

华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	71
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	73
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	73
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	73
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	73
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	73
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	74
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	74
7.12 投资组合报告附注.....	74
§8 基金份额持有人信息.....	76
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	76
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	76
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	77
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	77
§9 开放式基金份额变动.....	78
§10 重大事件揭示.....	79
10.1 基金份额持有人大会决议.....	79
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	79
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	79
10.4 基金投资策略的改变.....	79
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	79
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	79
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	79
10.8 其他重大事件.....	81
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	84

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	84
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	84
§12 备查文件目录.....	85
12.1 备查文件目录.....	85
12.2 存放地点.....	85
12.3 查阅方式.....	85

§ 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	59,882,654.55 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2015-06-16		
下属分级基金的基金简称	1000A	1000B	华宝中证 1000 指数分级
下属分级基金场内简称:	1000A	1000B	1000 分级
下属分级基金的交易代码	150263	150264	162413
报告期末下属分级基金份额总额	1,772,901.00 份	1,772,901.00 份	56,336,852.55 份

2.2 基金产品说明

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

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	田青
	联系电话	021-38505888	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、 021-38924558	010—67595096
传真		021-38505777	010-66275853
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		孔祥清	田国立

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	-3,417,472.24
本期利润	8,666,753.60
加权平均基金份额本期利润	0.1433
本期加权平均净值利润率	17.88%
本期基金份额净值增长率	20.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	-101,343,081.13
期末可供分配基金份额利润	-1.6924
期末基金资产净值	48,316,486.63
期末基金份额净值	0.8069
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-67.36%

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

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

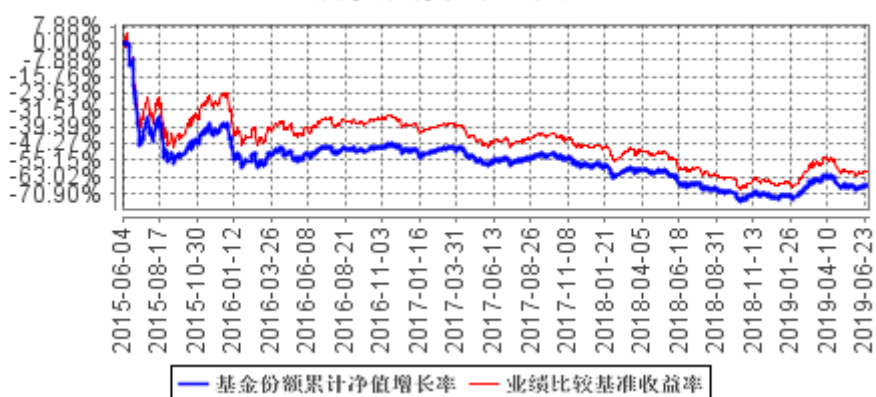
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.10%	1.41%	-0.22%	1.45%	0.32%	-0.04%
过去三个月	-8.16%	1.80%	-9.45%	1.84%	1.29%	-0.04%
过去六个月	20.83%	1.76%	19.16%	1.80%	1.67%	-0.04%
过去一年	-3.86%	1.64%	-4.68%	1.67%	0.82%	-0.03%
过去三年	-34.51%	1.30%	-37.34%	1.32%	2.83%	-0.02%

自基金合同生效日起至今	-67.36%	1.88%	-60.64%	1.90%	-6.72%	-0.02%
-------------	---------	-------	---------	-------	--------	--------

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

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人是在 2003 年 3 月 7 日正式成立的合资基金管理公司，截至本报告期末（2019 年 6 月 30 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、华宝科技先锋基金、华宝宝裕纯债基金、华宝大健康基金、华宝中短债基金、华宝稳健 FOF 基金、华宝宝盛纯债基金、华宝宝怡纯债基金、华宝消费升级基金、华宝质量价值基金等，正在管理运作的证券投资基金资产净值合计 171,851,775,826.03 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	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、

	价值 ETF、华宝上证 180 价值 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				数量分析师、投资经理助理、投资经理等职务。2015 年 11 月起任上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2016 年 8 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2018 年 4 月起任华宝中证 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。
张奇	本基金基金经理助理、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、华宝银行 ETF 联接基金经理助理	2017 年 4 月 6 日	-	9 年	本科。曾先后在毕博管理咨询有限公司、德邦证券从事咨询顾问及董事副总经理的工作。2014 年 10 月加入华宝基金管理有限公司担任高级数量分析师的职务。2015 年 4 月起兼任上证 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，2018 年 11 月起任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理，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合规守信情况的说明

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

由于股、债市的系统性风险和申购赎回引起的基金资产规模变化，中证 1000 指数分级证券投资基金在短期内出现过股票投资低于基金资产净值 90%的情况。发生此类情况后，该基金均在合理期限内得到了调整，没有给投资人带来额外风险或损失。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年上半年在中美贸易战的不确定性及 GDP 增速下降的背景下，市场对于宏观经济的预期放低，A 股市场倒是创出了近几年少有的单季度涨幅，在上涨过程中以中证 1000 为代表的中小市值指数表现较好，尤其是二三月份，在市场热度逐渐升温的过程中，之前被忽视的小盘股明显受到资金的边际参与，走出了一波犀利的反弹行情。四月下旬开始下跌，五月跌幅趋缓并在六月份企稳反弹。

本报告期本基金为正常运作期，在操作中，我们遵守基金合同，按照既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为 20.83%，业绩比较基准收益率为 19.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，面对复杂严峻的形势，未来继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策，着力

深化供给侧结构性改革，持续打好三大攻坚战，加快实施新旧动能转换应是题中之义。尽管科创板的推出可能让市场对于小盘股供给过大而压低市场估值的担心，但另一方面以中证 1000 为代表的小盘股可能受益于市场热度回升带来流动性改善。我们认为中证 1000 指数作为小盘股的基准指数，具有重要且独特的配置价值。

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，实现对指数的有效跟踪。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期亏损，未有应分未分的利润。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金基金合同生效于 2015 年 6 月 4 日，截至 2019 年 6 月 30 日，本基金基金资产净值存在连续超过六十个工作日低于五千万元的情形。根据相关规定，基金管理人已拟定解决方案，目前已通过证监会备案，基金管理人将尽快付诸实施，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝中证 1000 指数分级证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,897,112.69	2,632,693.09
结算备付金		-	-
存出保证金		3,125.81	818.24
交易性金融资产	6.4.7.2	45,571,341.43	37,797,465.57
其中：股票投资		45,566,453.11	37,797,465.57
基金投资		-	-
债券投资		4,888.32	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		39,644.54	30,510.65
应收利息	6.4.7.5	585.60	570.91
应收股利		-	-
应收申购款		44,733.41	26,802.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		48,556,543.48	40,488,861.34
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		16,963.69	72,229.05
应付管理人报酬		39,211.57	35,633.00
应付托管费		8,626.55	7,839.26
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	56,900.95	66,562.70

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	118,354.09	120,263.75
负债合计		240,056.85	302,527.76
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	148,034,289.42	148,771,293.31
未分配利润	6.4.7.10	-99,717,802.79	-108,584,959.73
所有者权益合计		48,316,486.63	40,186,333.58
负债和所有者权益总计		48,556,543.48	40,488,861.34

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，华宝中证 1000 基础份额基金份额净值 0.8069 元，基金份额总额 59,882,654.55 份；华宝中证 1000A 份额基金份额参考净值 1.0298 元，基金份额总额 1,772,901.00 份；华宝中证 1000B 份额基金份额参考净值 0.5840 元，基金份额总额 1,772,901.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华宝中证 1000 指数分级证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		9,159,456.85	-11,957,286.81
1.利息收入		12,336.16	13,517.83
其中：存款利息收入	6.4.7.11	12,333.32	13,517.83
债券利息收入		2.84	-
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）		-2,953,477.48	-6,872,184.03
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-3,303,910.11	-7,212,433.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	350,432.63	340,249.64
3.公允价值变动收益（损失以	6.4.7.17	12,084,225.84	-5,109,171.25

“-”号填列)			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	16,372.33	10,550.64
减:二、费用		492,703.25	571,017.94
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	238,890.75	300,293.22
2. 托管费	6.4.10.2.2	52,555.95	66,064.48
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	32,545.28	41,042.24
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	168,711.27	163,618.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		8,666,753.60	-12,528,304.75
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		8,666,753.60	-12,528,304.75

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 华宝中证 1000 指数分级证券投资基金

本报告期: 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	148,771,293.31	-108,584,959.73	40,186,333.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	8,666,753.60	8,666,753.60
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)	-737,003.89	200,403.34	-536,600.55
其中: 1.基金申购款	33,759,634.83	-22,726,022.76	11,033,612.07
2. 基金赎回款	-34,496,638.72	22,926,426.10	-11,570,212.62
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）	148,034,289.42	-99,717,802.79	48,316,486.63
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	170,411,754.42	-98,487,892.80	71,923,861.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-12,528,304.75	-12,528,304.75
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-24,456,710.35	14,617,707.51	-9,839,002.84
其中：1.基金申购款	9,920,382.64	-6,037,562.36	3,882,820.28
2.基金赎回款	-34,377,092.99	20,655,269.87	-13,721,823.12
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	145,955,044.07	-96,398,490.04	49,556,554.03

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝中证 1000 指数分级证券投资基金(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年收益率逐日计算，计算出华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值后，根据华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值与华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额之间的基金份额参考净值关系，可以计算出华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值。

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

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

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

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

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

本基金的财务报表于 2019 年 8 月 29 日已经本基金的基金管理人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本

准则》、各项具体会计准则及相关规定(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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

-

6.4.5.2 会计估计变更的说明

-

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于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]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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	2,897,112.69
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：	2,897,112.69

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	61,923,758.11	45,566,453.11	-16,357,305.00
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	4,888.32	88.32
	银行间市场	-	-
	合计	4,888.32	88.32
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	61,928,558.11	45,571,341.43	-16,357,216.68

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末及上年度末未持买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	580.92
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	2.84
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	0.44
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.40
合计	585.60

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	56,900.95
银行间市场应付交易费用	-
合计	56,900.95

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	57.82
预提费用	68,296.27

应付指数使用费	50,000.00
合计	118,354.09

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	60,180,650.42	148,771,293.31
本期申购	13,656,307.73	33,759,634.83
本期赎回(以“-”号填列)	-13,954,303.60	-34,496,638.72
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	59,882,654.55	148,034,289.42

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

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-98,430,827.42	-10,154,132.31	-108,584,959.73
本期利润	-3,417,472.24	12,084,225.84	8,666,753.60
本期基金份额交易产生的变动数	505,218.53	-304,815.19	200,403.34
其中：基金申购款	-22,522,947.46	-203,075.30	-22,726,022.76
基金赎回款	23,028,165.99	-101,739.89	22,926,426.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-101,343,081.13	1,625,278.34	-99,717,802.79

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

活期存款利息收入	12,126.76
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	167.14
其他	39.42
合计	12,333.32

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	11,428,540.70
减：卖出股票成本总额	14,732,450.81
买卖股票差价收入	-3,303,910.11

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	350,432.63
基金投资产生的股利收益	-
合计	350,432.63

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	12,084,225.84
——股票投资	12,084,137.52
——债券投资	88.32
——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	12,084,225.84

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	16,372.33
其他	-
合计	16,372.33

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

计入基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	32,545.28
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	32,545.28

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	18,707.70
基金上市费	29,752.78
银行汇划费用	415.00
其他	-
指数使用费	100,000.00
合计	168,711.27

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华宝基金管理有限公司(“华宝基金”)	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
华宝信托有限责任公司(“华宝信托”)	基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙(Warburg Pincus Asset Management, L.P.)	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司(“宝武集团”)	华宝信托的最终控制人
华宝证券有限责任公司(“华宝证券”)	受宝武集团控制的公司
华宝投资有限公司(“华宝投资”)	受宝武集团控制的公司
宝钢集团财务有限责任公司(“宝钢财务”)	受宝武集团控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

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交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	238,890.75	300,293.22
其中：支付销售机构的客户维护费	94,314.06	127,238.30

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 X 1.00% / 当年

天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	52,555.95	66,064.48

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.22% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.22% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用自有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	2,897,112.69	12,126.76	3,301,620.70	13,348.75

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019 年 6 月 26 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。

其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000029	深深房 A	2016 年 9 月 19 日	重大事项停牌	10.97	-	-	6,200	81,266.58	68,014.00	-
002323	*ST 百特	2018 年 8 月 20 日	重大事项停牌	1.31	-	-	2,900	40,046.79	3,799.00	-

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

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只指数型的分级证券投资基金，华宝中证 1000A 份额具有较低风险、收益相对稳定的特征；华宝中证 1000B 份额具有较高风险、较高预期收益的特征。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券等。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在经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；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结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；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。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,897,112.69	-	-	-	2,897,112.69
存出保证金	3,125.81	-	-	-	3,125.81
交易性金融资产	4,888.32	-	-	45,566,453.11	45,571,341.43
应收证券清算款	-	-	-	39,644.54	39,644.54
应收利息	-	-	-	585.60	585.60
应收申购款	1,218.79	-	-	43,514.62	44,733.41
资产总计	2,906,345.61	-	-	45,650,197.87	48,556,543.48
负债					
应付赎回款	-	-	-	16,963.69	16,963.69
应付管理人报酬	-	-	-	39,211.57	39,211.57
应付托管费	-	-	-	8,626.55	8,626.55

应付交易费用	-	-	-	56,900.95	56,900.95
其他负债	-	-	-	118,354.09	118,354.09
负债总计	-	-	-	240,056.85	240,056.85
利率敏感度缺口	2,906,345.61	-	-	-45,410,141.02	48,316,486.63
上年度末 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

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率上升 25 个基点	-55.69	-
2. 市场利率下降 25 个基点	56.82	-	

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法进行指数化投资，股票资产跟踪的标的指数为中证 1000 指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 90%，投资于中证 1000 指数成份股和备选成份股的市值不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5% 的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	45,566,453.11	94.31	37,797,465.57	94.06
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	4,888.32	0.01	-	-
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	45,571,341.43	94.32	37,797,465.57	94.06

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	2,366,162.75	2,001,388.72
	2. 业绩比较基准下降 5%	-2,366,162.75	-2,001,388.72

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 45,460,770.17 元，属于第二层次的余额为 110,571.26 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 37,724,412.57 元，第二层次 73,053.00 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 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 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。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	45,566,453.11	93.84
	其中：股票	45,566,453.11	93.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,888.32	0.01
	其中：债券	4,888.32	0.01
	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	2,897,112.69	5.97
8	其他各项资产	88,089.36	0.18
9	合计	48,556,543.48	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	542,845.10	1.12
B	采矿业	936,560.28	1.94
C	制造业	27,783,850.84	57.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,228,912.10	2.54
E	建筑业	1,249,794.95	2.59
F	批发和零售业	1,581,376.68	3.27
G	交通运输、仓储和邮政业	1,007,639.56	2.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,370,660.64	11.12

J	金融业	331,024.40	0.69
K	房地产业	1,804,843.01	3.74
L	租赁和商务服务业	430,965.39	0.89
M	科学研究和技术服务业	837,247.26	1.73
N	水利、环境和公共设施管理业	651,355.51	1.35
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	86,919.00	0.18
Q	卫生和社会工作	567,800.00	1.18
R	文化、体育和娱乐业	621,638.89	1.29
S	综合	298,312.20	0.62
	合计	45,331,745.81	93.82

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	29,912.30	0.06
C	制造业	77,595.18	0.16
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	21,516.88	0.04
J	金融业	33,869.94	0.07
K	房地产业	68,014.00	0.14
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	234,707.30	0.49

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300347	泰格医药	4,900	377,790.00	0.78
2	300014	亿纬锂能	5,881	179,135.26	0.37
3	300012	华测检测	16,100	173,880.00	0.36
4	600728	佳都科技	15,680	154,448.00	0.32
5	600635	大众公用	23,500	150,870.00	0.31
6	300285	国瓷材料	8,150	138,631.50	0.29
7	002138	顺络电子	7,800	137,124.00	0.28
8	600132	重庆啤酒	2,900	136,764.00	0.28
9	601799	星宇股份	1,700	134,232.00	0.28
10	600776	东方通信	5,800	133,284.00	0.28
11	300271	华宇软件	6,880	130,720.00	0.27
12	600797	浙大网新	12,800	130,432.00	0.27
13	002124	天邦股份	9,900	129,096.00	0.27
14	600873	梅花生物	26,400	126,456.00	0.26
15	600446	金证股份	6,200	121,768.00	0.25
16	600273	嘉化能源	10,400	120,224.00	0.25
17	300098	高新兴	14,963	119,404.74	0.25
18	300628	亿联网络	1,100	117,777.00	0.24
19	300170	汉得信息	8,600	116,874.00	0.24
20	000831	五矿稀土	7,100	115,233.00	0.24
21	600675	中华企业	22,200	115,218.00	0.24
22	600529	山东药玻	5,040	114,811.20	0.24
23	600604	市北高新	8,500	112,880.00	0.23
24	000735	罗牛山	11,200	110,544.00	0.23
25	002237	恒邦股份	6,600	110,286.00	0.23
26	300357	我武生物	3,140	106,508.80	0.22

27	002185	华天科技	20,700	105,363.00	0.22
28	300188	美亚柏科	5,900	105,197.00	0.22
29	600305	恒顺醋业	5,700	104,994.00	0.22
30	002035	华帝股份	8,530	103,895.40	0.22
31	300226	上海钢联	1,386	103,894.56	0.22
32	300558	贝达药业	2,400	99,600.00	0.21
33	600252	中恒集团	33,800	99,034.00	0.20
34	300079	数码科技	17,400	99,006.00	0.20
35	002123	梦网集团	6,900	97,566.00	0.20
36	000800	一汽轿车	9,900	97,416.00	0.20
37	000516	国际医学	19,100	97,028.00	0.20
38	000917	电广传媒	13,800	97,014.00	0.20
39	300180	华峰超纤	6,900	96,738.00	0.20
40	002648	卫星石化	6,500	96,720.00	0.20
41	002511	中顺洁柔	7,855	96,459.40	0.20
42	300212	易华录	3,936	96,432.00	0.20
43	300339	润和软件	6,800	95,880.00	0.20
44	603338	浙江鼎力	1,632	95,814.72	0.20
45	600323	瀚蓝环境	5,600	94,528.00	0.20
46	002396	星网锐捷	4,200	94,248.00	0.20
47	300529	健帆生物	1,500	93,525.00	0.19
48	600756	浪潮软件	3,900	93,288.00	0.19
49	300038	数知科技	9,960	93,225.60	0.19
50	600601	方正科技	26,600	92,036.00	0.19
51	002547	春兴精工	8,200	92,004.00	0.19
52	600320	振华重工	24,180	90,916.80	0.19
53	300203	聚光科技	3,800	90,820.00	0.19
54	002023	海特高新	7,400	90,576.00	0.19
55	000683	远兴能源	33,340	87,017.40	0.18
56	600868	梅雁吉祥	23,000	86,480.00	0.18
57	600206	有研新材	7,200	86,040.00	0.18
58	300463	迈克生物	3,400	85,442.00	0.18
59	000967	盈峰环境	11,492	85,040.80	0.18
60	000902	新洋丰	7,900	84,767.00	0.18
61	600711	盛屯矿业	15,600	84,396.00	0.17
62	600559	老白干酒	6,405	83,841.45	0.17
63	000591	太阳能	25,560	83,836.80	0.17
64	002099	海翔药业	11,800	83,780.00	0.17
65	002413	雷科防务	13,100	83,709.00	0.17

66	000040	东旭蓝天	12,600	83,664.00	0.17
67	002151	北斗星通	3,600	83,628.00	0.17
68	601011	宝泰隆	13,700	83,433.00	0.17
69	300496	中科创达	2,827	82,209.16	0.17
70	000560	我爱我家	17,180	82,120.40	0.17
71	000667	美好置业	31,100	81,793.00	0.17
72	002610	爱康科技	43,600	81,532.00	0.17
73	600771	广誉远	4,200	81,480.00	0.17
74	000968	蓝焰控股	7,000	81,270.00	0.17
75	002020	京新药业	7,000	80,640.00	0.17
76	300699	光威复材	2,460	80,442.00	0.17
77	002042	华孚时尚	11,050	80,223.00	0.17
78	002467	二六三	13,030	80,004.20	0.17
79	002727	一心堂	2,800	79,772.00	0.17
80	600702	舍得酒业	2,900	78,822.00	0.16
81	300567	精测电子	1,500	78,780.00	0.16
82	002449	国星光电	5,930	78,750.40	0.16
83	300451	创业慧康	5,250	78,487.50	0.16
84	000710	贝瑞基因	2,200	78,452.00	0.16
85	300118	东方日升	7,700	78,386.00	0.16
86	600803	新奥股份	7,500	78,375.00	0.16
87	002557	洽洽食品	3,100	78,275.00	0.16
88	002402	和而泰	8,250	78,127.50	0.16
89	300630	普利制药	1,350	77,787.00	0.16
90	600621	华鑫股份	5,200	77,428.00	0.16
91	600366	宁波韵升	8,400	77,112.00	0.16
92	600490	鹏欣资源	15,600	77,064.00	0.16
93	600667	太极实业	10,200	77,010.00	0.16
94	002203	海亮股份	7,100	76,822.00	0.16
95	600677	航天通信	4,400	76,428.00	0.16
96	601636	旗滨集团	19,600	76,244.00	0.16
97	600330	天通股份	9,680	76,084.80	0.16
98	300352	北信源	12,275	75,736.75	0.16
99	000650	仁和药业	10,500	75,705.00	0.16
100	002025	航天电器	3,100	75,578.00	0.16
101	600708	光明地产	13,467	75,145.86	0.16
102	600422	昆药集团	6,500	74,945.00	0.16
103	000059	华锦股份	11,700	74,880.00	0.15
104	002597	金禾实业	4,100	74,784.00	0.15

105	300369	绿盟科技	5,800	74,298.00	0.15
106	600596	新安股份	6,900	74,244.00	0.15
107	600503	华丽家族	19,500	74,100.00	0.15
108	600988	赤峰黄金	12,100	74,052.00	0.15
109	300073	当升科技	3,200	73,504.00	0.15
110	600185	格力地产	14,980	72,952.60	0.15
111	000697	炼石航空	6,500	72,930.00	0.15
112	601588	北辰实业	19,400	72,750.00	0.15
113	600226	瀚叶股份	22,806	72,523.08	0.15
114	600284	浦东建设	9,400	72,380.00	0.15
115	300068	南都电源	6,400	72,320.00	0.15
116	002063	远光软件	8,300	72,293.00	0.15
117	002126	银轮股份	9,700	72,168.00	0.15
118	300618	寒锐钴业	1,200	72,000.00	0.15
119	300367	东方网力	7,250	71,557.50	0.15
120	002488	金固股份	8,550	71,221.50	0.15
121	603368	柳药股份	2,164	71,152.32	0.15
122	000035	中国天楹	11,800	70,800.00	0.15
123	000739	普洛药业	7,200	70,776.00	0.15
124	002436	兴森科技	10,800	70,740.00	0.15
125	002446	盛路通信	7,420	70,712.60	0.15
126	000799	酒鬼酒	2,800	70,700.00	0.15
127	300595	欧普康视	1,980	70,488.00	0.15
128	300747	锐科激光	500	70,005.00	0.14
129	601222	林洋能源	14,908	69,918.52	0.14
130	002567	唐人神	6,050	69,877.50	0.14
131	600072	中船科技	5,400	69,876.00	0.14
132	600641	万业企业	5,900	69,738.00	0.14
133	300078	思创医惠	6,824	69,673.04	0.14
134	603707	健友股份	1,970	69,639.50	0.14
135	300616	尚品宅配	920	69,570.40	0.14
136	603128	华贸物流	7,400	69,560.00	0.14
137	600736	苏州高新	8,400	68,880.00	0.14
138	600936	广西广电	14,200	68,870.00	0.14
139	601519	大智慧	9,700	68,773.00	0.14
140	601375	中原证券	13,000	68,770.00	0.14
141	000921	海信家电	5,500	68,640.00	0.14
142	603658	安图生物	1,000	68,360.00	0.14
143	601058	赛轮轮胎	22,940	68,131.80	0.14

144	002376	新北洋	5,700	68,115.00	0.14
145	300401	花园生物	4,100	68,101.00	0.14
146	002458	益生股份	3,490	68,089.90	0.14
147	600562	国睿科技	4,432	68,075.52	0.14
148	603708	家家悦	2,968	67,729.76	0.14
149	002481	双塔食品	9,100	67,249.00	0.14
150	600612	老凤祥	1,500	67,050.00	0.14
151	000070	特发信息	5,480	67,020.40	0.14
152	002643	万润股份	6,600	66,660.00	0.14
153	002262	恩华药业	6,136	66,207.44	0.14
154	000875	吉电股份	20,800	66,144.00	0.14
155	603660	苏州科达	4,240	66,101.60	0.14
156	600850	华东电脑	3,100	65,999.00	0.14
157	002073	软控股份	11,300	65,992.00	0.14
158	600459	贵研铂业	3,650	65,955.50	0.14
159	600720	祁连山	7,500	65,925.00	0.14
160	000592	平潭发展	18,800	65,800.00	0.14
161	600108	亚盛集团	18,900	65,772.00	0.14
162	600175	美都能源	26,100	65,772.00	0.14
163	603678	火炬电子	3,250	65,487.50	0.14
164	000836	富通鑫茂	14,700	65,415.00	0.14
165	000793	华闻传媒	19,400	65,184.00	0.13
166	002531	天顺风能	10,780	65,111.20	0.13
167	300284	苏文科	7,052	65,089.96	0.13
168	300036	超图软件	4,400	65,032.00	0.13
169	000989	九芝堂	7,305	65,014.50	0.13
170	002497	雅化集团	9,300	65,007.00	0.13
171	300292	吴通控股	10,800	64,800.00	0.13
172	000851	高鸿股份	11,000	64,680.00	0.13
173	603043	广州酒家	2,000	64,660.00	0.13
174	600546	山煤国际	12,000	64,560.00	0.13
175	000036	华联控股	12,610	64,437.10	0.13
176	600483	福能股份	7,500	64,200.00	0.13
177	600491	龙元建设	9,300	64,170.00	0.13
178	601929	吉视传媒	26,400	64,152.00	0.13
179	300482	万孚生物	1,700	64,090.00	0.13
180	000901	航天科技	5,150	64,066.00	0.13
181	300054	鼎龙股份	8,040	63,918.00	0.13
182	000818	航锦科技	6,000	63,900.00	0.13

183	600326	西藏天路	8,400	63,840.00	0.13
184	600624	复旦复华	5,730	63,832.20	0.13
185	600783	鲁信创投	3,600	63,792.00	0.13
186	300149	量子生物	4,200	63,630.00	0.13
187	002389	航天彩虹	5,700	63,612.00	0.13
188	300476	胜宏科技	5,620	63,506.00	0.13
189	300326	凯利泰	7,000	63,350.00	0.13
190	002675	东诚药业	5,800	63,336.00	0.13
191	002716	金贵银业	8,120	63,336.00	0.13
192	002400	省广集团	21,200	63,176.00	0.13
193	600269	赣粤高速	14,200	63,048.00	0.13
194	600093	易见股份	5,500	62,975.00	0.13
195	600740	山西焦化	7,400	62,826.00	0.13
196	000733	振华科技	3,800	62,624.00	0.13
197	002618	丹邦科技	4,650	62,356.50	0.13
198	600337	美克家居	15,100	62,212.00	0.13
199	600217	中再资环	8,600	62,178.00	0.13
200	600110	诺德股份	14,000	62,020.00	0.13
201	600197	伊力特	3,200	61,760.00	0.13
202	002234	民和股份	2,200	61,578.00	0.13
203	002867	周大生	1,800	61,542.00	0.13
204	300185	通裕重工	31,700	61,498.00	0.13
205	002383	合众思壮	5,400	61,344.00	0.13
206	300377	赢时胜	5,400	61,128.00	0.13
207	002168	惠程科技	6,900	61,065.00	0.13
208	300085	银之杰	4,300	61,017.00	0.13
209	600360	华微电子	9,400	61,006.00	0.13
210	002683	宏大爆破	5,200	60,840.00	0.13
211	600123	兰花科创	8,300	60,756.00	0.13
212	300666	江丰电子	1,600	60,672.00	0.13
213	300145	中金环境	13,940	60,499.60	0.13
214	600761	安徽合力	6,300	60,480.00	0.13
215	002421	达实智能	16,200	60,426.00	0.13
216	002429	兆驰股份	22,000	60,280.00	0.12
217	000958	东方能源	9,400	60,160.00	0.12
218	000672	上峰水泥	4,900	60,123.00	0.12
219	000900	现代投资	12,900	60,114.00	0.12
220	600517	置信电气	8,200	60,024.00	0.12
221	603323	苏农银行	10,810	59,887.40	0.12

222	600602	云赛智联	7,800	59,826.00	0.12
223	600067	冠城大通	12,700	59,817.00	0.12
224	601666	平煤股份	14,300	59,774.00	0.12
225	600210	紫江企业	14,700	59,535.00	0.12
226	300053	欧比特	5,945	59,331.10	0.12
227	600456	宝钛股份	2,600	59,306.00	0.12
228	002156	通富微电	6,970	59,105.60	0.12
229	000546	金圆股份	6,100	58,804.00	0.12
230	300294	博雅生物	2,150	58,372.50	0.12
231	300037	新宙邦	2,800	58,352.00	0.12
232	603882	金域医学	1,700	58,310.00	0.12
233	601918	新集能源	18,900	58,212.00	0.12
234	000933	神火股份	13,800	58,098.00	0.12
235	000918	嘉凯城	8,800	58,080.00	0.12
236	000936	华西股份	6,500	58,045.00	0.12
237	600057	厦门象屿	13,026	57,965.70	0.12
238	600502	安徽水利	12,456	57,920.40	0.12
239	000789	万年青	5,750	57,615.00	0.12
240	600116	三峡水利	7,200	57,456.00	0.12
241	600363	联创光电	4,300	57,448.00	0.12
242	002657	中科金财	3,300	57,420.00	0.12
243	002097	山河智能	9,200	57,408.00	0.12
244	002326	永太科技	7,000	57,400.00	0.12
245	600020	中原高速	10,900	57,225.00	0.12
246	002568	百润股份	3,200	57,216.00	0.12
247	300184	力源信息	5,640	57,189.60	0.12
248	002537	海联金汇	7,580	57,153.20	0.12
249	000016	深康佳 A	13,600	57,120.00	0.12
250	002649	博彦科技	6,400	57,024.00	0.12
251	002139	拓邦股份	9,825	56,985.00	0.12
252	002430	杭氧股份	4,700	56,682.00	0.12
253	600577	精达股份	18,700	56,661.00	0.12
254	000996	中国中期	4,150	56,564.50	0.12
255	002596	海南瑞泽	7,000	56,560.00	0.12
256	603345	安井食品	1,100	56,540.00	0.12
257	002717	岭南股份	11,180	56,347.20	0.12
258	002912	中新赛克	600	56,322.00	0.12
259	300222	科大智能	4,320	56,246.40	0.12
260	300457	赢合科技	2,250	56,092.50	0.12

261	603018	中设集团	4,500	56,025.00	0.12
262	002036	联创电子	6,110	55,906.50	0.12
263	600990	四创电子	1,200	55,824.00	0.12
264	300137	先河环保	6,700	55,811.00	0.12
265	300355	蒙草生态	13,600	55,760.00	0.12
266	002145	中核钛白	13,500	55,755.00	0.12
267	002130	沃尔核材	10,700	55,747.00	0.12
268	300176	派生科技	3,790	55,713.00	0.12
269	300310	宜通世纪	7,488	55,710.72	0.12
270	600331	宏达股份	17,300	55,533.00	0.11
271	002614	奥佳华	3,400	55,488.00	0.11
272	002171	楚江新材	8,700	55,332.00	0.11
273	600512	腾达建设	19,400	55,290.00	0.11
274	300349	金卡智能	3,100	55,118.00	0.11
275	300379	东方通	2,700	55,080.00	0.11
276	002047	宝鹰股份	9,800	54,978.00	0.11
277	000976	华铁股份	9,700	54,708.00	0.11
278	300130	新国都	3,440	54,696.00	0.11
279	002313	日海智能	2,700	54,540.00	0.11
280	002080	中材科技	6,014	54,486.84	0.11
281	002851	麦格米特	2,750	54,367.50	0.11
282	600986	科达股份	12,840	54,313.20	0.11
283	300322	硕贝德	3,500	54,250.00	0.11
284	600846	同济科技	6,100	54,107.00	0.11
285	002091	江苏国泰	9,460	54,016.60	0.11
286	000582	北部湾港	6,000	54,000.00	0.11
287	603718	海利生物	3,885	53,884.95	0.11
288	002737	葵花药业	3,500	53,865.00	0.11
289	600668	尖峰集团	4,200	53,760.00	0.11
290	601369	陕鼓动力	8,100	53,703.00	0.11
291	000555	神州信息	4,700	53,486.00	0.11
292	600851	海欣股份	7,200	53,352.00	0.11
293	002697	红旗连锁	8,240	53,312.80	0.11
294	600531	豫光金铅	10,600	53,106.00	0.11
295	600764	中国海防	1,900	52,972.00	0.11
296	000951	中国重汽	3,300	52,965.00	0.11
297	300232	洲明科技	5,448	52,736.64	0.11
298	600622	光大嘉宝	10,820	52,693.40	0.11
299	000726	鲁泰 A	5,500	52,580.00	0.11

300	002292	奥飞娱乐	8,200	52,562.00	0.11
301	603027	千禾味业	2,200	52,514.00	0.11
302	600981	汇鸿集团	10,900	52,429.00	0.11
303	300238	冠昊生物	2,600	52,364.00	0.11
304	603588	高能环境	4,900	52,283.00	0.11
305	600059	古越龙山	5,900	52,274.00	0.11
306	002370	亚太药业	3,300	52,140.00	0.11
307	603399	吉翔股份	4,600	51,750.00	0.11
308	600200	江苏吴中	8,800	51,744.00	0.11
309	001696	宗申动力	8,300	51,709.00	0.11
310	300300	汉鼎宇佑	4,975	51,640.50	0.11
311	000034	神州数码	4,000	51,600.00	0.11
312	601677	明泰铝业	5,000	51,550.00	0.11
313	603026	石大胜华	1,700	51,442.00	0.11
314	300047	天源迪科	6,145	51,433.65	0.11
315	600742	一汽富维	4,820	51,429.40	0.11
316	600477	杭萧钢构	15,670	51,397.60	0.11
317	000088	盐田港	9,400	51,324.00	0.11
318	300725	药石科技	820	51,110.60	0.11
319	600105	永鼎股份	10,540	50,802.80	0.11
320	300348	长亮科技	3,500	50,750.00	0.11
321	000882	华联股份	19,900	50,745.00	0.11
322	300102	乾照光电	8,700	50,721.00	0.10
323	002550	千红制药	10,900	50,576.00	0.10
324	300208	青岛中程	6,450	50,503.50	0.10
325	600789	鲁抗医药	7,540	50,216.40	0.10
326	600162	香江控股	20,550	50,142.00	0.10
327	002022	科华生物	5,000	50,050.00	0.10
328	603599	广信股份	3,400	49,878.00	0.10
329	002564	天沃科技	8,600	49,708.00	0.10
330	603686	龙马环卫	2,500	49,700.00	0.10
331	000795	英洛华	6,900	49,680.00	0.10
332	002522	浙江众成	6,600	49,566.00	0.10
333	300353	东土科技	3,800	49,552.00	0.10
334	600966	博汇纸业	13,000	49,530.00	0.10
335	600129	太极集团	4,700	49,491.00	0.10
336	002104	恒宝股份	6,876	49,438.44	0.10
337	002100	天康生物	6,100	49,410.00	0.10
338	300177	中海达	5,650	49,268.00	0.10

339	300101	振芯科技	4,800	49,200.00	0.10
340	002261	拓维信息	8,000	48,880.00	0.10
341	600496	精工钢构	15,400	48,818.00	0.10
342	000507	珠海港	7,900	48,743.00	0.10
343	600495	晋西车轴	10,280	48,727.20	0.10
344	000550	江铃汽车	2,500	48,475.00	0.10
345	000751	锌业股份	13,700	48,361.00	0.10
346	300131	英唐智控	9,100	48,230.00	0.10
347	002428	云南锗业	6,300	48,069.00	0.10
348	600285	羚锐制药	5,700	48,051.00	0.10
349	002276	万马股份	8,800	47,960.00	0.10
350	002498	汉缆股份	16,200	47,952.00	0.10
351	002182	云海金属	6,300	47,943.00	0.10
352	601069	西部黄金	3,100	47,740.00	0.10
353	300123	亚光科技	6,040	47,595.20	0.10
354	600300	维维股份	14,200	47,570.00	0.10
355	000429	粤高速 A	6,300	47,565.00	0.10
356	002117	东港股份	4,550	47,547.50	0.10
357	002115	三维通信	4,000	47,520.00	0.10
358	300044	赛为智能	6,580	47,507.60	0.10
359	603039	泛微网络	640	47,488.00	0.10
360	000043	中航善达	4,000	47,400.00	0.10
361	000666	经纬纺机	3,800	47,310.00	0.10
362	000903	云内动力	16,700	47,261.00	0.10
363	600343	航天动力	4,600	47,150.00	0.10
364	600997	开滦股份	7,700	47,124.00	0.10
365	002621	美吉姆	3,600	47,088.00	0.10
366	002041	登海种业	4,300	47,042.00	0.10
367	300365	恒华科技	2,900	47,009.00	0.10
368	002108	沧州明珠	12,042	46,963.80	0.10
369	000603	盛达矿业	4,200	46,956.00	0.10
370	002215	诺普信	6,700	46,900.00	0.10
371	002067	景兴纸业	13,500	46,440.00	0.10
372	000915	山大华特	2,270	46,421.50	0.10
373	300205	天喻信息	3,100	46,376.00	0.10
374	002663	普邦股份	15,300	46,359.00	0.10
375	002222	福晶科技	4,150	46,355.50	0.10
376	603605	珀莱雅	700	46,326.00	0.10
377	000810	创维数字	5,200	45,968.00	0.10

378	600063	皖维高新	16,400	45,920.00	0.10
379	000828	东莞控股	5,000	45,850.00	0.09
380	603508	思维列控	700	45,556.00	0.09
381	002474	榕基软件	5,300	45,527.00	0.09
382	600420	现代制药	5,100	45,492.00	0.09
383	300236	上海新阳	1,400	45,416.00	0.09
384	300233	金城医药	2,400	45,408.00	0.09
385	000801	四川九洲	7,500	45,375.00	0.09
386	600790	轻纺城	12,500	45,375.00	0.09
387	300406	九强生物	3,000	45,240.00	0.09
388	002301	齐心集团	3,900	45,201.00	0.09
389	002698	博实股份	5,000	45,200.00	0.09
390	603113	金能科技	4,100	45,182.00	0.09
391	300020	银江股份	5,600	45,136.00	0.09
392	000676	智度股份	5,000	45,100.00	0.09
393	002031	巨轮智能	21,400	44,940.00	0.09
394	002167	东方锆业	6,000	44,940.00	0.09
395	002303	美盈森	9,300	44,919.00	0.09
396	002705	新宝股份	3,900	44,850.00	0.09
397	000935	四川双马	2,800	44,772.00	0.09
398	002192	融捷股份	2,200	44,660.00	0.09
399	600400	红豆股份	12,220	44,603.00	0.09
400	002318	久立特材	6,100	44,591.00	0.09
401	000910	大亚圣象	4,000	44,560.00	0.09
402	300495	美尚生态	3,283	44,550.31	0.09
403	002425	凯撒文化	6,880	44,513.60	0.09
404	002235	安妮股份	5,075	44,507.75	0.09
405	300091	金通灵	8,920	44,332.40	0.09
406	002267	陕天然气	5,400	44,226.00	0.09
407	603318	派思股份	2,000	44,200.00	0.09
408	600133	东湖高新	7,000	44,170.00	0.09
409	002721	金一文化	7,100	44,162.00	0.09
410	600308	华泰股份	9,900	44,154.00	0.09
411	002309	中利集团	6,400	44,032.00	0.09
412	300685	艾德生物	840	43,990.80	0.09
413	300183	东软载波	2,800	43,904.00	0.09
414	603108	润达医疗	4,140	43,801.20	0.09
415	000688	国城矿业	4,100	43,706.00	0.09
416	000928	中钢国际	7,520	43,691.20	0.09

417	002307	北新路桥	6,500	43,680.00	0.09
418	300456	耐威科技	1,600	43,680.00	0.09
419	601890	亚星锚链	7,000	43,680.00	0.09
420	600146	商赢环球	2,900	43,558.00	0.09
421	603118	共进股份	4,700	43,522.00	0.09
422	000957	中通客车	5,800	43,500.00	0.09
423	600987	航民股份	6,570	43,427.70	0.09
424	300474	景嘉微	1,100	43,406.00	0.09
425	002003	伟星股份	6,400	43,264.00	0.09
426	600812	华北制药	9,900	43,263.00	0.09
427	300523	辰安科技	800	43,088.00	0.09
428	002206	海利得	10,400	42,952.00	0.09
429	002095	生意宝	1,800	42,948.00	0.09
430	601949	中国出版	6,600	42,900.00	0.09
431	300633	开立医疗	1,500	42,840.00	0.09
432	002367	康力电梯	5,800	42,804.00	0.09
433	002228	合兴包装	8,500	42,755.00	0.09
434	603638	艾迪精密	1,895	42,637.50	0.09
435	002585	双星新材	8,390	42,453.40	0.09
436	600626	申达股份	6,200	42,408.00	0.09
437	601908	京运通	12,100	42,229.00	0.09
438	000520	长航凤凰	12,300	42,189.00	0.09
439	002798	帝欧家居	2,300	42,113.00	0.09
440	002859	洁美科技	1,600	42,080.00	0.09
441	300031	宝通科技	3,400	42,024.00	0.09
442	000811	冰轮环境	4,750	41,942.50	0.09
443	002746	仙坛股份	2,710	41,923.70	0.09
444	000731	四川美丰	7,200	41,832.00	0.09
445	002298	中电兴发	5,900	41,772.00	0.09
446	002258	利尔化学	3,200	41,760.00	0.09
447	600391	航发科技	2,800	41,692.00	0.09
448	600636	三爱富	3,800	41,686.00	0.09
449	300502	新易盛	1,700	41,684.00	0.09
450	601700	风范股份	6,900	41,676.00	0.09
451	300237	美晨生态	10,600	41,658.00	0.09
452	300299	富春股份	6,140	41,629.20	0.09
453	002135	东南网架	7,500	41,550.00	0.09
454	600255	梦舟股份	21,500	41,495.00	0.09
455	002733	雄韬股份	2,050	41,451.00	0.09

456	300075	数字政通	3,700	41,440.00	0.09
457	002668	奥马电器	7,994	41,408.92	0.09
458	600658	电子城	8,100	41,391.00	0.09
459	603881	数据港	1,300	41,366.00	0.09
460	002219	恒康医疗	13,600	41,208.00	0.09
461	601116	三江购物	2,700	41,148.00	0.09
462	600963	岳阳林纸	8,500	41,140.00	0.09
463	600096	云天化	6,900	41,124.00	0.09
464	300194	福安药业	7,200	41,112.00	0.09
465	002447	晨鑫科技	12,050	41,090.50	0.09
466	300487	蓝晓科技	1,300	40,976.00	0.08
467	000597	东北制药	3,700	40,959.00	0.08
468	002226	江南化工	7,600	40,888.00	0.08
469	300066	三川智慧	7,600	40,888.00	0.08
470	002341	新纶科技	7,000	40,880.00	0.08
471	000889	中嘉博创	3,200	40,864.00	0.08
472	300303	聚飞光电	12,340	40,845.40	0.08
473	002515	金字火腿	7,020	40,786.20	0.08
474	300661	圣邦股份	400	40,708.00	0.08
475	300158	振东制药	7,500	40,650.00	0.08
476	600569	安阳钢铁	13,900	40,588.00	0.08
477	600590	泰豪科技	6,260	40,502.20	0.08
478	300039	上海凯宝	9,100	40,495.00	0.08
479	600055	万东医疗	3,900	40,482.00	0.08
480	600230	沧州大化	2,960	40,404.00	0.08
481	600773	西藏城投	6,000	40,380.00	0.08
482	600662	强生控股	7,700	40,348.00	0.08
483	603609	禾丰牧业	3,400	40,256.00	0.08
484	603363	傲农生物	2,100	40,236.00	0.08
485	300045	华力创通	4,500	40,230.00	0.08
486	000030	富奥股份	8,600	40,162.00	0.08
487	600571	信雅达	4,300	40,076.00	0.08
488	002061	浙江交科	6,700	40,066.00	0.08
489	002726	龙大肉食	3,680	40,038.40	0.08
490	002364	中恒电气	4,100	40,016.00	0.08
491	002677	浙江美大	3,040	40,006.40	0.08
492	600351	亚宝药业	6,500	39,975.00	0.08
493	300096	易联众	4,200	39,900.00	0.08
494	002277	友阿股份	11,800	39,884.00	0.08

495	002043	兔宝宝	6,600	39,864.00	0.08
496	300458	全志科技	1,906	39,835.40	0.08
497	600661	昂立教育	1,700	39,831.00	0.08
498	300298	三诺生物	3,380	39,816.40	0.08
499	601886	江河集团	5,600	39,816.00	0.08
500	000639	西王食品	4,660	39,796.40	0.08
501	300034	钢研高纳	2,679	39,756.36	0.08
502	300081	恒信东方	3,200	39,744.00	0.08
503	600076	康欣新材	8,800	39,600.00	0.08
504	002256	兆新股份	13,700	39,593.00	0.08
505	002327	富安娜	5,300	39,591.00	0.08
506	000687	华讯方舟	5,600	39,536.00	0.08
507	000155	川能动力	9,300	39,525.00	0.08
508	600810	神马股份	3,200	39,520.00	0.08
509	002542	中化岩土	8,750	39,462.50	0.08
510	600239	云南城投	13,600	39,440.00	0.08
511	002293	罗莱生活	3,970	39,342.70	0.08
512	601113	华鼎股份	5,600	39,256.00	0.08
513	000049	德赛电池	1,500	39,045.00	0.08
514	600261	阳光照明	10,600	38,902.00	0.08
515	002545	东方铁塔	6,100	38,857.00	0.08
516	600322	天房发展	10,700	38,841.00	0.08
517	600681	百川能源	5,220	38,836.80	0.08
518	300198	纳川股份	9,980	38,822.20	0.08
519	300602	飞荣达	1,500	38,820.00	0.08
520	601606	长城军工	2,600	38,818.00	0.08
521	000973	佛塑科技	9,400	38,728.00	0.08
522	002166	莱茵生物	4,800	38,640.00	0.08
523	603127	昭衍新药	800	38,544.00	0.08
524	002079	苏州固锝	5,300	38,531.00	0.08
525	601388	怡球资源	17,180	38,483.20	0.08
526	300366	创意信息	3,800	38,418.00	0.08
527	002308	威创股份	7,700	38,346.00	0.08
528	002647	仁东控股	2,700	38,340.00	0.08
529	601952	苏垦农发	4,990	38,323.20	0.08
530	002619	艾格拉斯	11,180	38,235.60	0.08
531	002355	兴民智通	4,600	38,226.00	0.08
532	600075	新疆天业	7,180	38,125.80	0.08
533	000620	新华联	9,200	38,088.00	0.08

534	601858	中国科传	2,900	38,019.00	0.08
535	300219	鸿利智汇	5,150	38,007.00	0.08
536	600389	江山股份	1,800	37,980.00	0.08
537	002792	通宇通讯	1,650	37,900.50	0.08
538	600691	阳煤化工	14,400	37,872.00	0.08
539	000601	韶能股份	7,900	37,841.00	0.08
540	600676	交运股份	7,500	37,800.00	0.08
541	002240	威华股份	4,500	37,755.00	0.08
542	002055	得润电子	3,500	37,730.00	0.08
543	002283	天润曲轴	9,600	37,728.00	0.08
544	000584	哈工智能	5,200	37,544.00	0.08
545	603096	新经典	700	37,534.00	0.08
546	300506	名家汇	3,990	37,506.00	0.08
547	300398	飞凯材料	3,020	37,478.20	0.08
548	300735	光弘科技	2,190	37,405.20	0.08
549	600106	重庆路桥	11,606	37,255.26	0.08
550	300679	电连技术	1,330	37,053.80	0.08
551	300311	任子行	4,931	37,031.81	0.08
552	600481	双良节能	10,000	37,000.00	0.08
553	300568	星源材质	1,600	36,880.00	0.08
554	300128	锦富技术	9,288	36,780.48	0.08
555	600856	中天能源	11,600	36,772.00	0.08
556	002443	金洲管道	5,100	36,669.00	0.08
557	600929	湖南盐业	4,500	36,630.00	0.08
558	002540	亚太科技	7,700	36,498.00	0.08
559	002322	理工环科	2,900	36,482.00	0.08
560	002239	奥特佳	19,000	36,480.00	0.08
561	300083	劲胜智能	12,200	36,478.00	0.08
562	601163	三角轮胎	2,900	36,366.00	0.08
563	002530	金财互联	3,720	36,307.20	0.08
564	300107	建新股份	4,000	36,280.00	0.08
565	002245	澳洋顺昌	8,300	36,271.00	0.08
566	600710	苏美达	6,300	36,225.00	0.07
567	300623	捷捷微电	1,600	36,192.00	0.07
568	000797	中国武夷	7,951	36,177.05	0.07
569	600568	中珠医疗	16,900	36,166.00	0.07
570	000525	红太阳	2,800	36,148.00	0.07
571	600855	航天长峰	2,600	36,114.00	0.07
572	002224	三力士	6,100	36,112.00	0.07

573	600552	凯盛科技	7,400	36,112.00	0.07
574	300748	金力永磁	600	36,048.00	0.07
575	002510	天汽模	8,900	36,045.00	0.07
576	002747	埃斯顿	4,100	36,039.00	0.07
577	300016	北陆药业	4,150	36,022.00	0.07
578	601101	昊华能源	5,800	36,018.00	0.07
579	002462	嘉事堂	2,400	36,000.00	0.07
580	002776	柏堡龙	2,200	35,970.00	0.07
581	600734	实达集团	3,800	35,948.00	0.07
582	300252	金信诺	3,440	35,913.60	0.07
583	002279	久其软件	5,180	35,897.40	0.07
584	002695	煌上煌	2,500	35,875.00	0.07
585	600800	天津磁卡	5,900	35,695.00	0.07
586	603458	勘设股份	1,595	35,600.40	0.07
587	600184	光电股份	3,100	35,557.00	0.07
588	600227	圣济堂	12,300	35,547.00	0.07
589	002029	七匹狼	5,500	35,530.00	0.07
590	603111	康尼机电	7,200	35,496.00	0.07
591	002630	华西能源	11,500	35,420.00	0.07
592	300726	宏达电子	1,500	35,400.00	0.07
593	300157	恒泰艾普	6,900	35,397.00	0.07
594	601126	四方股份	5,900	35,282.00	0.07
595	000802	北京文化	3,500	35,245.00	0.07
596	002484	江海股份	5,816	35,244.96	0.07
597	000544	中原环保	4,650	35,200.50	0.07
598	300527	中国应急	3,183	35,172.15	0.07
599	002626	金达威	3,000	35,160.00	0.07
600	300255	常山药业	5,700	35,112.00	0.07
601	603357	设计总院	2,800	35,084.00	0.07
602	600523	贵航股份	2,460	35,055.00	0.07
603	300224	正海磁材	3,950	35,036.50	0.07
604	002636	金安国纪	3,500	34,965.00	0.07
605	300409	道氏技术	2,760	34,858.80	0.07
606	300309	吉艾科技	5,280	34,848.00	0.07
607	600715	文投控股	9,000	34,830.00	0.07
608	600211	西藏药业	1,100	34,826.00	0.07
609	300737	科顺股份	3,700	34,780.00	0.07
610	002148	北纬科技	5,460	34,725.60	0.07
611	000150	宜华健康	6,304	34,672.00	0.07

612	002464	众应互联	4,334	34,672.00	0.07
613	603989	艾华集团	1,830	34,550.40	0.07
614	300373	扬杰科技	2,300	34,477.00	0.07
615	600114	东睦股份	5,480	34,469.20	0.07
616	002582	好想你	3,800	34,428.00	0.07
617	002204	大连重工	9,400	34,404.00	0.07
618	000950	重药控股	6,300	34,398.00	0.07
619	603063	禾望电气	3,100	34,348.00	0.07
620	002034	旺能环境	2,000	34,320.00	0.07
621	600581	八一钢铁	9,300	34,317.00	0.07
622	300021	大禹节水	5,800	34,278.00	0.07
623	300065	海兰信	2,850	34,257.00	0.07
624	002343	慈文传媒	4,530	34,246.80	0.07
625	000665	湖北广电	4,100	34,112.00	0.07
626	300343	联创互联	4,730	34,056.00	0.07
627	002611	东方精工	8,840	34,034.00	0.07
628	600172	黄河旋风	10,560	34,003.20	0.07
629	000913	钱江摩托	3,300	33,990.00	0.07
630	600508	上海能源	3,500	33,915.00	0.07
631	002321	华英农业	5,200	33,800.00	0.07
632	600290	华仪电气	6,500	33,800.00	0.07
633	600550	保变电气	8,900	33,731.00	0.07
634	603803	瑞斯康达	2,600	33,696.00	0.07
635	300050	世纪鼎利	5,300	33,602.00	0.07
636	000055	方大集团	6,550	33,536.00	0.07
637	600382	广东明珠	4,350	33,451.50	0.07
638	000925	众合科技	4,700	33,370.00	0.07
639	002197	证通电子	4,400	33,352.00	0.07
640	002121	科陆电子	6,800	33,320.00	0.07
641	002929	润建股份	1,100	33,286.00	0.07
642	600758	红阳能源	6,400	33,216.00	0.07
643	002378	章源钨业	4,500	33,210.00	0.07
644	300256	星星科技	9,250	33,207.50	0.07
645	000545	金浦钛业	8,400	33,180.00	0.07
646	603220	贝通信	1,200	33,180.00	0.07
647	002930	宏川智慧	2,060	33,063.00	0.07
648	002554	惠博普	9,100	33,033.00	0.07
649	000822	山东海化	6,500	33,020.00	0.07
650	300262	巴安水务	4,900	32,977.00	0.07

651	600995	文山电力	4,100	32,964.00	0.07
652	000407	胜利股份	8,500	32,895.00	0.07
653	600318	新力金融	4,400	32,868.00	0.07
654	002060	粤水电	10,200	32,844.00	0.07
655	002768	国恩股份	1,300	32,825.00	0.07
656	002448	中原内配	5,900	32,804.00	0.07
657	600090	同济堂	7,000	32,760.00	0.07
658	603393	新天然气	1,400	32,760.00	0.07
659	300323	华灿光电	5,300	32,754.00	0.07
660	600103	青山纸业	13,970	32,689.80	0.07
661	002453	华软科技	5,500	32,670.00	0.07
662	300110	华仁药业	7,120	32,609.60	0.07
663	601366	利群股份	5,200	32,604.00	0.07
664	000927	一汽夏利	7,700	32,571.00	0.07
665	002433	太安堂	6,500	32,565.00	0.07
666	603456	九洲药业	3,900	32,565.00	0.07
667	300634	彩讯股份	1,500	32,505.00	0.07
668	600303	曙光股份	6,600	32,406.00	0.07
669	603699	纽威股份	2,700	32,400.00	0.07
670	600231	凌钢股份	10,060	32,393.20	0.07
671	600798	宁波海运	8,800	32,384.00	0.07
672	300438	鹏辉能源	2,000	32,360.00	0.07
673	603387	基蛋生物	1,260	32,319.00	0.07
674	600229	城市传媒	4,300	32,293.00	0.07
675	300223	北京君正	1,160	32,271.20	0.07
676	603337	杰克股份	1,572	32,210.28	0.07
677	603636	南威软件	3,200	32,160.00	0.07
678	600136	当代明诚	3,000	32,100.00	0.07
679	601107	四川成渝	7,900	31,995.00	0.07
680	002253	川大智胜	2,150	31,949.00	0.07
681	300724	捷佳伟创	1,200	31,944.00	0.07
682	300006	莱美药业	6,838	31,933.46	0.07
683	300064	豫金刚石	7,300	31,901.00	0.07
684	002928	华夏航空	2,850	31,863.00	0.07
685	603367	辰欣药业	2,200	31,790.00	0.07
686	300007	汉威科技	2,500	31,725.00	0.07
687	002320	海峡股份	3,545	31,692.30	0.07
688	000065	北方国际	3,625	31,646.25	0.07
689	000821	京山轻机	3,900	31,629.00	0.07

690	300263	隆华科技	6,700	31,557.00	0.07
691	300008	天海防务	8,150	31,540.50	0.07
692	603359	东珠生态	1,860	31,527.00	0.07
693	000815	美利云	3,400	31,518.00	0.07
694	002650	加加食品	8,400	31,416.00	0.07
695	002664	长鹰信质	2,400	31,416.00	0.07
696	002609	捷顺科技	3,900	31,356.00	0.06
697	002229	鸿博股份	4,150	31,332.50	0.06
698	002617	露笑科技	7,199	31,243.66	0.06
699	300388	国祯环保	3,300	31,119.00	0.06
700	603308	应流股份	3,200	31,072.00	0.06
701	601015	陕西黑猫	7,865	30,988.10	0.06
702	603980	吉华集团	3,400	30,804.00	0.06
703	300759	康龙化成	900	30,762.00	0.06
704	000615	京汉股份	5,700	30,723.00	0.06
705	300386	飞天诚信	2,500	30,600.00	0.06
706	300229	拓尔思	2,900	30,566.00	0.06
707	002094	青岛金王	5,840	30,368.00	0.06
708	300231	银信科技	4,300	30,358.00	0.06
709	603618	杭电股份	4,200	30,282.00	0.06
710	600278	东方创业	2,500	30,100.00	0.06
711	300332	天壕环境	6,400	30,080.00	0.06
712	300364	中文在线	6,519	30,052.59	0.06
713	000657	中钨高新	4,280	29,960.00	0.06
714	002329	皇氏集团	6,040	29,777.20	0.06
715	600480	凌云股份	3,400	29,750.00	0.06
716	002314	南山控股	9,900	29,700.00	0.06
717	300477	合纵科技	3,500	29,680.00	0.06
718	600449	宁夏建材	3,500	29,680.00	0.06
719	000881	中广核技	3,700	29,637.00	0.06
720	603959	百利科技	2,056	29,606.40	0.06
721	002218	拓日新能	9,000	29,520.00	0.06
722	601789	宁波建工	7,100	29,394.00	0.06
723	002646	青青稞酒	2,200	29,392.00	0.06
724	300191	潜能恒信	1,600	29,328.00	0.06
725	000576	广东甘化	3,200	29,280.00	0.06
726	300465	高伟达	3,780	29,257.20	0.06
727	600630	龙头股份	3,600	29,196.00	0.06
728	603003	龙宇燃油	3,500	29,155.00	0.06

729	600180	瑞茂通	3,700	29,119.00	0.06
730	603298	杭叉集团	2,300	29,118.00	0.06
731	600684	珠江实业	7,260	29,112.60	0.06
732	002284	亚太股份	5,400	29,106.00	0.06
733	300571	平治信息	700	29,085.00	0.06
734	300424	航新科技	1,916	29,008.24	0.06
735	300148	天舟文化	7,200	28,944.00	0.06
736	002519	银河电子	6,710	28,920.10	0.06
737	600650	锦江投资	2,400	28,920.00	0.06
738	603979	金诚信	3,434	28,914.28	0.06
739	002840	华统股份	1,700	28,900.00	0.06
740	300215	电科院	4,600	28,842.00	0.06
741	600054	黄山旅游	3,100	28,799.00	0.06
742	300302	同有科技	2,740	28,770.00	0.06
743	000498	山东路桥	5,400	28,674.00	0.06
744	002556	辉隆股份	5,200	28,652.00	0.06
745	300213	佳讯飞鸿	4,300	28,638.00	0.06
746	000019	深粮控股	4,000	28,600.00	0.06
747	600501	航天晨光	3,100	28,582.00	0.06
748	300336	新文化	6,850	28,564.50	0.06
749	002653	海思科	2,000	28,400.00	0.06
750	002539	云图控股	6,100	28,365.00	0.06
751	300607	拓斯达	800	28,304.00	0.06
752	002335	科华恒盛	1,600	28,240.00	0.06
753	600295	鄂尔多斯	3,400	28,186.00	0.06
754	300755	华致酒行	800	28,168.00	0.06
755	600467	好当家	10,600	28,090.00	0.06
756	000791	甘肃电投	6,520	28,036.00	0.06
757	000558	莱茵体育	7,800	28,002.00	0.06
758	300410	正业科技	2,389	27,975.19	0.06
759	300288	朗玛信息	2,100	27,951.00	0.06
760	000711	京蓝科技	5,000	27,950.00	0.06
761	601330	绿色动力	1,800	27,918.00	0.06
762	600686	金龙汽车	3,700	27,824.00	0.06
763	300359	全通教育	4,550	27,709.50	0.06
764	000557	西部创业	7,100	27,690.00	0.06
765	300178	腾邦国际	4,500	27,675.00	0.06
766	600738	兰州民百	3,800	27,588.00	0.06
767	600603	广汇物流	6,100	27,572.00	0.06

768	603920	世运电路	2,000	27,540.00	0.06
769	600533	栖霞建设	7,600	27,512.00	0.06
770	002741	光华科技	2,300	27,439.00	0.06
771	000923	河北宣工	1,600	27,376.00	0.06
772	600638	新黄浦	3,220	27,370.00	0.06
773	601599	鹿港文化	8,700	27,318.00	0.06
774	002362	汉王科技	1,800	27,180.00	0.06
775	603313	梦百合	1,570	27,145.30	0.06
776	300307	慈星股份	3,900	27,144.00	0.06
777	300664	鹏鹞环保	2,300	27,117.00	0.06
778	300328	宜安科技	2,780	27,105.00	0.06
779	002451	摩恩电气	2,700	27,081.00	0.06
780	000796	凯撒旅游	3,900	27,066.00	0.06
781	002543	万和电气	2,010	26,974.20	0.06
782	002581	未名医药	4,000	26,960.00	0.06
783	300504	天邑股份	1,000	26,950.00	0.06
784	300143	星普医科	3,300	26,895.00	0.06
785	300171	东富龙	3,100	26,877.00	0.06
786	000885	城发环境	2,400	26,808.00	0.06
787	002305	南国置业	10,500	26,775.00	0.06
788	002538	司尔特	5,200	26,728.00	0.06
789	002755	奥赛康	2,300	26,703.00	0.06
790	000631	顺发恒业	8,900	26,700.00	0.06
791	300248	新开普	3,423	26,699.40	0.06
792	002516	旷达科技	9,100	26,663.00	0.06
793	600012	皖通高速	4,200	26,586.00	0.06
794	300114	中航电测	2,850	26,533.50	0.05
795	002631	德尔未来	3,200	26,528.00	0.05
796	002393	力生制药	1,100	26,488.00	0.05
797	603008	喜临门	2,400	26,472.00	0.05
798	000837	秦川机床	5,900	26,314.00	0.05
799	002638	勤上股份	9,150	26,169.00	0.05
800	300209	天泽信息	2,100	26,166.00	0.05
801	002418	康盛股份	6,900	26,151.00	0.05
802	603896	寿仙谷	700	26,040.00	0.05
803	000151	中成股份	2,200	25,960.00	0.05
804	300317	珈伟新能	5,025	25,878.75	0.05
805	601566	九牧王	2,100	25,872.00	0.05
806	600619	海立股份	2,800	25,816.00	0.05

807	300467	迅游科技	1,400	25,788.00	0.05
808	300278	华昌达	4,400	25,740.00	0.05
809	603299	苏盐井神	3,800	25,650.00	0.05
810	000532	华金资本	2,500	25,600.00	0.05
811	000561	烽火电子	3,700	25,530.00	0.05
812	002833	弘亚数控	700	25,487.00	0.05
813	300441	鲍斯股份	3,160	25,469.60	0.05
814	002409	雅克科技	1,700	25,449.00	0.05
815	600781	辅仁药业	2,300	25,369.00	0.05
816	300741	华宝股份	800	25,360.00	0.05
817	300751	迈为股份	200	25,352.00	0.05
818	600310	桂东电力	5,000	25,350.00	0.05
819	603218	日月股份	1,300	25,220.00	0.05
820	002605	姚记扑克	2,400	25,200.00	0.05
821	002141	贤丰控股	6,900	25,185.00	0.05
822	002658	雪迪龙	2,900	25,172.00	0.05
823	002502	骅威文化	7,300	25,112.00	0.05
824	300304	云意电气	6,300	25,074.00	0.05
825	000965	天保基建	6,680	25,050.00	0.05
826	002662	京威股份	7,300	25,039.00	0.05
827	002345	潮宏基	5,500	25,025.00	0.05
828	300439	美康生物	1,700	25,007.00	0.05
829	300520	科大国创	1,500	24,975.00	0.05
830	300378	鼎捷软件	1,850	24,956.50	0.05
831	002518	科士达	2,775	24,864.00	0.05
832	002756	永兴特钢	1,700	24,820.00	0.05
833	603898	好莱客	1,500	24,810.00	0.05
834	300531	优博讯	1,400	24,584.00	0.05
835	603728	鸣志电器	2,000	24,540.00	0.05
836	002101	广东鸿图	3,200	24,480.00	0.05
837	000905	厦门港务	3,200	24,448.00	0.05
838	603808	歌力思	1,600	24,432.00	0.05
839	300140	中环装备	2,100	24,423.00	0.05
840	603777	来伊份	1,700	24,242.00	0.05
841	300684	中石科技	1,200	24,240.00	0.05
842	002349	精华制药	4,100	24,231.00	0.05
843	002461	珠江啤酒	3,800	24,130.00	0.05
844	600069	银鸽投资	9,900	24,057.00	0.05
845	002751	易尚展示	1,100	24,046.00	0.05

846	300423	鲁亿通	1,800	23,958.00	0.05
847	300429	强力新材	2,403	23,933.88	0.05
848	603305	旭升股份	1,000	23,910.00	0.05
849	300723	一品红	600	23,868.00	0.05
850	300221	银禧科技	3,700	23,865.00	0.05
851	002033	丽江旅游	3,990	23,860.20	0.05
852	300485	赛升药业	2,400	23,808.00	0.05
853	002178	延华智能	6,100	23,790.00	0.05
854	002016	世荣兆业	2,900	23,780.00	0.05
855	300497	富祥股份	1,580	23,715.80	0.05
856	300510	金冠股份	4,279	23,662.87	0.05
857	000517	荣安地产	7,700	23,639.00	0.05
858	300276	三丰智能	2,800	23,632.00	0.05
859	002137	麦达数字	3,500	23,485.00	0.05
860	002590	万安科技	2,900	23,345.00	0.05
861	603590	康辰药业	600	23,334.00	0.05
862	603466	风语筑	1,400	23,170.00	0.05
863	300368	汇金股份	3,200	23,136.00	0.05
864	300431	暴风集团	3,160	22,973.20	0.05
865	002656	摩登大道	4,280	22,769.60	0.05
866	603587	地素时尚	1,000	22,740.00	0.05
867	002562	兄弟科技	5,260	22,723.20	0.05
868	002913	奥士康	500	22,680.00	0.05
869	002158	汉钟精机	2,600	22,672.00	0.05
870	601500	通用股份	3,200	22,624.00	0.05
871	002822	中装建设	3,600	22,608.00	0.05
872	002769	普路通	2,299	22,323.29	0.05
873	601020	华钰矿业	1,900	22,268.00	0.05
874	000892	欢瑞世纪	6,000	22,200.00	0.05
875	603583	捷昌驱动	600	22,122.00	0.05
876	603612	索通发展	2,060	22,062.60	0.05
877	002232	启明信息	2,500	22,050.00	0.05
878	002068	黑猫股份	4,400	21,956.00	0.05
879	603666	亿嘉和	400	21,908.00	0.05
880	002918	蒙娜丽莎	1,870	21,897.70	0.05
881	000626	远大控股	2,600	21,840.00	0.05
882	600173	卧龙地产	5,100	21,828.00	0.05
883	300363	博腾股份	2,600	21,814.00	0.05
884	001896	豫能控股	5,600	21,784.00	0.05

885	603603	博天环境	1,500	21,660.00	0.04
886	002685	华东重机	3,700	21,571.00	0.04
887	603919	金徽酒	1,400	21,546.00	0.04
888	002759	天际股份	1,600	21,520.00	0.04
889	002584	西陇科学	4,300	21,500.00	0.04
890	603421	鼎信通讯	1,100	21,450.00	0.04
891	603619	中曼石油	1,000	21,430.00	0.04
892	002246	北化股份	2,700	21,384.00	0.04
893	300109	新开源	1,274	21,339.50	0.04
894	600618	氯碱化工	2,700	21,222.00	0.04
895	300011	鼎汉技术	3,400	21,182.00	0.04
896	300097	智云股份	2,100	21,168.00	0.04
897	603648	畅联股份	1,800	21,096.00	0.04
898	603126	中材节能	3,700	20,979.00	0.04
899	603713	密尔克卫	600	20,898.00	0.04
900	002346	柘中股份	1,600	20,768.00	0.04
901	600207	安彩高科	4,200	20,622.00	0.04
902	002435	长江润发	4,500	20,610.00	0.04
903	603801	志邦家居	1,040	20,550.40	0.04
904	603579	荣泰健康	700	20,510.00	0.04
905	300511	雪榕生物	2,510	20,205.50	0.04
906	000058	深赛格	3,600	20,160.00	0.04
907	603595	东尼电子	924	20,152.44	0.04
908	600242	中昌数据	2,200	20,064.00	0.04
909	000838	财信发展	5,300	19,822.00	0.04
910	002850	科达利	1,000	19,770.00	0.04
911	000514	渝开发	4,100	19,762.00	0.04
912	603185	上机数控	500	19,675.00	0.04
913	002782	可立克	1,600	19,664.00	0.04
914	000056	皇庭国际	4,500	19,575.00	0.04
915	603385	惠达卫浴	2,160	19,548.00	0.04
916	300625	三雄极光	1,400	19,390.00	0.04
917	300624	万兴科技	400	19,292.00	0.04
918	300393	中来股份	1,814	19,246.54	0.04
919	002712	思美传媒	2,760	19,154.40	0.04
920	002752	昇兴股份	3,000	19,140.00	0.04
921	603843	正平股份	2,400	19,080.00	0.04
922	300242	佳云科技	4,600	19,044.00	0.04
923	002852	道道全	1,350	18,940.50	0.04

924	000567	海德股份	2,300	18,883.00	0.04
925	600283	钱江水利	1,700	18,870.00	0.04
926	603693	江苏新能	1,500	18,645.00	0.04
927	300673	佩蒂股份	700	18,634.00	0.04
928	000662	天夏智慧	4,000	18,600.00	0.04
929	000673	当代东方	4,800	18,432.00	0.04
930	002534	杭锅股份	2,700	18,279.00	0.04
931	603839	安正时尚	1,480	18,204.00	0.04
932	000011	深物业 A	1,900	18,145.00	0.04
933	300533	冰川网络	500	18,140.00	0.04
934	002651	利君股份	3,700	18,056.00	0.04
935	300682	朗新科技	1,000	18,000.00	0.04
936	603010	万盛股份	1,620	17,965.80	0.04
937	603727	博迈科	1,100	17,963.00	0.04
938	300613	富瀚微	200	17,864.00	0.04
939	002485	希努尔	2,600	17,706.00	0.04
940	600381	青海春天	2,900	17,661.00	0.04
941	600876	洛阳玻璃	1,500	17,490.00	0.04
942	300100	双林股份	2,300	17,480.00	0.04
943	002895	川恒股份	1,500	17,415.00	0.04
944	300173	智慧松德	3,600	17,388.00	0.04
945	603997	继峰股份	2,250	17,370.00	0.04
946	002933	新兴装备	400	17,280.00	0.04
947	002247	聚力文化	5,200	17,264.00	0.04
948	300061	康旗股份	2,500	17,175.00	0.04
949	603711	香飘飘	500	16,985.00	0.04
950	002351	漫步者	2,900	16,617.00	0.03
951	600933	爱柯迪	2,100	16,485.00	0.03
952	002901	大博医疗	500	16,440.00	0.03
953	300432	富临精工	2,400	16,440.00	0.03
954	603730	岱美股份	700	16,408.00	0.03
955	300740	御家汇	2,000	16,220.00	0.03
956	601619	嘉泽新能	3,500	16,170.00	0.03
957	603303	得邦照明	1,800	16,092.00	0.03
958	603533	掌阅科技	1,000	16,090.00	0.03
959	300426	唐德影视	2,500	15,850.00	0.03
960	603876	鼎胜新材	1,000	15,820.00	0.03
961	603626	科森科技	1,980	15,701.40	0.03
962	603999	读者传媒	2,800	15,652.00	0.03

963	603098	森特股份	1,200	15,336.00	0.03
964	300447	全信股份	1,380	15,235.20	0.03
965	603557	起步股份	1,700	15,198.00	0.03
966	002577	雷柏科技	1,400	15,050.00	0.03
967	002377	国创高新	3,300	14,883.00	0.03
968	603348	文灿股份	800	14,704.00	0.03
969	601882	海天精工	1,900	14,573.00	0.03
970	002287	奇正藏药	500	14,530.00	0.03
971	603055	台华新材	1,860	14,191.80	0.03
972	300674	宇信科技	500	14,095.00	0.03
973	603103	横店影视	880	13,939.20	0.03
974	603900	莱绅通灵	1,120	13,854.40	0.03
975	603105	芯能科技	1,200	13,296.00	0.03
976	300528	幸福蓝海	1,740	13,258.80	0.03
977	000038	深大通	1,880	13,254.00	0.03
978	603081	大丰实业	1,000	12,550.00	0.03
979	300512	中亚股份	1,000	12,530.00	0.03
980	002906	华阳集团	1,100	12,419.00	0.03
981	603058	永吉股份	1,500	12,405.00	0.03
982	603339	四方科技	800	12,304.00	0.03
983	300518	盛讯达	500	12,240.00	0.03
984	603733	仙鹤股份	800	12,136.00	0.03
985	300660	江苏雷利	808	12,055.36	0.02
986	603555	贵人鸟	2,300	11,937.00	0.02
987	603358	华达科技	1,076	11,836.00	0.02
988	603165	荣晟环保	600	11,262.00	0.02
989	603013	亚普股份	700	11,116.00	0.02
990	603180	金牌厨柜	200	11,048.00	0.02
991	603680	今创集团	700	11,004.00	0.02
992	603861	白云电器	1,100	11,000.00	0.02
993	002907	华森制药	600	10,680.00	0.02
994	002911	佛燃股份	700	10,521.00	0.02
995	603277	银都股份	1,000	9,700.00	0.02
996	603773	沃格光电	300	9,384.00	0.02
997	603676	卫信康	800	8,904.00	0.02
998	603848	好太太	600	8,766.00	0.02
999	603596	伯特利	500	8,255.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000029	深深房 A	6,200	68,014.00	0.14
2	300782	卓胜微	322	35,072.24	0.07
3	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.07
4	600968	海油发展	8,426	29,912.30	0.06
5	603867	新化股份	940	24,261.40	0.05
6	601698	中国卫通	5,489	21,516.88	0.04
7	300594	朗进科技	414	18,261.54	0.04
8	002323	*ST 百特	2,900	3,799.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300347	泰格医药	307,194.00	0.76
2	600989	宝丰能源	212,158.48	0.53
3	600635	大众公用	162,150.00	0.40
4	600776	东方通信	129,354.00	0.32
5	600601	方正科技	92,568.00	0.23
6	002123	梦网集团	92,165.00	0.23
7	000667	美好置业	84,281.00	0.21
8	600366	宁波韵升	80,640.00	0.20
9	600503	华丽家族	74,239.00	0.18
10	300401	花园生物	72,324.00	0.18
11	600736	苏州高新	71,563.00	0.18
12	600936	广西广电	67,450.00	0.17
13	002063	远光软件	66,779.00	0.17
14	600850	华东电脑	66,318.00	0.17

15	601519	大智慧	64,602.00	0.16
16	002400	省广集团	63,812.00	0.16
17	600284	浦东建设	63,450.00	0.16
18	603658	安图生物	62,761.00	0.16
19	600761	安徽合力	61,711.00	0.15
20	600483	福能股份	61,453.00	0.15

注：买入金额不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000977	浪潮信息	319,410.00	0.79
2	002157	正邦科技	287,704.00	0.72
3	600989	宝丰能源	240,013.82	0.60
4	600763	通策医疗	218,981.00	0.54
5	300601	康泰生物	217,956.45	0.54
6	002821	凯莱英	196,873.40	0.49
7	600745	闻泰科技	183,903.00	0.46
8	300009	安科生物	143,870.04	0.36
9	600486	扬农化工	139,861.00	0.35
10	300207	欣旺达	127,673.00	0.32
11	603939	益丰药房	121,707.00	0.30
12	600845	宝信软件	116,359.00	0.29
13	000883	湖北能源	116,217.00	0.29
14	002958	青农商行	111,694.08	0.28
15	603517	绝味食品	109,519.80	0.27
16	002812	恩捷股份	100,688.00	0.25
17	000301	东方盛虹	95,259.00	0.24
18	002419	天虹股份	86,026.00	0.21
19	300759	康龙化成	72,533.69	0.18
20	002387	维信诺	72,356.00	0.18

注：卖出金额不包括相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	10,417,300.83
卖出股票收入（成交）总额	11,428,540.70

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	4,888.32	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,888.32	0.01

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128062	亚药转债	48	4,888.32	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,125.81
2	应收证券清算款	39,644.54
3	应收股利	-

4	应收利息	585.60
5	应收申购款	44,733.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	88,089.36

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000029	深深房 A	68,014.00	0.14	重大事项停牌
2	601236	红塔证券	33,869.94	0.07	新股锁定

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1000A	60	29,548.35	1,417,560.00	79.96%	355,341.00	20.04%
1000B	276	6,423.55	145.00	0.01%	1,772,756.00	99.99%
华宝中证 1000 指数分级	4,346	12,962.92	402,619.09	0.71%	55,934,233.46	99.29%
合计	4,682	12,789.97	1,820,324.09	3.04%	58,062,330.46	96.96%

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

8.2 期末上市基金前十名持有人

1000A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	新华人寿保险股份有限公司	1,417,560.00	79.96%
2	陈云利	43,365.00	2.45%
3	张翱	39,746.00	2.24%
4	王少男	37,985.00	2.14%
5	李惠莲	35,051.00	1.98%
6	曹蜀湘	31,200.00	1.76%
7	唐梦雪	29,000.00	1.64%
8	李文霞	27,100.00	1.53%
9	张志赟	17,241.00	0.97%
10	史环宇	15,320.00	0.86%

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	340,790.00	19.22%
2	丁建英	191,324.00	10.79%
3	祝东华	106,463.00	6.01%
4	曹国安	98,400.00	5.55%

5	刘娟	50,712.00	2.86%
6	姚绿绿	46,000.00	2.59%
7	谢锦星	44,722.00	2.52%
8	杨玉锋	42,314.00	2.39%
9	张爱勇	38,122.00	2.15%
10	郑昕沂	36,900.00	2.08%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1000A	-	-
	1000B	-	-
	华宝中证 1000 指数分级	13,649.60	0.0228%
	合计	13,649.60	0.0228%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	1000A	1000B	华宝中证 1000 指数分级
基金合同生效日（2015 年 6 月 4 日）基金份额总额	29,441,582.00	29,441,582.00	271,827,940.54
本报告期期初基金份额总额	1,598,464.00	1,598,464.00	56,983,722.42
本报告期期间基金总申购份额	-	-	13,656,307.73
减:本报告期期间基金总赎回份额	-	-	13,954,303.60
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	174,437.00	174,437.00	-348,874.00
本报告期末基金份额总额	1,772,901.00	1,772,901.00	56,336,852.55

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及份额折算的份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	2	7,145,812.38	34.06%	6,511.91	33.82%	-
中信证券	2	4,605,126.36	21.95%	4,288.85	22.27%	-
天风证券	2	3,660,622.17	17.45%	3,335.78	17.33%	-
广发证券	2	1,420,455.99	6.77%	1,323.18	6.87%	-
国泰君安	2	1,387,525.03	6.61%	1,290.52	6.70%	-
申万宏源	3	708,124.96	3.37%	659.32	3.42%	-
中信建投	1	686,442.18	3.27%	625.54	3.25%	-
东吴证券	1	429,713.09	2.05%	400.16	2.08%	-
海通证券	1	288,110.01	1.37%	268.31	1.39%	-
西部证券	1	224,107.77	1.07%	159.41	0.83%	-
招商证券	2	201,000.49	0.96%	183.17	0.95%	-
银河证券	1	141,267.00	0.67%	131.58	0.68%	-
万联证券	1	62,771.40	0.30%	57.20	0.30%	-
中投证券	1	20,590.08	0.10%	19.18	0.10%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-

中金国际	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准：资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，并能为本基金提供全面的信息服；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、本基金本报告期券商交易单元新增：红塔证券。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其它证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝基金管理有限公司旗下基金资产净值公告+C1314C1284:D1314	基金管理人网站	2019 年 1 月 1 日
2	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京百度百	上海证券报、证券时报、中国证券报、基	2019 年 1 月 10 日

	盈基金销售有限公司为代销机构的公告	金管理人网站	
3	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	2019 年 1 月 15 日
4	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、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2019 年 1 月 15 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宜信普泽（北京）基金销售有限公司为代销机构的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2019 年 1 月 18 日
6	华宝基金管理有限公司关于参加宜信普泽（北京）基金销售有限公司费率优惠活动的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2019 年 1 月 18 日
7	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	证券日报、基金管理人网站	2019 年 1 月 21 日
8	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	证券日报、基金管理人网站	2019 年 2 月 1 日
9	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暂停大额申购（含定期定额投资）业务的公告	证券日报、基金管理人网站	2019 年 2 月 22 日
10	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京汇成基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2019 年 3 月 21 日
11	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2018 年度报告	基金管理人网站	2019 年 3 月 30 日
12	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2018 年度报告（摘要）	证券日报、基金管理人网站	2019 年 3 月 30 日
13	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 B 份额交易价格波动提示公告	证券日报、基金管理人网站	2019 年 4 月 9 日
14	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 B 份额交易价格波动提示公告	证券日报、基金管理人网站	2019 年 4 月 12 日
15	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金恢复场外大额申购（含定期定额投资）业务、暂停场内申购业务并暂停跨系统转托管（场外转场内）业务的公告	证券日报、基金管理人网站	2019 年 4 月 13 日
16	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 B 份额交易价格波动提示公告	证券日报、基金管理人网站	2019 年 4 月 17 日
17	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	证券日报、基金管理人网站	2019 年 4 月 19 日

18	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 B 份额交易价格波动提示公告	证券日报、基金管理人网站	2019 年 4 月 20 日
19	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 B 份额交易价格波动提示公告	证券日报、基金管理人网站	2019 年 4 月 25 日
20	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	证券日报、基金管理人网站	2019 年 5 月 8 日
21	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	证券日报、基金管理人网站	2019 年 5 月 14 日
22	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	证券日报、基金管理人网站	2019 年 5 月 17 日
23	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	证券日报、基金管理人网站	2019 年 5 月 22 日
24	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	证券日报、基金管理人网站	2019 年 5 月 25 日
25	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	证券日报、基金管理人网站	2019 年 5 月 30 日
26	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	证券日报、基金管理人网站	2019 年 6 月 6 日
27	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	证券日报、基金管理人网站	2019 年 6 月 12 日
28	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加通华财富（上海）基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2019 年 6 月 12 日
29	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	证券日报、基金管理人网站	2019 年 6 月 18 日
30	华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站	2019 年 6 月 22 日
31	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	2019 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于 2019 年 6 月 22 日发布《华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告》，具体内容详见公司公告，请投资者予以关注。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

12.3 查阅方式

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

华宝基金管理有限公司

2019 年 8 月 29 日