

华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 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：2018 年 8 月 24 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2018年8月23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2018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.....	16
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.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	52
7.1 期末基金资产组合情况.....	52
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	52
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.....	54
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	80
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	82
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.....	82
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.....	82
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.....	82
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.....	82
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	82
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	82
7.12 投资组合报告附注.....	83
§8 基金份额持有人信息.....	85
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	85
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	85
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	86
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.....	86
§9 开放式基金份额变动.....	87
§10 重大事件揭示.....	88
10.1 基金份额持有人大会决议.....	88
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.....	88
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	88
10.4 基金投资策略的改变.....	88
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	88
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.....	88
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	88
10.8 其他重大事件.....	92
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	94

11.1 影响投资者决策的其他重要信息	94
§12 备查文件目录.....	95
12.1 备查文件目录.....	95
12.2 存放地点.....	95
12.3 查阅方式.....	95

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金		
基金简称	华宝中证 1000 指数分级		
场内简称	1000 分级		
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	2015 年 6 月 4 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	57,103,244.34 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	1,562,512.00 份	1,562,512.00 份	53,978,220.34 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		孔祥清	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《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(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	-7,419,133.50
本期利润	-12,528,304.75
加权平均基金份额本期利润	-0.1841
本期加权平均净值利润率	-20.68%
本期基金份额净值增长率	-19.55%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	-96,398,490.04
期末可供分配基金份额利润	-1.6881
期末基金资产净值	49,556,554.03
期末基金份额净值	0.8678
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-66.05%

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

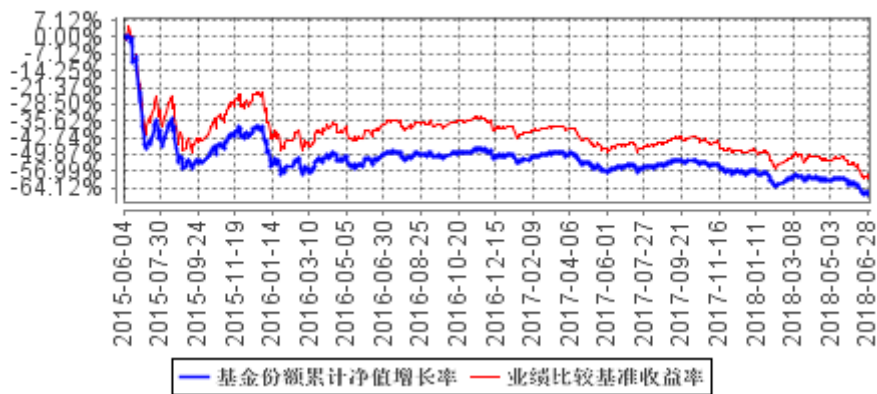
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-10.51%	1.82%	-10.64%	1.87%	0.13%	-0.05%
过去三个月	-16.59%	1.35%	-16.68%	1.38%	0.09%	-0.03%
过去六个月	-19.55%	1.41%	-19.11%	1.43%	-0.44%	-0.02%
过去一年	-24.51%	1.19%	-23.71%	1.21%	-0.80%	-0.02%
过去三年	-55.87%	1.88%	-48.54%	1.92%	-7.33%	-0.04%

自基金合同生效日起至今	-66.05%	1.95%	-58.70%	1.97%	-7.35%	-0.02%
-------------	---------	-------	---------	-------	--------	--------

注：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

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（2018 年 6 月 30 日），所管理的证券投资基金包括宝康系列基金、华宝多策略基金、华宝现金宝货币市场基金、华宝动力组合基金、华宝收益增长基金、华宝先进成长基金、华宝行业精选基金、华宝海外中国成长基金、华宝大盘精选基金、华宝增强收益基金、华宝中证 100 基金、上证 180 价值 ETF、华宝上证 180 价值 ETF 联接基金、华宝新兴产业基金、华宝可转债基金、上证 180 成长 ETF、华宝上证 180 成长 ETF 联接基金、华宝油气基金、华宝医药生物基金、华宝资源优选基金、华宝添益货币市场基金、华宝服务优选基金、华宝创新优选基金、华宝生态中国基金、华宝量化对冲基金、华宝高端制造基金、华宝品质生活基金、华宝稳健回报基金、华宝事件驱动基金、华宝国策导向基金、华宝新价值基金、华宝新机遇基金、华宝医疗分级基金、华宝中证 1000 分级基金、华宝万物互联基金、华宝转型升级基金、华宝核心优势基金、华宝美国消费基金、华宝宝鑫纯债基金、华宝香港中小盘基金、华宝中证全指证券公司 ETF、华宝中证军工 ETF、华宝新活力基金、华宝沪深 300 指数增强基金、华宝未来主导产业基金、华宝新起点基金、华宝红利基金、华宝新飞跃基金、华宝新优选基金、华宝香港大盘基金、华宝智慧产业基金、华宝第三产业基金、华宝新优享基金、华宝银行 ETF、华宝价值发现基金、华宝香港本地基金、华宝中证 500 指数增强基金、华宝香港精选基金、华宝券商 ETF 联接基金，所管理的证券投资基金资产净值合计 153,280,039,194.92 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	量化投资部副总经理、本基金基金经理、上证 180 成长	2015 年 6 月 4 日	-	12 年	金融学硕士。2006 年 6 月加入华宝基金管理有限公司，先后在交易部、产品开发部和量化投资部工作，2012 年 10 月起任上证 180 成

	ETF、华宝上证 180 成长 ETF 联接、华宝中证医疗指数分级、华宝中证军工 ETF、华宝标普中国 A 股红利机会指数 (LOF)、华宝中证银行 ETF (场内简称“银行 ETF”) 基金经理				长交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 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 月兼任华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。2017 年 7 月任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2018 年 6 月任量化投资部副总经理。
张奇	本基金基金经理助理、上证 180 价值 ETF、华宝上证 180 价值 ETF 联接、上证 180 成长 ETF、华宝上证 180 成长 ETF 联接、华宝中证医疗指数分级、华宝中证军工 ETF 基金经理助理	2017 年 4 月 6 日	-	8 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 月起兼任华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理，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 月起任华宝中证医疗指数分级证券投资基金、华宝中证 1000 指数分级证券投资基金、华宝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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝中证 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

2018 年上半年，国际经济形势较为错综复杂，全球政治经济形式不确定性上升。国内方面，在中国政府坚定的去杠杆的决心之下，经济增速恐有所放缓，经济结构调整大势所趋。国际方面，贸易摩擦不断升温，人民币汇率出现较大波动。在此背景下，政府关注到了市场对中国宏观经济下滑的预期，积极采取了定向降准措施，对冲内外需下降对经济增速的影响。市场表现来看，今年上半年 A 股整体先扬后抑，1 月白马蓝筹股延续了去年的上涨动量，整体表现强势。随后 2 月开始在美股剧烈调整、美联储加息以及贸易战等多因素影响下，A 股开始进入系统性调整。目前，代表新兴经济和高成长的创业板及中小市值股票率先企稳，蓝筹股在持续一年多的稳健上涨后调整幅度较深。指数方面，各主流指数出现不同幅度的下跌。本报告期中，以沪深 300 指数和中证 100 指数为代表的大盘蓝筹股指数分别下跌了 12.9%和 11.77%；而以中证 500 和中证 1000 为代表的中小盘股指数分别下跌了 16.53%和 20.08%。

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-19.55%，同期业绩比较基准收益率为-19.11%，基金表现落后业绩比较基准 0.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年下半年，中国经济增速可能适度放缓，压力来自经济结构调整与去杠杆。一方面，政府对房地产行业的调控决心空前坚定；另一方面，对于“影子银行”的清理所带来的信用收缩也是大势所趋。经济结构调整必将带来短期阵痛，但有利于经济的长期持续健康发展。央行对货币政策的表态表现了政府对维护经济稳定、不发生系统性风险的信心和决心。总体来说，中国经济

基本面依然向好，金融风险整体可控。随着中国加入 MSCI，A 股市场投资者结构将进一步转变，市场参与者将更加趋于理性及成熟。长期来看，投资者更应该关注上市公司盈利质量和可持续性，经营稳定、已经具有一定规模效应和经营壁垒的行业龙头股和优质白马股更具有长期配置的价值。短期来看，投资者同时可以关注估值修复下的结构性行情机会。中证 1000 指数作为中小市值股票的代表，个股集中度低，行业配置分散，是投资 A 股中小市值公司的有效工具。中证 1000 指数经过了 2017 年以来近一年半的调整，风险释放已经较为充分，估值处于相对底部，估值水平较为合理，投资价值逐步显现。

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

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

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

(1) 日常估值流程

本基金的估值由基金会计负责，基金会计以本基金为会计核算主体，基金会计核算独立于公司会计核算，独立建账、独立核算。基金会计采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式进行；基金会计每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对，每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。

(2) 特殊业务估值流程

根据中国证券监督管理委员会[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、中国证券投资基金业协会《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》、《中国证

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期亏损，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：华宝中证 1000 指数分级证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,301,620.70	4,357,559.83
结算备付金		3,507.18	659.67
存出保证金		2,836.83	3,423.38
交易性金融资产	6.4.7.2	46,825,227.14	67,809,162.38
其中：股票投资		46,825,227.14	67,809,162.38
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	682.33	997.97
应收股利		-	-
应收申购款		146,335.92	90,705.86
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		50,280,210.10	72,262,509.09
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 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		367,152.41	1.20
应付赎回款		95,912.75	24,210.13
应付管理人报酬		42,909.31	62,259.51
应付托管费		9,440.06	13,697.09
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	94,744.48	88,468.04

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	113,497.06	150,011.50
负债合计		723,656.07	338,647.47
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	145,955,044.07	170,411,754.42
未分配利润	6.4.7.10	-96,398,490.04	-98,487,892.80
所有者权益合计		49,556,554.03	71,923,861.62
负债和所有者权益总计		50,280,210.10	72,262,509.09

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，华宝中证 1000 基础份额基金份额净值 0.8678 元，基金份额总额 142830020.07 份；华宝中证 1000A 份额基金份额净值 1.0223 元，基金份额总额 1562512.00 份；华宝中证 1000B 份额基金份额净值 0.7133 元，基金份额总额 1562512.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华宝中证 1000 指数分级证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-11,957,286.81	-7,953,840.33
1.利息收入		13,517.83	22,169.81
其中：存款利息收入	6.4.7.11	13,517.83	22,169.81
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）		-6,872,184.03	-1,253,874.89
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-7,212,433.67	-1,596,223.96
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	6.4.7.13.2	-	-
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	340,249.64	342,349.07
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-5,109,171.25	-6,735,897.39
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	10,550.64	13,762.14
减：二、费用		571,017.94	852,663.73
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	300,293.22	488,355.17
2. 托管费	6.4.10.2.2	66,064.48	107,438.10
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	41,042.24	61,802.72
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	163,618.00	195,067.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-12,528,304.75	-8,806,504.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-12,528,304.75	-8,806,504.06

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝中证 1000 指数分级证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	170,411,754.42	-98,487,892.80	71,923,861.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-12,528,304.75	-12,528,304.75
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）	-24,456,710.35	14,617,707.51	-9,839,002.84
其中：1.基金申购款	9,920,382.64	-6,037,562.36	3,882,820.28
2.基金赎回款	-34,377,092.99	20,655,269.87	-13,721,823.12
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）	145,955,044.07	-96,398,490.04	49,556,554.03
项目	上年度可比期间 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

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：

_____ 黄小慧 _____

基金管理人负责人

_____ 向辉 _____

主管会计工作负责人

_____ 张幸骏 _____

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝中证 1000 指数分级证券投资基金(原华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]第 664 号《关于准予华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金注册的批复》核准,由华宝基金管理有限公司依照《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基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

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

基金份额的净值按如下原则计算:华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数,其中基金份额总数为华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A

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

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

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

中证 1000B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元时，华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的份额数将相应缩减。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、资产支持证券、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 2018 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 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[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：

(a) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(b) 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。

(c) 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。

(d) 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。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
活期存款	3,301,620.70
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计：	3,301,620.70

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	69,172,570.70	46,825,227.14	-22,347,343.56
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	69,172,570.70	46,825,227.14	-22,347,343.56

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末未持买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应收活期存款利息	678.83
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1.60
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.70
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.20
合计	682.33

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 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	94,744.48
银行间市场应付交易费用	-
合计	94,744.48

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	94.06
预提费用	63,403.00
应付指数使用费	50,000.00
合计	113,497.06

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	108,055,458.63	170,411,754.42
本期申购	1,778,846.16	2,805,367.50
本期赎回(以“-”号填列)	-5,031,836.23	-7,935,685.79
2018年2月2日 基金拆分/份额 折算前	104,802,468.56	165,281,436.13
基金拆分/份额折算变动份额	-40,138,055.97	-
本期申购	2,783,675.85	7,115,015.14
本期赎回(以“-”号填列)	-10,344,844.10	-26,441,407.20
本期末	57,103,244.34	145,955,044.07

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	-99,663,522.64	1,175,629.84	-98,487,892.80
本期利润	-7,419,133.50	-5,109,171.25	-12,528,304.75
本期基金份额交易 产生的变动数	14,552,927.99	64,779.52	14,617,707.51
其中：基金申购款	-5,981,467.69	-56,094.67	-6,037,562.36
基金赎回款	20,534,395.68	120,874.19	20,655,269.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-92,529,728.15	-3,868,761.89	-96,398,490.04

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	13,348.75
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	124.32
其他	44.76
合计	13,517.83

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	16,483,086.48
减：卖出股票成本总额	23,695,520.15
买卖股票差价收入	-7,212,433.67

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 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 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	340,249.64

基金投资产生的股利收益	-
合计	340,249.64

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-5,109,171.25
——股票投资	-5,109,171.25
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-5,109,171.25

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	10,550.64
合计	10,550.64

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
	2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	41,042.24
银行间市场交易费用	-
合计	41,042.24

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	13,814.43
基金上市费	29,752.78
其他	50.00
银行汇划费用	165.00
指数使用费	100,000.00
合计	163,618.00

6.4.7.21 分部报告

无。

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
华宝基金管理有限公司（“华宝基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
华宝信托有限责任公司（“华宝信托”）	基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.）	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司（“宝武集团”）	华宝信托的最终控制人

华宝证券有限责任公司(“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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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 2018年1月1日至2018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
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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%	-	-
------	--------	-------	---	---

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。权证交易不计佣金。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	300,293.22	488,355.17
其中：支付销售机构的客户维护费	127,238.30	178,727.56

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
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	66,064.48	107,438.10

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	3,301,620.70	13,348.75	5,080,602.31	21,912.24

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（2018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	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
------	------	------	------	-------	------	--------	-------	--------	--------	----

				价						
000022	深赤湾A	2017年11月20日	重大事件停牌	22.82	2018年7月10日	20.55	2,400	42,985.59	54,768.00	-
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	-
000035	中国天楹	2017年8月22日	重大事件停牌	6.72	2018年7月9日	6.05	12,400	103,669.00	83,328.00	-
000038	深大通	2018年2月26日	重大事件停牌	18.10	-	-	1,580	47,074.98	28,598.00	-
000048	ST康达	2018年5月2日	重大事件停牌	21.90	2018年7月2日	20.81	4,200	147,427.74	91,980.00	-
000545	金浦钛业	2018年6月11日	重大事件停牌	3.76	-	-	8,700	59,021.77	32,712.00	-
000584	哈工智能	2018年3月29日	重大事件停牌	13.87	2018年7月16日	12.48	5,900	69,115.60	81,833.00	-
000603	盛达矿业	2018年6月11日	重大事件停牌	10.83	2018年8月21日	9.75	4,300	76,475.20	46,569.00	-
000666	经纬纺机	2018年3月12日	重大事件停牌	18.08	-	-	2,200	47,277.01	39,776.00	-
000673	当代	2018年	重大事件	18.34	2018年	16.51	5,300	81,250.81	97,202.00	-

	东方	5月23日	项停牌		8月2日						
000711	京蓝科技	2018年3月26日	重大事 项停牌	10.02	-	-	4,800	50,152.33	48,096.00	-	-
000796	凯撒旅游	2018年1月19日	重大事 项停牌	12.90	2018年7月19日	11.61	3,700	61,610.00	47,730.00	-	-
000967	盈峰环境	2018年5月18日	重大事 项停牌	8.70	2018年7月31日	8.01	6,292	62,334.49	54,740.40	-	-
002053	云南能投	2018年5月28日	重大事 项停牌	10.08	2018年7月13日	9.07	3,000	36,978.99	30,240.00	-	-
002059	云南旅游	2018年3月26日	重大事 项停牌	7.28	-	-	4,000	39,038.10	29,120.00	-	-
002086	东方海洋	2018年6月15日	重大事 项停牌	6.68	-	-	5,700	61,665.00	38,076.00	-	-
002089	新海宜	2018年4月20日	重大事 项停牌	6.05	2018年7月20日	5.45	13,100	144,354.10	79,255.00	-	-
002102	冠福股份	2018年6月1日	重大事 项停牌	4.07	-	-	28,600	131,758.12	116,402.00	-	-
002113	天润数娱	2018年2月1日	重大事 项停牌	5.78	-	-	9,860	72,116.21	56,990.80	-	-

002121	科陆 电子	2018年 6月7 日	重大事 项停牌	6.49	2018年 8月6 日	5.84	7,600	87,418.25	49,324.00	-
002171	楚江 新材	2018年 6月7 日	重大事 项停牌	6.78	-	-	5,800	58,695.71	39,324.00	-
002210	飞马 国际	2018年 4月18 日	重大事 项停牌	12.33	-	-	8,980	96,071.16	110,723.40	-
002226	江南 化工	2018年 5月2 日	重大事 项停牌	5.42	-	-	5,100	41,375.53	27,642.00	-
002239	奥特 佳	2018年 4月2 日	重大事 项停牌	3.62	-	-	12,800	63,398.10	46,336.00	-
002256	兆新 股份	2018年 3月2 日	重大事 项停牌	4.52	2018年 7月2 日	4.07	11,300	69,147.91	51,076.00	-
002263	*ST 东南	2018年 2月26 日	重大事 项停牌	2.96	-	-	22,900	108,062.28	67,784.00	-
002301	齐心 集团	2018年 2月2 日	重大事 项停牌	10.50	2018年 7月9 日	9.45	3,900	51,738.83	40,950.00	-
002436	兴森 科技	2018年 6月14 日	重大事 项停牌	4.29	-	-	15,100	102,706.88	64,779.00	-
002445	中南 文化	2018年 6月13 日	重大事 项停牌	8.44	-	-	6,300	119,797.27	53,172.00	-

		日								
002464	众应 互联	2018年 2月2 日	重大事 项停牌	21.19	2018年 7月31 日	19.07	2,996	87,324.73	63,485.24	-
002502	骅威 文化	2018年 6月5 日	重大事 项停牌	5.82	-	-	5,800	80,259.58	33,756.00	-
002609	捷顺 科技	2018年 6月19 日	重大事 项停牌	9.52	2018年 7月3 日	8.57	4,200	78,901.70	39,984.00	-
002610	爱康 科技	2018年 6月5 日	重大事 项停牌	2.10	-	-	48,800	153,001.70	102,480.00	-
002611	东方 精工	2018年 6月19 日	重大事 项停牌	6.17	2018年 7月3 日	6.01	7,040	66,851.15	43,436.80	-
002617	露笑 科技	2018年 5月9 日	重大事 项停牌	8.15	-	-	7,399	65,349.81	60,301.85	-
002630	华西 能源	2018年 6月20 日	重大事 项停牌	6.54	-	-	11,900	98,700.87	77,826.00	-
002650	加加 食品	2018年 3月12 日	重大事 项停牌	4.86	-	-	9,500	67,742.23	46,170.00	-
002656	摩登 大道	2018年 6月19 日	重大事 项停牌	9.61	-	-	3,580	49,207.27	34,403.80	-
002668	奥马	2018年	重大事	20.10	-	-	4,820	109,806.08	96,882.00	-

	电器	6月15日	项停牌								
002716	金贵银业	2018年5月3日	重大事 项停牌	16.84	-	-	4,600	57,704.62	77,464.00	-	
002721	金一文化	2018年5月29日	重大事 项停牌	8.99	2018年7月9日	8.35	5,600	115,253.58	50,344.00	-	
002872	天圣制药	2018年4月3日	重大事 项停牌	31.05	2018年7月3日	27.95	900	26,983.80	27,945.00	-	
300008	天海防务	2018年6月4日	重大事 项停牌	4.81	2018年7月2日	5.20	7,250	64,744.29	34,872.50	-	
300090	盛运环保	2018年6月20日	重大事 项停牌	8.32	2018年7月4日	7.49	18,000	189,247.64	149,760.00	-	
300118	东方日升	2018年5月7日	重大事 项停牌	10.80	2018年8月7日	9.63	6,100	90,519.39	65,880.00	-	
300131	英唐智控	2018年5月29日	重大事 项停牌	5.67	-	-	7,200	91,285.11	40,824.00	-	
300198	纳川股份	2018年2月2日	重大事 项停牌	5.99	2018年8月2日	5.38	9,580	63,831.94	57,384.20	-	
300229	拓尔思	2018年4月17日	重大事 项停牌	15.88	2018年7月17日	14.29	2,600	70,337.78	41,288.00	-	

300238	冠昊生物	2018年 2月2日	重大事 项停牌	18.87	2018年 7月18日	16.96	3,300	144,822.14	62,271.00	-
300299	富春股份	2018年 6月19日	重大事 项停牌	4.67	2018年 7月17日	5.14	4,640	53,105.75	21,668.80	-
300317	珈伟股份	2018年 2月5日	重大事 项停牌	11.90	2018年 7月3日	10.71	5,325	120,384.39	63,367.50	-
300343	联创互联	2018年 6月19日	重大事 项停牌	10.00	-	-	3,730	76,885.09	37,300.00	-
300350	华鹏飞	2018年 5月10日	重大事 项停牌	8.13	2018年 7月16日	7.32	2,840	35,434.86	23,089.20	-
300362	天翔环境	2018年 6月8日	重大事 项停牌	9.68	-	-	2,200	37,864.09	21,296.00	-
600146	商赢环球	2018年 6月19日	重大事 项停牌	22.22	2018年 8月15日	20.00	3,000	74,100.00	66,660.00	-
600165	新日恒力	2018年 2月13日	重大事 项停牌	16.51	2018年 7月5日	14.06	6,250	70,563.73	103,187.50	-
600175	美都能源	2018年 5月30日	重大事 项停牌	4.16	2018年 8月17日	3.74	28,900	148,909.11	120,224.00	-
600217	中再资环	2018年 3月29日	重大事 项停牌	6.13	-	-	9,600	69,216.00	58,848.00	-

		日								
600226	瀚叶股份	2017年11月28日	重大事件停牌	4.56	-	-26,806	158,633.06	122,235.36	-	-
600318	新力金融	2018年3月23日	重大事件停牌	11.04	-	-5,300	71,635.76	58,512.00	-	-
600399	抚顺特钢	2018年1月31日	重大事件停牌	5.50	-	-14,100	128,260.45	77,550.00	-	-
600490	鹏欣资源	2018年4月16日	重大事件停牌	8.67	-	-18,000	149,188.07	156,060.00	-	-
600641	万业企业	2018年4月17日	重大事件停牌	12.18	2018年8月9日	10.96	5,500	73,563.85	66,990.00	-
600745	闻泰科技	2018年4月18日	重大事件停牌	30.48	-	-4,600	107,203.69	140,208.00	-	-
600764	中国海防	2018年4月16日	重大事件停牌	31.77	-	-2,200	69,847.99	69,894.00	-	-
600784	鲁银投资	2018年1月11日	重大事件停牌	5.46	2018年7月9日	5.24	7,100	78,823.20	38,766.00	-
600800	天津磁卡	2018年5月22日	重大事件停牌	5.47	-	-6,600	67,661.68	36,102.00	-	-
603299	井神	2018年	重大事件	8.25	2018年	8.48	3,500	49,543.77	28,875.00	-

	股份	6月28日	项停牌		7月5日					
603636	南威软件	2018年5月29日	重大事件停牌	8.79	-	-	3,600	55,658.31	31,644.00	-
603939	益丰药房	2018年4月17日	重大事件停牌	53.07	2018年7月16日	65.69	2,000	72,093.84	106,140.00	-
603997	继峰股份	2018年5月31日	重大事件停牌	10.87	-	-	2,550	36,434.04	27,718.50	-

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。

为了规避信用风险，本公司在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。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 2018 年 6 月 30 日，本基金无债券投资。（2017 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。

于 2018 年 6 月 30 日，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。（2017 年 12 月 31 日：同）

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、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 2018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	3,301,620.70	-	-	-	3,301,620.70
结算备付金	3,507.18	-	-	-	3,507.18
存出保证金	2,836.83	-	-	-	2,836.83
交易性金融资产	-	-	-	46,825,227.14	46,825,227.14
应收利息	-	-	-	682.33	682.33
应收申购款	204.00	-	-	146,131.92	146,335.92
资产总计	3,308,168.71	-	-	46,972,041.39	50,280,210.10
负债					
应付证券清算款	-	-	-	367,152.41	367,152.41
应付赎回款	-	-	-	95,912.75	95,912.75
应付管理人报酬	-	-	-	42,909.31	42,909.31
应付托管费	-	-	-	9,440.06	9,440.06
应付交易费用	-	-	-	94,744.48	94,744.48

其他负债	-	-	-	113,497.06	113,497.06
负债总计	-	-	-	723,656.07	723,656.07
利率敏感度缺口	3,308,168.71	-	-	-46,248,385.32	49,556,554.03
上年度末 2017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	4,357,559.83	-	-	-	4,357,559.83
结算备付金	659.67	-	-	-	659.67
存出保证金	3,423.38	-	-	-	3,423.38
交易性金融资产	-	-	-	-67,809,162.38	67,809,162.38
应收利息	-	-	-	997.97	997.97
应收申购款	1,448.81	-	-	89,257.05	90,705.86
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,363,091.69	-	-	-67,899,417.40	72,262,509.09
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1.20	1.20
应付赎回款	-	-	-	24,210.13	24,210.13
应付管理人报酬	-	-	-	62,259.51	62,259.51
应付托管费	-	-	-	13,697.09	13,697.09
应付交易费用	-	-	-	88,468.04	88,468.04
其他负债	-	-	-	150,011.50	150,011.50
负债总计	-	-	-	338,647.47	338,647.47
利率敏感度缺口	4,363,091.69	-	-	-67,560,769.93	71,923,861.62

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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2018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。（2017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 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	46,825,227.14	94.49	67,809,162.38	94.28
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	46,825,227.14	94.49	67,809,162.38	94.28

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（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	比较基准上涨 5%	2,444,683.29	3,580,772.96
比较基准下降 5%	-2,444,683.29	-3,580,772.96	

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 2018 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 42,519,092.69 元，属于第二层次的余额为 4,306,134.45 元，无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 63,255,338.89 元，第二层次 4,553,823.49 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和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(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 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

§ 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	46,825,227.14	93.13
	其中：股票	46,825,227.14	93.13
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	3,305,127.88	6.57
7	其他各项资产	149,855.08	0.30
8	合计	50,280,210.10	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	421,787.90	0.85
B	采矿业	1,077,502.02	2.17
C	制造业	29,756,958.13	60.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,102,712.10	2.23
E	建筑业	1,272,416.54	2.57
F	批发和零售业	1,969,147.72	3.97
G	交通运输、仓储和邮政业	1,106,043.34	2.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,722,585.34	9.53
J	金融业	196,881.00	0.40
K	房地产业	1,508,523.67	3.04

L	租赁和商务服务业	612,218.60	1.24
M	科学研究和技术服务业	473,092.90	0.95
N	水利、环境和公共设施管理业	559,873.30	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	465,678.00	0.94
R	文化、体育和娱乐业	801,132.86	1.62
S	综合	400,625.50	0.81
	合计	46,447,178.92	93.73

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	254,378.00	0.51
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	69,254.00	0.14
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	54,416.22	0.11
	合计	378,048.22	0.76

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	300142	沃森生物	15,800	315,684.00	0.64
2	600779	水井坊	4,400	243,012.00	0.49
3	300347	泰格医药	3,900	241,293.00	0.49
4	300601	康泰生物	3,245	201,352.25	0.41
5	300168	万达信息	9,300	189,720.00	0.38
6	300176	鸿特科技	2,100	174,153.00	0.35
7	600567	山鹰纸业	41,100	158,646.00	0.32
8	002821	凯莱英	1,800	157,014.00	0.32
9	002507	涪陵榨菜	6,100	156,648.00	0.32
10	600490	鹏欣资源	18,000	156,060.00	0.31
11	000735	罗牛山	11,800	152,456.00	0.31
12	300090	盛运环保	18,000	149,760.00	0.30
13	600771	广誉远	2,700	148,392.00	0.30
14	002035	华帝股份	6,020	147,068.60	0.30
15	300170	汉得信息	9,000	146,160.00	0.29
16	601699	潞安环能	15,400	142,604.00	0.29
17	300009	安科生物	7,732	142,578.08	0.29
18	002680	长生生物	6,300	140,427.00	0.28
19	600745	闻泰科技	4,600	140,208.00	0.28
20	600711	盛屯矿业	15,100	136,353.00	0.28
21	300450	先导智能	4,492	135,838.08	0.27
22	600486	扬农化工	2,400	134,232.00	0.27
23	002262	恩华药业	6,436	128,784.36	0.26
24	600702	舍得酒业	3,500	126,315.00	0.25
25	002383	合众思壮	7,600	125,780.00	0.25
26	002185	华天科技	21,900	123,516.00	0.25
27	600226	瀚叶股份	26,806	122,235.36	0.25
28	600763	通策医疗	2,500	121,675.00	0.25

29	300271	华宇软件	6,880	121,638.40	0.25
30	000040	东旭蓝天	12,000	121,200.00	0.24
31	600175	美都能源	28,900	120,224.00	0.24
32	002372	伟星新材	6,725	118,965.25	0.24
33	300413	快乐购	3,100	117,614.00	0.24
34	300558	贝达药业	2,100	116,907.00	0.24
35	002138	顺络电子	7,300	116,873.00	0.24
36	002102	冠福股份	28,600	116,402.00	0.23
37	300073	当升科技	3,400	115,804.00	0.23
38	600252	中恒集团	35,700	115,668.00	0.23
39	300285	国瓷材料	5,800	115,652.00	0.23
40	002341	新纶科技	8,600	114,294.00	0.23
41	300616	尚品宅配	1,020	111,180.00	0.22
42	002210	飞马国际	8,980	110,723.40	0.22
43	300316	晶盛机电	8,280	110,041.20	0.22
44	601799	星宇股份	1,800	107,802.00	0.22
45	603939	益丰药房	2,000	106,140.00	0.21
46	000989	九芝堂	5,605	105,934.50	0.21
47	300203	聚光科技	4,100	104,960.00	0.21
48	002497	雅化集团	9,900	104,346.00	0.21
49	600165	新日恒力	6,250	103,187.50	0.21
50	002610	爱康科技	48,800	102,480.00	0.21
51	000831	五矿稀土	8,800	102,432.00	0.21
52	000717	韶钢松山	15,500	101,680.00	0.21
53	000683	远兴能源	35,640	100,861.20	0.20
54	600507	方大特钢	9,300	99,417.00	0.20
55	002376	新北洋	6,000	99,240.00	0.20
56	300355	蒙草生态	16,500	99,165.00	0.20
57	000591	太阳能	27,060	99,039.60	0.20
58	002023	海特高新	7,800	97,812.00	0.20
59	000673	当代东方	5,300	97,202.00	0.20
60	002668	奥马电器	4,820	96,882.00	0.20
61	000516	国际医学	20,200	96,758.00	0.20
62	300014	亿纬锂能	5,481	96,465.60	0.19
63	300012	华测检测	16,800	96,432.00	0.19
64	600797	浙大网新	9,500	95,855.00	0.19
65	300226	上海钢联	1,586	94,922.10	0.19
66	600740	山西焦化	9,200	94,576.00	0.19
67	002727	一心堂	2,900	94,105.00	0.19

68	300036	超图软件	4,600	93,794.00	0.19
69	300188	美亚柏科	5,100	93,330.00	0.19
70	300496	中科创达	3,127	92,152.69	0.19
71	601636	旗滨集团	20,700	92,115.00	0.19
72	600782	新钢股份	16,400	91,512.00	0.18
73	600803	新奥股份	7,900	91,166.00	0.18
74	600728	佳都科技	12,480	90,979.20	0.18
75	300098	高新兴	11,363	90,676.74	0.18
76	002343	慈文传媒	4,830	90,659.10	0.18
77	002419	天虹股份	6,200	90,520.00	0.18
78	300618	寒锐钴业	700	89,838.00	0.18
79	600323	瀚蓝环境	5,900	89,798.00	0.18
80	300463	迈克生物	3,600	89,748.00	0.18
81	600320	振华重工	21,300	89,247.00	0.18
82	300207	欣旺达	9,900	89,199.00	0.18
83	600675	中华企业	18,100	88,871.00	0.18
84	002042	华孚时尚	11,750	87,420.00	0.18
85	002597	金禾实业	4,300	87,204.00	0.18
86	600185	格力地产	15,880	86,228.40	0.17
87	600273	嘉化能源	9,500	86,070.00	0.17
88	603678	火炬电子	3,450	85,974.00	0.17
89	600132	重庆啤酒	3,100	85,839.00	0.17
90	600559	老白干酒	4,281	85,577.19	0.17
91	002596	海南瑞泽	8,300	85,158.00	0.17
92	002151	北斗星通	3,300	84,810.00	0.17
93	000059	华锦股份	12,300	84,747.00	0.17
94	000917	电广传媒	14,600	84,096.00	0.17
95	000035	中国天楹	12,400	83,328.00	0.17
96	600562	国睿科技	4,832	82,868.80	0.17
97	000818	航锦科技	7,100	82,573.00	0.17
98	300367	东方网力	6,550	81,875.00	0.17
99	000697	炼石有色	5,700	81,852.00	0.17
100	000584	哈工智能	5,900	81,833.00	0.17
101	603660	苏州科达	3,600	81,540.00	0.16
102	000799	酒鬼酒	2,900	80,475.00	0.16
103	300077	国民技术	7,200	80,064.00	0.16
104	600667	太极实业	10,800	79,488.00	0.16
105	002089	新海宜	13,100	79,255.00	0.16
106	300628	亿联网络	1,200	79,092.00	0.16

107	300180	华峰超纤	7,300	79,059.00	0.16
108	000150	宜华健康	2,900	78,590.00	0.16
109	000968	蓝焰控股	7,500	77,925.00	0.16
110	002630	华西能源	11,900	77,826.00	0.16
111	000800	一汽轿车	10,400	77,792.00	0.16
112	002511	中顺洁柔	8,255	77,762.10	0.16
113	300037	新宙邦	2,900	77,691.00	0.16
114	002501	利源精制	12,500	77,500.00	0.16
115	002716	金贵银业	4,600	77,464.00	0.16
116	300377	赢时胜	5,700	77,463.00	0.16
117	600110	诺德股份	14,800	77,404.00	0.16
118	000902	新洋丰	8,400	77,280.00	0.16
119	600868	梅雁吉祥	24,400	76,860.00	0.16
120	600197	伊力特	3,400	76,670.00	0.15
121	002313	日海通讯	3,200	76,576.00	0.15
122	002537	海联金汇	8,080	76,275.20	0.15
123	002025	航天电器	3,300	76,230.00	0.15
124	000507	珠海港	8,100	75,978.00	0.15
125	300476	胜宏科技	4,920	75,768.00	0.15
126	000016	深康佳 A	14,400	75,600.00	0.15
127	300054	鼎龙股份	8,640	75,340.80	0.15
128	601918	新集能源	20,000	75,200.00	0.15
129	002108	沧州明珠	12,742	74,795.54	0.15
130	002614	奥佳华	3,600	74,484.00	0.15
131	300149	量子高科	4,500	74,160.00	0.15
132	600568	中珠医疗	15,400	73,920.00	0.15
133	300053	欧比特	6,345	73,602.00	0.15
134	300459	金科文化	7,600	73,416.00	0.15
135	000836	鑫茂科技	15,500	73,160.00	0.15
136	300145	中金环境	9,300	72,819.00	0.15
137	600446	金证股份	6,600	72,666.00	0.15
138	002402	和而泰	8,750	72,625.00	0.15
139	300323	华灿光电	5,600	72,352.00	0.15
140	601588	北辰实业	20,500	72,160.00	0.15
141	600756	浪潮软件	4,200	72,072.00	0.15
142	603399	吉翔股份	4,200	70,980.00	0.14
143	300101	振芯科技	5,000	70,650.00	0.14
144	002130	沃尔核材	16,200	70,632.00	0.14
145	000650	仁和药业	11,100	70,596.00	0.14

146	000710	贝瑞基因	1,400	70,504.00	0.14
147	600330	天通股份	10,280	70,418.00	0.14
148	300137	先河环保	4,400	70,312.00	0.14
149	000933	神火股份	14,600	70,226.00	0.14
150	601100	恒立液压	3,360	70,156.80	0.14
151	600200	江苏吴中	9,300	70,122.00	0.14
152	002421	达实智能	17,300	70,065.00	0.14
153	600230	沧州大化	3,160	70,025.60	0.14
154	300482	万孚生物	1,000	70,000.00	0.14
155	600764	中国海防	2,200	69,894.00	0.14
156	300294	博雅生物	2,250	69,727.50	0.14
157	000537	广宇发展	7,200	69,408.00	0.14
158	600057	厦门象屿	13,826	68,991.74	0.14
159	300222	科大智能	3,720	68,968.80	0.14
160	002812	创新股份	1,400	68,782.00	0.14
161	300373	扬杰科技	2,400	68,640.00	0.14
162	300529	健帆生物	1,600	68,624.00	0.14
163	002095	生意宝	1,900	68,191.00	0.14
164	300409	道氏技术	1,700	68,187.00	0.14
165	300212	易华录	2,880	68,112.00	0.14
166	603517	绝味食品	1,600	67,920.00	0.14
167	601222	林洋能源	13,608	67,767.84	0.14
168	000869	张裕 A	1,700	67,762.00	0.14
169	600856	中天能源	10,500	67,620.00	0.14
170	601058	赛轮金宇	27,740	67,408.20	0.14
171	002449	国星光电	6,330	67,351.20	0.14
172	600206	有研新材	7,600	67,260.00	0.14
173	300208	恒顺众昇	6,850	67,198.50	0.14
174	000034	神州数码	4,200	67,116.00	0.14
175	300068	南都电源	5,600	67,088.00	0.14
176	600641	万业企业	5,500	66,990.00	0.14
177	300079	数码科技	18,400	66,976.00	0.14
178	600337	美克家居	11,400	66,804.00	0.13
179	300237	美晨生态	9,300	66,774.00	0.13
180	600146	商赢环球	3,000	66,660.00	0.13
181	002389	南洋科技	4,900	66,346.00	0.13
182	600477	杭萧钢构	13,808	66,140.32	0.13
183	002020	京新药业	5,600	65,968.00	0.13
184	000088	盐田港	10,000	65,900.00	0.13

185	300118	东方日升	6,100	65,880.00	0.13
186	002258	利尔化学	3,400	65,824.00	0.13
187	002036	联创电子	5,000	65,600.00	0.13
188	002664	长鹰信质	2,600	65,260.00	0.13
189	000739	普洛药业	9,100	65,156.00	0.13
190	300568	星源材质	1,700	64,957.00	0.13
191	002126	银轮股份	7,200	64,944.00	0.13
192	002737	葵花药业	3,000	64,890.00	0.13
193	002436	兴森科技	15,100	64,779.00	0.13
194	600239	云南城投	14,400	64,656.00	0.13
195	002156	通富微电	5,970	64,655.10	0.13
196	300038	梅泰诺	6,060	64,599.60	0.13
197	002091	江苏国泰	10,160	64,516.00	0.13
198	002550	千红制药	11,500	64,285.00	0.13
199	600622	光大嘉宝	8,923	64,156.37	0.13
200	002099	海翔药业	12,500	64,125.00	0.13
201	002237	恒邦股份	7,000	63,910.00	0.13
202	600742	一汽富维	5,220	63,840.60	0.13
203	300020	银江股份	6,700	63,717.00	0.13
204	300567	精测电子	800	63,680.00	0.13
205	601666	平煤股份	15,200	63,536.00	0.13
206	002464	众应互联	2,996	63,485.24	0.13
207	300317	珈伟股份	5,325	63,367.50	0.13
208	300699	光威复材	1,400	63,280.00	0.13
209	601929	吉视传媒	28,000	63,000.00	0.13
210	300309	吉艾科技	3,100	62,868.00	0.13
211	002292	奥飞娱乐	7,000	62,510.00	0.13
212	600851	海欣股份	7,600	62,472.00	0.13
213	002240	威华股份	4,800	62,400.00	0.13
214	300238	冠昊生物	3,300	62,271.00	0.13
215	000875	吉电股份	22,000	62,260.00	0.13
216	600322	天房发展	11,400	62,244.00	0.13
217	000676	智度股份	5,000	61,900.00	0.12
218	000546	金圆股份	4,600	61,502.00	0.12
219	600789	鲁抗医药	6,100	61,427.00	0.12
220	600269	赣粤高速	15,000	61,350.00	0.12
221	600708	光明地产	14,267	61,348.10	0.12
222	600123	兰花科创	8,800	61,336.00	0.12
223	000036	华联控股	10,300	61,182.00	0.12

224	002675	东诚药业	6,000	61,140.00	0.12
225	600577	精达股份	17,600	61,072.00	0.12
226	002157	正邦科技	15,000	61,050.00	0.12
227	000910	大亚圣象	3,600	60,840.00	0.12
228	300185	通裕重工	33,600	60,816.00	0.12
229	002327	富安娜	5,600	60,704.00	0.12
230	000767	漳泽电力	23,700	60,435.00	0.12
231	002047	宝鹰股份	10,300	60,358.00	0.12
232	300102	乾照光电	9,200	60,352.00	0.12
233	000576	广东甘化	3,400	60,316.00	0.12
234	002617	露笑科技	7,399	60,301.85	0.12
235	002747	埃斯顿	4,300	60,114.00	0.12
236	000921	海信科龙	5,800	60,088.00	0.12
237	002145	中核钛白	16,300	59,984.00	0.12
238	300091	金通灵	4,300	59,340.00	0.12
239	600420	现代制药	5,700	59,280.00	0.12
240	002697	红旗连锁	12,240	59,241.60	0.12
241	600990	四创电子	1,200	59,184.00	0.12
242	600966	博汇纸业	13,700	59,047.00	0.12
243	300078	思创医惠	6,224	59,003.52	0.12
244	600217	中再资环	9,600	58,848.00	0.12
245	603718	海利生物	4,085	58,660.60	0.12
246	601908	京运通	12,800	58,624.00	0.12
247	600318	新力金融	5,300	58,512.00	0.12
248	300085	银之杰	4,500	58,410.00	0.12
249	601011	宝泰隆	10,300	58,401.00	0.12
250	300348	长亮科技	2,100	58,317.00	0.12
251	600133	东湖高新	6,900	58,098.00	0.12
252	600845	宝信软件	2,200	57,970.00	0.12
253	002429	兆驰股份	23,300	57,784.00	0.12
254	002245	澳洋顺昌	8,900	57,583.00	0.12
255	600172	黄河旋风	13,260	57,548.40	0.12
256	600612	老凤祥	1,600	57,504.00	0.12
257	300198	纳川股份	9,580	57,384.20	0.12
258	603323	吴江银行	9,300	57,381.00	0.12
259	002293	罗莱生活	3,800	57,114.00	0.12
260	600986	科达股份	6,100	57,096.00	0.12
261	002113	天润数娱	9,860	56,990.80	0.12
262	002387	黑牛食品	5,300	56,975.00	0.11

263	002067	景兴纸业	14,500	56,840.00	0.11
264	002222	福晶科技	4,350	56,724.00	0.11
265	600546	山煤国际	12,700	56,642.00	0.11
266	002618	丹邦科技	4,950	56,628.00	0.11
267	600114	东睦股份	5,780	56,470.60	0.11
268	300178	腾邦国际	4,000	56,240.00	0.11
269	603686	龙马环卫	2,300	56,212.00	0.11
270	603368	柳药股份	1,664	56,209.92	0.11
271	300047	天源迪科	3,600	56,160.00	0.11
272	000733	振华科技	4,200	55,902.00	0.11
273	002192	融捷股份	2,300	55,775.00	0.11
274	300369	绿盟科技	5,200	55,640.00	0.11
275	000901	航天科技	5,550	55,611.00	0.11
276	002626	金达威	3,200	55,520.00	0.11
277	000882	华联股份	21,100	55,493.00	0.11
278	601069	西部黄金	3,300	55,407.00	0.11
279	300339	润和软件	5,100	55,386.00	0.11
280	600491	龙元建设	7,900	55,221.00	0.11
281	600693	东百集团	9,200	55,108.00	0.11
282	600162	香江控股	21,850	55,062.00	0.11
283	000155	川化股份	9,800	54,978.00	0.11
284	600621	华鑫股份	5,400	54,918.00	0.11
285	000022	深赤湾A	2,400	54,768.00	0.11
286	000967	盈峰环境	6,292	54,740.40	0.11
287	600285	羚锐制药	6,100	54,351.00	0.11
288	000687	华讯方舟	5,900	54,339.00	0.11
289	600720	祁连山	8,000	53,920.00	0.11
290	601369	陕鼓动力	8,400	53,760.00	0.11
291	600668	尖峰集团	4,400	53,680.00	0.11
292	600988	赤峰黄金	11,000	53,570.00	0.11
293	600502	安徽水利	13,256	53,289.12	0.11
294	600067	冠城大通	13,400	53,198.00	0.11
295	002445	中南文化	6,300	53,172.00	0.11
296	600033	福建高速	17,600	53,152.00	0.11
297	000688	建新矿业	4,400	53,108.00	0.11
298	002430	杭氧股份	3,700	53,021.00	0.11
299	002097	山河智能	8,100	52,974.00	0.11
300	300352	北信源	13,075	52,823.00	0.11
301	002203	海亮股份	6,500	52,650.00	0.11

302	600326	西藏天路	8,900	52,599.00	0.11
303	300300	汉鼎宇佑	2,900	52,577.00	0.11
304	600210	紫江企业	15,600	52,572.00	0.11
305	002061	浙江交科	5,000	52,350.00	0.11
306	002643	万润股份	7,000	52,290.00	0.11
307	601003	柳钢股份	6,600	52,272.00	0.11
308	002303	美盈森	9,900	52,272.00	0.11
309	600072	中船科技	5,700	52,212.00	0.11
310	300177	中海达	4,000	52,000.00	0.10
311	002139	拓邦股份	9,125	51,921.25	0.10
312	603708	家家悦	2,360	51,896.40	0.10
313	600681	百川能源	4,000	51,840.00	0.10
314	002433	太安堂	6,900	51,612.00	0.10
315	600116	三峡水利	7,700	51,436.00	0.10
316	000789	万年青	4,700	51,418.00	0.10
317	002256	兆新股份	11,300	51,076.00	0.10
318	300431	暴风集团	3,360	51,004.80	0.10
319	600076	康欣新材	10,600	50,880.00	0.10
320	000525	红太阳	3,000	50,850.00	0.10
321	600255	梦舟股份	22,700	50,848.00	0.10
322	600581	八一钢铁	9,800	50,666.00	0.10
323	002043	兔宝宝	6,600	50,556.00	0.10
324	002462	嘉事堂	2,600	50,440.00	0.10
325	600290	华仪电气	4,900	50,421.00	0.10
326	002721	金一文化	5,600	50,344.00	0.10
327	002717	岭南股份	5,120	50,227.20	0.10
328	000851	高鸿股份	9,300	50,034.00	0.10
329	000810	创维数字	5,500	49,940.00	0.10
330	600227	圣济堂	13,200	49,632.00	0.10
331	300298	三诺生物	2,400	49,632.00	0.10
332	002104	恒宝股份	7,276	49,549.56	0.10
333	002531	天顺风能	11,380	49,503.00	0.10
334	603008	喜临门	2,500	49,450.00	0.10
335	002055	得润电子	3,100	49,445.00	0.10
336	002121	科陆电子	7,600	49,324.00	0.10
337	002031	巨轮智能	22,600	49,268.00	0.10
338	002649	博彦科技	5,400	49,248.00	0.10
339	000055	方大集团	8,750	49,175.00	0.10
340	000555	神州信息	3,700	49,136.00	0.10

341	600129	太极集团	3,600	48,996.00	0.10
342	002117	东港股份	3,300	48,939.00	0.10
343	600400	红豆股份	13,020	48,825.00	0.10
344	002215	诺普信	7,000	48,720.00	0.10
345	600707	彩虹股份	6,900	48,714.00	0.10
346	600686	金龙汽车	3,900	48,711.00	0.10
347	600360	华微电子	7,700	48,664.00	0.10
348	600075	新疆天业	7,480	48,620.00	0.10
349	600569	安阳钢铁	12,300	48,462.00	0.10
350	600531	豫光金铅	9,800	48,412.00	0.10
351	000429	粤高速 A	6,700	48,374.00	0.10
352	600638	新黄浦	3,600	48,348.00	0.10
353	000030	富奥股份	6,500	48,230.00	0.10
354	600846	同济科技	6,400	48,192.00	0.10
355	300467	迅游科技	1,500	48,150.00	0.10
356	002094	青岛金王	5,340	48,113.40	0.10
357	000711	京蓝科技	4,800	48,096.00	0.10
358	000822	山东海化	6,900	48,093.00	0.10
359	002320	海峡股份	2,530	47,943.50	0.10
360	603588	高能环境	5,100	47,838.00	0.10
361	000796	凯撒旅游	3,700	47,730.00	0.10
362	000915	山大华特	2,370	47,660.70	0.10
363	300157	恒泰艾普	7,300	47,450.00	0.10
364	600331	宏达股份	18,300	47,397.00	0.10
365	000751	锌业股份	14,500	47,270.00	0.10
366	002206	海利得	9,400	46,906.00	0.09
367	000672	上峰水泥	5,200	46,852.00	0.09
368	002016	世荣兆业	3,100	46,717.00	0.09
369	600963	岳阳林纸	9,000	46,620.00	0.09
370	000603	盛达矿业	4,300	46,569.00	0.09
371	300474	景嘉微	1,000	46,480.00	0.09
372	002488	金固股份	4,300	46,397.00	0.09
373	002239	奥特佳	12,800	46,336.00	0.09
374	600987	航民股份	4,900	46,305.00	0.09
375	002650	加加食品	9,500	46,170.00	0.09
376	600512	腾达建设	20,500	46,125.00	0.09
377	300183	东软载波	3,000	46,110.00	0.09
378	300406	九强生物	3,200	46,080.00	0.09
379	603337	杰克股份	1,184	46,022.08	0.09

380	000952	广济药业	3,200	45,984.00	0.09
381	300236	上海新阳	1,500	45,945.00	0.09
382	002711	欧浦智网	5,468	45,821.84	0.09
383	601388	怡球资源	18,180	45,813.60	0.09
384	002318	久立特材	7,600	45,752.00	0.09
385	600812	华北制药	10,500	45,570.00	0.09
386	603338	浙江鼎力	980	45,472.00	0.09
387	002279	久其软件	4,580	45,387.80	0.09
388	002443	金洲管道	6,700	45,292.00	0.09
389	000951	中国重汽	3,400	45,186.00	0.09
390	300495	美尚生态	3,883	45,042.80	0.09
391	600343	航天动力	4,900	44,982.00	0.09
392	000797	中国武夷	6,500	44,980.00	0.09
393	300458	全志科技	2,506	44,907.52	0.09
394	000935	四川双马	2,900	44,892.00	0.09
395	300457	赢合科技	1,950	44,869.50	0.09
396	002581	未名医药	4,200	44,730.00	0.09
397	002564	天沃科技	7,900	44,635.00	0.09
398	300075	数字政通	3,300	44,517.00	0.09
399	002474	榕基软件	5,600	44,408.00	0.09
400	300083	劲胜智能	9,200	44,344.00	0.09
401	300666	江丰电子	800	44,104.00	0.09
402	000571	新大洲A	10,500	44,100.00	0.09
403	300219	鸿利智汇	4,550	44,044.00	0.09
404	002447	晨鑫科技	12,850	43,947.00	0.09
405	300310	宜通世纪	6,888	43,945.44	0.09
406	002467	二六三	8,100	43,902.00	0.09
407	002326	永太科技	6,300	43,785.00	0.09
408	600391	航发科技	3,000	43,650.00	0.09
409	300523	辰安科技	700	43,596.00	0.09
410	002510	天汽模	9,200	43,516.00	0.09
411	002582	好想你	4,000	43,480.00	0.09
412	002611	东方精工	7,040	43,436.80	0.09
413	600020	中原高速	11,500	43,355.00	0.09
414	600093	易见股份	4,300	43,344.00	0.09
415	002448	中原内配	6,200	43,214.00	0.09
416	600684	珠江实业	7,660	43,202.40	0.09
417	300398	飞凯材料	2,200	43,032.00	0.09
418	600997	开滦股份	8,200	42,968.00	0.09

419	300288	朗玛信息	2,600	42,744.00	0.09
420	603881	数据港	1,100	42,724.00	0.09
421	000976	华铁股份	8,200	42,722.00	0.09
422	603308	应流股份	3,300	42,702.00	0.09
423	600604	市北高新	9,000	42,660.00	0.09
424	000996	中国中期	4,450	42,542.00	0.09
425	600363	联创光电	4,600	42,504.00	0.09
426	300438	鹏辉能源	2,200	42,482.00	0.09
427	300031	宝通科技	3,100	42,470.00	0.09
428	002677	浙江美大	2,440	42,456.00	0.09
429	002684	猛狮科技	3,600	42,408.00	0.09
430	300364	中文在线	6,019	42,373.76	0.09
431	002080	中材科技	4,980	42,330.00	0.09
432	300349	金卡智能	2,200	42,328.00	0.09
433	000918	嘉凯城	9,300	42,315.00	0.09
434	603111	康尼机电	6,400	42,304.00	0.09
435	000828	东莞控股	5,300	42,294.00	0.09
436	300353	东土科技	3,300	42,207.00	0.09
437	300044	赛为智能	5,980	42,159.00	0.09
438	600261	阳光照明	11,200	42,112.00	0.08
439	600090	同济堂	7,400	42,106.00	0.08
440	300292	吴通控股	11,500	42,090.00	0.08
441	300607	拓斯达	700	42,084.00	0.08
442	603096	新经典	500	41,890.00	0.08
443	600495	晋西车轴	10,880	41,779.20	0.08
444	002622	融钰集团	8,600	41,624.00	0.08
445	300224	正海磁材	5,250	41,527.50	0.08
446	601163	三角轮胎	3,100	41,416.00	0.08
447	002484	江海股份	6,316	41,306.64	0.08
448	002586	围海股份	5,900	41,300.00	0.08
449	300229	拓尔思	2,600	41,288.00	0.08
450	000820	神雾节能	4,900	41,258.00	0.08
451	603233	大参林	600	41,076.00	0.08
452	300130	新国都	3,040	41,009.60	0.08
453	601139	深圳燃气	7,380	40,959.00	0.08
454	000881	中广核技	4,100	40,959.00	0.08
455	002301	齐心集团	3,900	40,950.00	0.08
456	300284	苏交科	5,160	40,918.80	0.08
457	000889	茂业通信	3,200	40,832.00	0.08

458	300131	英唐智控	7,200	40,824.00	0.08
459	600069	银鸽投资	10,300	40,788.00	0.08
460	000928	中钢国际	8,020	40,661.40	0.08
461	600456	宝钛股份	2,800	40,600.00	0.08
462	002229	鸿博股份	4,550	40,495.00	0.08
463	601101	昊华能源	6,200	40,300.00	0.08
464	600550	保变电气	9,900	40,293.00	0.08
465	002362	汉王科技	2,000	40,240.00	0.08
466	000582	北部湾港	5,300	40,121.00	0.08
467	600602	云赛智联	6,900	40,020.00	0.08
468	300429	强力新材	1,370	40,004.00	0.08
469	002283	天润曲轴	10,100	39,996.00	0.08
470	002609	捷顺科技	4,200	39,984.00	0.08
471	002756	永兴特钢	2,300	39,951.00	0.08
472	002267	陕天然气	5,700	39,900.00	0.08
473	000731	四川美丰	7,600	39,900.00	0.08
474	002413	雷科防务	7,400	39,886.00	0.08
475	600063	皖维高新	14,800	39,812.00	0.08
476	002204	大连重工	9,900	39,798.00	0.08
477	000520	长航凤凰	13,000	39,780.00	0.08
478	000666	经纬纺机	2,200	39,776.00	0.08
479	603367	辰欣药业	1,700	39,729.00	0.08
480	002557	洽洽食品	2,600	39,650.00	0.08
481	600508	上海能源	3,700	39,516.00	0.08
482	002585	双星新材	7,390	39,462.60	0.08
483	002171	楚江新材	5,800	39,324.00	0.08
484	002167	东方锆业	6,400	39,296.00	0.08
485	600676	交运股份	7,900	39,263.00	0.08
486	300336	新文化	4,800	39,120.00	0.08
487	002859	洁美科技	1,000	38,950.00	0.08
488	300232	洲明科技	3,940	38,927.20	0.08
489	300439	美康生物	1,800	38,880.00	0.08
490	300065	海兰信	2,750	38,720.00	0.08
491	600055	万东医疗	3,500	38,640.00	0.08
492	000802	北京文化	3,700	38,628.00	0.08
493	300388	国祯环保	2,000	38,540.00	0.08
494	600054	黄山旅游	3,300	38,445.00	0.08
495	000973	佛塑科技	9,900	38,412.00	0.08
496	300379	东方通	2,500	38,275.00	0.08

497	300128	锦富技术	9,788	38,173.20	0.08
498	002307	北新路桥	6,900	38,088.00	0.08
499	002086	东方海洋	5,700	38,076.00	0.08
500	600382	广东明珠	3,600	37,980.00	0.08
501	600677	航天通信	4,700	37,929.00	0.08
502	300007	汉威科技	3,000	37,920.00	0.08
503	603128	华贸物流	6,500	37,895.00	0.08
504	002547	春兴精工	8,700	37,845.00	0.08
505	600180	瑞茂通	3,900	37,791.00	0.08
506	002867	周大生	1,200	37,788.00	0.08
507	000615	京汉股份	6,000	37,740.00	0.08
508	002197	证通电子	4,600	37,720.00	0.08
509	600303	曙光股份	6,900	37,674.00	0.08
510	600231	凌钢股份	10,660	37,629.80	0.08
511	002912	中新赛克	400	37,600.00	0.08
512	002522	浙江众成	5,800	37,526.00	0.08
513	600136	当代明诚	3,100	37,510.00	0.08
514	300506	名家汇	1,800	37,314.00	0.08
515	002562	兄弟科技	5,560	37,307.60	0.08
516	300343	联创互联	3,730	37,300.00	0.08
517	002833	弘亚数控	700	37,205.00	0.08
518	002542	中化岩土	6,950	37,113.00	0.07
519	300045	华力创通	4,000	37,080.00	0.07
520	300096	易联众	4,400	37,048.00	0.07
521	600405	动力源	7,200	36,864.00	0.07
522	600783	鲁信创投	3,800	36,708.00	0.07
523	002481	双塔食品	8,100	36,612.00	0.07
524	603026	石大胜华	1,600	36,544.00	0.07
525	300184	力源信息	3,400	36,448.00	0.07
526	000601	韶能股份	8,300	36,437.00	0.07
527	002367	康力电梯	6,100	36,356.00	0.07
528	300110	华仁药业	7,620	36,195.00	0.07
529	600800	天津磁卡	6,600	36,102.00	0.07
530	002247	帝龙文化	4,400	36,080.00	0.07
531	300485	赛升药业	2,500	35,975.00	0.07
532	000639	西王食品	2,800	35,924.00	0.07
533	601952	苏垦农发	5,290	35,919.10	0.07
534	600590	泰豪科技	5,560	35,862.00	0.07
535	000957	中通客车	5,200	35,568.00	0.07

536	300223	北京君正	1,560	35,568.00	0.07
537	603387	基蛋生物	700	35,546.00	0.07
538	000801	四川九洲	7,900	35,313.00	0.07
539	300424	航新科技	1,816	35,266.72	0.07
540	600552	凯盛科技	7,900	35,234.00	0.07
541	002079	苏州固锴	5,600	35,224.00	0.07
542	002178	延华智能	5,500	35,200.00	0.07
543	002224	三力士	5,900	35,164.00	0.07
544	002115	三维通信	4,300	35,131.00	0.07
545	002409	雅克科技	1,800	35,100.00	0.07
546	600105	永鼎股份	9,640	35,089.60	0.07
547	002453	天马精化	5,900	34,987.00	0.07
548	603579	荣泰健康	500	34,980.00	0.07
549	300393	中来股份	1,200	34,896.00	0.07
550	300008	天海防务	7,250	34,872.50	0.07
551	002364	中恒电气	3,600	34,848.00	0.07
552	000958	东方能源	9,900	34,848.00	0.07
553	300228	富瑞特装	6,080	34,838.40	0.07
554	600084	中葡股份	8,700	34,800.00	0.07
555	002695	煌上煌	2,600	34,788.00	0.07
556	000936	华西股份	5,700	34,713.00	0.07
557	000560	我爱我家	6,080	34,412.80	0.07
558	002656	摩登大道	3,580	34,403.80	0.07
559	000795	英洛华	7,300	34,383.00	0.07
560	603989	艾华集团	1,530	34,379.10	0.07
561	300158	振东制药	6,700	34,304.00	0.07
562	600096	云天化	6,800	34,272.00	0.07
563	600734	实达集团	5,000	34,250.00	0.07
564	300231	银信科技	4,500	34,200.00	0.07
565	002516	旷达科技	9,600	34,176.00	0.07
566	600595	中孚实业	12,600	34,146.00	0.07
567	002253	川大智胜	2,350	34,098.50	0.07
568	600103	青山纸业	11,400	34,086.00	0.07
569	300527	华舟应急	3,383	34,032.98	0.07
570	600106	重庆路桥	11,324	33,972.00	0.07
571	300252	金信诺	3,740	33,921.80	0.07
572	300456	耐威科技	1,500	33,900.00	0.07
573	603393	新天然气	1,000	33,880.00	0.07
574	600798	宁波海运	9,300	33,852.00	0.07

575	002540	亚太科技	6,500	33,800.00	0.07
576	300242	佳云科技	4,800	33,792.00	0.07
577	002502	骅威文化	5,800	33,756.00	0.07
578	002446	盛路通信	4,920	33,751.20	0.07
579	600480	凌云股份	3,500	33,670.00	0.07
580	002255	海陆重工	6,500	33,670.00	0.07
581	300097	智云股份	1,900	33,668.00	0.07
582	300245	天玑科技	3,300	33,660.00	0.07
583	000544	中原环保	5,050	33,582.50	0.07
584	002305	南国置业	11,100	33,522.00	0.07
585	002712	思美传媒	1,800	33,462.00	0.07
586	002148	北纬科技	5,760	33,408.00	0.07
587	002521	齐峰新材	5,100	33,252.00	0.07
588	603003	龙宇燃油	4,000	33,240.00	0.07
589	300016	北陆药业	2,900	33,205.00	0.07
590	603777	来伊份	1,800	33,174.00	0.07
591	601116	三江购物	2,100	33,159.00	0.07
592	002284	亚太股份	5,700	33,060.00	0.07
593	603108	润达医疗	2,940	32,986.80	0.07
594	600626	申达股份	6,400	32,960.00	0.07
595	002322	理工环科	2,600	32,942.00	0.07
596	600459	贵研铂业	3,050	32,940.00	0.07
597	002543	万和电气	1,700	32,844.00	0.07
598	000545	金浦钛业	8,700	32,712.00	0.07
599	000550	江铃汽车	2,700	32,697.00	0.07
600	000407	胜利股份	7,900	32,627.00	0.07
601	000657	中钨高新	3,200	32,608.00	0.07
602	601599	鹿港文化	8,000	32,560.00	0.07
603	002335	科华恒盛	1,800	32,490.00	0.07
604	601566	九牧王	2,200	32,450.00	0.07
605	002235	安妮股份	4,775	32,326.75	0.07
606	600662	强生控股	8,100	32,319.00	0.07
607	600995	文山电力	4,300	32,293.00	0.07
608	000631	顺发恒业	9,400	32,242.00	0.07
609	000821	京山轻机	3,500	32,235.00	0.07
610	002638	勤上股份	9,750	32,175.00	0.06
611	002685	华东重机	3,900	32,097.00	0.06
612	002766	索菱股份	2,700	32,076.00	0.06
613	601126	四方股份	6,300	32,067.00	0.06

614	601890	亚星锚链	7,400	32,042.00	0.06
615	002124	天邦股份	7,400	31,968.00	0.06
616	000927	一汽夏利	8,200	31,898.00	0.06
617	603979	金诚信	3,734	31,851.02	0.06
618	002298	中电鑫龙	4,500	31,770.00	0.06
619	300278	华昌达	3,500	31,745.00	0.06
620	002496	辉丰股份	11,620	31,722.60	0.06
621	600855	航天长峰	2,700	31,698.00	0.06
622	300221	银禧科技	3,200	31,680.00	0.06
623	002060	粤水电	10,800	31,644.00	0.06
624	603636	南威软件	3,600	31,644.00	0.06
625	300021	大禹节水	6,100	31,598.00	0.06
626	600624	复旦复华	6,130	31,569.50	0.06
627	000782	美达股份	5,400	31,536.00	0.06
628	300322	硕贝德	3,700	31,524.00	0.06
629	600246	万通地产	7,900	31,521.00	0.06
630	603898	好莱客	1,200	31,488.00	0.06
631	002538	司尔特	6,500	31,330.00	0.06
632	000965	天保基建	7,080	31,293.60	0.06
633	002751	易尚展示	1,000	31,290.00	0.06
634	300109	新开源	900	31,230.00	0.06
635	300256	星星科技	7,450	31,215.50	0.06
636	300005	探路者	8,000	31,040.00	0.06
637	002355	兴民智通	4,000	31,040.00	0.06
638	002850	科达利	1,100	30,976.00	0.06
639	002515	金字火腿	6,320	30,841.60	0.06
640	002418	康盛股份	7,300	30,806.00	0.06
641	300303	聚飞光电	11,240	30,797.60	0.06
642	600571	信雅达	4,000	30,760.00	0.06
643	603603	博天环境	1,500	30,735.00	0.06
644	300048	合康新能	10,000	30,700.00	0.06
645	300034	钢研高纳	3,279	30,691.44	0.06
646	300269	联建光电	4,700	30,691.00	0.06
647	000837	秦川机床	6,200	30,690.00	0.06
648	002518	科士达	3,075	30,657.75	0.06
649	002288	超华科技	7,200	30,600.00	0.06
650	601366	利群股份	3,300	30,591.00	0.06
651	002141	贤丰控股	7,300	30,587.00	0.06
652	000018	神州长城	9,200	30,544.00	0.06

653	000043	中航善达	4,300	30,487.00	0.06
654	002033	丽江旅游	4,190	30,461.30	0.06
655	002182	云海金属	5,000	30,450.00	0.06
656	600082	海泰发展	6,600	30,294.00	0.06
657	002705	新宝股份	3,100	30,287.00	0.06
658	002053	云南能投	3,000	30,240.00	0.06
659	603609	禾丰牧业	3,200	30,208.00	0.06
660	600652	游久游戏	6,400	30,144.00	0.06
661	300685	艾德生物	540	30,110.40	0.06
662	300679	电连技术	800	30,088.00	0.06
663	002769	普路通	2,399	30,083.46	0.06
664	000065	北方国际	3,925	30,065.50	0.06
665	600616	金枫酒业	4,598	30,024.94	0.06
666	002196	方正电机	4,080	29,988.00	0.06
667	002636	金安国纪	3,700	29,859.00	0.06
668	002425	凯撒文化	6,280	29,830.00	0.06
669	603843	正平股份	2,600	29,796.00	0.06
670	002648	卫星石化	2,700	29,781.00	0.06
671	002545	东方铁塔	5,000	29,750.00	0.06
672	002458	益生股份	1,700	29,750.00	0.06
673	000558	莱茵体育	8,300	29,714.00	0.06
674	600130	波导股份	9,900	29,700.00	0.06
675	002619	艾格拉斯	7,080	29,665.20	0.06
676	600758	红阳能源	6,800	29,512.00	0.06
677	603298	杭叉集团	2,400	29,496.00	0.06
678	002331	皖通科技	3,980	29,452.00	0.06
679	300066	三川智慧	8,000	29,440.00	0.06
680	002792	通宇通讯	1,200	29,412.00	0.06
681	000815	美利云	3,600	29,412.00	0.06
682	002177	御银股份	7,800	29,406.00	0.06
683	002339	积成电子	4,000	29,400.00	0.06
684	002321	华英农业	4,800	29,376.00	0.06
685	002393	力生制药	1,200	29,376.00	0.06
686	603959	百利科技	1,640	29,339.60	0.06
687	300465	高伟达	3,480	29,301.60	0.06
688	300209	天泽信息	1,900	29,298.00	0.06
689	300148	天舟文化	6,500	29,250.00	0.06
690	600207	安彩高科	4,400	29,172.00	0.06
691	600449	宁夏建材	3,700	29,156.00	0.06

692	002494	华斯股份	3,500	29,155.00	0.06
693	002059	云南旅游	4,000	29,120.00	0.06
694	002218	拓日新能	9,500	29,070.00	0.06
695	600548	深高速	3,700	29,045.00	0.06
696	603707	健友股份	1,070	29,029.10	0.06
697	002314	南山控股	7,200	29,016.00	0.06
698	300215	电科院	4,900	29,008.00	0.06
699	000070	特发信息	4,000	29,000.00	0.06
700	000554	泰山石油	4,900	28,910.00	0.06
701	603299	井神股份	3,500	28,875.00	0.06
702	603466	风语筑	1,100	28,875.00	0.06
703	300359	全通教育	4,050	28,836.00	0.06
704	000665	湖北广电	3,300	28,776.00	0.06
705	600973	宝胜股份	7,879	28,758.35	0.06
706	600838	上海九百	4,100	28,700.00	0.06
707	300194	福安药业	6,100	28,670.00	0.06
708	600630	龙头股份	3,800	28,614.00	0.06
709	603839	安正时尚	1,580	28,613.80	0.06
710	603595	东尼电子	400	28,600.00	0.06
711	000038	深大通	1,580	28,598.00	0.06
712	300737	科顺股份	2,400	28,584.00	0.06
713	002166	莱茵生物	3,900	28,548.00	0.06
714	300625	三雄极光	1,400	28,490.00	0.06
715	002772	众兴菌业	3,400	28,458.00	0.06
716	300191	潜能恒信	1,600	28,416.00	0.06
717	300363	博腾股份	2,800	28,280.00	0.06
718	601500	通用股份	2,800	28,280.00	0.06
719	002584	西陇科学	3,800	28,272.00	0.06
720	000971	高升控股	6,500	28,145.00	0.06
721	300304	云意电气	6,700	28,140.00	0.06
722	603118	共进股份	5,000	28,000.00	0.06
723	300302	同有科技	2,740	27,948.00	0.06
724	002872	天圣制药	900	27,945.00	0.06
725	600533	栖霞建设	8,100	27,945.00	0.06
726	600295	鄂尔多斯	3,100	27,869.00	0.06
727	603997	继峰股份	2,550	27,718.50	0.06
728	300613	富瀚微	200	27,700.00	0.06
729	002226	江南化工	5,100	27,642.00	0.06
730	300114	中航电测	3,050	27,572.00	0.06

731	002556	辉隆股份	5,500	27,500.00	0.06
732	002406	远东传动	5,000	27,450.00	0.06
733	002329	皇氏集团	6,440	27,434.40	0.06
734	600035	楚天高速	8,900	27,412.00	0.06
735	000151	中成股份	2,300	27,393.00	0.06
736	002530	金财互联	3,000	27,330.00	0.06
737	603801	志邦股份	600	27,288.00	0.06
738	603359	东珠景观	1,260	27,241.20	0.05
739	000404	华意压缩	6,275	27,170.75	0.05
740	002476	宝莫股份	6,300	27,153.00	0.05
741	603618	杭电股份	4,400	27,104.00	0.05
742	601789	宁波建工	7,500	27,075.00	0.05
743	300497	富祥股份	700	26,908.00	0.05
744	002135	东南网架	5,300	26,871.00	0.05
745	600012	皖通高速	4,500	26,820.00	0.05
746	002432	九安医疗	3,900	26,793.00	0.05
747	300520	科大国创	1,300	26,780.00	0.05
748	000905	厦门港务	3,400	26,758.00	0.05
749	000506	中润资源	8,300	26,726.00	0.05
750	300735	光弘科技	1,400	26,684.00	0.05
751	000532	华金资本	2,700	26,649.00	0.05
752	002234	民和股份	2,300	26,634.00	0.05
753	603900	莱绅通灵	1,320	26,584.80	0.05
754	600381	青海春天	3,200	26,528.00	0.05
755	300332	天壕环境	5,700	26,505.00	0.05
756	600467	好当家	11,300	26,216.00	0.05
757	600650	锦江投资	2,500	26,200.00	0.05
758	000838	财信发展	7,100	26,199.00	0.05
759	000416	民生控股	5,500	26,070.00	0.05
760	000925	众合科技	4,200	26,040.00	0.05
761	300255	常山药业	4,800	25,968.00	0.05
762	300006	莱美药业	6,238	25,950.08	0.05
763	300426	唐德影视	2,100	25,935.00	0.05
764	002175	东方网络	6,800	25,908.00	0.05
765	002137	麦达数字	3,000	25,890.00	0.05
766	601137	博威合金	3,200	25,856.00	0.05
767	002554	惠博普	8,200	25,830.00	0.05
768	300050	世纪鼎利	4,300	25,800.00	0.05
769	002519	银河电子	5,810	25,796.40	0.05

770	603357	设计总院	1,300	25,792.00	0.05
771	603612	索通发展	900	25,740.00	0.05
772	000701	厦门信达	3,700	25,678.00	0.05
773	300311	任子行	3,431	25,629.57	0.05
774	300276	三丰智能	2,100	25,578.00	0.05
775	600830	香溢融通	4,700	25,474.00	0.05
776	002524	光正集团	5,200	25,428.00	0.05
777	002590	万安科技	3,100	25,420.00	0.05
778	000885	同力水泥	2,500	25,400.00	0.05
779	603648	畅联股份	1,400	25,368.00	0.05
780	600933	爱柯迪	2,200	25,344.00	0.05
781	601700	风范股份	7,300	25,258.00	0.05
782	603555	贵人鸟	2,400	25,248.00	0.05
783	002782	可立克	1,600	25,248.00	0.05
784	600313	农发种业	8,350	25,133.50	0.05
785	300307	慈星股份	4,100	25,133.00	0.05
786	002349	精华制药	4,300	25,112.00	0.05
787	000517	荣安地产	8,200	25,092.00	0.05
788	300205	天喻信息	3,300	25,047.00	0.05
789	600283	钱江水利	2,300	24,978.00	0.05
790	002274	华昌化工	4,100	24,805.00	0.05
791	603126	中材节能	3,900	24,765.00	0.05
792	300518	盛讯达	500	24,755.00	0.05
793	300386	飞天诚信	2,100	24,717.00	0.05
794	000498	山东路桥	5,800	24,708.00	0.05
795	300064	豫金刚石	4,600	24,702.00	0.05
796	600526	菲达环保	4,200	24,696.00	0.05
797	600744	华银电力	9,100	24,570.00	0.05
798	603010	万盛股份	1,300	24,531.00	0.05
799	600135	乐凯胶片	3,400	24,446.00	0.05
800	002631	德尔未来	3,300	24,420.00	0.05
801	002662	京威股份	5,800	24,360.00	0.05
802	600775	南京熊猫	4,300	24,338.00	0.05
803	002158	汉钟精机	2,700	24,246.00	0.05
804	300366	创意信息	2,700	24,246.00	0.05
805	002567	唐人神	5,350	24,235.50	0.05
806	002658	雪迪龙	3,100	24,211.00	0.05
807	002356	赫美集团	2,000	24,180.00	0.05
808	603882	金域医学	900	24,120.00	0.05

809	300468	四方精创	1,260	24,091.20	0.05
810	000923	河北宣工	1,700	24,089.00	0.05
811	600173	卧龙地产	5,600	24,080.00	0.05
812	600354	敦煌种业	4,700	24,064.00	0.05
813	002246	北化股份	2,800	23,996.00	0.05
814	000811	冰轮环境	5,050	23,987.50	0.05
815	002457	青龙管业	3,000	23,940.00	0.05
816	300213	佳讯飞鸿	3,800	23,940.00	0.05
817	600501	航天晨光	3,200	23,904.00	0.05
818	300441	鲍斯股份	2,560	23,808.00	0.05
819	002378	章源钨业	3,600	23,796.00	0.05
820	600279	重庆港九	5,350	23,754.00	0.05
821	300263	隆华节能	4,500	23,580.00	0.05
822	000892	欢瑞世纪	5,000	23,550.00	0.05
823	600475	华光股份	2,200	23,518.00	0.05
824	300410	正业科技	1,000	23,510.00	0.05
825	000700	模塑科技	6,400	23,488.00	0.05
826	002535	林州重机	6,180	23,236.80	0.05
827	603919	金徽酒	1,400	23,142.00	0.05
828	300350	华鹏飞	2,840	23,089.20	0.05
829	000561	烽火电子	3,900	23,088.00	0.05
830	002733	雄韬股份	2,250	23,017.50	0.05
831	603626	科森科技	1,580	22,973.20	0.05
832	300011	鼎汉技术	3,600	22,968.00	0.05
833	600818	中路股份	1,500	22,965.00	0.05
834	600814	杭州解百	3,700	22,940.00	0.05
835	002451	摩恩电气	2,300	22,908.00	0.05
836	600119	长江投资	2,800	22,904.00	0.05
837	002101	广东鸿图	2,700	22,896.00	0.05
838	000533	万家乐	6,200	22,878.00	0.05
839	600107	美尔雅	3,700	22,866.00	0.05
840	000819	岳阳兴长	2,400	22,824.00	0.05
841	300248	新开普	3,723	22,784.76	0.05
842	300664	鹏鹞环保	1,200	22,740.00	0.05
843	002539	云图控股	5,200	22,724.00	0.05
844	601949	中国出版	4,700	22,701.00	0.05
845	300051	三五互联	2,800	22,680.00	0.05
846	601015	陕西黑猫	3,250	22,652.50	0.05
847	300381	溢多利	2,600	22,646.00	0.05

848	300295	三六五网	1,700	22,644.00	0.05
849	601595	上海电影	1,400	22,582.00	0.05
850	600876	洛阳玻璃	1,600	22,512.00	0.05
851	002906	华阳集团	1,200	22,440.00	0.05
852	600692	亚通股份	3,200	22,432.00	0.05
853	300328	宜安科技	2,980	22,290.40	0.04
854	002852	道道全	1,450	22,286.50	0.04
855	300262	巴安水务	4,300	22,274.00	0.04
856	300502	新易盛	1,500	22,185.00	0.04
857	600592	龙溪股份	3,600	22,140.00	0.04
858	000011	深物业 A	2,000	22,140.00	0.04
859	002781	奇信股份	1,400	22,120.00	0.04
860	000791	甘肃电投	5,000	22,000.00	0.04
861	002746	仙坛股份	1,940	21,999.60	0.04
862	002346	柘中股份	1,700	21,998.00	0.04
863	300172	中电环保	3,900	21,957.00	0.04
864	002071	长城影视	4,000	21,920.00	0.04
865	300528	幸福蓝海	1,940	21,825.00	0.04
866	002901	大博医疗	600	21,792.00	0.04
867	600523	贵航股份	2,560	21,760.00	0.04
868	601900	南方传媒	2,300	21,712.00	0.04
869	300507	苏奥传感	920	21,693.60	0.04
870	300299	富春股份	4,640	21,668.80	0.04
871	300171	东富龙	3,200	21,632.00	0.04
872	600190	锦州港	6,900	21,597.00	0.04
873	002742	三圣股份	2,200	21,582.00	0.04
874	300074	华平股份	5,600	21,560.00	0.04
875	603103	横店影视	700	21,504.00	0.04
876	000607	华媒控股	5,200	21,372.00	0.04
877	603458	勘设股份	500	21,345.00	0.04
878	300052	中青宝	2,000	21,320.00	0.04
879	600278	东方创业	2,700	21,303.00	0.04
880	300362	天翔环境	2,200	21,296.00	0.04
881	002918	蒙娜丽莎	900	21,294.00	0.04
882	002579	中京电子	2,400	21,240.00	0.04
883	603980	吉华集团	1,300	21,060.00	0.04
884	603116	红蜻蜓	1,600	20,992.00	0.04
885	002788	鹭燕医药	1,250	20,937.50	0.04
886	600310	桂东电力	5,300	20,935.00	0.04

887	002461	珠江啤酒	4,000	20,880.00	0.04
888	300378	鼎捷软件	1,650	20,707.50	0.04
889	600113	浙江东日	2,500	20,475.00	0.04
890	300447	全信股份	1,580	20,445.20	0.04
891	300633	开立医疗	600	20,436.00	0.04
892	603508	思维列控	600	20,382.00	0.04
893	002577	雷柏科技	1,500	20,370.00	0.04
894	000920	南方汇通	3,300	20,361.00	0.04
895	002232	启明信息	2,600	20,306.00	0.04
896	600629	华建集团	1,700	20,281.00	0.04
897	002726	龙大肉食	2,880	20,275.20	0.04
898	002616	长青集团	3,800	20,254.00	0.04
899	002114	罗平锌电	2,500	20,250.00	0.04
900	600386	北巴传媒	5,200	20,228.00	0.04
901	300173	智慧松德	3,000	20,190.00	0.04
902	300531	优博讯	1,400	20,174.00	0.04
903	002351	漫步者	3,100	20,119.00	0.04
904	002651	利君股份	3,900	20,085.00	0.04
905	603227	雪峰科技	5,100	19,788.00	0.04
906	603920	世运电路	1,500	19,635.00	0.04
907	300511	雪榕生物	2,210	19,624.80	0.04
908	603619	中曼石油	600	19,482.00	0.04
909	000058	深赛格	3,800	19,456.00	0.04
910	603533	掌阅科技	600	19,416.00	0.04
911	000514	渝开发	4,300	19,393.00	0.04
912	002401	中远海科	1,900	19,057.00	0.04
913	002534	杭锅股份	2,800	18,956.00	0.04
914	601858	中国科传	2,000	18,940.00	0.04
915	300440	运达科技	2,900	18,937.00	0.04
916	300494	盛天网络	1,500	18,900.00	0.04
917	002574	明牌珠宝	3,400	18,836.00	0.04
918	002499	科林环保	1,700	18,785.00	0.04
919	300660	江苏雷利	720	18,784.80	0.04
920	300533	冰川网络	500	18,595.00	0.04
921	603817	海峡环保	2,300	18,492.00	0.04
922	300140	中环装备	2,200	18,414.00	0.04
923	603058	永吉股份	1,600	18,208.00	0.04
924	603727	博迈科	1,200	18,204.00	0.04
925	002606	大连电瓷	3,700	18,130.00	0.04

926	300419	浩丰科技	2,800	18,116.00	0.04
927	603305	旭升股份	600	17,958.00	0.04
928	603258	电魂网络	900	17,955.00	0.04
929	603999	读者传媒	3,000	17,880.00	0.04
930	002575	群兴玩具	4,500	17,865.00	0.04
931	300516	久之洋	500	17,865.00	0.04
932	002911	佛燃股份	800	17,864.00	0.04
933	002822	中装建设	3,100	17,825.00	0.04
934	603779	威龙股份	1,200	17,628.00	0.04
935	300432	富临精工	2,000	17,520.00	0.04
936	603313	梦百合	900	17,505.00	0.04
937	002783	凯龙股份	2,120	17,447.60	0.04
938	603800	道森股份	1,100	17,314.00	0.03
939	002287	奇正藏药	600	17,274.00	0.03
940	300726	宏达电子	600	17,040.00	0.03
941	600828	茂业商业	3,317	16,916.70	0.03
942	300512	中亚股份	1,000	16,910.00	0.03
943	002907	华森制药	600	16,842.00	0.03
944	300368	汇金股份	2,800	16,800.00	0.03
945	603358	华达科技	840	16,699.20	0.03
946	601968	宝钢包装	4,300	16,598.00	0.03
947	300471	厚普股份	2,350	16,473.50	0.03
948	603303	得邦照明	1,600	16,448.00	0.03
949	300100	双林股份	1,500	16,425.00	0.03
950	601038	一拖股份	3,100	16,399.00	0.03
951	603385	惠达卫浴	1,460	16,366.60	0.03
952	002759	天际股份	1,700	16,320.00	0.03
953	603165	荣晟环保	700	16,226.00	0.03
954	300484	蓝海华腾	1,100	16,203.00	0.03
955	000626	远大控股	2,300	16,192.00	0.03
956	603730	岱美股份	600	16,164.00	0.03
957	300063	天龙集团	4,650	16,089.00	0.03
958	600735	新华锦	2,400	16,056.00	0.03
959	300312	邦讯技术	2,000	15,960.00	0.03
960	300160	秀强股份	3,800	15,960.00	0.03
961	603043	广州酒家	700	15,939.00	0.03
962	603339	四方冷链	800	15,872.00	0.03
963	300356	光一科技	2,600	15,730.00	0.03
964	002231	奥维通信	2,700	15,714.00	0.03

965	001896	豫能控股	4,400	15,576.00	0.03
966	300443	金雷风电	1,480	15,495.60	0.03
967	002724	海洋王	2,760	15,428.40	0.03
968	603166	福达股份	2,340	15,139.80	0.03
969	601882	海天精工	1,300	15,028.00	0.03
970	603218	日月股份	800	14,984.00	0.03
971	002388	新亚制程	2,600	14,924.00	0.03
972	002323	雅百特	2,900	14,732.00	0.03
973	002605	姚记扑克	2,000	14,700.00	0.03
974	603098	森特股份	1,200	14,664.00	0.03
975	002791	坚朗五金	1,200	14,628.00	0.03
976	000722	湖南发展	2,400	14,592.00	0.03
977	603996	中新科技	1,500	14,565.00	0.03
978	603848	好太太	600	14,214.00	0.03
979	002703	浙江世宝	2,850	14,107.50	0.03
980	603113	金能科技	1,000	14,070.00	0.03
981	603398	邦宝益智	800	13,768.00	0.03
982	603055	台华新材	900	13,275.00	0.03
983	603711	香飘飘	600	13,230.00	0.03
984	002801	微光股份	500	13,230.00	0.03
985	002762	金发拉比	1,850	13,209.00	0.03
986	300682	朗新科技	600	13,194.00	0.03
987	603861	白云电器	1,100	12,793.00	0.03
988	002786	银宝山新	2,000	12,400.00	0.03
989	603277	银都股份	1,000	12,260.00	0.02
990	603600	永艺股份	1,200	11,328.00	0.02
991	603958	哈森股份	1,100	11,000.00	0.02
992	603421	鼎信通讯	600	10,812.00	0.02
993	002895	川恒股份	500	10,550.00	0.02
994	603081	大丰实业	700	10,479.00	0.02
995	603803	瑞斯康达	800	10,360.00	0.02
996	300508	维宏股份	320	10,323.20	0.02
997	603557	起步股份	700	9,373.00	0.02
998	603063	禾望电气	800	9,048.00	0.02
999	603758	秦安股份	800	7,120.00	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	占基金资产净值比例（%）
1	000048	康达尔	4,200	91,980.00	0.19
2	600399	抚顺特钢	14,100	77,550.00	0.16
3	000029	深深房A	6,200	69,254.00	0.14
4	002263	*ST 东南	22,900	67,784.00	0.14
5	600784	鲁银投资	7,100	38,766.00	0.08
6	002260	*ST 德奥	3,600	17,064.00	0.03
7	000409	山东地矿	4,786	15,650.22	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	300176	鸿特科技	162,617.20	0.23
2	601699	潞安环能	153,736.00	0.21
3	300601	康泰生物	145,835.00	0.20
4	002507	涪陵榨菜	143,028.00	0.20
5	002821	凯莱英	108,890.00	0.15
6	000697	炼石有色	102,102.00	0.14
7	002727	一心堂	97,950.00	0.14
8	300558	贝达药业	97,289.00	0.14
9	600200	江苏吴中	88,624.00	0.12
10	603399	吉翔股份	87,071.00	0.12
11	000799	酒鬼酒	82,940.00	0.12
12	000507	珠海港	82,015.00	0.11
13	002292	奥飞娱乐	79,942.00	0.11
14	000710	贝瑞基因	78,865.00	0.11
15	601100	恒立液压	76,833.00	0.11
16	600146	商赢环球	74,100.00	0.10

17	601929	吉视传媒	72,880.00	0.10
18	300091	金通灵	71,898.00	0.10
19	600851	海欣股份	71,794.00	0.10
20	002020	京新药业	70,527.40	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	300418	昆仑万维	159,556.00	0.22
2	002600	领益智造	156,835.00	0.22
3	603885	吉祥航空	146,975.80	0.20
4	300308	中际旭创	105,268.00	0.15
5	002302	西部建设	103,016.00	0.14
6	002647	民盛金科	99,218.40	0.14
7	002625	光启技术	96,875.80	0.13
8	002509	天广中茂	88,757.56	0.12
9	000518	四环生物	87,901.00	0.12
10	600777	新潮能源	87,632.00	0.12
11	000980	众泰汽车	84,184.00	0.12
12	000735	罗牛山	79,942.00	0.11
13	600057	厦门象屿	77,419.00	0.11
14	002212	南洋股份	76,214.00	0.11
15	000553	沙隆达 A	67,315.00	0.09
16	600620	天宸股份	65,977.00	0.09
17	000042	中洲控股	62,626.00	0.09
18	600258	首旅酒店	62,486.00	0.09
19	000752	西藏发展	58,522.00	0.08
20	300086	康芝药业	57,835.50	0.08

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	7,820,756.16
卖出股票收入（成交）总额	16,483,086.48

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

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	2,836.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	682.33
5	应收申购款	146,335.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	149,855.08

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	600490	鹏欣资源	156,060.00	0.31	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	000048	康达尔	91,980.00	0.19	重大事项停牌
2	600399	抚顺特钢	77,550.00	0.16	重大事项停牌
3	000029	深深房 A	69,254.00	0.14	重大事项停牌
4	002263	*ST 东南	67,784.00	0.14	重大事项停牌
5	600784	鲁银投资	38,766.00	0.08	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	61	25,614.95	1,418,376.00	90.78%	144,136.00	9.22%
1000B	299	5,225.79	145.00	0.01%	1,562,367.00	99.99%
华宝中证1000指数分级	3,961	13,627.42	389,408.38	0.72%	53,588,811.96	99.28%
合计	4,321	13,215.28	1,807,929.38	3.17%	55,295,314.96	96.83%

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	1,417,560.00	90.72%
2	张志赟	16,675.00	1.07%
3	郑建伟	14,618.00	0.94%
4	郑志	13,869.00	0.89%
5	梁小红	13,598.00	0.87%
6	黄晖	12,398.00	0.79%
7	曾亭曦	6,900.00	0.44%
8	孙大威	6,663.00	0.43%
9	曲惠琴	6,482.00	0.41%
10	邵文杰	5,911.00	0.38%

1000B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	朱金元	339,291.00	21.71%
2	祝东华	156,463.00	10.01%
3	吴天爵	81,056.00	5.19%
4	谢锦星	50,722.00	3.25%

5	杨玉锋	42,314.00	2.71%
6	张珊珊	40,050.00	2.56%
7	刘文卿	35,311.00	2.26%
8	王跃文	28,194.00	1.80%
9	施春阳	26,500.00	1.70%
10	姚焕炯	25,724.00	1.65%

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	-	-
	1000B	-	-
	华宝中证 1000 指数分级	34,772.18	0.0644%
	合计	34,772.18	0.0609%

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	7,220,835.00	7,220,835.00	93,613,788.63
本报告期基金总申购份额	-	-	4,562,522.01
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	15,376,680.33
本报告期基金拆分变动份额(份额减少 以“-”填列)	-5,658,323.00	-5,658,323.00	-28,821,409.97
本报告期期末基金份额总额	1,562,512.00	1,562,512.00	53,978,220.34

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

2018年4月11日,经公司董事会审议通过,聘任李慧勇为公司副总经理。该事项经中国证券投资基金业协会备案,并在指定媒体上披露。

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	
天风证券	2	9,854,150.90	40.58%	8,993.32	40.14%	-
长江证券	1	4,202,628.80	17.31%	3,914.15	17.47%	-
东吴证券	1	2,095,664.32	8.63%	1,951.61	8.71%	-
国泰君安	2	1,995,375.00	8.22%	1,858.73	8.30%	-
东北证券	1	1,573,475.00	6.48%	1,465.38	6.54%	-
东方证券	2	1,237,516.00	5.10%	1,152.45	5.14%	-
中泰证券	2	664,292.80	2.74%	605.31	2.70%	-
东兴证券	1	645,846.93	2.66%	588.61	2.63%	-
中信证券	2	580,850.40	2.39%	540.99	2.41%	-
国信证券	1	323,874.00	1.33%	301.60	1.35%	-
华创证券	1	284,178.00	1.17%	264.69	1.18%	-
民生证券	1	231,011.00	0.95%	215.22	0.96%	-
方正证券	2	190,792.79	0.79%	177.86	0.79%	-
瑞银证券	1	146,018.00	0.60%	136.07	0.61%	-
中金国际	1	129,253.00	0.53%	120.43	0.54%	-
太平洋证券	2	125,777.50	0.52%	117.22	0.52%	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-

东海证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	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动。

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
天风证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金招募说明书（更新）摘要	上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站	2018 年 1 月 16 日
2	华宝中证 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、证券时报以及基金管理人网站	2018 年 1 月 16 日
3	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加南京苏宁基金销售有限公司为代销机构及费率优惠的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站	2018 年 1 月 17 日
4	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海基煜基金销售有限公司为代销机构及费率优惠的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站	2018 年 1 月 17 日
5	华宝中证 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、证券时报以及基金管理人网站	2018 年 1 月 20 日
6	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站	2018 年 1 月 22 日
7	华宝中证 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、证券时报以及基金管理人网站	2018 年 2 月 1 日
8	关于调整华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 B 类份额折算基准日证券简称的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站	2018 年 2 月 2 日
9	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站	2018 年 2 月 2 日
10	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务期间暂停及恢复申购、赎回、定期定额投资业务、转托管、配对转换业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站	2018 年 2 月 2 日
11	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金	上海证券报、中国证	2018 年 2 月 2 日

	基金不定期份额折算期间1000B的风险提示公告	券报、证券时报以及基金管理人网站	
12	关于华宝中证1000指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务期间1000A、1000B停复牌的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站	2018年2月5日
13	关于华宝中证1000指数分级证券投资基金不定期份额折算后1000A和1000B前收盘价调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站	2018年2月6日
14	关于华宝中证1000指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站	2018年2月6日
15	华宝基金公司关于旗下部分基金增加西南证券为代销机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站	2018年3月19日
16	华宝中证1000指数分级证券投资基金2017年度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站	2018年3月27日
17	华宝中证1000指数分级证券投资基金2017年度报告（摘要）	上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站	2018年3月27日
18	华宝基金管理有限公司关于旗下基金修订基金合同有关条款的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站	2018年3月28日
19	华宝基金公司关于旗下部分公募基金增加广发证券为代销机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站	2018年3月30日
20	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海万得基金销售有限公司为代销机构及费率优惠的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站	2018年4月16日
21	华宝中证1000指数分级证券投资基金2018年第1季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报以及基金管理人网站	2018年4月21日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

1、基金管理人于 2018 年 3 月 28 日发布《华宝基金管理有限公司关于旗下基金修订基金合同有关条款的公告》，公司根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》，对旗下部分基金基金合同有关条款进行修订并相应修订了托管协议，具体修订内容详见公司公告，请投资者予以关注。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

12.3 查阅方式

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

华宝基金管理有限公司

2018 年 8 月 24 日