002606	大连电瓷	7,000	146,090.00	0.17
62	600165	新日恒力	8,650	145,666.00	0.17
63	002462	嘉事堂	3,700	145,373.00	0.17
64	002145	中核钛白	23,800	144,704.00	0.17
65	002600	江粉磁材	12,600	144,396.00	0.17
66	002102	冠福股份	34,500	144,210.00	0.17
67	300077	国民技术	10,500	143,745.00	0.17

68	600568	中珠医疗	7,500	143,700.00	0.17
69	002262	恩华药业	9,436	142,766.68	0.17
70	600226	瀚叶股份	16,100	142,163.00	0.17
71	300148	天舟文化	9,100	141,687.00	0.17
72	002547	春兴精工	13,000	141,570.00	0.17
73	000807	云铝股份	19,500	140,790.00	0.17
74	002668	奥马电器	7,120	140,264.00	0.16
75	002497	雅化集团	14,400	139,680.00	0.16
76	600210	紫江企业	22,700	139,378.00	0.16
77	600076	康欣新材	15,500	139,035.00	0.16
78	002389	南洋科技	6,600	138,996.00	0.16
79	002522	浙江众成	8,500	138,975.00	0.16
80	002625	光启技术	3,800	138,168.00	0.16
81	002036	联创电子	8,300	136,950.00	0.16
82	300020	银江股份	9,800	135,632.00	0.16
83	000036	华联控股	14,900	135,590.00	0.16
84	300347	泰格医药	5,600	135,520.00	0.16
85	000048	康达尔	5,100	134,793.00	0.16
86	002043	兔宝宝	9,700	134,248.00	0.16
87	000666	经纬纺机	5,900	134,166.00	0.16
88	600255	鑫科材料	33,100	133,724.00	0.16
89	002638	勤上股份	16,350	133,089.00	0.16
90	300463	迈克生物	5,200	132,600.00	0.16
91	002421	达实智能	21,600	132,192.00	0.16
92	300009	安科生物	8,009	131,427.69	0.15
93	002464	金利科技	3,040	131,115.20	0.15
94	002570	贝因美	9,600	130,560.00	0.15
95	600420	现代制药	8,300	130,227.00	0.15
96	600502	安徽水利	16,880	129,807.20	0.15
97	600559	老白干酒	5,672	128,697.68	0.15
98	000687	华讯方舟	8,500	128,690.00	0.15
99	002302	西部建设	5,800	128,586.00	0.15
100	300496	中科创达	4,527	128,114.10	0.15
101	002427	尤夫股份	5,100	128,061.00	0.15
102	000915	山大华特	3,470	127,938.90	0.15
103	600620	天宸股份	10,250	127,612.50	0.15
104	002630	华西能源	11,000	127,490.00	0.15
105	002447	壹桥股份	14,100	126,900.00	0.15
106	600491	龙元建设	11,800	126,614.00	0.15

107	600803	新奥股份	9,200	126,408.00	0.15
108	002643	万润股份	8,500	125,460.00	0.15
109	000901	航天科技	4,600	124,936.00	0.15
110	600343	航天动力	7,200	124,848.00	0.15
111	600323	瀚蓝环境	8,600	124,786.00	0.15
112	600116	三峡水利	11,100	124,431.00	0.15
113	002117	东港股份	4,800	124,224.00	0.15
114	300284	苏交科	6,300	123,984.00	0.15
115	000989	九芝堂	6,505	123,334.80	0.14
116	002436	兴森科技	19,500	122,850.00	0.14
117	002402	和而泰	12,450	122,757.00	0.14
118	002047	宝鹰股份	14,200	122,688.00	0.14
119	600562	国睿科技	4,440	122,277.60	0.14
120	300149	量子高科	6,300	122,031.00	0.14
121	002089	新海宜	18,000	121,860.00	0.14
122	300294	博雅生物	2,950	121,658.00	0.14
123	600438	通威股份	21,800	121,644.00	0.14
124	002542	中化岩土	10,050	121,504.50	0.14
125	002716	金贵银业	6,300	120,897.00	0.14
126	600756	浪潮软件	6,100	120,719.00	0.14
127	600742	一汽富维	6,300	120,393.00	0.14
128	000615	京汉股份	8,700	120,147.00	0.14
129	002067	景兴纸业	20,400	119,748.00	0.14
130	300073	当升科技	4,800	119,712.00	0.14
131	300118	东方日升	8,500	119,425.00	0.14
132	002313	日海通讯	5,800	118,958.00	0.14
133	600638	新黄浦	7,300	118,479.00	0.14
134	300431	暴风集团	4,960	118,196.80	0.14
135	600745	中茵股份	6,300	117,873.00	0.14
136	000921	海信科龙	6,800	117,028.00	0.14
137	601666	平煤股份	22,100	116,467.00	0.14
138	000958	东方能源	14,400	116,352.00	0.14
139	600072	中船科技	6,900	116,058.00	0.14
140	002023	海特高新	11,300	116,051.00	0.14
141	600728	佳都科技	14,980	115,945.20	0.14
142	002055	得润电子	5,100	115,923.00	0.14
143	002610	爱康科技	47,500	115,900.00	0.14
144	002597	金禾实业	5,300	115,858.00	0.14
145	300170	汉得信息	11,200	115,472.00	0.14

146	603588	高能环境	7,400	115,440.00	0.14
147	600391	航发科技	4,300	115,111.00	0.14
148	000673	当代东方	8,500	115,005.00	0.14
149	300216	千山药机	4,700	114,915.00	0.14
150	300316	晶盛机电	9,200	114,908.00	0.14
151	600273	嘉化能源	12,200	114,436.00	0.13
152	300269	联建光电	5,700	114,171.00	0.13
153	600162	香江控股	31,750	113,982.50	0.13
154	002376	新北洋	8,300	113,876.00	0.13
155	600269	赣粤高速	21,800	113,578.00	0.13
156	601636	旗滨集团	25,100	113,201.00	0.13
157	002418	康盛股份	12,100	112,651.00	0.13
158	000881	中广核技	5,900	112,395.00	0.13
159	002091	江苏国泰	11,760	112,308.00	0.13
160	300364	中文在线	3,006	112,063.68	0.13
161	000571	新大洲 A	13,800	111,918.00	0.13
162	002307	北新路桥	6,200	111,910.00	0.13
163	600990	四创电子	1,800	111,582.00	0.13
164	300185	通裕重工	42,700	111,447.00	0.13
165	600495	晋西车轴	15,780	111,249.00	0.13
166	000928	中钢国际	11,720	110,871.20	0.13
167	600057	象屿股份	10,900	110,853.00	0.13
168	000882	华联股份	30,700	110,827.00	0.13
169	000902	新洋丰	12,300	110,700.00	0.13
170	000407	胜利股份	11,500	110,400.00	0.13
171	600326	西藏天路	10,000	110,400.00	0.13
172	300459	金科娱乐	8,900	110,360.00	0.13
173	000801	四川九洲	11,500	110,055.00	0.13
174	600668	尖峰集团	6,400	109,952.00	0.13
175	600239	云南城投	21,000	109,620.00	0.13
176	600337	美克家居	19,400	109,610.00	0.13
177	300053	欧比特	8,145	109,550.25	0.13
178	300352	北信源	18,975	109,485.75	0.13
179	000520	长航凤凰	18,900	109,431.00	0.13
180	600667	太极实业	15,700	109,429.00	0.13
181	600807	天业股份	11,600	109,388.00	0.13
182	300054	鼎龙股份	10,740	109,225.80	0.13
183	002721	金一文化	7,300	108,989.00	0.13
184	600330	天通股份	12,400	108,872.00	0.13

185	002126	银轮股份	10,800	108,648.00	0.13
186	601890	亚星锚链	12,500	108,625.00	0.13
187	002260	德奥通航	4,700	108,570.00	0.13
188	600480	凌云股份	5,100	107,559.00	0.13
189	600653	申华控股	32,900	107,254.00	0.13
190	600261	阳光照明	16,300	107,091.00	0.13
191	002326	永太科技	7,700	106,722.00	0.13
192	002372	伟星新材	5,696	106,401.28	0.13
193	002151	北斗星通	3,800	106,210.00	0.12
194	600708	光明地产	15,990	106,173.60	0.12
195	600399	抚顺特钢	17,000	106,080.00	0.12
196	300098	高新兴	8,220	106,038.00	0.12
197	002664	信质电机	3,700	105,894.00	0.12
198	002130	沃尔核材	16,400	105,452.00	0.12
199	600577	精达股份	21,900	105,120.00	0.12
200	601069	西部黄金	4,000	105,040.00	0.12
201	600132	重庆啤酒	4,500	104,895.00	0.12
202	000584	友利控股	8,000	104,480.00	0.12
203	002341	新纶科技	5,600	104,440.00	0.12
204	600185	格力地产	15,380	104,430.20	0.12
205	002178	延华智能	9,500	103,835.00	0.12
206	300322	硕贝德	6,100	103,822.00	0.12
207	002429	兆驰股份	33,800	103,766.00	0.12
208	000751	锌业股份	21,100	103,601.00	0.12
209	002198	嘉应制药	7,600	103,588.00	0.12
210	300237	美晨科技	6,000	103,560.00	0.12
211	000506	中润资源	11,800	103,250.00	0.12
212	600303	曙光股份	10,100	103,222.00	0.12
213	600764	中电广通	3,100	103,075.00	0.12
214	300310	宜通世纪	7,788	102,957.36	0.12
215	000976	春晖股份	11,900	102,935.00	0.12
216	002449	国星光电	6,200	102,610.00	0.12
217	000016	深康佳 A	20,900	102,201.00	0.12
218	300101	振芯科技	7,300	102,200.00	0.12
219	002167	东方锆业	9,300	102,114.00	0.12
220	300332	天壕环境	10,100	102,010.00	0.12
221	600988	赤峰黄金	8,000	102,000.00	0.12
222	000150	宜华健康	4,200	101,934.00	0.12
223	002684	猛狮科技	4,800	101,856.00	0.12

224	300038	梅泰诺	2,400	101,640.00	0.12
225	600652	游久游戏	9,300	101,556.00	0.12
226	000875	吉电股份	20,100	101,505.00	0.12
227	000018	神州长城	13,400	101,438.00	0.12
228	300238	冠昊生物	4,000	101,400.00	0.12
229	300012	华测检测	21,900	101,397.00	0.12
230	000918	嘉凯城	13,500	101,385.00	0.12
231	603111	康尼机电	8,300	101,260.00	0.12
232	002099	海翔药业	15,200	101,232.00	0.12
233	603368	柳州医药	1,760	100,760.00	0.12
234	000601	韶能股份	14,100	100,533.00	0.12
235	002097	山河智能	11,300	100,457.00	0.12
236	002564	天沃科技	11,000	100,430.00	0.12
237	002104	恒宝股份	10,676	100,247.64	0.12
238	002445	中南文化	7,800	100,230.00	0.12
239	002245	澳洋顺昌	11,100	100,122.00	0.12
240	600285	羚锐制药	8,900	99,947.00	0.12
241	002020	京新药业	8,400	99,540.00	0.12
242	002550	千红制药	16,700	99,198.00	0.12
243	600963	岳阳林纸	13,100	98,643.00	0.12
244	000040	东旭蓝天	7,500	98,625.00	0.12
245	000683	远兴能源	36,440	98,388.00	0.12
246	601011	宝泰隆	15,300	98,379.00	0.12
247	000533	万家乐	9,000	98,370.00	0.12
248	601222	林洋能源	13,208	98,135.44	0.12
249	600590	泰豪科技	7,500	98,100.00	0.12
250	000035	中国天楹	13,900	97,856.00	0.12
251	600986	科达股份	7,200	97,632.00	0.11
252	600123	兰花科创	12,800	97,536.00	0.11
253	600033	福建高速	25,600	97,536.00	0.11
254	000733	振华科技	6,100	96,990.00	0.11
255	000650	仁和药业	16,200	96,876.00	0.11
256	300078	思创医惠	9,024	96,827.52	0.11
257	300188	美亚柏科	5,600	96,824.00	0.11
258	002095	生意宝	2,800	96,768.00	0.11
259	002086	东方海洋	7,700	96,635.00	0.11
260	300037	新宙邦	4,200	96,516.00	0.11
261	300036	超图软件	5,900	96,465.00	0.11
262	300011	鼎汉技术	6,000	96,000.00	0.11

263	002756	永兴特钢	3,400	95,880.00	0.11
264	600621	华鑫股份	7,900	95,827.00	0.11
265	600206	有研新材	11,000	95,480.00	0.11
266	300152	科融环境	12,100	95,469.00	0.11
267	002224	三力士	8,600	95,460.00	0.11
268	600783	鲁信创投	5,600	95,368.00	0.11
269	002139	拓邦股份	8,850	95,314.50	0.11
270	600782	新钢股份	26,000	94,900.00	0.11
271	600662	强生控股	11,800	94,754.00	0.11
272	002481	双塔食品	14,200	94,714.00	0.11
273	000739	普洛药业	12,900	94,686.00	0.11
274	002614	奥佳华	5,200	94,536.00	0.11
275	002210	飞马国际	5,500	94,435.00	0.11
276	000735	罗牛山	15,100	94,375.00	0.11
277	300085	银之杰	5,100	94,350.00	0.11
278	002467	二六三	11,900	94,248.00	0.11
279	600595	中孚实业	19,500	93,990.00	0.11
280	300317	珈伟股份	6,425	93,805.00	0.11
281	601388	怡球资源	26,480	93,739.20	0.11
282	600084	中葡股份	12,600	93,618.00	0.11
283	000828	东莞控股	7,800	93,600.00	0.11
284	002711	欧浦智网	4,980	93,574.20	0.11
285	002255	海陆重工	9,300	93,558.00	0.11
286	300222	科大智能	4,120	93,482.80	0.11
287	002283	天润曲轴	14,600	93,440.00	0.11
288	600677	航天通信	6,800	93,364.00	0.11
289	002511	中顺洁柔	7,050	93,271.50	0.11
290	002636	金安国纪	5,400	93,258.00	0.11
291	603678	火炬电子	3,350	93,230.50	0.11
292	002611	东方精工	6,500	93,210.00	0.11
293	600400	红豆股份	13,500	92,880.00	0.11
294	300309	吉艾科技	4,500	92,790.00	0.11
295	300128	锦富技术	11,045	92,778.00	0.11
296	300336	新文化	6,000	92,760.00	0.11
297	603008	喜临门	5,200	92,612.00	0.11
298	002697	红旗连锁	15,240	92,506.80	0.11
299	600363	联创光电	6,600	92,466.00	0.11
300	000603	盛达矿业	6,800	92,344.00	0.11
301	002156	通富微电	9,070	92,332.60	0.11

302	300075	数字政通	4,400	92,136.00	0.11
303	002284	亚太股份	8,300	92,130.00	0.11
304	600209	罗顿发展	6,600	92,004.00	0.11
305	300482	万孚生物	1,300	91,897.00	0.11
306	002413	雷科防务	8,200	91,840.00	0.11
307	000065	北方国际	3,850	91,553.00	0.11
308	300157	恒泰艾普	9,300	91,326.00	0.11
309	000818	方大化工	8,900	91,314.00	0.11
310	000957	中通客车	7,800	91,260.00	0.11
311	002263	大东南	27,800	91,184.00	0.11
312	002148	北纬通信	8,460	91,114.20	0.11
313	600133	东湖高新	9,500	91,105.00	0.11
314	600855	航天长峰	4,300	91,074.00	0.11
315	002510	天汽模	12,500	90,750.00	0.11
316	002222	福晶科技	6,350	90,614.50	0.11
317	600763	通策医疗	3,600	90,324.00	0.11
318	002121	科陆电子	10,500	90,300.00	0.11
319	002318	久立特材	11,000	89,980.00	0.11
320	300102	乾照光电	10,500	89,670.00	0.11
321	002094	青岛金王	4,200	89,586.00	0.11
322	002031	巨轮智能	28,800	89,568.00	0.11
323	600758	红阳能源	10,000	89,400.00	0.11
324	002443	金洲管道	9,700	89,240.00	0.10
325	600063	皖维高新	21,600	89,208.00	0.10
326	002080	中材科技	4,500	89,190.00	0.10
327	002448	中原内配	8,800	89,144.00	0.10
328	300288	朗玛信息	3,200	89,120.00	0.10
329	002457	青龙管业	5,000	89,000.00	0.10
330	000967	盈峰环境	8,192	88,801.28	0.10
331	600552	凯盛科技	11,500	88,780.00	0.10
332	002303	美盈森	11,500	88,780.00	0.10
333	300044	赛为智能	4,500	88,650.00	0.10
334	000889	茂业通信	5,300	88,563.00	0.10
335	002531	天顺风能	13,280	88,312.00	0.10
336	300212	易华录	3,500	88,305.00	0.10
337	002474	榕基软件	8,100	87,885.00	0.10
338	600012	皖通高速	6,500	87,815.00	0.10
339	600626	申达股份	9,300	87,699.00	0.10
340	002367	康力电梯	7,500	87,600.00	0.10

341	300096	易联众	6,400	87,552.00	0.10
342	002188	巴士在线	3,400	87,380.00	0.10
343	002256	兆新股份	19,900	87,361.00	0.10
344	002192	融捷股份	3,400	87,312.00	0.10
345	002339	积成电子	6,400	87,296.00	0.10
346	000797	中国武夷	9,300	87,234.00	0.10
347	002649	博彦科技	7,900	87,137.00	0.10
348	600707	彩虹股份	11,000	87,120.00	0.10
349	000591	太阳能	16,860	86,660.40	0.10
350	002446	盛路通信	7,120	86,650.40	0.10
351	002515	金字火腿	9,120	86,457.60	0.10
352	600602	云赛智联	11,500	86,365.00	0.10
353	002215	诺普信	10,200	86,292.00	0.10
354	002419	天虹股份	6,000	86,280.00	0.10
355	002364	中恒电气	6,300	86,247.00	0.10
356	600405	动力源	10,700	86,242.00	0.10
357	002170	芭田股份	11,600	86,188.00	0.10
358	300323	华灿光电	6,200	86,056.00	0.10
359	300183	东软载波	4,200	86,016.00	0.10
360	601126	四方股份	9,100	85,904.00	0.10
361	002650	加加食品	14,600	85,848.00	0.10
362	002141	贤丰控股	12,000	85,800.00	0.10
363	002618	丹邦科技	7,150	85,585.50	0.10
364	002675	东诚药业	6,000	85,560.00	0.10
365	600105	永鼎股份	10,600	85,542.00	0.10
366	000811	烟台冰轮	4,900	85,505.00	0.10
367	000851	高鸿股份	9,400	85,446.00	0.10
368	600227	赤天化	13,000	85,410.00	0.10
369	600130	波导股份	14,400	85,392.00	0.10
370	300413	快乐购	4,200	85,218.00	0.10
371	600290	华仪电气	7,100	85,058.00	0.10
372	002537	海立美达	6,980	85,016.40	0.10
373	002206	海利得	11,400	84,702.00	0.10
374	600020	中原高速	16,800	84,672.00	0.10
375	600093	易见股份	6,300	84,609.00	0.10
376	002596	海南瑞泽	10,200	84,558.00	0.10
377	002538	司尔特	9,400	84,506.00	0.10
378	600507	方大特钢	9,900	84,447.00	0.10
379	300339	润和软件	6,700	84,420.00	0.10

380	300131	英唐智控	10,000	84,200.00	0.10
381	600114	东睦股份	4,800	84,000.00	0.10
382	002247	帝龙文化	6,400	83,968.00	0.10
383	002496	辉丰股份	16,920	83,923.20	0.10
384	002604	龙力生物	9,000	83,790.00	0.10
385	600641	万业企业	7,500	83,700.00	0.10
386	300495	美尚生态	5,583	83,410.02	0.10
387	002585	双星新材	10,790	83,406.70	0.10
388	000576	广东甘化	5,000	83,350.00	0.10
389	600322	天房发展	16,500	83,325.00	0.10
390	002331	皖通科技	5,880	83,260.80	0.10
391	000731	四川美丰	11,100	83,250.00	0.10
392	000042	中洲控股	5,000	83,150.00	0.10
393	601116	三江购物	3,100	83,142.00	0.10
394	002717	岭南园林	3,100	83,080.00	0.10
395	600331	宏达股份	15,200	82,992.00	0.10
396	300219	鸿利智汇	6,250	82,875.00	0.10
397	000005	世纪星源	15,800	82,792.00	0.10
398	603718	海利生物	5,985	82,712.70	0.10
399	300476	胜宏科技	3,500	82,705.00	0.10
400	002554	惠博普	14,000	82,600.00	0.10
401	300252	金信诺	3,800	82,270.00	0.10
402	600713	南京医药	11,700	82,251.00	0.10
403	300110	华仁药业	9,200	82,248.00	0.10
404	600054	黄山旅游	4,800	82,080.00	0.10
405	600456	宝钛股份	4,000	82,080.00	0.10
406	600684	珠江实业	9,300	81,840.00	0.10
407	300458	全志科技	3,106	81,812.04	0.10
408	002212	南洋股份	6,400	81,728.00	0.10
409	002387	黑牛食品	5,300	81,726.00	0.10
410	000965	天保基建	9,400	81,404.00	0.10
411	002471	中超控股	16,600	81,174.00	0.10
412	002543	万和电气	3,300	81,081.00	0.10
413	000996	中国中期	4,300	80,969.00	0.10
414	300031	宝通科技	4,400	80,916.00	0.10
415	000676	智度股份	5,400	80,838.00	0.10
416	300303	聚飞光电	18,640	80,711.20	0.09
417	600571	信雅达	5,800	80,620.00	0.09
418	300292	吴通控股	11,900	80,563.00	0.09

419	603118	共进股份	5,900	80,417.00	0.09
420	002253	川大智胜	3,350	80,400.00	0.09
421	002042	华孚色纺	7,500	80,175.00	0.09
422	600197	伊力特	4,100	80,073.00	0.09
423	000525	红太阳	4,300	80,023.00	0.09
424	002658	雪迪龙	4,500	79,875.00	0.09
425	600360	华微电子	11,000	79,860.00	0.09
426	300228	富瑞特装	7,080	79,720.80	0.09
427	002433	太安堂	8,600	79,550.00	0.09
428	000582	北部湾港	7,000	79,450.00	0.09
429	300111	向日葵	20,900	79,420.00	0.09
430	600007	中国国贸	3,800	79,078.00	0.09
431	300506	名家汇	2,800	79,044.00	0.09
432	002695	煌上煌	3,700	79,032.00	0.09
433	600824	益民集团	13,800	78,936.00	0.09
434	000767	漳泽电力	23,000	78,890.00	0.09
435	000802	北京文化	5,400	78,624.00	0.09
436	300377	赢时胜	6,900	78,591.00	0.09
437	300300	汉鼎宇佑	4,300	78,002.00	0.09
438	002157	正邦科技	17,100	77,805.00	0.09
439	300359	全通教育	5,950	77,766.50	0.09
440	300226	上海钢联	2,086	77,599.20	0.09
441	000022	深赤湾 A	2,600	77,350.00	0.09
442	002203	海亮股份	9,500	77,330.00	0.09
443	600318	新力金融	7,200	77,256.00	0.09
444	600106	重庆路桥	14,940	77,239.80	0.09
445	002321	华英农业	7,000	76,860.00	0.09
446	600987	航民股份	5,900	76,464.00	0.09
447	600135	乐凯胶片	4,900	76,391.00	0.09
448	300278	华昌达	4,600	76,314.00	0.09
449	603026	石大胜华	2,700	76,302.00	0.09
450	002239	奥特佳	17,600	76,208.00	0.09
451	000700	模塑科技	9,400	76,046.00	0.09
452	600846	同济科技	9,300	75,981.00	0.09
453	300256	星星科技	7,300	75,920.00	0.09
454	600686	金龙汽车	5,700	75,810.00	0.09
455	603126	中材节能	4,600	75,716.00	0.09
456	300048	合康新能	14,400	75,600.00	0.09
457	002484	江海股份	7,616	75,550.72	0.09

458	000545	金浦钛业	12,900	75,465.00	0.09
459	000863	三湘印象	10,300	75,396.00	0.09
460	002329	皇氏集团	7,840	75,342.40	0.09
461	600527	江南高纤	15,000	75,300.00	0.09
462	300232	洲明科技	4,700	75,200.00	0.09
463	000573	粤宏远 A	11,600	75,168.00	0.09
464	002502	骅威文化	8,000	75,120.00	0.09
465	600531	豫光金铅	10,200	75,072.00	0.09
466	600321	国栋建设	16,900	75,036.00	0.09
467	600382	广东明珠	5,200	74,932.00	0.09
468	300326	凯利泰	7,973	74,866.47	0.09
469	002609	捷顺科技	5,000	74,850.00	0.09
470	600107	美尔雅	5,400	74,844.00	0.09
471	000925	众合科技	3,600	74,772.00	0.09
472	300409	道氏技术	2,000	74,440.00	0.09
473	000782	美达股份	7,900	74,418.00	0.09
474	300467	迅游科技	1,800	74,394.00	0.09
475	002369	卓翼科技	8,600	74,304.00	0.09
476	002648	卫星石化	4,500	74,250.00	0.09
477	603979	金诚信	4,180	74,069.60	0.09
478	300008	天海防务	8,950	74,016.50	0.09
479	300034	钢研高纳	4,679	73,974.99	0.09
480	000055	方大集团	10,150	73,892.00	0.09
481	002229	鸿博股份	6,550	73,360.00	0.09
482	600096	云天化	9,900	73,260.00	0.09
483	601599	鹿港文化	11,700	73,242.00	0.09
484	000892	欢瑞世纪	7,300	73,219.00	0.09
485	600459	贵研铂业	3,400	73,202.00	0.09
486	300007	汉威电子	3,800	73,188.00	0.09
487	002521	齐峰新材	7,400	73,112.00	0.09
488	002488	金固股份	6,300	72,891.00	0.09
489	600186	莲花健康	19,800	72,864.00	0.09
490	603566	普莱柯	3,000	72,780.00	0.09
491	600997	开滦股份	11,900	72,590.00	0.09
492	600838	上海九百	6,000	72,540.00	0.09
493	002288	超华科技	10,400	72,488.00	0.09
494	002166	莱茵生物	6,500	72,345.00	0.09
495	300215	电科院	7,100	72,278.00	0.08
496	002100	天康生物	9,000	72,270.00	0.08

497	002631	德尔未来	4,900	72,177.00	0.08
498	600730	中国高科	8,800	72,072.00	0.08
499	300180	华峰超纤	2,700	72,063.00	0.08
500	002322	理工环科	3,000	71,880.00	0.08
501	300304	云意电气	8,100	71,847.00	0.08
502	000821	京山轻机	5,400	71,658.00	0.08
503	600616	金枫酒业	6,698	71,601.62	0.08
504	600676	交运股份	9,600	71,520.00	0.08
505	000404	华意压缩	9,075	71,420.25	0.08
506	600035	楚天高速	12,900	71,079.00	0.08
507	002476	宝莫股份	9,100	70,980.00	0.08
508	300302	同有科技	3,940	70,959.40	0.08
509	600798	宁波海运	13,500	70,875.00	0.08
510	603308	应流股份	4,900	70,854.00	0.08
511	300424	航新科技	1,500	70,755.00	0.08
512	000760	斯太尔	8,800	70,752.00	0.08
513	300064	豫金刚石	6,800	70,720.00	0.08
514	000952	广济药业	4,700	70,641.00	0.08
515	300379	东方通	3,600	70,560.00	0.08
516	600740	山西焦化	10,000	70,400.00	0.08
517	600501	航天晨光	4,700	70,265.00	0.08
518	002314	南山控股	10,500	70,245.00	0.08
519	600800	天津磁卡	9,100	70,161.00	0.08
520	002348	高乐股份	10,000	70,100.00	0.08
521	300451	创业软件	2,300	69,874.00	0.08
522	300426	唐德影视	2,950	69,797.00	0.08
523	600965	福成股份	6,100	69,479.00	0.08
524	002499	科林环保	2,400	69,408.00	0.08
525	600533	栖霞建设	11,800	69,384.00	0.08
526	002154	报喜鸟	18,700	69,377.00	0.08
527	000070	特发信息	5,900	69,325.00	0.08
528	300432	富临精工	2,900	69,310.00	0.08
529	300209	天泽信息	2,500	69,300.00	0.08
530	000029	深深房 A	6,200	69,254.00	0.08
531	002453	天马精化	8,500	69,190.00	0.08
532	603108	润达医疗	4,340	69,136.20	0.08
533	002472	双环传动	6,300	69,111.00	0.08
534	600288	大恒科技	6,500	68,900.00	0.08
535	600789	鲁抗医药	8,700	68,817.00	0.08

536	603686	龙马环卫	2,000	68,800.00	0.08
537	300299	富春股份	3,600	68,580.00	0.08
538	002355	兴民智通	6,700	68,541.00	0.08
539	002556	辉隆股份	9,400	68,526.00	0.08
540	002540	亚太科技	9,700	68,482.00	0.08
541	300004	南风股份	5,700	68,457.00	0.08
542	300172	中电环保	6,600	68,376.00	0.08
543	002103	广博股份	5,160	68,318.40	0.08
544	002451	摩恩电气	3,300	68,178.00	0.08
545	300518	盛讯达	600	67,980.00	0.08
546	002737	葵花药业	2,200	67,760.00	0.08
547	600836	界龙实业	9,900	67,518.00	0.08
548	300097	智云股份	2,500	67,500.00	0.08
549	603939	益丰药房	2,000	67,400.00	0.08
550	300231	银信科技	5,100	67,320.00	0.08
551	002218	拓日新能	6,900	67,206.00	0.08
552	002324	普利特	2,500	67,200.00	0.08
553	600830	香溢融通	6,800	67,048.00	0.08
554	002246	北化股份	4,600	67,022.00	0.08
555	603989	艾华集团	1,700	66,708.00	0.08
556	300178	腾邦国际	5,200	66,560.00	0.08
557	000553	沙隆达 A	4,800	66,432.00	0.08
558	300369	绿盟科技	6,000	66,360.00	0.08
559	002301	齐心集团	3,200	66,336.00	0.08
560	601799	星宇股份	1,500	66,330.00	0.08
561	300045	华力创通	6,500	66,300.00	0.08
562	002279	久其软件	5,280	66,264.00	0.08
563	000701	厦门信达	5,300	66,250.00	0.08
564	002182	云海金属	7,200	66,168.00	0.08
565	600103	青山纸业	16,600	66,068.00	0.08
566	300177	中海达	5,800	65,946.00	0.08
567	000795	英洛华	10,600	65,826.00	0.08
568	002060	粤水电	15,700	65,783.00	0.08
569	000409	山东地矿	6,686	65,723.38	0.08
570	000837	秦川机床	9,100	65,702.00	0.08
571	002821	凯莱英	900	65,673.00	0.08
572	002626	金达威	4,600	65,550.00	0.08
573	300016	北陆药业	4,300	65,532.00	0.08
574	300438	鹏辉能源	2,600	65,520.00	0.08

575	002567	唐人神	6,750	65,475.00	0.08
576	600744	华银电力	13,300	65,436.00	0.08
577	300005	探路者	8,300	65,404.00	0.08
578	300366	创意信息	3,900	65,364.00	0.08
579	300221	银禧科技	4,700	65,330.00	0.08
580	000905	厦门港务	5,000	65,300.00	0.08
581	002111	威海广泰	3,600	65,268.00	0.08
582	002539	云图控股	7,500	65,250.00	0.08
583	300056	三维丝	4,300	65,188.00	0.08
584	002586	围海股份	6,600	65,142.00	0.08
585	300109	新开源	1,400	65,044.00	0.08
586	300100	双林股份	2,500	64,900.00	0.08
587	600630	龙头股份	5,600	64,848.00	0.08
588	300066	三川智慧	11,700	64,818.00	0.08
589	002812	创新股份	800	64,800.00	0.08
590	002177	御银股份	11,400	64,752.00	0.08
591	600129	太极集团	4,800	64,656.00	0.08
592	300343	联创互联	3,330	64,602.00	0.08
593	600650	锦江投资	3,600	64,584.00	0.08
594	600775	南京熊猫	6,300	64,386.00	0.08
595	603128	华贸物流	7,500	64,200.00	0.08
596	600726	华电能源	14,300	64,064.00	0.08
597	000416	民生控股	8,000	64,000.00	0.08
598	002518	科士达	4,375	63,962.50	0.08
599	002759	天际股份	2,500	63,925.00	0.08
600	300191	潜能恒信	2,400	63,888.00	0.08
601	000971	高升控股	3,800	63,802.00	0.08
602	300262	巴安水务	4,200	63,798.00	0.08
603	600973	宝胜股份	11,379	63,722.40	0.07
604	300135	宝利国际	12,100	63,525.00	0.07
605	601700	风范股份	10,600	63,494.00	0.07
606	600075	新疆天业	7,280	63,481.60	0.07
607	002616	长青集团	5,600	63,336.00	0.07
608	600136	当代明诚	4,200	63,294.00	0.07
609	002033	丽江旅游	6,190	63,261.80	0.07
610	000626	远大控股	3,400	63,240.00	0.07
611	000537	广宇发展	7,700	63,217.00	0.07
612	002590	万安科技	4,500	63,045.00	0.07
613	600508	上海能源	5,400	63,018.00	0.07

614	300440	运达科技	4,800	62,976.00	0.07
615	603117	万林股份	5,200	62,972.00	0.07
616	600237	铜峰电子	10,500	62,895.00	0.07
617	600526	菲达环保	6,100	62,891.00	0.07
618	300193	佳士科技	7,560	62,823.60	0.07
619	000927	一汽夏利	11,900	62,713.00	0.07
620	300333	兆日科技	5,000	62,700.00	0.07
621	002494	华斯股份	4,300	62,694.00	0.07
622	300198	纳川股份	10,880	62,560.00	0.07
623	002592	八菱科技	2,100	62,349.00	0.07
624	002617	露笑科技	4,130	62,073.90	0.07
625	000151	中成股份	3,300	61,974.00	0.07
626	600624	复旦复华	8,930	61,884.90	0.07
627	600229	城市传媒	6,600	61,842.00	0.07
628	300353	东土科技	4,800	61,824.00	0.07
629	002527	新时达	5,800	61,654.00	0.07
630	300457	赢合科技	900	61,560.00	0.07
631	002197	证通电子	4,900	61,544.00	0.07
632	600082	海泰发展	9,700	61,498.00	0.07
633	002516	旷达科技	11,200	61,488.00	0.07
634	601028	玉龙股份	7,300	61,320.00	0.07
635	600995	文山电力	6,300	61,299.00	0.07
636	000838	财信发展	9,300	61,287.00	0.07
637	000752	西藏发展	4,900	61,152.00	0.07
638	002524	光正集团	6,600	61,116.00	0.07
639	002393	力生制药	1,700	60,979.00	0.07
640	300086	康芝药业	5,850	60,957.00	0.07
641	002559	亚威股份	5,600	60,928.00	0.07
642	000531	穗恒运 A	6,400	60,928.00	0.07
643	300406	九强生物	3,700	60,902.00	0.07
644	300021	大禹节水	7,400	60,754.00	0.07
645	300307	慈星股份	6,000	60,720.00	0.07
646	300363	博腾股份	4,000	60,640.00	0.07
647	002584	西陇科学	4,400	60,588.00	0.07
648	300217	东方电热	16,620	60,496.80	0.07
649	002662	京威股份	8,400	60,480.00	0.07
650	002079	苏州固锝	8,200	60,434.00	0.07
651	002296	辉煌科技	5,600	60,368.00	0.07
652	300160	秀强股份	6,700	60,099.00	0.07

653	000498	山东路桥	8,400	60,060.00	0.07
654	000011	深物业 A	3,000	60,000.00	0.07
655	000523	广州浪奇	5,900	59,885.00	0.07
656	000058	深赛格	7,400	59,866.00	0.07
657	002226	江南化工	8,500	59,840.00	0.07
658	600692	亚通股份	4,600	59,800.00	0.07
659	600555	海航创新	12,700	59,690.00	0.07
660	002162	悦心健康	9,000	59,490.00	0.07
661	000719	大地传媒	5,700	59,451.00	0.07
662	603898	好莱客	1,700	59,415.00	0.07
663	300348	长亮科技	2,800	59,360.00	0.07
664	603338	浙江鼎力	900	59,337.00	0.07
665	002171	楚江新材	4,000	59,320.00	0.07
666	000819	岳阳兴长	3,500	59,290.00	0.07
667	002751	易尚展示	1,600	59,280.00	0.07
668	000043	中航地产	6,200	59,272.00	0.07
669	300047	天源迪科	4,700	59,267.00	0.07
670	002349	精华制药	6,300	59,220.00	0.07
671	300006	莱美药业	9,138	59,214.24	0.07
672	002406	远东传动	7,300	59,057.00	0.07
673	300485	赛升药业	1,800	59,004.00	0.07
674	300368	汇金股份	4,100	58,958.00	0.07
675	002792	通宇通讯	1,700	58,871.00	0.07
676	600119	长江投资	4,000	58,800.00	0.07
677	002071	长城影视	5,900	58,764.00	0.07
678	600658	电子城	4,500	58,725.00	0.07
679	002204	大连重工	14,400	58,608.00	0.07
680	002619	巨龙管业	9,180	58,476.60	0.07
681	000920	南方汇通	4,700	58,468.00	0.07
682	000554	泰山石油	7,200	58,320.00	0.07
683	000665	湖北广电	4,800	58,320.00	0.07
684	601500	通用股份	4,100	58,302.00	0.07
685	000936	华西股份	8,300	58,266.00	0.07
686	002196	方正电机	5,080	58,064.40	0.07
687	000657	中钨高新	4,700	57,904.00	0.07
688	600589	广东榕泰	7,900	57,749.00	0.07
689	600865	百大集团	4,900	57,526.00	0.07
690	000607	华媒控股	7,600	57,456.00	0.07
691	600190	锦州港	13,300	57,323.00	0.07

692	300140	中环装备	3,200	57,280.00	0.07
693	601900	南方传媒	4,600	57,224.00	0.07
694	601107	四川成渝	12,100	57,112.00	0.07
695	002655	共达电声	6,700	56,950.00	0.07
696	300242	明家联合	6,000	56,940.00	0.07
697	600246	万通地产	11,500	56,925.00	0.07
698	002362	汉王科技	2,800	56,868.00	0.07
699	000561	烽火电子	5,600	56,728.00	0.07
700	600784	鲁银投资	8,500	56,695.00	0.07
701	002575	群兴玩具	6,600	56,496.00	0.07
702	600604	市北高新	7,900	56,485.00	0.07
703	300050	世纪鼎利	5,600	56,392.00	0.07
704	000532	华金资本	3,900	56,277.00	0.07
705	300362	天翔环境	3,300	56,265.00	0.07
706	300018	中元股份	6,400	56,256.00	0.07
707	300224	正海磁材	6,250	56,250.00	0.07
708	002259	升达林业	8,400	56,196.00	0.07
709	603808	歌力思	1,900	56,088.00	0.07
710	000790	泰合健康	6,400	56,064.00	0.07
711	000990	诚志股份	3,500	55,930.00	0.07
712	600467	好当家	16,400	55,924.00	0.07
713	300439	美康生物	2,600	55,900.00	0.07
714	300204	舒泰神	3,578	55,781.02	0.07
715	002115	三维通信	5,400	55,728.00	0.07
716	002425	凯撒文化	6,080	55,571.20	0.07
717	300392	腾信股份	3,600	55,368.00	0.07
718	002059	云南旅游	5,500	55,275.00	0.06
719	300386	飞天诚信	3,100	55,149.00	0.06
720	300171	东富龙	4,700	54,943.00	0.06
721	300187	永清环保	4,800	54,912.00	0.06
722	002009	天奇股份	4,800	54,816.00	0.06
723	000796	凯撒旅游	4,500	54,540.00	0.06
724	300263	隆华节能	6,600	54,384.00	0.06
725	603456	九洲药业	3,300	54,351.00	0.06
726	601368	绿城水务	5,500	54,120.00	0.06
727	300337	银邦股份	6,100	54,107.00	0.06
728	000010	美丽生态	10,700	54,035.00	0.06
729	600592	龙溪股份	5,200	54,028.00	0.06
730	600173	卧龙地产	8,100	53,865.00	0.06

731	600396	金山股份	13,800	53,682.00	0.06
732	300030	阳普医疗	4,600	53,452.00	0.06
733	300419	浩丰科技	4,100	53,423.00	0.06
734	603258	电魂网络	1,300	53,352.00	0.06
735	600283	钱江水利	4,600	53,222.00	0.06
736	002335	科华恒盛	1,500	53,160.00	0.06
737	300474	景嘉微	1,500	53,100.00	0.06
738	601789	宁波建工	10,900	53,083.00	0.06
739	603618	杭电股份	5,100	52,887.00	0.06
740	300351	永贵电器	2,900	52,867.00	0.06
741	300533	冰川网络	600	52,830.00	0.06
742	600310	桂东电力	7,700	52,822.00	0.06
743	300497	富祥股份	1,000	52,790.00	0.06
744	300502	新易盛	2,200	52,756.00	0.06
745	002053	云南能投	4,200	52,710.00	0.06
746	002747	埃斯顿	4,600	52,624.00	0.06
747	300471	厚普股份	3,450	52,474.50	0.06
748	300373	扬杰科技	2,600	52,390.00	0.06
749	300173	智慧松德	4,400	52,316.00	0.06
750	601595	上海电影	2,100	52,248.00	0.06
751	600845	宝信软件	3,100	52,235.00	0.06
752	600279	重庆港九	7,750	52,235.00	0.06
753	300456	耐威科技	1,400	52,192.00	0.06
754	300063	天龙集团	6,250	52,187.50	0.06
755	300246	宝莱特	1,900	51,965.00	0.06
756	603579	荣泰健康	400	51,928.00	0.06
757	600449	宁夏建材	5,400	51,894.00	0.06
758	603997	继峰股份	3,550	51,865.50	0.06
759	300071	华谊嘉信	6,400	51,840.00	0.06
760	002712	思美传媒	2,400	51,792.00	0.06
761	600354	敦煌种业	6,900	51,681.00	0.06
762	002458	益生股份	2,500	51,625.00	0.06
763	601566	九牧王	3,200	51,584.00	0.06
764	000688	建新矿业	6,400	51,200.00	0.06
765	300328	宜安科技	4,580	50,838.00	0.06
766	002135	东南网架	6,400	50,752.00	0.06
767	300236	上海新阳	1,800	50,724.00	0.06
768	002677	浙江美大	3,640	50,705.20	0.06
769	000893	东凌国际	5,700	50,673.00	0.06

770	300311	任子行	3,301	50,670.35	0.06
771	600090	同济堂	5,400	50,598.00	0.06
772	600336	澳柯玛	8,700	50,547.00	0.06
773	600386	北巴传媒	3,800	50,540.00	0.06
774	002519	银河电子	6,410	50,446.70	0.06
775	000544	中原环保	2,400	50,400.00	0.06
776	002270	华明装备	4,700	50,384.00	0.06
777	002782	可立克	2,400	50,280.00	0.06
778	002124	天邦股份	5,800	50,228.00	0.06
779	300245	天玑科技	3,600	50,220.00	0.06
780	002612	朗姿股份	3,700	50,098.00	0.06
781	601339	百隆东方	8,400	49,980.00	0.06
782	600523	贵航股份	2,700	49,977.00	0.06
783	600077	宋都股份	12,500	49,875.00	0.06
784	300205	天喻信息	4,800	49,824.00	0.06
785	600313	农发种业	12,150	49,815.00	0.06
786	600113	浙江东日	3,600	49,788.00	0.06
787	603227	雪峰科技	7,400	49,654.00	0.06
788	600470	六国化工	7,800	49,608.00	0.06
789	000639	西王食品	2,500	49,475.00	0.06
790	300342	天银机电	3,240	49,442.40	0.06
791	600530	交大昂立	8,700	49,155.00	0.06
792	603999	读者传媒	2,200	49,104.00	0.06
793	300429	强力新材	1,970	49,072.70	0.06
794	000159	国际实业	7,200	49,032.00	0.06
795	000789	万年青	6,900	48,921.00	0.06
796	600548	深高速	5,400	48,816.00	0.06
797	002328	新朋股份	5,900	48,793.00	0.06
798	603012	创力集团	5,900	48,734.00	0.06
799	002351	漫步者	4,400	48,708.00	0.06
800	300388	国祯环保	2,300	48,645.00	0.06
801	300213	佳讯飞鸿	5,400	48,546.00	0.06
802	300248	新开普	3,000	48,510.00	0.06
803	300074	华平股份	7,100	48,493.00	0.06
804	600207	安彩高科	6,500	48,490.00	0.06
805	002356	赫美集团	1,900	48,279.00	0.06
806	603777	来伊份	1,300	48,269.00	0.06
807	000551	创元科技	5,200	48,256.00	0.06
808	002577	雷柏科技	2,100	48,237.00	0.06

809	300384	三联虹普	1,300	48,217.00	0.06
810	601199	江南水务	7,000	48,090.00	0.06
811	000546	金圆股份	4,400	47,960.00	0.06
812	300051	三五互联	4,100	47,847.00	0.06
813	600814	杭州解百	5,300	47,806.00	0.06
814	600381	青海春天	3,800	47,804.00	0.06
815	300558	贝达药业	800	47,712.00	0.06
816	603508	思维列控	900	47,592.00	0.06
817	300527	华舟应急	2,735	47,534.30	0.06
818	002114	罗平锌电	2,400	47,496.00	0.06
819	600735	新华锦	4,200	47,460.00	0.06
820	000514	渝开发	6,300	47,439.00	0.06
821	002535	林州重机	8,980	47,414.40	0.06
822	300076	GQY 视讯	5,500	47,410.00	0.06
823	002452	长高集团	6,900	47,403.00	0.06
824	000548	湖南投资	6,500	47,255.00	0.06
825	300181	佐力药业	6,800	47,192.00	0.06
826	300358	楚天科技	3,300	47,091.00	0.06
827	002772	众兴菌业	3,500	47,075.00	0.06
828	002378	章源钨业	5,200	47,060.00	0.06
829	300206	理邦仪器	5,450	47,033.50	0.06
830	002235	安妮股份	3,850	46,970.00	0.06
831	300052	中青宝	2,900	46,864.00	0.06
832	300295	三六五网	2,500	46,775.00	0.05
833	300568	星源材质	1,100	46,695.00	0.05
834	002274	华昌化工	5,900	46,669.00	0.05
835	300194	福安药业	6,700	46,565.00	0.05
836	002703	浙江世宝	1,700	46,563.00	0.05
837	600983	惠而浦	4,300	46,526.00	0.05
838	000899	赣能股份	5,500	46,475.00	0.05
839	600818	中路股份	2,200	46,376.00	0.05
840	300403	地尔汉宇	2,550	46,359.00	0.05
841	300223	北京君正	1,900	46,265.00	0.05
842	002441	众业达	4,000	46,240.00	0.05
843	002232	启明信息	3,800	46,208.00	0.05
844	300276	三丰智能	2,800	46,200.00	0.05
845	603636	南威软件	3,800	46,132.00	0.05
846	002432	九安医疗	4,000	46,120.00	0.05
847	300084	海默科技	5,000	46,100.00	0.05

848	600257	大湖股份	6,300	45,990.00	0.05
849	002346	柘中股份	1,700	45,968.00	0.05
850	300195	长荣股份	3,200	45,696.00	0.05
851	300465	高伟达	4,280	45,667.60	0.05
852	002678	珠江钢琴	3,600	45,648.00	0.05
853	001896	豫能控股	6,500	45,630.00	0.05
854	603358	华达科技	900	45,594.00	0.05
855	601007	金陵饭店	3,900	45,513.00	0.05
856	002545	东方铁塔	3,700	45,325.00	0.05
857	300447	全信股份	2,080	45,323.20	0.05
858	002726	龙大肉食	2,500	45,275.00	0.05
859	601968	宝钢包装	6,200	45,198.00	0.05
860	300114	中航电测	3,350	45,158.00	0.05
861	300444	双杰电气	2,100	45,066.00	0.05
862	300441	鲍斯股份	2,100	45,003.00	0.05
863	603609	禾丰牧业	4,700	44,932.00	0.05
864	600192	长城电工	5,800	44,834.00	0.05
865	300516	久之洋	700	44,443.00	0.05
866	600843	上工申贝	3,400	44,370.00	0.05
867	002172	澳洋科技	5,500	44,220.00	0.05
868	603900	通灵珠宝	1,400	44,142.00	0.05
869	000722	湖南发展	3,500	43,995.00	0.05
870	002783	凯龙股份	1,950	43,953.00	0.05
871	603708	家家悦	2,660	43,757.00	0.05
872	002822	中装建设	3,400	43,690.00	0.05
873	300175	朗源股份	5,300	43,566.00	0.05
874	300318	博晖创新	6,152	43,556.16	0.05
875	002017	东信和平	3,900	43,407.00	0.05
876	300229	拓尔思	3,500	43,295.00	0.05
877	000419	通程控股	6,100	43,188.00	0.05
878	600218	全柴动力	4,800	43,152.00	0.05
879	603818	曲美家居	2,700	43,011.00	0.05
880	601003	柳钢股份	9,600	43,008.00	0.05
881	002323	雅百特	4,200	43,008.00	0.05
882	002231	奥维通信	4,000	42,960.00	0.05
883	002733	雄韬股份	2,650	42,850.50	0.05
884	600193	创兴资源	6,300	42,651.00	0.05
885	300165	天瑞仪器	5,200	42,640.00	0.05
886	002574	明牌珠宝	4,900	42,630.00	0.05

887	000757	浩物股份	5,900	42,598.00	0.05
888	002016	世荣兆业	4,500	42,570.00	0.05
889	002769	普路通	2,799	42,544.80	0.05
890	002298	中电鑫龙	3,900	42,393.00	0.05
891	002110	三钢闽光	3,300	42,306.00	0.05
892	002234	民和股份	3,400	42,296.00	0.05
893	603116	红蜻蜓	2,300	42,274.00	0.05
894	002741	光华科技	2,700	42,228.00	0.05
895	603727	博迈科	1,300	41,938.00	0.05
896	002605	姚记扑克	3,000	41,820.00	0.05
897	002791	坚朗五金	1,800	41,814.00	0.05
898	002777	久远银海	600	41,760.00	0.05
899	300494	盛天网络	1,800	41,742.00	0.05
900	603313	梦百合	1,300	41,704.00	0.05
901	300130	新国都	2,200	41,558.00	0.05
902	300436	广生堂	1,100	41,371.00	0.05
903	600101	明星电力	4,200	41,370.00	0.05
904	002771	真视通	1,500	41,325.00	0.05
905	002363	隆基机械	4,360	41,202.00	0.05
906	002483	润邦股份	6,240	41,121.60	0.05
907	002746	仙坛股份	1,400	40,782.00	0.05
908	601038	一拖股份	4,400	40,612.00	0.05
909	600128	弘业股份	3,700	40,293.00	0.05
910	600876	洛阳玻璃	2,100	39,984.00	0.05
911	002788	鹭燕医药	1,200	39,960.00	0.05
912	601015	陕西黑猫	5,250	39,900.00	0.05
913	002388	新亚制程	3,700	39,738.00	0.05
914	300410	正业科技	1,100	39,710.00	0.05
915	002320	海峡股份	2,800	39,704.00	0.05
916	300449	汉邦高科	1,600	39,296.00	0.05
917	002137	麦达数字	4,300	39,001.00	0.05
918	000948	南天信息	3,200	38,912.00	0.05
919	603861	白云电器	1,600	38,832.00	0.05
920	300378	鼎捷软件	2,450	38,734.50	0.05
921	000014	沙河股份	2,300	38,732.00	0.05
922	000885	同力水泥	2,000	38,580.00	0.05
923	000637	茂化实华	5,800	38,512.00	0.05
924	002752	昇兴股份	3,155	38,491.00	0.05
925	603737	三棵树	600	38,478.00	0.05

926	300381	溢多利	2,300	38,410.00	0.05
927	002579	中京电子	3,500	38,395.00	0.05
928	600724	宁波富达	8,100	38,394.00	0.05
929	600287	江苏舜天	4,900	38,318.00	0.05
930	600278	东方创业	2,900	38,164.00	0.04
931	603919	金徽酒	2,000	38,160.00	0.04
932	300443	金雷风电	1,780	38,127.60	0.04
933	300473	德尔股份	800	38,080.00	0.04
934	300312	邦讯技术	3,000	37,980.00	0.04
935	603996	中新科技	2,200	37,620.00	0.04
936	601858	中国科传	3,000	37,560.00	0.04
937	002546	新联电子	6,260	37,247.00	0.04
938	300227	光韵达	1,700	36,873.00	0.04
939	002401	中远海科	2,800	36,820.00	0.04
940	300484	蓝海华腾	1,200	36,432.00	0.04
941	300349	金卡智能	1,300	36,296.00	0.04
942	300028	金亚科技	4,500	36,180.00	0.04
943	603166	福达股份	3,340	36,072.00	0.04
944	300448	浩云科技	1,495	35,939.80	0.04
945	002651	利君股份	3,700	35,927.00	0.04
946	300468	四方精创	800	35,672.00	0.04
947	002762	金发拉比	1,500	35,625.00	0.04
948	603393	新天然气	900	35,478.00	0.04
949	002461	珠江啤酒	2,900	35,409.00	0.04
950	002644	佛慈制药	3,800	35,340.00	0.04
951	603298	杭叉集团	1,700	35,241.00	0.04
952	000909	数源科技	2,900	35,090.00	0.04
953	300314	戴维医疗	2,200	34,804.00	0.04
954	603800	道森股份	1,600	34,784.00	0.04
955	002528	英飞拓	5,850	34,690.50	0.04
956	603098	森特股份	1,500	34,620.00	0.04
957	603936	博敏电子	1,300	34,255.00	0.04
958	300356	光一科技	3,900	33,969.00	0.04
959	300531	优博讯	1,600	33,856.00	0.04
960	300528	幸福蓝海	2,040	33,762.00	0.04
961	603669	灵康药业	1,500	33,480.00	0.04
962	002287	奇正藏药	800	32,888.00	0.04
963	002724	海洋王	2,200	32,736.00	0.04
964	300507	苏奥传感	720	32,313.60	0.04

965	600359	新农开发	4,300	32,293.00	0.04
966	000570	苏常柴 A	4,600	32,200.00	0.04
967	300380	安硕信息	1,300	32,188.00	0.04
968	300523	辰安科技	800	32,000.00	0.04
969	300350	华鹏飞	3,040	31,342.40	0.04
970	603843	正平股份	2,200	31,130.00	0.04
971	603339	四方冷链	1,200	31,032.00	0.04
972	603958	哈森股份	1,200	30,624.00	0.04
973	002786	银宝山新	2,100	30,618.00	0.04
974	300512	中亚股份	1,500	30,420.00	0.04
975	600828	茂业商业	3,600	29,952.00	0.04
976	002660	茂硕电源	3,100	29,574.00	0.03
977	002781	奇信股份	1,000	29,440.00	0.03
978	300399	京天利	1,150	29,244.50	0.03
979	002790	瑞尔特	900	29,169.00	0.03
980	002227	奥特迅	1,600	29,136.00	0.03
981	002801	微光股份	700	28,567.00	0.03
982	002667	鞍重股份	1,500	27,945.00	0.03
983	300162	雷曼股份	2,600	27,378.00	0.03
984	300529	健帆生物	900	26,604.00	0.03
985	300520	科大国创	500	26,245.00	0.03
986	603398	邦宝益智	1,200	25,728.00	0.03
987	300511	雪榕生物	1,300	25,584.00	0.03
988	000038	深大通	800	25,392.00	0.03
989	300519	新光药业	400	25,300.00	0.03
990	603421	鼎信通讯	900	25,191.00	0.03
991	603299	井神股份	2,400	25,128.00	0.03
992	300522	世名科技	400	24,864.00	0.03
993	603779	威龙股份	1,100	24,068.00	0.03
994	603959	百利科技	1,300	23,452.00	0.03
995	603600	永艺股份	1,400	23,044.00	0.03
996	300508	维宏股份	300	20,820.00	0.02
997	603058	永吉股份	900	19,530.00	0.02
998	002802	洪汇新材	600	19,320.00	0.02
999	601882	海天精工	1,000	17,380.00	0.02

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	占基金资产净值比例（%）
1	000682	东方电子	22,500	117,000.00	0.14
2	002070	*ST 众和	10,700	108,819.00	0.13
3	002504	*ST 弘高	10,798	87,463.80	0.10
4	002880	卫光生物	998	75,548.60	0.09
5	000916	华北高速	10,700	69,122.00	0.08
6	300151	昌红科技	5,300	61,109.00	0.07
7	300298	三诺生物	3,420	55,643.40	0.07
8	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.05
9	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.03
10	002881	美格智能	989	22,608.54	0.03
11	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.02

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	002035	华帝股份	349,846.00	0.33
2	600004	白云机场	315,047.00	0.30
3	000820	神雾节能	244,154.00	0.23
4	300145	中金环境	233,483.00	0.22
5	600252	中恒集团	225,849.00	0.22
6	600320	振华重工	177,482.00	0.17
7	000088	盐田港	175,042.00	0.17
8	002429	兆驰股份	174,039.00	0.17
9	600797	浙大网新	171,783.00	0.16
10	600779	水井坊	168,810.00	0.16
11	002647	民盛金科	159,553.00	0.15
12	000615	京汉股份	151,734.00	0.14

13	600803	新奥股份	136,216.00	0.13
14	600076	康欣新材	134,602.00	0.13
15	002108	沧州明珠	134,103.00	0.13
16	000881	中广核技	123,235.76	0.12
17	601666	平煤股份	118,056.00	0.11
18	000921	海信科龙	114,611.01	0.11
19	600337	美克家居	110,322.00	0.11
20	600132	重庆啤酒	109,919.00	0.10

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	002411	必康股份	279,630.00	0.27
2	603799	华友钴业	279,613.40	0.27
3	002583	海能达	224,028.40	0.21
4	002601	龙鳞佰利	201,522.00	0.19
5	300383	光环新网	193,825.00	0.18
6	002429	兆驰股份	180,642.00	0.17
7	300618	寒锐钴业	163,233.00	0.16
8	002852	道道全	162,638.33	0.15
9	002108	沧州明珠	156,174.00	0.15
10	600401	*ST 海润	148,473.00	0.14
11	002035	华帝股份	143,987.00	0.14
12	000766	通化金马	142,009.00	0.14
13	600848	上海临港	138,336.00	0.13
14	000932	*ST 华菱	128,252.00	0.12
15	300376	易事特	125,134.00	0.12
16	600577	精达股份	122,499.00	0.12
17	601375	中原证券	120,673.20	0.11
18	300323	华灿光电	119,965.00	0.11
19	300583	赛托生物	115,614.04	0.11
20	002709	天赐材料	107,029.40	0.10

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	13,933,815.76
卖出股票收入（成交）总额	24,393,068.07

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。

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。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

中证 1000 指数分级基金截至 2017 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的天广中茂（002509）于 2017 年 5 月 9 日收到福建证监局警告。因公司未对非经营性资金占用事项履行临时报告的信息披露义务，决定采取出具警示函的监督管理措施。

本基金为开放式指数分级基金，采用完全复制法进行指数化投资，按照成份股在中证 1000 指数中的基准权重构建指数化投资组合。基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。本报告期内，本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,717.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,117.13
5	应收申购款	8,410.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,245.21

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

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	002509	天广中茂	319,276.80	0.38	重大事项停牌
2	300145	中金环境	228,420.00	0.27	重大事项停牌
3	600490	鹏欣资源	227,808.00	0.27	重大事项停牌

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	000682	东方电子	117,000.00	0.14	重大事项停牌
2	002070	*ST 众和	108,819.00	0.13	重大事项停牌
3	002504	*ST 弘高	87,463.80	0.10	重大事项停牌

§ 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
1000A	94	82,204.79	7,226,411.00	93.52%	500,839.00	6.48%
1000B	381	20,281.50	446,709.00	5.78%	7,280,541.00	94.22%
华宝兴业 中证 1000 指数分级	3,949	25,270.04	606,927.97	0.61%	99,184,477.85	99.39%
合计	4,424	26,050.16	8,280,047.97	7.18%	106,965,857.85	92.82%

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

8.2 期末上市基金前十名持有人

1000A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	新华人寿保险股份有限公司	6,254,646.00	80.94%
2	上海明泐投资管理有限公司—明泐多策略对冲 1 号基金	793,702.00	10.27%
3	北京天演资本管理有限公司—星辰之天演 2 号私募证券投资基金	162,952.00	2.11%
4	李时龙	135,248.00	1.75%
5	孙大威	29,400.00	0.38%
6	邵文杰	26,079.00	0.34%
7	张殿刚	25,619.00	0.33%
8	魏永斌	23,597.00	0.31%
9	夏永清	22,800.00	0.30%
10	江利雄	19,200.00	0.25%

1000B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	祝东华	690,354.00	8.93%
2	黄梅	570,221.00	7.38%

3	吴天爵	462,100.00	5.98%
4	易方达基金—民生银行—杭州银行股份有限公司	416,309.00	5.39%
5	何凤珍	297,700.00	3.85%
6	谢锦星	223,800.00	2.90%
7	张珊珊	213,200.00	2.76%
8	杨玉锋	186,700.00	2.42%
9	刘文卿	155,800.00	2.02%
10	王杰	135,837.00	1.76%

8.3 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	1000A	0.00	0.0000%
	1000B	0.00	0.0000%
	华宝兴业中证 1000 指数分级	86,939.67	0.0871%
	合计	86,939.67	0.0754%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	1000A	0
	1000B	0
	华宝兴业中证 1000 指数分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	1000A	0
	1000B	0
	华宝兴业中证 1000 指数分级	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	1000A	1000B	华宝兴业中证 1000 指数分级
基金合同生效日（2015 年 6 月 4 日） 基金份额总额	29,441,582.00	29,441,582.00	271,827,940.54
本报告期期初基金份额总额	12,008,007.00	12,008,007.00	105,684,936.59
本报告期基金总申购份额	-	-	3,061,239.39
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	17,516,284.16
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-4,280,757.00	-4,280,757.00	8,561,514.00
本报告期期末基金份额总额	7,727,250.00	7,727,250.00	99,791,405.82

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及份额折算的份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动

2017 年 6 月 9 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，副总经理任志强因个人原因，自 2017 年 5 月 31 日起不再担任副总经理的职务。

2017 年 8 月 11 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，董事长郑安国先生因个人原因，自 2017 年 8 月 9 日起不再担任董事长的职务，由孔祥清先生接任公司董事长职务。

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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	2	14,774,339.30	39.81%	13,463.86	39.46%	-
海通证券	1	7,128,220.48	19.21%	6,638.81	19.46%	-
招商证券	2	5,959,360.15	16.06%	5,430.71	15.92%	-
安信证券	1	2,620,910.41	7.06%	2,441.67	7.16%	-
申万宏源	3	1,562,691.73	4.21%	1,455.30	4.27%	-
华泰证券	1	1,129,156.20	3.04%	1,051.51	3.08%	-
兴业证券	2	970,013.21	2.61%	884.01	2.59%	-
天风证券	2	549,199.02	1.48%	511.75	1.50%	-
国泰君安	2	504,814.75	1.36%	461.12	1.35%	-
银河证券	1	434,714.00	1.17%	404.84	1.19%	-
东吴证券	1	378,145.47	1.02%	352.14	1.03%	-
国金证券	1	285,416.00	0.77%	265.88	0.78%	-
中银国际	1	245,683.69	0.66%	228.84	0.67%	-
华宝证券	1	192,771.74	0.52%	179.55	0.53%	-
华创证券	1	155,984.80	0.42%	145.26	0.43%	-
信达证券	1	82,421.64	0.22%	76.76	0.22%	-
东北证券	1	72,444.48	0.20%	67.47	0.20%	-
方正证券	2	62,688.90	0.17%	57.12	0.17%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-

长城证券	1	-	-	-	-	-
中金国际	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	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：资力雄厚，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无变化。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

申万宏源	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

中航证券	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于开通华宝兴业网上直销赎回 T+0 转申购业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报及基金管理人网站	2017 年 01 月 19 日
2	关于开通华宝兴业网上交易赎回转申购业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报及基金管理人网站	2017 年 02 月 23 日
3	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京蛋壳基金销售有限公司为代销机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报及基金管理人网站	2017 年 04 月 19 日
4	《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报及基金管理人网站	2017 年 04 月 25 日
5	华宝兴业基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金首次申购最低金额、追加申购最低金额、定期定额申购最低金额、单笔最低赎回份额、赎回后最低保有份额及基金转换份额限制的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报及基金管理人网站	2017 年 05 月 15 日
6	华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	上海证券报、中国证券报、证券时报及基金管理人网站	2017 年 05 月 24 日
7	华宝兴业中证 1000 指数分级证	上海证券报、中国证	2017 年 06 月 02 日

	券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	券报、证券时报及基金管理人网站	
8	关于华宝兴业基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金新增财通证券股份有限公司为代销机构并开展费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报及基金管理人网站	2017 年 06 月 09 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

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

11.2 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。

11.3 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。

华宝兴业基金管理有限公司

2017 年 8 月 25 日