

华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2018 年年度报告

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2019 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§ 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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.9 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.....	17
§ 5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
§ 6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
§ 7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	25
7.4 报表附注.....	27
§ 8 投资组合报告	56
8.1 期末基金资产组合情况.....	56
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	56
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	94
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	96
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	97
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	97

8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	97
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	97
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	97
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	97
8.12	投资组合报告附注	97
§9	基金份额持有人信息	99
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	99
9.2	期末上市基金前十名持有人	99
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	100
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	100
§10	开放式基金份额变动	102
§11	重大事件揭示	103
11.1	基金份额持有人大会决议	103
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	103
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	103
11.4	基金投资策略的改变	103
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	103
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	103
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	103
11.8	其他重大事件	106
§12	影响投资者决策的其他重要信息	111
§13	备查文件目录	111
13.1	备查文件目录	111
13.2	存放地点	111
13.3	查阅方式	111

§ 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		
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	60,180,650.42 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
下属分级基金的场内简称	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	1,598,464.00 份	1,598,464.00 份	56,983,722.42 份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常情况下，本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。
投资策略	本基金原则上采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成

	<p>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	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、	010—67595096

	021-38924558	
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	《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金年度报告备置地点	本基金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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-11,514,960.51	-7,585,252.22	-26,938,665.53
本期利润	-22,718,230.72	-13,338,496.79	-29,529,606.35
加权平均基金份额本期利润	-0.3617	-0.1135	-0.1912
本期加权平均净值利润率	-43.49%	-14.90%	-23.23%
本期基金份额净值增长率	-35.99%	-14.42%	-19.19%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	-108,584,959.73	-99,663,522.64	-115,486,611.86
期末可供分配基金份额利润	-1.8043	-0.9223	-0.8904
期末基金资产净值	40,186,333.58	71,923,861.62	104,976,629.34
期末基金份额净值	0.6678	0.6656	0.8094
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值增长率	-72.99%	-57.79%	-50.68%

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、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。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

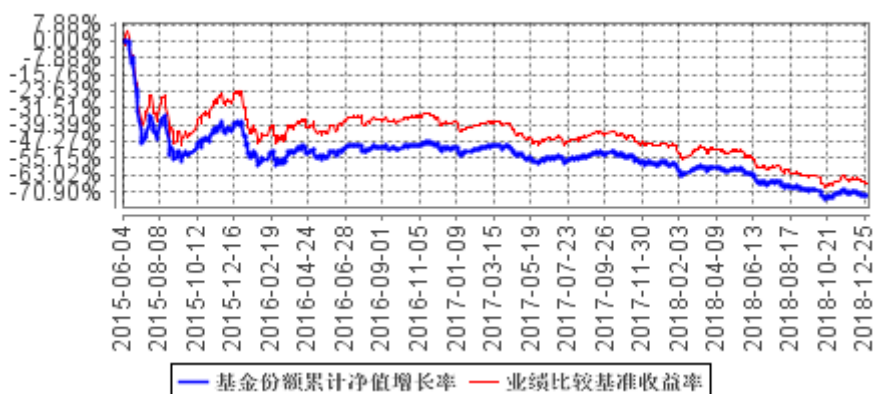
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-10.72%	1.76%	-10.59%	1.80%	-0.13%	-0.04%
过去六个月	-20.43%	1.50%	-20.00%	1.54%	-0.43%	-0.04%

过去一年	-35.99%	1.45%	-35.29%	1.48%	-0.70%	-0.03%
过去三年	-55.74%	1.51%	-56.17%	1.53%	0.43%	-0.02%
自基金合同生效日起至 今	-72.99%	1.89%	-66.96%	1.92%	-6.03%	-0.03%

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

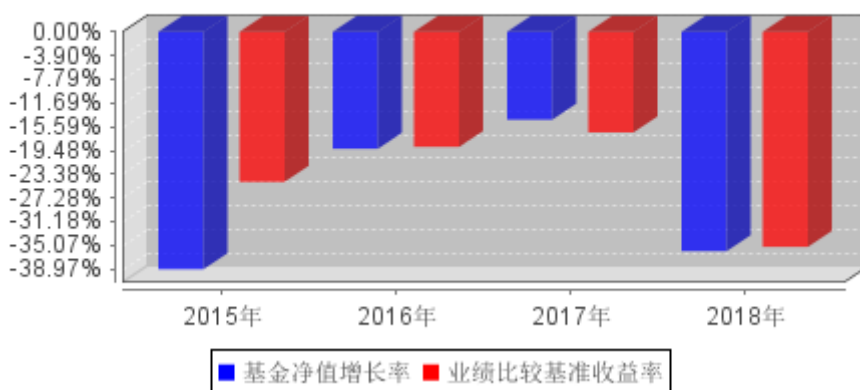
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2015 年 6 月 4 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未实施利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人是 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 12 月 31 日），正在管理运作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、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、华宝银行 ETF、华宝银行 ETF 联接基金、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、华宝宝丰高等级债券基金、华宝绿色主题基金、华宝沪港深价值基金等，正在管理运作的证券投资基金资产净值合计 167,457,512,458.20 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		
丰晨成	本基金基金 经理、上证 180 价值 ETF、华宝上 证 180 价值	2018 年 8 月 24 日	-	9 年	硕士。2009 年加入华宝基金管理有限公司，先后担任助理产品经理、数量分析师、投资经理助理、投资经理等职务。2015 年 11 月起任上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 180

	ETF 联接、华宝中证全指证券公司 ETF、华宝中证 500 增强、华宝券商 ETF 联接基金经理				价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2016 年 8 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2018 年 4 月起任华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2018 年 6 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2018 年 8 月起任华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金经理。
胡洁	本基金经理、量化投资部副总经理、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、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	2015 年 6 月 4 日	2018 年 8 月 24 日	12 年	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，现任量化投资部副总经理。2012 年 10 月起任上证 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。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 月至 2018 年 8 月任华宝中证 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 月起任华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，2017 年 7 月起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。2019 年 1 月起任华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。
张奇	本基金经理	2017 年 4	-	8 年	本科。曾先后在毕博管理咨询有限公司、

	经理助理、华宝中证医疗指数分级、上证 180 价值 ETF、华宝上证 180 价值 ETF 联接、华宝业中证军工 ETF、华宝中证银行 ETF 基金经理助理	月 6 日		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 月至 2018 年 11 月兼任上证 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 月至 2019 年 1 月任华宝中证医疗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，2017 年 4 月起任华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金经理助理，2019 年 1 月起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、《华宝基金管理有限公司华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

基金管理人从研究分析、授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节

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

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

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

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

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

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

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

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年全年 A 股市场呈现振荡走低的格局，受民企信用债违约、股票质押风险暴露、中美贸易战等因素下，中小盘股票相对于大市值股票的跌幅更多。中证 1000 指数作为 A 股市场小盘股的典型代表，其成分股中的民营企业占比较高，受宏观经济增速放缓预期加之贸易战带来的未来进出口的悲观预期，加之部分上市公司的信用问题暴露、大股东股权质押比例高等问题产生连锁影响，使得市场对于整个中小市值公司产生悲观预期的叠加，2018 年该类上市公司的估值水平在持续向下修正。

本报告期为本基金的正常运作期，在实际操作中，我们遵守基金合同，按照既定的投资策略达到投资目标。

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 -35.99%，同期业绩比较基准收益率为 -35.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中证 1000 指数作为 A 股市场小盘股的典型代表，在 2017、2018 年中小市值股票跌幅较大市值股票明显要多，在经历了 2015 年以来小盘股的估值逐渐回归正常并向着大盘股估值水平逐渐收敛，同时从历史回顾来看，大盘股和中小盘股的相对强弱具有周期性，对于中证 1000 指数在 2019

年的表现我们相对积极。

作为指数基金的管理人，我们将继续遵守基金合同，按照既定的指数化投资策略，积极应对成分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。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

公司自 2003 年 3 月成立以来始终注重合规性和业务风险控制。加强对基金运作的内部操作风险控制、保障基金份额持有人的利益始终是公司制定各项内部制度、流程的指导思想。公司监察稽核部门对公司遵守各项法规和管理制度及公司所管理的各基金履行合同义务的情况进行核查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向监管部门、公司管理层及上级公司出具相关报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

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

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

（三）有重点地全面开展内部审计稽核工作。2018 年，监察稽核部门按计划对公司营运、投资、市场部门进行了业务审计、依据《证券期货投资者适当性管理办法》对公司相关内部流程进行了差异性评估、根据监管要求开展了涉及投研、运营、销售等方面的专项自查；并与相关部门进行沟通，形成后续跟踪和业务上相互促进的良性循环，不断提高工作质量。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会和基金合

同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

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

（1）日常估值流程

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

（2）特殊业务估值流程

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期亏损，未有应分未分的利润。

4.9 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

本基金基金合同生效于2015年6月4日，截至2018年12月31日，本基金基金资产净值已连续超过六十个工作日低于5000万元。根据相关规定，基金管理人已向证监会提交本基金变更注册的申请，并已获证监会审批通过。后续基金管理人将付诸实施，并及时履行信息披露义务。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期，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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第 21758 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了华宝中证 1000 指数分级证券投资基金(以下简称“华宝中证 1000 指数基金”)的财务报表,包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表,2018 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了华宝中证 1000 指数基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华宝中证 1000 指数基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>华宝中证 1000 指数基金的基金管理人华宝基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误</p>

	<p>导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华宝中证 1000 指数基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华宝中证 1000 指数基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督华宝中证 1000 指数基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p>

	<p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时, 根据获取的审计证据, 就可能对导致对华宝中证 1000 指数基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性, 审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露; 如果披露不充分, 我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而, 未来的事项或情况可能导致华宝中证 1000 指数基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露), 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>普华永道中天 会计师事务所(特殊普通合伙)</p>	
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>陈熹</p>	<p>曹阳</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>中国·上海市</p>	
<p>审计报告日期</p>	<p>2019 年 3 月 26 日</p>	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华宝中证 1000 指数分级证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	2,632,693.09	4,357,559.83
结算备付金		-	659.67
存出保证金		818.24	3,423.38
交易性金融资产	7.4.7.2	37,797,465.57	67,809,162.38
其中：股票投资		37,797,465.57	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		30,510.65	-
应收利息	7.4.7.5	570.91	997.97
应收股利		-	-
应收申购款		26,802.88	90,705.86
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		40,488,861.34	72,262,509.09
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	1.20
应付赎回款		72,229.05	24,210.13
应付管理人报酬		35,633.00	62,259.51
应付托管费		7,839.26	13,697.09
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	66,562.70	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	7.4.7.8	120,263.75	150,011.50
负债合计		302,527.76	338,647.47
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	148,771,293.31	170,411,754.42
未分配利润	7.4.7.10	-108,584,959.73	-98,487,892.80
所有者权益合计		40,186,333.58	71,923,861.62
负债和所有者权益总计		40,488,861.34	72,262,509.09

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，华宝中证 1000 基础份额基金份额净值 0.6678 元，基金份额总额 56,983,722.42 份；华宝中证 1000A 份额基金份额参考净值 1.0026 元，基金份额总额 1,598,464.00 份；华宝中证 1000B 份额基金份额参考净值 0.3330 元，基金份额总额 1,598,464.00 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-21,689,726.15	-11,740,361.71
1.利息收入		24,981.14	40,269.51
其中：存款利息收入	7.4.7.11	24,981.14	40,265.34
债券利息收入		-	4.17
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）		-10,525,462.99	-6,051,543.73
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-10,984,857.80	-6,519,909.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	5,533.29
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	459,394.81	462,832.31
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-11,203,270.21	-5,753,244.57
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	14,025.91	24,157.08
减：二、费用		1,028,504.57	1,598,135.08
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	522,988.67	898,221.32
2. 托管费	7.4.10.2.2	115,057.48	197,608.64
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	7.4.7.19	59,998.42	111,085.12
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	330,460.00	391,220.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-22,718,230.72	-13,338,496.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-22,718,230.72	-13,338,496.79

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝中证 1000 指数分级证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	-22,718,230.72	-22,718,230.72
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）	-21,640,461.11	12,621,163.79	-9,019,297.32
其中：1. 基金申购款	23,375,617.12	-15,466,937.73	7,908,679.39
2. 基金赎回款	-45,016,078.23	28,088,101.52	-16,927,976.71

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）	148,771,293.31	-108,584,959.73	40,186,333.58
项目	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	-13,338,496.79	-13,338,496.79
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）	-42,457,349.19	22,743,078.26	-19,714,270.93
其中：1. 基金申购款	12,103,309.67	-6,606,632.31	5,496,677.36
2. 基金赎回款	-54,560,658.86	29,349,710.57	-25,210,948.29
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）	170,411,754.42	-98,487,892.80	71,923,861.62

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

黄小蕙

向辉

张幸骏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

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

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

内华宝中证 1000 基础份额按照 1:1 的份额配比转换成 1 份华宝中证 1000A 份额与 1 份华宝中证 1000B 份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每 1 份华宝中证 1000A 份额与 1 份华宝中证 1000B 份额按照 1:1 的基金份额配比转换成 2 份场内华宝中证 1000 基础份额的行为。

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

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

除以上的定期份额折算外，当华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时，或当华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元时，本基金将进行不定期份额折算(基金管理人可根据市场情况确定基金份额不定期折算基准日)：份额折算后本基金将确保华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的比例为 1:1，份额折算后华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值、华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值和华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值均调整为 1.0000 元。当华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时，

基金份额折算基准日折算前华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值及华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值超出 1.0000 元的部分均将折算为华宝中证 1000 基础份额分别分配给华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的持有人。当华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元时，华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的份额数将相应缩减。

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

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

本财务报表由本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2019 年 3 月 26 日批准报出。

7.4.2 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 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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2018 年 12 月 31 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 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 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本

基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，在存续期内，本基金（包括华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额与华宝中证 1000B 份额）不进行收益分配。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[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》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

（2）对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[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》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照中证指

数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
活期存款	2,632,693.09	4,357,559.83
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	2,632,693.09	4,357,559.83

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	66,238,908.09	37,797,465.57	-28,441,442.52

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		66,238,908.09	37,797,465.57	-28,441,442.52
项目	上年度末 2017年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票		85,047,334.69	67,809,162.38	-17,238,172.31
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		85,047,334.69	67,809,162.38	-17,238,172.31

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末及上年度末未持买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	570.06	995.56
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	-	0.33
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	0.41	0.32
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	0.44	1.76
合计	570.91	997.97

7.4.7.6 其他资产

本基金本期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	66,562.70	88,468.04
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	66,562.70	88,468.04

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	263.75	11.50
预提费用	70,000.00	100,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	120,263.75	150,011.50

7.4.7.9 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 12 月 31 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	-38,165,142.75	-
本期申购	8,055,955.01	20,570,249.62
本期赎回（以“-”号填列）	-14,512,630.40	-37,080,392.44
本期末	60,180,650.42	148,771,293.31

注：

1. 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。

2. 本基金在 2018 年度共发生以下 2 次折算：

(1) 根据《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定和华宝基金管理有限公司于 2018 年 2 月 6 日发布的《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》，本基金以 2018 年 2 月 2 日为不定期折算基准日，进行不定期份额折算。折算前，华宝中证 1000 基础份额场外份额和场内份额分别为 89,341,201.56 份和 1,140,797.00 份，根据份额折算公式，份额折算比例为 0.617012326，折算后华宝中证 1000 基础份额场外份额和场内份额分别为 55,124,622.59 份和 703,885.00 份，份额净值为 1.0000 元。折算前，华宝中证 1000A 份额总额为 7,160,235.00 份，根据份额折算公式，份额折算比例为 0.226641091，折算后华宝中证 1000A 份额总额为 1,622,803.00 份，份额净值为 1.0000 元，新增华宝中证 1000 基础份额场内份额 5,590,299.00 份。折算前，华宝中证 1000B 份额总额为 7,160,235.00 份，根据份额折算公式，份额折算比例为 0.226641091，折算后华宝中证 1000B 份额总额为 1,622,803.00 份，份额净值为 1.0000 元。

(2) 根据《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定和华宝基金管理有限公司于 2018 年 12 月 18 日发布的《华宝基金管理有限公司关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告》，本基金以 2018 年 12 月 14 日为定期折算基准日，进行定期份额折算。折算前，华宝中证 1000 基础份额场外份额和场内份额分别为 54,290,851.24 份和 642,840.00 份，根据份额折算公式，新增份额折算比例为 0.033941008，折算后华宝中证 1000 基础份额场外份额和场内份额分别为 56,133,537.46 份和 773,067.00 份（含华宝中证 1000A 份额经折算后产生的新增华宝中证 1000 基础份额场内份额），份额净值为 0.699 元。折算前，华宝中证 1000A 份额总额为 1,597,035.00 份，根据份额折算公式，新增份额折算比例为 0.067882015，折算后华宝中证 1000A 份额总额为 1,597,035.00 份，份额净值为 1.000 元。

3. 截至 2018 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 3,966,308.00 份（其中华宝中证 1000 基础份额为 769,380.00 份，华宝中证 1000A 份额与华宝中证 1000B 份额均为 1,598,464.00 份），托管在场外未上市交易的基金份额为 56,214,342.42 份，均为华宝中证 1000 基础份额（2017 年 12 月 31 日：本基金于深交所上市的基金份额为 15,622,968.00 份（其中华宝中证 1000 基础份额为 1,181,298.00 份，华宝中证 1000A 份额与华宝中证 1000B 份额均为 7,220,835.00 份），托管在场外未上市交易的基金份额为 92,432,490.63 份，均为华宝中证 1000 基础份额）。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-99,663,522.64	1,175,629.84	-98,487,892.80
本期利润	-11,514,960.51	-11,203,270.21	-22,718,230.72
本期基金份额交易产生的变动数	12,747,655.73	-126,491.94	12,621,163.79
其中：基金申购款	-14,600,803.27	-866,134.46	-15,466,937.73
基金赎回款	27,348,459.00	739,642.52	28,088,101.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-98,430,827.42	-10,154,132.31	-108,584,959.73

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
活期存款利息收入	24,671.85	39,811.70
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	230.99	362.55
其他	78.30	91.09
合计	24,981.14	40,265.34

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018	2017年1月1日至2017年

	年 12 月 31 日	12 月 31 日
卖出股票成交总额	22,980,099.28	43,745,421.65
减：卖出股票成本总额	33,964,957.08	50,265,330.98
买卖股票差价收入	-10,984,857.80	-6,519,909.33

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-	5,533.29
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-	5,533.29

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	-	31,737.46
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	-	26,200.00
减：应收利息总额	-	4.17
买卖债券差价收入	-	5,533.29

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	459,394.81	462,832.31
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	459,394.81	462,832.31

7.4.7.17 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-11,203,270.21	-5,753,244.57
——股票投资	-11,203,270.21	-5,753,244.57
——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	-11,203,270.21	-5,753,244.57

7.4.7.18 其他收入

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 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	13,507.48	17,463.44
其他	518.43	6,693.64
合计	14,025.91	24,157.08

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。

7.4.7.19 交易费用

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 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	59,998.42	111,085.12
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	59,998.42	111,085.12

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	30,000.00	90,000.00
基金上市费	60,000.00	60,000.00
其他	50.00	-
银行汇划费用	410.00	1,220.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
合计	330,460.00	391,220.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华宝基金管理有限公司（“华宝基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
华宝信托有限责任公司（“华宝信托”）	基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.）	自 2017 年 10 月 17 日起，系基金管理人的股东
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：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 2017 年 10 月 17 日，华宝基金管理有限公司正式完成上海市工商局变更登记备案手续，变更后的股权结构为：华宝信托有限责任公司持股 51%，Warburg Pincus Asset Management, L.P. 持股 49%。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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	0.29%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 权证交易

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权证交易。

7.4.10.1.5 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 12 月 31 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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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	0.29%	-	-

注：

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	522,988.67	898,221.32
其中：支付销售机构的客户维护费	217,048.81	331,620.14

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 1.00% 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 × 1.00% / 当年天数。

7.4.10.2.2 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 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	115,057.48	197,608.64

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 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	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	2,632,693.09	24,671.85	4,357,559.83	39,811.70

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比较期均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000029	深深房 A	2016 年 9 月 14 日	重大事项停牌	11.17	-	-	6,200	81,266.58	69,254.00	-
002323	*ST 百特	2018 年 8 月 17 日	重大事项停牌	1.31	-	-	2,900	40,046.79	3,799.00	-

注：本基金截至 2018 年 12 月 31 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、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及基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；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。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款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，违约风险

可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2018 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2017 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2018 年 12 月 31 日，除附注中列示的卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上

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%。于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.18%。

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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,632,693.09	-	-	-	2,632,693.09
存出保证金	818.24	-	-	-	818.24
交易性金融资产	-	-	-37,797,465.57	-	37,797,465.57
应收证券清算款	-	-	-	30,510.65	30,510.65
应收利息	-	-	-	570.91	570.91
应收申购款	1,002.81	-	-	25,800.07	26,802.88
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,634,514.14	-	-37,854,347.20	-	40,488,861.34
负债					
应付赎回款	-	-	-	72,229.05	72,229.05
应付管理人报酬	-	-	-	35,633.00	35,633.00
应付托管费	-	-	-	7,839.26	7,839.26
应付交易费用	-	-	-	66,562.70	66,562.70
其他负债	-	-	-	120,263.75	120,263.75
负债总计	-	-	-	302,527.76	302,527.76
利率敏感度缺口	2,634,514.14	-	-37,551,819.44	-	40,186,333.58
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，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2017 年 12 月 31 日：同），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）。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 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	37,797,465.57	94.06	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	37,797,465.57	94.06	67,809,162.38	94.28

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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 12 月 31 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	2,001,388.72	3,580,772.96
	2. 业绩比较基准下降 5%	-2,001,388.72	-3,580,772.96

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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 12 月 31 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 37,724,412.57 元，属于第二层次的余额为 73,053.00 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

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 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(2017 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。

(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。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	37,797,465.57	93.35
	其中：股票	37,797,465.57	93.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,632,693.09	6.50
8	其他各项资产	58,702.68	0.14
9	合计	40,488,861.34	100.00

注：由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	416,031.90	1.04
B	采矿业	810,795.66	2.02
C	制造业	23,766,928.39	59.14

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,072,231.70	2.67
E	建筑业	1,067,182.96	2.66
F	批发和零售业	1,370,873.93	3.41
G	交通运输、仓储和邮政业	871,505.24	2.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,042,872.10	10.06
J	金融业	277,582.80	0.69
K	房地产业	1,374,634.29	3.42
L	租赁和商务服务业	394,516.14	0.98
M	科学研究和技术服务业	510,489.50	1.27
N	水利、环境和公共设施管理业	483,186.10	1.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	27,384.00	0.07
Q	卫生和社会工作	311,102.80	0.77
R	文化、体育和娱乐业	652,369.56	1.62
S	综合	274,725.50	0.68
	合计	37,724,412.57	93.87

8.2.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供	-	-

	应业		
E	建筑业	3,799.00	0.01
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	0.17
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	73,053.00	0.18

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000977	浪潮信息	11,400	181,488.00	0.45

2	300176	派生科技	3,890	147,353.20	0.37
3	300601	康泰生物	3,945	141,152.10	0.35
4	002821	凯莱英	1,800	122,130.00	0.30
5	600873	梅花生物	27,600	116,472.00	0.29
6	002138	顺络电子	8,300	114,872.00	0.29
7	600763	通策医疗	2,400	113,928.00	0.28
8	000735	罗牛山	11,700	113,022.00	0.28
9	300012	华测检测	16,900	110,695.00	0.28
10	600675	中华企业	19,400	108,252.00	0.27
11	600745	闻泰科技	4,900	103,537.00	0.26
12	300203	聚光科技	4,000	102,600.00	0.26
13	300009	安科生物	7,632	101,963.52	0.25
14	002168	深圳惠程	10,300	101,867.00	0.25
15	300271	华宇软件	6,780	101,767.80	0.25
16	000917	电广传媒	14,400	99,648.00	0.25
17	000516	国际医学	20,100	99,495.00	0.25
18	600728	佳都科技	14,380	99,078.20	0.25
19	600273	嘉化能源	10,900	97,991.00	0.24
20	000040	东旭蓝天	13,200	95,436.00	0.24
21	600132	重庆啤酒	3,100	95,263.00	0.24
22	300285	国瓷材料	5,700	95,019.00	0.24
23	300073	当升科技	3,300	91,377.00	0.23
24	000883	湖北能源	24,800	91,016.00	0.23
25	600252	中恒集团	35,400	90,978.00	0.23
26	002376	新北洋	5,900	90,506.00	0.23
27	600486	扬农化工	2,400	90,384.00	0.22
28	002383	合众思壮	7,600	89,908.00	0.22
29	600771	广誉远	3,100	89,497.00	0.22

30	002812	恩捷股份	1,800	88,938.00	0.22
31	002185	华天科技	21,700	88,102.00	0.22
32	300170	汉得信息	8,900	87,042.00	0.22
33	002341	新纶科技	7,300	86,724.00	0.22
34	300014	亿纬锂能	5,481	86,161.32	0.21
35	601799	星宇股份	1,800	85,500.00	0.21
36	300628	亿联网络	1,100	85,426.00	0.21
37	300036	超图软件	4,600	84,318.00	0.21
38	300207	欣旺达	9,800	84,182.00	0.21
39	000301	东方盛虹	15,400	84,084.00	0.21
40	000683	远兴能源	35,340	83,755.80	0.21
41	300558	贝达药业	2,600	83,122.00	0.21
42	300038	数知科技	8,860	82,663.80	0.21
43	002537	海联金汇	7,980	81,795.00	0.20
44	600323	瀚蓝环境	5,800	81,374.00	0.20
45	600320	振华重工	25,380	80,454.60	0.20
46	300180	华峰超纤	7,200	80,280.00	0.20
47	002035	华帝股份	9,030	79,915.50	0.20
48	002023	海特高新	7,700	79,695.00	0.20
49	002157	正邦科技	15,000	79,650.00	0.20
50	300068	南都电源	5,600	79,632.00	0.20
51	300188	美亚柏科	6,100	79,422.00	0.20
52	603939	益丰药房	1,900	79,230.00	0.20
53	000591	太阳能	26,760	79,209.60	0.20
54	000968	蓝焰控股	7,400	78,810.00	0.20
55	601011	宝泰隆	14,300	78,650.00	0.20
56	601636	旗滨集团	20,500	77,900.00	0.19
57	600702	舍得酒业	3,400	77,588.00	0.19

58	600803	新奥股份	7,800	77,532.00	0.19
59	600797	浙大网新	10,700	77,147.00	0.19
60	600596	新安股份	7,200	76,968.00	0.19
61	002126	银轮股份	10,200	75,888.00	0.19
62	002396	星网锐捷	4,400	75,768.00	0.19
63	300098	高新兴	11,163	75,461.88	0.19
64	600711	盛屯矿业	16,300	74,491.00	0.19
65	000902	新洋丰	8,300	74,368.00	0.19
66	000697	炼石航空	6,000	74,340.00	0.18
67	600490	鹏欣资源	16,100	73,255.00	0.18
68	300377	赢时胜	6,600	72,864.00	0.18
69	000059	华锦股份	12,200	72,468.00	0.18
70	300226	上海钢联	1,586	72,210.58	0.18
71	600529	山东药玻	3,800	72,200.00	0.18
72	600612	老凤祥	1,600	72,000.00	0.18
73	002061	浙江交科	7,000	71,890.00	0.18
74	002610	爱康科技	45,700	71,749.00	0.18
75	300078	思创医惠	7,124	70,812.56	0.18
76	002025	航天电器	3,300	70,719.00	0.18
77	002697	红旗连锁	13,740	70,486.20	0.18
78	600604	市北高新	9,100	70,161.00	0.17
79	000918	嘉凯城	9,200	70,104.00	0.17
80	300222	科大智能	4,520	70,060.00	0.17
81	300212	易华录	3,380	70,033.60	0.17
82	002047	宝鹰股份	10,200	69,870.00	0.17
83	002643	万润股份	6,900	69,828.00	0.17
84	300037	新宙邦	2,900	69,745.00	0.17
85	002151	北斗星通	3,300	69,630.00	0.17

86	603517	绝味食品	2,100	69,531.00	0.17
87	002511	中顺洁柔	8,155	69,480.60	0.17
88	300451	创业慧康	3,600	68,940.00	0.17
89	000800	一汽轿车	10,400	68,848.00	0.17
90	600845	宝信软件	3,300	68,805.00	0.17
91	600868	梅雁吉祥	24,100	68,685.00	0.17
92	002597	金禾实业	4,300	68,327.00	0.17
93	002618	丹邦科技	4,950	68,161.50	0.17
94	300476	胜宏科技	5,820	68,094.00	0.17
95	002419	天虹股份	6,100	66,917.00	0.17
96	300496	中科创达	3,027	66,896.70	0.17
97	300357	我武生物	1,800	66,582.00	0.17
98	300529	健帆生物	1,600	66,400.00	0.17
99	002421	达实智能	16,900	66,248.00	0.16
100	002449	国星光电	6,330	65,705.40	0.16
101	300457	赢合科技	2,350	65,447.50	0.16
102	601222	林洋能源	13,508	65,378.72	0.16
103	300149	量子生物	4,400	64,372.00	0.16
104	600185	格力地产	15,780	63,909.00	0.16
105	300284	苏交科	6,160	63,879.20	0.16
106	300355	蒙草生态	16,300	63,407.00	0.16
107	002042	华孚时尚	11,650	63,259.50	0.16
108	002313	日海智能	2,800	63,224.00	0.16
109	000831	五矿稀土	7,500	62,775.00	0.16
110	600756	浪潮软件	4,100	62,689.00	0.16
111	600337	美克家居	15,800	62,410.00	0.16
112	600305	恒顺醋业	6,000	62,400.00	0.16
113	600446	金证股份	6,500	61,750.00	0.15

114	601058	赛轮轮胎	27,540	61,414.20	0.15
115	002557	洽洽食品	3,200	60,928.00	0.15
116	000793	华闻传媒	20,300	60,291.00	0.15
117	000650	仁和药业	11,000	60,280.00	0.15
118	002089	新海宜	14,000	60,200.00	0.15
119	600175	美都能源	27,300	60,060.00	0.15
120	000836	富通鑫茂	15,400	59,906.00	0.15
121	300079	数码科技	18,200	59,878.00	0.15
122	000150	宜华健康	4,060	59,803.80	0.15
123	600562	国睿科技	4,632	59,613.84	0.15
124	601918	新集能源	19,800	59,598.00	0.15
125	600783	鲁信创投	3,800	59,584.00	0.15
126	002488	金固股份	8,950	59,338.50	0.15
127	600110	诺德股份	14,600	59,276.00	0.15
128	002262	恩华药业	6,536	58,954.72	0.15
129	002203	海亮股份	7,500	58,950.00	0.15
130	002237	恒邦股份	7,000	58,660.00	0.15
131	002389	航天彩虹	4,800	58,608.00	0.15
132	600740	山西焦化	7,300	58,473.00	0.15
133	300458	全志科技	2,906	58,120.00	0.14
134	600269	赣粤高速	14,900	58,110.00	0.14
135	300294	博雅生物	2,150	58,028.50	0.14
136	601375	中原证券	13,600	57,936.00	0.14
137	000034	神州数码	4,300	57,835.00	0.14
138	002614	奥佳华	3,600	57,420.00	0.14
139	600057	厦门象屿	13,726	57,374.68	0.14
140	300367	东方网力	6,450	57,211.50	0.14
141	300137	先河环保	7,000	57,050.00	0.14

142	600326	西藏天路	8,800	57,024.00	0.14
143	603043	广州酒家	2,100	56,868.00	0.14
144	601929	吉视传媒	27,700	56,785.00	0.14
145	600123	兰花科创	8,700	56,724.00	0.14
146	000933	神火股份	14,500	56,550.00	0.14
147	002497	雅化集团	8,500	56,440.00	0.14
148	002091	江苏国泰	10,060	56,336.00	0.14
149	000818	航锦科技	6,100	56,303.00	0.14
150	600641	万业企业	6,200	56,296.00	0.14
151	000429	粤高速 A	6,700	56,213.00	0.14
152	603323	吴江银行	9,200	56,212.00	0.14
153	000036	华联控股	10,200	56,202.00	0.14
154	600330	天通股份	10,180	56,091.80	0.14
155	600210	紫江企业	15,400	56,056.00	0.14
156	002099	海翔药业	12,400	56,048.00	0.14
157	600226	瀚叶股份	20,006	56,016.80	0.14
158	603678	火炬电子	3,550	55,983.50	0.14
159	000560	我爱我家	11,980	55,946.60	0.14
160	300616	尚品宅配	920	55,908.40	0.14
161	300482	万孚生物	2,200	55,902.00	0.14
162	002020	京新药业	6,500	55,900.00	0.14
163	000739	普洛药业	7,500	55,800.00	0.14
164	600116	三峡水利	7,600	55,632.00	0.14
165	300747	锐科激光	400	55,040.00	0.14
166	300054	鼎龙股份	8,640	55,036.80	0.14
167	601588	北辰实业	20,300	55,013.00	0.14
168	002737	葵花药业	3,700	54,686.00	0.14
169	600667	太极实业	10,700	54,677.00	0.14

170	600200	江苏吴中	9,200	54,464.00	0.14
171	300326	凯利泰	6,400	54,400.00	0.14
172	002402	和而泰	8,750	54,075.00	0.13
173	002413	雷科防务	10,100	54,035.00	0.13
174	000875	吉电股份	21,900	53,655.00	0.13
175	300102	乾照光电	9,200	53,636.00	0.13
176	300185	通裕重工	33,300	53,613.00	0.13
177	000035	中国天楹	10,300	53,560.00	0.13
178	002382	蓝帆医疗	3,600	53,496.00	0.13
179	002073	软控股份	11,800	53,454.00	0.13
180	603660	苏州科达	3,200	53,344.00	0.13
181	002727	一心堂	3,000	53,340.00	0.13
182	002108	沧州明珠	12,642	53,222.82	0.13
183	000989	九芝堂	5,405	53,023.05	0.13
184	000603	盛达矿业	5,300	53,000.00	0.13
185	603718	海利生物	4,185	52,982.10	0.13
186	600559	老白干酒	4,281	52,913.16	0.13
187	002716	金贵银业	8,620	52,840.60	0.13
188	600491	龙元建设	7,800	52,806.00	0.13
189	000507	珠海港	8,000	52,800.00	0.13
190	601666	平煤股份	15,000	52,800.00	0.13
191	300077	国民技术	7,100	52,469.00	0.13
192	000592	平潭发展	19,600	52,332.00	0.13
193	600108	亚盛集团	19,800	52,272.00	0.13
194	002648	卫星石化	5,400	52,218.00	0.13
195	002130	沃尔核材	16,100	52,164.00	0.13
196	002145	中核钛白	16,200	52,164.00	0.13
197	600742	一汽富维	5,220	52,095.60	0.13

198	600851	海欣股份	7,500	52,050.00	0.13
199	600033	福建高速	17,500	51,975.00	0.13
200	600668	尖峰集团	4,400	51,920.00	0.13
201	300618	寒锐钴业	700	51,856.00	0.13
202	002156	通富微电	7,270	51,835.10	0.13
203	300053	欧比特	6,345	51,775.20	0.13
204	600577	精达股份	17,400	51,678.00	0.13
205	002436	兴森科技	11,400	51,528.00	0.13
206	603368	柳药股份	1,964	51,456.80	0.13
207	300495	美尚生态	3,883	51,255.60	0.13
208	000789	万年青	4,700	51,183.00	0.13
209	300463	迈克生物	3,500	51,100.00	0.13
210	600720	祁连山	7,900	50,955.00	0.13
211	600988	赤峰黄金	12,700	50,673.00	0.13
212	002531	天顺风能	11,380	50,641.00	0.13
213	002364	中恒电气	4,300	50,568.00	0.13
214	002067	景兴纸业	14,400	50,544.00	0.13
215	300567	精测电子	1,000	50,480.00	0.13
216	002124	天邦股份	7,400	50,320.00	0.13
217	601369	陕鼓动力	8,300	50,215.00	0.12
218	300699	光威复材	1,400	50,120.00	0.12
219	600622	光大嘉宝	8,823	50,026.41	0.12
220	600708	光明地产	14,267	49,791.83	0.12
221	000688	国城矿业	4,300	49,622.00	0.12
222	603338	浙江鼎力	880	49,561.60	0.12
223	000088	盐田港	9,900	49,500.00	0.12
224	300101	振芯科技	5,000	49,500.00	0.12
225	600067	冠城大通	13,300	49,476.00	0.12

226	603708	家家悦	2,460	49,421.40	0.12
227	600230	沧州大化	3,060	49,419.00	0.12
228	600420	现代制药	5,400	49,356.00	0.12
229	600477	杭萧钢构	13,708	49,348.80	0.12
230	600986	科达股份	11,740	49,190.60	0.12
231	002596	海南瑞泽	8,200	49,118.00	0.12
232	000901	航天科技	5,550	49,062.00	0.12
233	600206	有研新材	7,500	48,975.00	0.12
234	002219	恒康医疗	14,200	48,848.00	0.12
235	002022	科华生物	5,200	48,776.00	0.12
236	002292	奥飞娱乐	8,600	48,676.00	0.12
237	600400	红豆股份	12,920	48,450.00	0.12
238	300145	中金环境	14,740	47,905.00	0.12
239	600764	中国海防	2,000	47,680.00	0.12
240	000546	金圆股份	5,500	47,630.00	0.12
241	601069	西部黄金	3,200	47,584.00	0.12
242	002318	久立特材	7,500	47,550.00	0.12
243	600621	华鑫股份	5,400	47,412.00	0.12
244	002215	诺普信	7,000	47,320.00	0.12
245	600162	香江控股	21,650	47,197.00	0.12
246	000620	新华联	12,000	46,920.00	0.12
247	600502	安徽水利	13,156	46,835.36	0.12
248	002097	山河智能	8,400	46,620.00	0.12
249	000882	华联股份	20,900	46,607.00	0.12
250	300339	润和软件	5,100	46,512.00	0.12
251	000676	智度股份	4,900	46,501.00	0.12
252	000799	酒鬼酒	2,900	46,342.00	0.12
253	600681	百川能源	3,900	46,176.00	0.11

254	000016	深康佳 A	14,200	46,008.00	0.11
255	000733	振华科技	4,200	45,948.00	0.11
256	600997	开滦股份	8,100	45,927.00	0.11
257	300429	强力新材	1,470	45,864.00	0.11
258	002430	杭氧股份	4,900	45,815.00	0.11
259	000555	神州信息	4,900	45,766.00	0.11
260	600846	同济科技	6,400	45,760.00	0.11
261	002717	岭南股份	5,120	45,619.20	0.11
262	600197	伊力特	3,500	45,605.00	0.11
263	300047	天源迪科	4,100	45,551.00	0.11
264	002547	春兴精工	8,600	45,494.00	0.11
265	300666	江丰电子	1,100	45,452.00	0.11
266	601113	华鼎股份	5,600	45,416.00	0.11
267	600856	中天能源	12,200	45,384.00	0.11
268	600789	鲁抗医药	6,000	45,300.00	0.11
269	002117	东港股份	3,200	45,280.00	0.11
270	600308	华泰股份	10,400	45,240.00	0.11
271	600285	羚锐制药	6,000	45,120.00	0.11
272	002303	美盈森	9,700	45,105.00	0.11
273	300309	吉艾科技	5,580	44,974.80	0.11
274	002585	双星新材	8,790	44,829.00	0.11
275	600495	晋西车轴	10,880	44,716.80	0.11
276	000710	贝瑞基因	1,400	44,660.00	0.11
277	000869	张裕 A	1,700	44,200.00	0.11
278	300369	绿盟科技	5,100	44,166.00	0.11
279	002326	永太科技	6,300	44,037.00	0.11
280	000672	上峰水泥	5,200	43,888.00	0.11
281	000851	高鸿股份	9,200	43,792.00	0.11

282	002429	兆驰股份	23,000	43,700.00	0.11
283	600512	腾达建设	20,300	43,645.00	0.11
284	000935	四川双马	2,900	43,616.00	0.11
285	002343	慈文传媒	4,830	43,566.60	0.11
286	600677	航天通信	4,600	43,562.00	0.11
287	300292	吴通控股	11,400	43,548.00	0.11
288	000525	红太阳	3,100	43,493.00	0.11
289	300349	金卡智能	2,700	43,470.00	0.11
290	601886	江河集团	5,800	43,442.00	0.11
291	603337	杰克股份	1,184	43,440.96	0.11
292	002222	福晶科技	4,450	43,432.00	0.11
293	002258	利尔化学	3,300	43,362.00	0.11
294	002550	千红制药	11,400	43,320.00	0.11
295	000910	大亚圣象	4,200	43,302.00	0.11
296	600093	易见股份	5,700	43,206.00	0.11
297	603096	新经典	700	43,204.00	0.11
298	002370	亚太药业	2,600	43,186.00	0.11
299	000666	经纬纺机	4,000	43,120.00	0.11
300	600076	康欣新材	10,500	43,050.00	0.11
301	600105	永鼎股份	11,140	43,000.40	0.11
302	002657	中科金财	3,400	42,704.00	0.11
303	600966	博汇纸业	13,600	42,704.00	0.11
304	300352	北信源	12,975	42,687.75	0.11
305	002104	恒宝股份	7,276	42,637.36	0.11
306	300178	腾邦国际	4,700	42,488.00	0.11
307	002256	兆新股份	14,400	42,480.00	0.11
308	002447	晨鑫科技	14,450	42,338.50	0.11
309	600715	文投控股	9,400	42,300.00	0.11

310	002425	凯撒文化	7,180	42,218.40	0.11
311	600133	东湖高新	6,700	42,210.00	0.11
312	002036	联创电子	4,900	42,140.00	0.10
313	002267	陕天然气	5,700	42,123.00	0.10
314	002031	巨轮智能	22,400	42,112.00	0.10
315	600422	昆药集团	6,800	42,024.00	0.10
316	002192	融捷股份	2,300	41,952.00	0.10
317	300177	中海达	4,100	41,943.00	0.10
318	603357	设计总院	2,100	41,895.00	0.10
319	000687	华讯方舟	5,900	41,890.00	0.10
320	300252	金信诺	3,840	41,856.00	0.10
321	002668	奥马电器	8,594	41,852.78	0.10
322	600020	中原高速	11,400	41,838.00	0.10
323	600546	山煤国际	12,600	41,832.00	0.10
324	300365	恒华科技	2,000	41,800.00	0.10
325	600227	圣济堂	15,100	41,676.00	0.10
326	300523	辰安科技	700	41,650.00	0.10
327	000936	华西股份	6,800	41,616.00	0.10
328	600812	华北制药	10,400	41,600.00	0.10
329	002206	海利得	10,900	41,529.00	0.10
330	002115	三维通信	4,200	41,454.00	0.10
331	300075	数字政通	3,800	41,420.00	0.10
332	002327	富安娜	5,500	41,305.00	0.10
333	603399	吉翔股份	4,200	41,244.00	0.10
334	300323	华灿光电	5,700	41,211.00	0.10
335	600239	云南城投	14,300	41,184.00	0.10
336	600990	四创电子	1,200	41,148.00	0.10
337	000828	东莞控股	5,500	41,085.00	0.10

338	000751	锌业股份	14,400	41,040.00	0.10
339	002467	二六三	8,100	40,986.00	0.10
340	300219	鸿利智汇	5,350	40,981.00	0.10
341	603128	华贸物流	7,700	40,964.00	0.10
342	600059	古越龙山	6,200	40,920.00	0.10
343	002721	金一文化	6,400	40,832.00	0.10
344	600456	宝钛股份	2,700	40,743.00	0.10
345	002003	伟星股份	5,800	40,716.00	0.10
346	600255	梦舟股份	22,500	40,500.00	0.10
347	002139	拓邦股份	10,325	40,474.00	0.10
348	600172	黄河旋风	13,260	40,443.00	0.10
349	002647	仁东控股	2,800	40,432.00	0.10
350	000921	海信家电	5,700	40,299.00	0.10
351	002080	中材科技	4,980	40,288.20	0.10
352	002675	东诚药业	5,100	40,137.00	0.10
353	600987	航民股份	4,900	40,082.00	0.10
354	601908	京运通	12,700	40,005.00	0.10
355	002859	洁美科技	1,300	39,975.00	0.10
356	000802	北京文化	3,600	39,852.00	0.10
357	600063	皖维高新	17,100	39,843.00	0.10
358	600090	同济堂	7,300	39,712.00	0.10
359	002446	盛路通信	5,020	39,708.20	0.10
360	002564	天沃科技	7,900	39,658.00	0.10
361	601139	深圳燃气	7,380	39,630.60	0.10
362	002387	维信诺	5,200	39,624.00	0.10
363	002649	博彦科技	5,400	39,582.00	0.10
364	600360	华微电子	7,700	39,578.00	0.10
365	300031	宝通科技	3,000	39,570.00	0.10

366	002619	艾格拉斯	11,680	39,361.60	0.10
367	002171	楚江新材	8,500	39,355.00	0.10
368	002542	中化岩土	9,150	39,345.00	0.10
369	300208	青岛中程	6,850	39,319.00	0.10
370	300118	东方日升	6,900	39,261.00	0.10
371	603588	高能环境	5,000	39,250.00	0.10
372	600072	中船科技	5,600	39,032.00	0.10
373	300300	汉鼎宇佑	3,475	38,920.00	0.10
374	603989	艾华集团	1,930	38,870.20	0.10
375	603707	健友股份	2,070	38,853.90	0.10
376	300409	道氏技术	2,960	38,805.60	0.10
377	300595	欧普康视	1,000	38,740.00	0.10
378	000582	北部湾港	5,500	38,720.00	0.10
379	601677	明泰铝业	4,400	38,676.00	0.10
380	000520	长航凤凰	13,400	38,592.00	0.10
381	300039	上海凯宝	9,500	38,570.00	0.10
382	300232	洲明科技	4,040	38,541.60	0.10
383	600624	复旦复华	6,330	38,296.50	0.10
384	002484	江海股份	6,216	38,290.56	0.10
385	000996	中国中期	4,550	38,038.00	0.09
386	600322	天房发展	11,700	38,025.00	0.09
387	000797	中国武夷	8,351	37,997.05	0.09
388	002307	北新路桥	7,100	37,914.00	0.09
389	000951	中国重汽	3,400	37,876.00	0.09
390	603882	金域医学	1,700	37,876.00	0.09
391	600261	阳光照明	11,100	37,851.00	0.09
392	300568	星源材质	1,700	37,723.00	0.09
393	000731	四川美丰	7,500	37,650.00	0.09

394	002705	新宝股份	4,100	37,638.00	0.09
395	300020	银江股份	5,800	37,584.00	0.09
396	600114	东睦股份	5,980	37,494.60	0.09
397	002747	埃斯顿	4,400	37,444.00	0.09
398	002095	生意宝	1,900	37,392.00	0.09
399	002698	博实股份	4,200	37,338.00	0.09
400	603113	金能科技	3,400	37,298.00	0.09
401	002626	金达威	3,100	37,262.00	0.09
402	600343	航天动力	4,900	37,240.00	0.09
403	000976	华铁股份	8,100	37,098.00	0.09
404	002113	天润数娱	9,860	36,975.00	0.09
405	600569	安阳钢铁	12,200	36,966.00	0.09
406	603345	安井食品	1,000	36,800.00	0.09
407	002309	中利集团	4,400	36,696.00	0.09
408	600508	上海能源	3,800	36,670.00	0.09
409	601101	昊华能源	6,100	36,661.00	0.09
410	002298	中电兴发	6,200	36,580.00	0.09
411	600331	宏达股份	18,100	36,562.00	0.09
412	000915	山大华特	2,470	36,556.00	0.09
413	300183	东软载波	3,100	36,487.00	0.09
414	601952	苏垦农发	5,490	36,398.70	0.09
415	300096	易联众	4,400	36,344.00	0.09
416	002355	兴民智通	4,800	36,336.00	0.09
417	000928	中钢国际	8,320	36,192.00	0.09
418	300044	赛为智能	5,980	36,179.00	0.09
419	002148	北纬科技	6,060	36,178.20	0.09
420	300474	景嘉微	1,000	36,160.00	0.09
421	002462	嘉事堂	2,500	36,125.00	0.09

422	600300	维维股份	12,800	36,096.00	0.09
423	600130	波导股份	10,200	36,006.00	0.09
424	600363	联创光电	4,500	36,000.00	0.09
425	600217	中再资环	8,800	35,992.00	0.09
426	300085	银之杰	4,500	35,820.00	0.09
427	000584	哈工智能	5,700	35,796.00	0.09
428	002055	得润电子	3,700	35,779.00	0.09
429	000889	中嘉博创	3,500	35,700.00	0.09
430	600963	岳阳林纸	8,900	35,689.00	0.09
431	000571	新大洲 A	10,400	35,672.00	0.09
432	601163	三角轮胎	3,200	35,648.00	0.09
433	601366	利群股份	5,500	35,640.00	0.09
434	300045	华力创通	4,700	35,626.00	0.09
435	002261	拓维信息	8,400	35,448.00	0.09
436	600590	泰豪科技	6,560	35,358.40	0.09
437	600676	交运股份	8,200	35,342.00	0.09
438	300128	锦富技术	9,788	35,334.68	0.09
439	603605	珀莱雅	800	35,256.00	0.09
440	300630	普利制药	800	35,248.00	0.09
441	600106	重庆路桥	11,624	35,220.72	0.09
442	300131	英唐智控	8,200	35,178.00	0.09
443	300379	东方通	2,500	35,125.00	0.09
444	002501	利源精制	12,400	35,092.00	0.09
445	002367	康力电梯	6,300	35,091.00	0.09
446	000801	四川九洲	8,100	35,073.00	0.09
447	002611	东方精工	9,340	35,025.00	0.09
448	002240	威华股份	4,800	34,992.00	0.09
449	000155	川能动力	9,700	34,920.00	0.09

450	601388	怡球资源	18,080	34,894.40	0.09
451	600581	八一钢铁	9,800	34,888.00	0.09
452	002283	天润曲轴	10,400	34,840.00	0.09
453	300288	朗玛信息	2,700	34,830.00	0.09
454	002301	齐心集团	4,100	34,686.00	0.09
455	300373	扬杰科技	2,400	34,656.00	0.09
456	600568	中珠医疗	15,200	34,656.00	0.09
457	600550	保变电气	9,400	34,592.00	0.09
458	300398	飞凯材料	2,200	34,540.00	0.09
459	002448	中原内配	6,400	34,432.00	0.09
460	300310	宜通世纪	6,788	34,415.16	0.09
461	300130	新国都	3,040	34,412.80	0.09
462	300685	艾德生物	840	34,364.40	0.09
463	300322	硕贝德	3,600	34,344.00	0.09
464	002630	华西能源	12,000	34,200.00	0.09
465	002245	澳洋顺昌	8,800	34,144.00	0.08
466	002474	榕基软件	5,500	34,100.00	0.08
467	300353	东土科技	3,900	34,047.00	0.08
468	002320	海峡股份	2,530	34,028.50	0.08
469	300438	鹏辉能源	2,100	33,936.00	0.08
470	002851	麦格米特	1,600	33,920.00	0.08
471	600602	云赛智联	6,800	33,864.00	0.08
472	000967	盈峰环境	5,992	33,854.80	0.08
473	600531	豫光金铅	9,700	33,853.00	0.08
474	600075	新疆天业	7,480	33,809.60	0.08
475	002229	鸿博股份	4,650	33,805.50	0.08
476	600459	贵研铂业	3,050	33,794.00	0.08
477	002792	通宇通讯	1,100	33,682.00	0.08

478	002197	证通电子	4,800	33,600.00	0.08
479	603636	南威软件	3,500	33,600.00	0.08
480	002226	江南化工	6,600	33,594.00	0.08
481	000407	胜利股份	9,000	33,570.00	0.08
482	600096	云天化	6,700	33,567.00	0.08
483	603699	纽威股份	2,800	33,460.00	0.08
484	300602	飞荣达	1,000	33,410.00	0.08
485	300237	美晨生态	9,200	33,396.00	0.08
486	000030	富奥股份	9,000	33,390.00	0.08
487	600684	珠江实业	7,660	33,321.00	0.08
488	002433	太安堂	7,100	33,299.00	0.08
489	603458	勘设股份	1,100	33,275.00	0.08
490	002279	久其软件	4,680	33,274.80	0.08
491	002167	东方锆业	6,300	33,264.00	0.08
492	000550	江铃汽车	2,600	33,176.00	0.08
493	002867	周大生	1,200	33,156.00	0.08
494	002121	科陆电子	7,200	33,120.00	0.08
495	600662	强生控股	8,000	33,120.00	0.08
496	000973	佛塑科技	10,300	33,063.00	0.08
497	300364	中文在线	6,819	33,003.96	0.08
498	002428	云南锆业	6,600	33,000.00	0.08
499	000822	山东海化	6,800	32,980.00	0.08
500	000615	京汉股份	6,200	32,922.00	0.08
501	000043	中航善达	4,400	32,912.00	0.08
502	002293	罗莱生活	3,800	32,870.00	0.08
503	300348	长亮科技	2,000	32,860.00	0.08
504	000958	东方能源	10,200	32,844.00	0.08
505	300336	新文化	7,450	32,780.00	0.08

506	603118	共进股份	5,200	32,760.00	0.08
507	002510	天汽模	9,100	32,669.00	0.08
508	300477	合纵科技	3,600	32,616.00	0.08
509	002141	贤丰控股	7,500	32,475.00	0.08
510	300406	九强生物	3,300	32,439.00	0.08
511	002912	中新赛克	400	32,424.00	0.08
512	002677	浙江美大	3,240	32,302.80	0.08
513	300223	北京君正	1,760	32,120.00	0.08
514	603359	东珠生态	1,960	32,104.80	0.08
515	300467	迅游科技	1,400	32,102.00	0.08
516	000601	韶能股份	8,600	31,992.00	0.08
517	002043	兔宝宝	6,300	31,941.00	0.08
518	600054	黄山旅游	3,400	31,892.00	0.08
519	300388	国祯环保	3,600	31,860.00	0.08
520	300016	北陆药业	4,550	31,850.00	0.08
521	002182	云海金属	5,100	31,824.00	0.08
522	002239	奥特佳	15,900	31,800.00	0.08
523	603456	九洲药业	5,000	31,800.00	0.08
524	600391	航发科技	2,900	31,697.00	0.08
525	000810	创维数字	5,700	31,692.00	0.08
526	002305	南国置业	11,000	31,680.00	0.08
527	002650	加加食品	8,800	31,680.00	0.08
528	300506	名家汇	2,200	31,680.00	0.08
529	300298	三诺生物	2,980	31,588.00	0.08
530	601126	四方股份	6,200	31,558.00	0.08
531	300157	恒泰艾普	7,600	31,540.00	0.08
532	002567	唐人神	5,550	31,468.50	0.08
533	000821	京山轻机	4,100	31,406.00	0.08

534	002224	三力士	5,800	31,320.00	0.08
535	002768	国恩股份	1,400	31,220.00	0.08
536	603108	润达医疗	4,340	31,204.60	0.08
537	300065	海兰信	3,050	31,171.00	0.08
538	000913	钱江摩托	3,400	31,144.00	0.08
539	600626	申达股份	6,300	31,122.00	0.08
540	002210	飞马国际	8,480	31,121.60	0.08
541	002568	百润股份	3,400	31,076.00	0.08
542	002253	川大智胜	2,350	31,067.00	0.08
543	600800	天津磁卡	6,200	31,062.00	0.08
544	600798	宁波海运	9,600	31,008.00	0.08
545	300456	耐威科技	1,400	30,968.00	0.08
546	002540	亚太科技	6,700	30,954.00	0.08
547	601949	中国出版	7,000	30,730.00	0.08
548	002664	长鹰信质	2,500	30,700.00	0.08
549	600318	新力金融	4,300	30,616.00	0.08
550	300231	银信科技	4,700	30,550.00	0.08
551	603393	新天然气	1,000	30,500.00	0.08
552	601566	九牧王	2,300	30,475.00	0.08
553	002060	粤水电	11,200	30,464.00	0.08
554	603305	旭升股份	1,000	30,420.00	0.08
555	300007	汉威科技	3,100	30,411.00	0.08
556	300343	联创互联	4,530	30,260.40	0.08
557	600103	青山纸业	11,800	30,208.00	0.08
558	002204	大连重工	10,200	30,192.00	0.08
559	002453	华软科技	5,800	30,160.00	0.08
560	601116	三江购物	2,800	30,156.00	0.08
561	000065	北方国际	3,925	30,144.00	0.08

562	300091	金通灵	8,920	30,060.40	0.07
563	300679	电连技术	1,100	29,997.00	0.07
564	600069	银鸽投资	10,300	29,973.00	0.07
565	600693	东百集团	5,700	29,925.00	0.07
566	002094	青岛金王	6,140	29,901.80	0.07
567	002726	龙大肉食	3,780	29,899.80	0.07
568	002545	东方铁塔	5,100	29,886.00	0.07
569	000498	山东路桥	5,900	29,854.00	0.07
570	000070	特发信息	4,200	29,820.00	0.07
571	300148	天舟文化	6,700	29,815.00	0.07
572	300236	上海新阳	1,200	29,772.00	0.07
573	002543	万和电气	2,310	29,683.50	0.07
574	002314	南山控股	10,300	29,561.00	0.07
575	603298	杭叉集团	2,500	29,550.00	0.07
576	600231	凌钢股份	11,060	29,530.20	0.07
577	000892	欢瑞世纪	6,200	29,512.00	0.07
578	600055	万东医疗	3,400	29,512.00	0.07
579	600211	西藏药业	1,000	29,510.00	0.07
580	600652	游久游戏	6,600	29,502.00	0.07
581	300502	新易盛	1,500	29,475.00	0.07
582	300228	富瑞特装	6,080	29,427.20	0.07
583	603980	吉华集团	2,500	29,425.00	0.07
584	002522	浙江众成	6,000	29,340.00	0.07
585	002582	好想你	3,900	29,328.00	0.07
586	600707	彩虹股份	7,100	29,323.00	0.07
587	000711	京蓝科技	4,700	29,281.00	0.07
588	600129	太极集团	3,500	29,225.00	0.07
589	002556	辉隆股份	5,700	29,127.00	0.07

590	600995	文山电力	4,400	29,084.00	0.07
591	002005	德豪润达	13,400	29,078.00	0.07
592	002617	露笑科技	7,299	29,050.02	0.07
593	002521	齐峰新材	5,200	28,964.00	0.07
594	603026	石大胜华	1,500	28,950.00	0.07
595	002016	世荣兆业	3,200	28,864.00	0.07
596	300431	暴风集团	3,460	28,856.40	0.07
597	000631	顺发恒业	9,700	28,809.00	0.07
598	000545	金浦钛业	9,200	28,796.00	0.07
599	603979	金诚信	3,834	28,716.66	0.07
600	002235	安妮股份	5,575	28,711.25	0.07
601	002662	京威股份	7,600	28,652.00	0.07
602	601700	风范股份	7,500	28,650.00	0.07
603	002335	科华恒盛	1,900	28,633.00	0.07
604	002756	永兴特钢	2,400	28,608.00	0.07
605	603638	艾迪精密	1,180	28,567.80	0.07
606	600382	广东明珠	3,700	28,564.00	0.07
607	000820	神雾节能	5,100	28,509.00	0.07
608	002616	长青集团	3,900	28,470.00	0.07
609	002581	未名医药	4,400	28,424.00	0.07
610	000965	天保基建	7,380	28,413.00	0.07
611	002516	旷达科技	10,000	28,400.00	0.07
612	600638	新黄浦	3,320	28,286.40	0.07
613	300303	聚飞光电	11,640	28,285.20	0.07
614	600180	瑞茂通	4,000	28,200.00	0.07
615	300034	钢研高纳	3,279	28,199.40	0.07
616	600303	曙光股份	7,200	28,152.00	0.07
617	002443	金洲管道	5,300	28,143.00	0.07

618	600449	宁夏建材	3,800	28,006.00	0.07
619	002451	摩恩电气	2,300	27,991.00	0.07
620	300050	世纪鼎利	4,500	27,945.00	0.07
621	002746	仙坛股份	2,040	27,907.20	0.07
622	600467	好当家	11,600	27,840.00	0.07
623	002636	金安国纪	3,900	27,807.00	0.07
624	002656	摩登大道	4,480	27,776.00	0.07
625	600012	皖通高速	4,600	27,738.00	0.07
626	300205	天喻信息	3,400	27,676.00	0.07
627	603003	龙宇燃油	4,100	27,593.00	0.07
628	300066	三川智慧	8,300	27,556.00	0.07
629	300633	开立医疗	1,000	27,550.00	0.07
630	002101	广东鸿图	3,400	27,506.00	0.07
631	002234	民和股份	2,400	27,480.00	0.07
632	600480	凌云股份	3,600	27,468.00	0.07
633	300661	圣邦股份	400	27,440.00	0.07
634	000055	方大集团	6,850	27,400.00	0.07
635	600686	金龙汽车	4,000	27,400.00	0.07
636	600246	万通地产	8,200	27,388.00	0.07
637	600661	昂立教育	1,400	27,384.00	0.07
638	002515	金字火腿	6,520	27,318.80	0.07
639	300233	金城医药	2,000	27,300.00	0.07
640	002135	东南网架	5,500	27,280.00	0.07
641	300386	飞天诚信	2,700	27,243.00	0.07
642	002622	融钰集团	8,900	27,234.00	0.07
643	603881	数据港	1,100	27,214.00	0.07
644	300198	纳川股份	9,580	27,207.20	0.07
645	300064	豫金刚石	6,100	27,206.00	0.07

646	300005	探路者	8,300	27,141.00	0.07
647	002068	黑猫股份	4,600	27,140.00	0.07
648	600035	楚天高速	9,200	27,140.00	0.07
649	002079	苏州固锝	5,800	27,086.00	0.07
650	300410	正业科技	1,200	27,060.00	0.07
651	002218	拓日新能	9,800	26,950.00	0.07
652	600630	龙头股份	3,900	26,949.00	0.07
653	002695	煌上煌	2,700	26,838.00	0.07
654	002502	骅威文化	6,800	26,792.00	0.07
655	000795	英洛华	7,500	26,775.00	0.07
656	000927	一汽夏利	8,500	26,775.00	0.07
657	300299	富春股份	5,540	26,758.20	0.07
658	300229	拓尔思	3,100	26,753.00	0.07
659	601890	亚星锚链	7,600	26,752.00	0.07
660	300238	冠昊生物	2,800	26,712.00	0.07
661	002362	汉王科技	2,000	26,700.00	0.07
662	000532	华金资本	2,700	26,649.00	0.07
663	300184	力源信息	3,500	26,635.00	0.07
664	000811	冰轮环境	5,150	26,625.50	0.07
665	002481	双塔食品	9,500	26,600.00	0.07
666	002538	司尔特	5,500	26,565.00	0.07
667	600165	新日恒力	5,450	26,541.50	0.07
668	300215	电科院	5,000	26,500.00	0.07
669	603308	应流股份	3,300	26,466.00	0.07
670	000791	甘肃电投	5,200	26,312.00	0.07
671	300158	振东制药	6,900	26,289.00	0.07
672	002539	云图控股	6,400	26,240.00	0.07
673	601858	中国科传	3,000	26,220.00	0.07

674	002586	围海股份	5,800	26,216.00	0.07
675	000881	中广核技	3,900	26,208.00	0.07
676	600084	中葡股份	8,900	26,166.00	0.07
677	002086	东方海洋	6,000	26,160.00	0.07
678	300021	大禹节水	6,300	26,145.00	0.07
679	600136	当代明诚	3,200	26,144.00	0.07
680	603111	康尼机电	6,600	26,136.00	0.07
681	002929	润建通信	800	26,128.00	0.07
682	000544	中原环保	5,150	26,110.50	0.06
683	603686	龙马环卫	2,400	26,064.00	0.06
684	000639	西王食品	4,060	26,024.60	0.06
685	300248	新开普	3,823	25,958.17	0.06
686	002711	欧浦智网	6,668	25,938.52	0.06
687	601599	鹿港文化	8,300	25,896.00	0.06
688	002393	力生制药	1,200	25,836.00	0.06
689	600571	信雅达	4,100	25,830.00	0.06
690	002638	勤上股份	10,050	25,828.50	0.06
691	603367	辰欣药业	1,700	25,806.00	0.06
692	002321	华英农业	5,000	25,800.00	0.06
693	300504	天邑股份	1,000	25,760.00	0.06
694	600734	实达集团	4,100	25,748.00	0.06
695	002554	惠博普	9,500	25,745.00	0.06
696	000925	众合科技	4,400	25,740.00	0.06
697	300083	劲胜智能	10,900	25,724.00	0.06
698	300006	莱美药业	7,138	25,696.80	0.06
699	300363	博腾股份	2,900	25,694.00	0.06
700	603609	禾丰牧业	3,300	25,575.00	0.06
701	300123	亚光科技	2,800	25,564.00	0.06

702	300143	星普医科	2,800	25,452.00	0.06
703	300497	富祥股份	1,400	25,424.00	0.06
704	600619	海立股份	3,000	25,410.00	0.06
705	300256	星星科技	8,550	25,393.50	0.06
706	002769	普路通	2,499	25,339.86	0.06
707	600523	贵航股份	2,660	25,323.20	0.06
708	300424	航新科技	1,816	25,315.04	0.06
709	300269	联建光电	4,600	25,300.00	0.06
710	600855	航天长峰	2,800	25,284.00	0.06
711	000038	深大通	1,980	25,264.80	0.06
712	600595	中孚实业	13,000	25,220.00	0.06
713	002349	精华制药	4,400	25,212.00	0.06
714	002166	莱茵生物	4,100	25,174.00	0.06
715	002247	聚力文化	5,400	25,164.00	0.06
716	300213	佳讯飞鸿	4,500	25,155.00	0.06
717	000837	秦川机床	6,400	25,152.00	0.06
718	603612	索通发展	2,160	25,142.40	0.06
719	300110	华仁药业	7,820	25,102.20	0.06
720	300048	合康新能	10,500	25,095.00	0.06
721	002284	亚太股份	5,900	25,075.00	0.06
722	000404	长虹华意	6,475	24,993.50	0.06
723	000815	美利云	3,700	24,975.00	0.06
724	002409	雅克科技	1,800	24,966.00	0.06
725	600552	凯盛科技	6,800	24,956.00	0.06
726	000657	中钨高新	4,680	24,897.60	0.06
727	002033	丽江旅游	4,390	24,891.30	0.06
728	300741	华宝股份	800	24,856.00	0.06
729	300332	天壕环境	6,700	24,723.00	0.06

730	600533	栖霞建设	8,400	24,696.00	0.06
731	000558	莱茵体育	8,500	24,650.00	0.06
732	300607	拓斯达	800	24,600.00	0.06
733	300311	任子行	4,231	24,582.11	0.06
734	000151	中成股份	2,400	24,576.00	0.06
735	300097	智云股份	2,200	24,574.00	0.06
736	600650	锦江投资	2,600	24,570.00	0.06
737	300317	珈伟新能	5,225	24,557.50	0.06
738	603898	好莱客	1,600	24,528.00	0.06
739	300485	赛升药业	2,500	24,525.00	0.06
740	002562	兄弟科技	5,760	24,480.00	0.06
741	000957	中通客车	5,500	24,475.00	0.06
742	300100	双林股份	2,400	24,456.00	0.06
743	300224	正海磁材	4,150	24,443.50	0.06
744	002458	益生股份	1,700	24,395.00	0.06
745	000673	当代东方	5,200	24,388.00	0.06
746	002609	捷顺科技	4,400	24,376.00	0.06
747	000665	湖北广电	3,400	24,344.00	0.06
748	603959	百利科技	1,640	24,222.80	0.06
749	601789	宁波建工	7,800	24,180.00	0.06
750	300366	创意信息	3,300	24,156.00	0.06
751	300255	常山药业	5,900	24,131.00	0.06
752	002733	雄韬股份	2,350	24,087.50	0.06
753	300439	美康生物	1,800	24,048.00	0.06
754	300245	天玑科技	2,800	24,024.00	0.06
755	603618	杭电股份	4,600	24,012.00	0.06
756	600295	鄂尔多斯	3,200	24,000.00	0.06
757	603008	喜临门	2,600	23,972.00	0.06

758	002872	天圣制药	2,800	23,968.00	0.06
759	300262	巴安水务	4,400	23,936.00	0.06
760	603387	基蛋生物	900	23,913.00	0.06
761	000971	高升控股	7,200	23,904.00	0.06
762	603508	思维列控	600	23,886.00	0.06
763	603920	世运电路	2,000	23,820.00	0.06
764	002833	弘亚数控	700	23,800.00	0.06
765	300209	天泽信息	2,200	23,782.00	0.06
766	002653	海思科	2,000	23,780.00	0.06
767	300359	全通教育	4,050	23,692.50	0.06
768	002322	理工环科	2,600	23,608.00	0.06
769	300304	云意电气	6,900	23,598.00	0.06
770	300191	潜能恒信	1,600	23,552.00	0.06
771	002584	西陇科学	3,900	23,517.00	0.06
772	300531	优博讯	1,400	23,478.00	0.06
773	000058	深赛格	3,900	23,205.00	0.06
774	002752	昇兴股份	3,200	23,200.00	0.06
775	300263	隆华科技	5,800	23,200.00	0.06
776	600290	华仪电气	5,000	23,200.00	0.06
777	000506	中润资源	8,600	23,134.00	0.06
778	300171	东富龙	3,300	23,133.00	0.06
779	000923	河北宣工	1,700	23,120.00	0.06
780	002418	康盛股份	7,500	23,100.00	0.06
781	600758	红阳能源	7,100	23,075.00	0.06
782	000701	厦门信达	3,800	23,028.00	0.06
783	300527	中国应急	3,483	22,987.80	0.06
784	002518	科士达	3,175	22,860.00	0.06
785	600616	金枫酒业	4,798	22,838.48	0.06

786	600278	东方创业	2,800	22,820.00	0.06
787	300441	鲍斯股份	3,360	22,780.80	0.06
788	002658	雪迪龙	3,200	22,720.00	0.06
789	300276	三丰智能	2,200	22,682.00	0.06
790	002772	众兴菌业	3,500	22,645.00	0.06
791	300393	中来股份	1,500	22,620.00	0.06
792	002631	德尔未来	3,500	22,540.00	0.06
793	601137	博威合金	3,300	22,506.00	0.06
794	002346	柘中股份	1,800	22,500.00	0.06
795	000561	烽火电子	4,000	22,440.00	0.06
796	300114	中航电测	3,150	22,428.00	0.06
797	300011	鼎汉技术	3,700	22,385.00	0.06
798	300735	光弘科技	1,400	22,372.00	0.06
799	603603	博天环境	1,500	22,200.00	0.06
800	002485	希努尔	2,900	22,011.00	0.05
801	600173	卧龙地产	5,800	21,866.00	0.05
802	000056	皇庭国际	4,600	21,758.00	0.05
803	002464	众应互联	2,496	21,715.20	0.05
804	600279	重庆港九	5,550	21,700.50	0.05
805	002329	皇氏集团	6,640	21,580.00	0.05
806	300725	药石科技	400	21,532.00	0.05
807	300465	高伟达	3,580	21,515.80	0.05
808	002751	易尚展示	1,000	21,480.00	0.05
809	603803	瑞斯康达	2,100	21,273.00	0.05
810	002651	利君股份	5,200	21,268.00	0.05
811	000796	凯撒旅游	3,200	21,248.00	0.05
812	000905	厦门港务	3,500	21,210.00	0.05
813	002196	方正电机	4,180	21,192.60	0.05

814	300140	中环装备	2,300	21,160.00	0.05
815	300625	三雄极光	1,500	21,105.00	0.05
816	300302	同有科技	2,840	21,101.20	0.05
817	300737	科顺股份	2,400	21,072.00	0.05
818	300242	佳云科技	4,900	21,070.00	0.05
819	002137	麦达数字	3,100	21,018.00	0.05
820	000576	广东甘化	3,500	21,000.00	0.05
821	002519	银河电子	6,010	20,974.90	0.05
822	002178	延华智能	5,700	20,919.00	0.05
823	002840	华统股份	1,600	20,912.00	0.05
824	603730	岱美股份	1,000	20,890.00	0.05
825	300172	中电环保	4,000	20,880.00	0.05
826	603595	东尼电子	660	20,710.80	0.05
827	002930	宏川智慧	800	20,680.00	0.05
828	600501	航天晨光	3,400	20,638.00	0.05
829	002053	云南能投	3,000	20,610.00	0.05
830	603126	中材节能	4,000	20,600.00	0.05
831	002432	九安医疗	4,000	20,560.00	0.05
832	300307	慈星股份	4,300	20,554.00	0.05
833	002530	金财互联	3,100	20,429.00	0.05
834	600146	商赢环球	3,100	20,398.00	0.05
835	002590	万安科技	3,200	20,352.00	0.05
836	002850	科达利	1,100	20,295.00	0.05
837	300194	福安药业	6,300	20,223.00	0.05
838	601900	南方传媒	2,400	20,208.00	0.05
839	002781	奇信股份	1,400	20,174.00	0.05
840	600283	钱江水利	1,800	20,160.00	0.05
841	000018	神州长城	9,500	20,140.00	0.05

842	300221	银禧科技	3,900	20,085.00	0.05
843	002158	汉钟精机	2,800	20,076.00	0.05
844	600207	安彩高科	4,600	19,964.00	0.05
845	002356	赫美集团	2,700	19,872.00	0.05
846	300008	天海防务	7,650	19,813.50	0.05
847	600310	桂东电力	5,500	19,800.00	0.05
848	002822	中装建设	3,800	19,684.00	0.05
849	002685	华东重机	4,000	19,680.00	0.05
850	603997	继峰股份	2,550	19,507.50	0.05
851	603843	正平股份	2,500	19,500.00	0.05
852	300520	科大国创	1,300	19,487.00	0.05
853	000700	模塑科技	6,600	19,470.00	0.05
854	002143	印纪传媒	6,800	19,448.00	0.05
855	600526	菲达环保	4,400	19,448.00	0.05
856	000517	荣安地产	8,400	19,404.00	0.05
857	600814	杭州解百	3,800	19,304.00	0.05
858	002246	北化股份	2,900	19,169.00	0.05
859	002895	川恒股份	1,600	19,136.00	0.05
860	601500	通用股份	2,900	19,111.00	0.05
861	002071	长城影视	4,200	19,110.00	0.05
862	603299	苏盐井神	3,700	18,981.00	0.05
863	603303	得邦照明	1,600	18,960.00	0.05
864	002742	三圣股份	2,300	18,952.00	0.05
865	002852	道道全	1,550	18,925.50	0.05
866	300328	宜安科技	3,080	18,911.20	0.05
867	603313	梦百合	900	18,909.00	0.05
868	002782	可立克	1,700	18,666.00	0.05
869	000885	城发环境	2,600	18,642.00	0.05

870	601595	上海电影	1,500	18,345.00	0.05
871	002232	启明信息	2,700	18,333.00	0.05
872	603466	风语筑	1,200	18,288.00	0.05
873	300278	华昌达	3,200	18,272.00	0.05
874	002712	思美传媒	3,060	18,268.20	0.05
875	603010	万盛股份	1,300	18,265.00	0.05
876	002461	珠江啤酒	4,100	18,040.00	0.04
877	300613	富瀚微	200	17,996.00	0.04
878	001896	豫能控股	5,900	17,995.00	0.04
879	300682	朗新科技	1,100	17,985.00	0.04
880	002401	中远海科	2,000	17,940.00	0.04
881	300350	华鹏飞	3,140	17,803.80	0.04
882	600381	青海春天	3,100	17,794.00	0.04
883	600876	洛阳玻璃	1,600	17,792.00	0.04
884	601015	陕西黑猫	3,350	17,788.50	0.04
885	603098	森特股份	1,300	17,771.00	0.04
886	002378	章源钨业	3,700	17,464.00	0.04
887	603777	来伊份	1,800	17,334.00	0.04
888	002574	明牌珠宝	3,500	17,255.00	0.04
889	300378	鼎捷软件	1,750	17,132.50	0.04
890	300426	唐德影视	2,500	17,050.00	0.04
891	603063	禾望电气	2,700	17,037.00	0.04
892	300440	运达科技	3,000	17,010.00	0.04
893	603839	安正时尚	1,580	16,906.00	0.04
894	600933	爱柯迪	2,200	16,852.00	0.04
895	300173	智慧松德	3,700	16,761.00	0.04
896	000011	深物业 A	1,800	16,524.00	0.04
897	603218	日月股份	1,000	16,520.00	0.04

898	300368	汇金股份	2,900	16,443.00	0.04
899	000514	渝开发	4,500	16,425.00	0.04
900	000838	财信发展	5,600	16,408.00	0.04
901	603919	金徽酒	1,400	16,352.00	0.04
902	300528	幸福蓝海	1,940	16,296.00	0.04
903	000533	顺钠股份	6,400	16,192.00	0.04
904	300511	雪榕生物	2,710	16,178.70	0.04
905	603058	永吉股份	1,700	16,167.00	0.04
906	300109	新开源	1,174	16,142.50	0.04
907	600828	茂业商业	3,417	16,025.73	0.04
908	300494	盛天网络	1,600	15,936.00	0.04
909	600818	中路股份	1,500	15,900.00	0.04
910	603779	威龙股份	1,200	15,900.00	0.04
911	603626	科森科技	2,080	15,870.40	0.04
912	002351	漫步者	3,200	15,808.00	0.04
913	300533	冰川网络	500	15,795.00	0.04
914	002788	鹭燕医药	1,250	15,775.00	0.04
915	002605	姚记扑克	2,100	15,771.00	0.04
916	603900	莱绅通灵	1,320	15,721.20	0.04
917	603648	畅联股份	1,500	15,645.00	0.04
918	603103	横店影视	700	15,610.00	0.04
919	300664	鹏鹞环保	1,300	15,600.00	0.04
920	300447	全信股份	1,680	15,590.40	0.04
921	601038	一拖股份	3,200	15,552.00	0.04
922	002534	杭锅股份	2,900	15,515.00	0.04
923	300061	康旗股份	2,600	15,470.00	0.04
924	000626	远大控股	2,400	15,456.00	0.04
925	603258	电魂网络	900	15,309.00	0.04

926	002766	索菱股份	2,800	15,288.00	0.04
927	300468	四方精创	1,260	15,183.00	0.04
928	002287	奇正藏药	600	15,012.00	0.04
929	002918	蒙娜丽莎	900	14,940.00	0.04
930	603385	惠达卫浴	1,860	14,898.60	0.04
931	603055	台华新材	1,400	14,812.00	0.04
932	603727	博迈科	1,200	14,808.00	0.04
933	002388	新亚制程	2,700	14,796.00	0.04
934	002901	大博医疗	500	14,795.00	0.04
935	002577	雷柏科技	1,500	14,610.00	0.04
936	603999	读者传媒	3,000	14,520.00	0.04
937	000722	湖南发展	2,400	14,472.00	0.04
938	603039	泛微网络	200	14,460.00	0.04
939	603555	贵人鸟	2,500	14,425.00	0.04
940	603817	海峡环保	2,400	14,424.00	0.04
941	603801	志邦家居	600	14,406.00	0.04
942	300432	富临精工	2,500	14,400.00	0.04
943	300634	彩讯股份	600	14,322.00	0.04
944	002759	天际股份	1,800	14,292.00	0.04
945	002377	国创高新	3,400	14,246.00	0.04
946	603579	荣泰健康	500	14,180.00	0.04
947	603861	白云电器	1,200	13,920.00	0.03
948	300660	江苏雷利	720	13,838.40	0.03
949	300160	秀强股份	4,000	13,800.00	0.03
950	300516	久之洋	500	13,760.00	0.03
951	603358	华达科技	1,276	13,717.00	0.03
952	002911	佛燃股份	800	13,488.00	0.03
953	603557	起步股份	1,800	13,410.00	0.03

954	300471	厚普股份	2,450	13,328.00	0.03
955	300512	中亚股份	1,100	13,200.00	0.03
956	603808	歌力思	800	12,992.00	0.03
957	603421	鼎信通讯	600	12,798.00	0.03
958	002703	浙江世宝	3,050	12,779.50	0.03
959	603711	香飘飘	600	12,750.00	0.03
960	002906	华阳集团	1,300	12,688.00	0.03
961	603728	鸣志电器	1,000	12,650.00	0.03
962	603599	广信股份	1,200	12,600.00	0.03
963	300484	蓝海华腾	1,100	12,309.00	0.03
964	603996	中新科技	1,600	12,064.00	0.03
965	603339	四方科技	800	11,960.00	0.03
966	603081	大丰实业	1,000	11,630.00	0.03
967	300518	盛讯达	500	11,600.00	0.03
968	300362	天翔环境	2,200	11,506.00	0.03
969	002907	华森制药	600	11,304.00	0.03
970	002928	华夏航空	600	11,226.00	0.03
971	601330	绿色动力	900	11,205.00	0.03
972	600985	淮北矿业	1,200	11,160.00	0.03
973	603693	江苏新能	800	11,032.00	0.03
974	603587	地素时尚	500	10,995.00	0.03
975	300726	宏达电子	600	10,848.00	0.03
976	300624	万兴科技	200	10,812.00	0.03
977	603533	掌阅科技	600	10,668.00	0.03
978	603165	荣晟环保	700	10,535.00	0.03
979	603758	秦安股份	1,700	10,285.00	0.03
980	600781	辅仁药业	800	10,120.00	0.03
981	601882	海天精工	1,400	9,856.00	0.02

982	603277	银都股份	1,100	9,636.00	0.02
983	603619	中曼石油	600	9,312.00	0.02
984	603876	鼎胜新材	500	9,270.00	0.02
985	603666	亿嘉和	200	9,160.00	0.02
986	603848	好太太	600	9,066.00	0.02
987	600929	湖南盐业	1,100	9,053.00	0.02
988	603348	文灿股份	400	8,996.00	0.02
989	603773	沃格光电	200	8,656.00	0.02
990	002801	微光股份	400	8,492.00	0.02
991	603105	芯能科技	600	7,848.00	0.02
992	601619	嘉泽新能	1,600	7,440.00	0.02
993	603013	亚普股份	400	7,056.00	0.02
994	603596	伯特利	300	6,861.00	0.02
995	603363	傲农生物	800	6,720.00	0.02
996	603680	今创集团	400	6,316.00	0.02
997	603733	仙鹤股份	400	6,168.00	0.02
998	603180	金牌厨柜	100	5,802.00	0.01
999	603676	卫信康	400	4,508.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000029	深深房 A	6,200	69,254.00	0.17
2	002323	*ST 百特	2,900	3,799.00	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000977	浪潮信息	203,041.00	0.28
2	300601	康泰生物	179,796.00	0.25
3	300176	鸿特科技	166,294.20	0.23
4	601699	潞安环能	159,144.00	0.22
5	002507	涪陵榨菜	150,112.00	0.21
6	600596	新安股份	139,435.00	0.19
7	300760	迈瑞医疗	125,074.40	0.17
8	600873	梅花生物	117,055.00	0.16
9	300558	贝达药业	114,418.00	0.16
10	002821	凯莱英	108,890.00	0.15
11	000697	炼石航空	108,721.00	0.15
12	002727	一心堂	103,447.00	0.14
13	002168	深圳惠程	102,832.00	0.14
14	000883	湖北能源	92,888.00	0.13
15	600200	江苏吴中	91,415.00	0.13
16	002292	奥飞娱乐	91,106.00	0.13
17	603399	吉翔股份	90,796.00	0.13
18	000799	酒鬼酒	87,223.00	0.12
19	000301	东方盛虹	85,239.00	0.12
20	000507	珠海港	85,003.00	0.12

注：买入金额不包括相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300142	沃森生物	380,482.00	0.53

2	300760	迈瑞医疗	250,405.10	0.35
3	300347	泰格医药	237,425.00	0.33
4	600779	水井坊	199,049.00	0.28
5	600567	山鹰纸业	189,296.00	0.26
6	300450	先导智能	183,091.60	0.25
7	300168	万达信息	177,276.00	0.25
8	300413	芒果超媒	175,488.00	0.24
9	002507	涪陵榨菜	161,783.00	0.22
10	300418	昆仑万维	159,556.00	0.22
11	002600	领益智造	156,835.00	0.22
12	603885	吉祥航空	146,975.80	0.20
13	300316	晶盛机电	125,345.60	0.17
14	600507	方大特钢	124,914.00	0.17
15	601699	潞安环能	122,363.00	0.17
16	002372	伟星新材	122,218.49	0.17
17	600782	新钢股份	118,822.00	0.17
18	000717	韶钢松山	113,526.00	0.16
19	300308	中际旭创	105,268.00	0.15
20	002302	西部建设	103,016.00	0.14

注：卖出金额不包括相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	15,156,530.48
卖出股票收入（成交）总额	22,980,099.28

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内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。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	818.24
2	应收证券清算款	30,510.65
3	应收股利	-
4	应收利息	570.91
5	应收申购款	26,802.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	58,702.68

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名指数股票中不存在流通受限的情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000029	深深房 A	69,254.00	0.17	重大事项停牌
2	002323	*ST 百特	3,799.00	0.01	重大事项停牌

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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	62	25,781.68	1,418,376.00	88.73%	180,088.00	11.27%
1000B	283	5,648.28	145.00	0.01%	1,598,319.00	99.99%
华宝中证 1000 指数 分级	4,102	13,891.69	498,852.29	0.88%	56,484,870.13	99.12%
合计	4,447	13,532.86	1,917,373.29	3.19%	58,263,277.13	96.81%

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。

9.2 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	88.68%
2	曾亭曦	27,618.00	1.73%
3	张志赟	16,675.00	1.04%
4	郑建伟	14,618.00	0.91%
5	梁小红	14,059.00	0.88%
6	郑志	13,869.00	0.87%
7	彭登梅	13,295.00	0.83%
8	黄晖	11,310.00	0.71%
9	孙大威	6,663.00	0.42%

10	曲惠琴	6,482.00	0.41%
----	-----	----------	-------

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	340,690.00	21.31%
2	祝东华	106,463.00	6.66%
3	林赛莲	94,629.00	5.92%
4	解俊荣	75,761.00	4.74%
5	谢锦星	50,722.00	3.17%
6	杨玉锋	42,314.00	2.65%
7	吴天爵	40,756.00	2.55%
8	刘文卿	35,311.00	2.21%
9	钱中明	33,300.00	2.08%
10	王跃文	28,194.00	1.76%

9.3 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	13,649.60	0.0240%
	合计	13,649.60	0.0227%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	1000A	0

开放式基金	1000B	0
	华宝中证 1000 指数 分级	0
	合计	0

§ 10 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
本报告期期间基金总申购份额	-	-	9,834,801.17
减:本报告期期间基金总赎回份额	-	-	19,544,466.63
本报告期期间基金拆分变动份额（份 额减少以“-”填列）	-5,622,371.00	-5,622,371.00	-26,920,400.75
本报告期期末基金份额总额	1,598,464.00	1,598,464.00	56,983,722.42

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动

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、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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所在本报告期的审计报酬为 40,000.00 元人民币。目前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为: 本基金合同生效之日(2015 年 6 月 4 日)起至本报告期末。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内, 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

	数量	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	10,398,427.80	27.40%	9,498.72	28.23%	-
长江证券	1	7,661,044.12	20.18%	7,135.22	21.21%	-
西部证券	1	6,659,299.59	17.54%	4,736.69	14.08%	-
东吴证券	1	2,095,664.32	5.52%	1,951.61	5.80%	-
国泰君安	2	2,028,510.00	5.34%	1,889.59	5.62%	-
东方证券	2	1,852,727.04	4.88%	1,725.38	5.13%	-
东北证券	1	1,573,475.00	4.15%	1,465.38	4.35%	-
中信建投	1	965,292.00	2.54%	879.67	2.61%	-
国信证券	1	715,743.00	1.89%	666.53	1.98%	-
东兴证券	1	695,610.93	1.83%	633.96	1.88%	-
中泰证券	2	664,292.80	1.75%	605.31	1.80%	-
中信证券	2	580,850.40	1.53%	540.99	1.61%	-
方正证券	2	536,597.79	1.41%	499.98	1.49%	-
华创证券	1	524,503.00	1.38%	488.69	1.45%	-
招商证券	2	250,405.10	0.66%	228.18	0.68%	-
民生证券	1	231,011.00	0.61%	215.22	0.64%	-
瑞银证券	1	146,018.00	0.38%	136.07	0.40%	-
中金国际	1	129,253.00	0.34%	120.43	0.36%	-
太平洋证券	2	127,558.36	0.34%	118.84	0.35%	-
申万宏源	3	69,370.70	0.18%	64.61	0.19%	-
银河证券	1	51,115.43	0.13%	47.61	0.14%	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-

华安证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	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	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	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新增交易单元：太平洋证券、万联证券；退租交易单元：江海证券。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期末租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	2018 年 1 月 1 日
2	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金招募说明书（更新）	基金管理人网站	2018 年 1 月 16 日
3	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
4	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
5	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
6	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
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 1 月 20 日
8	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
9	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

10	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
11	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
12	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
13	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金不定期份额折算期间 1000B 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 2 日
14	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
15	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
16	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
17	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
18	华宝中证 1000 指数分级证券	基金管理人网站	2018 年 3 月 27 日

	投资基金 2017 年度报告		
19	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
20	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
21	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金托管协议	基金管理人网站	2018 年 3 月 28 日
22	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同	基金管理人网站	2018 年 3 月 28 日
23	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
24	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
25	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
26	华宝基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	2018 年 7 月 1 日
27	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金招募说明书（更新）	基金管理人网站	2018 年 7 月 17 日
28	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 7 月 17 日
29	华宝中证 1000 指数分级证券	上海证券报、中国证	2018 年 7 月 18 日

	投资基金 2018 年第 2 季度报告	券报、证券时报以及 基金管理人网站	
30	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2018 年半年度报告	基金管理人网站	2018 年 8 月 24 日
31	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2018 年半年度报告 (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 8 月 24 日
32	华宝基金管理有限公司关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金经理变更公告	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 8 月 24 日
33	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 10 月 12 日
34	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 10 月 17 日
35	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 10 月 18 日
36	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 10 月 19 日
37	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 10 月 22 日
38	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2018 年第 3 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 10 月 26 日
39	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金	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 10 月 30 日

	投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	券报、证券时报以及 基金管理人网站	
40	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 10 月 31 日
41	华宝基金管理有限公司关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金办理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 12 月 11 日
42	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金办理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 12 月 11 日
43	关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间 1000A 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 12 月 17 日
44	华宝基金管理有限公司关于华宝中证 1000A 份额定期份额折算后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 12 月 18 日
45	华宝基金管理有限公司关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金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 12 月 18 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

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。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
华宝中证 1000 指数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。

13.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

13.3 查阅方式

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

华宝基金管理有限公司

2019 年 3 月 30 日