

华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券 投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 03 月 30 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。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2021 年 03 月 15 日（基金合同生效日）起至 2021 年 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	6
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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	21
§ 8 投资组合报告	44

8.1 期末基金资产组合情况	44
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
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	70
8.7 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	70
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	70
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	70
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
8.12 投资组合报告附注	70
§ 9 基金份额持有人信息	71
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
9.2 期末上市基金前十名持有人	72
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	72
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情况	72
§ 10 开放式基金份额变动	72
§ 11 重大事件揭示	73
11.1 基金份额持有人大会决议	73
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	73
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	73
11.4 基金投资策略的改变	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
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	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
11.8 其他重大事件	74
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	76
12.1 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	76
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	76
§ 13 备查文件目录	77
13.1 备查文件目录	77
13.2 存放地点	77
13.3 查阅方式	77

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞中证 1000ETF
场内简称	中证 1000 (扩位证券简称: 1000ETF 基金)
基金主代码	516300
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 3 月 15 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	42,602,182.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 3 月 24 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现, 追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内, 年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	<p>1、股票的投资策略 本基金主要采取完全复制法, 即完全按照标的指数的成份股组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调整; 当标的指数进行定期调整、指数样本空间或者编制规则变更时, 本基金将根据标的指数的编制规则及调整公告, 及时进行投资组合的优化调整, 尽量降低跟踪误差, 力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内, 年化跟踪误差控制在 2% 以内。但在因特殊情况 (如流动性不足) 导致无法获得足够数量的股票时, 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, 追求尽可能贴近目标指数的表现。</p> <p>特殊情况包括但不限于以下情形: (1) 法律法规的限制; (2) 标的指数成份股流动性严重不足; (3) 标的指数的成份股票长期停牌; (4) 其他合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。</p> <p>2、存托凭证的投资策略 本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上, 根据审慎原则合理参与存托凭证的投资, 以更好地跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</p> <p>3、债券投资策略 本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券的影响, 进行合理的利率预期, 判断市场的基本走势, 构建债券投资组合, 以保证基金资产流动性, 并降低组合跟踪误差。</p> <p>4、股指期货的投资策略 本基金投资股指期货时, 将严格根据风险管理的原则, 以套期保值为目的, 对冲系统性风险和某些特殊情况</p>

	<p>下的流动性风险等。股指期货的投资主要采用流动性好、交易活跃的合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。</p> <p>5、资产支持证券的投资策略 资产支持证券为本基金的辅助性投资工具，本基金将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。</p> <p>6、融资及转融通证券出借业务 本基金还可以参与融资及转融通证券出借业务。本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。本基金参与转融通证券出借业务，将综合分析市场情况、投资者结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等条件，合理确定转融通证券出借的范围、期限和比例。</p>
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金，采用完全复制的被动式投资策略，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征：一方面，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。

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		华泰柏瑞基金管理有限公司	招商证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方	韩鑫普
	联系电话	021-38601777	0755-82943666
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95565
传真		021-38601799	0755-82960794
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
邮政编码		200135	518000
法定代表人		贾波	霍达

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号

	楼 17 层及基金托管人住所
--	----------------

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 (特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公 司	北京西城区金融大街 27 号投资广场 22-23 层

§ 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	2021 年 3 月 15 日（基金合同生效日）-2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	2,034,836.12
本期利润	5,797,925.17
加权平均基金份额本期利润	0.1390
本期加权平均净值利润率	12.39%
本期基金份额净值增长率	26.69%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末
期末可供分配利润	4,395,137.19
期末可供分配基金份额利润	0.1032
期末基金资产净值	53,971,358.62
期末基金份额净值	1.2669
3.1.3 累计期末指标	2021 年末
基金份额累计净值增长率	26.69%

注：1、上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、对期末可供分配利润，采用期末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。

4、基金合同自 2021 年 3 月 15 日起生效。

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

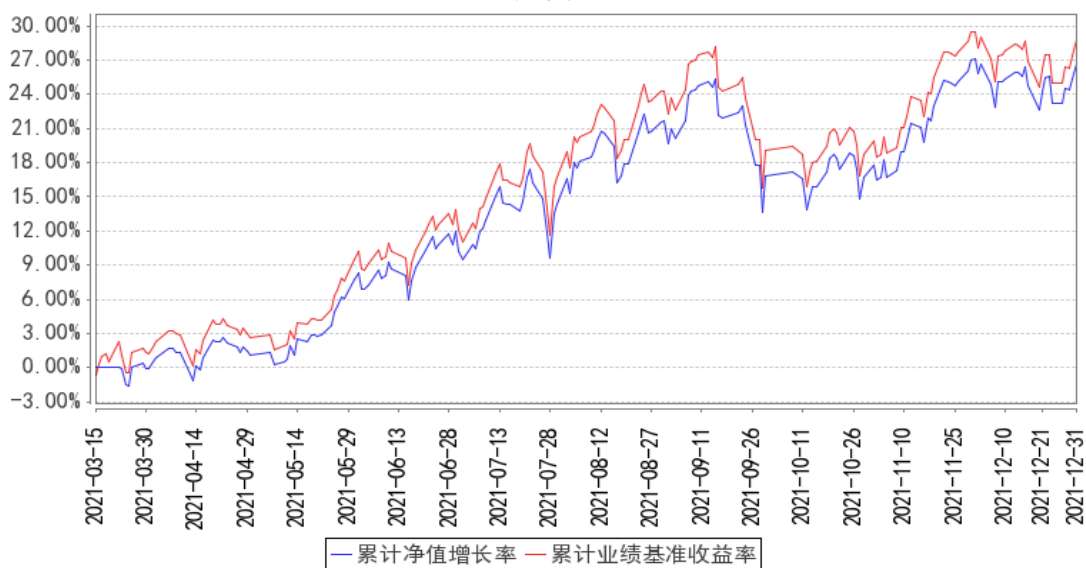
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.48%	1.03%	8.17%	1.05%	0.31%	-0.02%

过去六个月	13.11%	1.22%	13.08%	1.26%	0.03%	-0.04%
自基金合同生效起至今	26.69%	1.08%	28.77%	1.14%	-2.08%	-0.06%

注：份额业绩计算期间为 2021 年 3 月 15 日至 2021 年 12 月 31 日。

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

华泰柏瑞中证1000ETF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



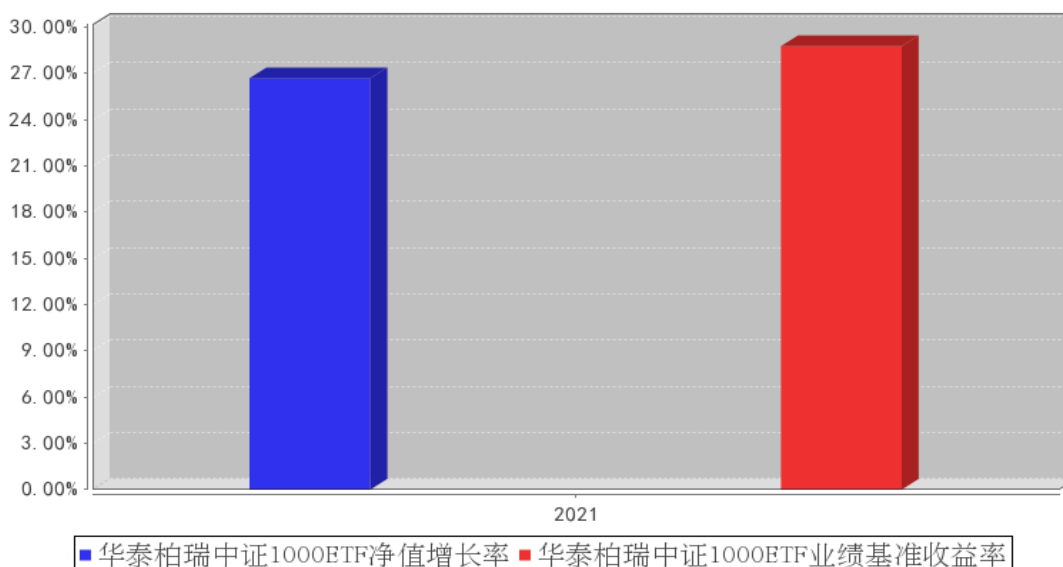
注：1、图示日期为 2021 年 3 月 15 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同投资范围中规定的比例。

3、自基金合同生效起至本报告期末不满一年。

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

华泰柏瑞中证1000ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同自 2021 年 3 月 15 日起生效，2021 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金未实施过利润分配。

§ 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

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证

券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞益通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金、华泰柏瑞益商一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞品质优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景利混合型证券投资基金、华泰柏瑞优势领航混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞锦乾债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金、华泰柏瑞成长智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金、华泰

柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金、华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞行业严选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞远见智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞创业板科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞锦元债券型证券投资基金、华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证沪港深品牌消费 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金。截至 2021 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 2443.87 亿元。

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		
李茜	本基金的基金经理	2021 年 3 月 15 日	-	6 年	曾任职于上海市虹口区金融服务局。2015 年 3 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任指数投资部助理研究员、研究员。2019 年 11 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 12 月起任华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起任华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

					<p>2021 年 2 月起任华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 3 月起任华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金和华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。</p> <p>2021 年 11 月起任华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期和离职日期指基金管理公司作出决定之日。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

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，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在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

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，对于场内交易的非组合指令启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3 日、5 日）下进行分析，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。

目前公司公募基金经理有兼任私募资产管理计划投资经理的情况，兼任业务遵照相关法律法规要求进行，同时遵守公司公平交易制度。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查，交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制，风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报告期内，该制度执行情况良好，无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中，均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。

本报告期本基金与公司所管理的其他投资组合没有参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的同日反向交易。

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

2021 年市场以结构性机会为主。其中电气设备、有色金属、采掘、化工、钢铁等行业录得正收益，期间电气设备行业指数上涨达 47.86%，有色金属行业指数上涨达 40.47%。整体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板涨跌幅分别为-5.20%、15.58%、20.52%和 12.02%。从市场风格来看，价值风格表现相对强势，优于成长风格，期间中证 500 价值指数和中证 500 成长指数的涨幅分别为 18.83%和 6.85%。沪深 300 价值指数相对于沪深 300 成长指数，亦略胜一筹。

我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内，本基金的日均绝对跟踪偏离度为 0.056%，期间日跟踪误差为 0.075%，较好地实现了本基金的投资目标。

本基金将继续严格遵守跟踪偏离最小化的被动投资策略，从而为基金投资人谋求与标的指数基本一致的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.2669 元；本报告期基金份额净值增长率为 26.69%，业

绩比较基准收益率为 28.77%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年经济走势前高后低，由于低基数逐渐消退、政策回归常态化，技术性驱动转为基本面主导，GDP 增速逐季下行。三季度 GDP 增速超预期下滑至 4.9%，经济增长动能明显放缓。展望 2022 年，在出口增速放缓，房地产投资回落、消费难有明显修复的大背景下，经济下行压力明显，随着通胀约束缓释，经济下行压力加大，胀的风险让位于滞，政策重心从“抑通胀”转为“稳增长”。市场将在估值提升与业绩下行背景下博弈，市场的不确定进一步加剧，依旧存在结构性机会。从结构上看，市值下沉或将成为主线。2021 年以来，代表大市值公司的沪深 300 明显跑输，而代表中小市值的中证 500、中证 1000 似乎成为了市场新的方向。年初至今中证 1000 指数收益超过 20%，第三季度的“专精特新”等政策也进一步引发了市场对于中小市值股票的关注。2022 年，大小市值风格趋势切换或将延续。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2021 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统进行事先合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对公司基金投资、研究、销售、后台运营、反洗钱等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司法律监察部门及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等，有效提高了公司员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，可进行收益分配。报告期内基金未实施收益分配。

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

截止本报告期末，因赎回等原因，本基金自 2021 年 3 月 31 日至 2021 年 9 月 6 日存在连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，但无基金份额持有人数量低于 200 人的情形。已于 2021 年 7 月 13 日将《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金资产净值低于五千万元情况的报告》上报中国证监会。

§ 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

本报告期内，招商证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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应尽的义务。

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

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、基金份额申购赎回价格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。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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(2022)第 28122 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	华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数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>我们审计了华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞中证 1000ETF 基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年 3 月 15 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间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,公允反映了华泰柏瑞中证 1000ETF 基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 3 月 15 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	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

	<p>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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华泰柏瑞中证 1000ETF 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>华泰柏瑞中证 1000ETF 基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司(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泰柏瑞中证 1000ETF 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泰柏瑞中证 1000ETF 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泰柏瑞中证 1000ETF 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，就可能对华泰柏瑞中证 1000ETF 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</p>

	<p>获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞中证 1000ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，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>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	张炯	朱宏宇
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2022 年 3 月 30 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	1,643,084.32
结算备付金		16,838.11
存出保证金		49,014.88
交易性金融资产	7.4.7.2	52,483,308.28
其中：股票投资		52,473,708.28
基金投资		-
债券投资		9,600.00
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		209,892.21
应收利息	7.4.7.5	792.23
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		54,402,930.03
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日

负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		618.70
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		9,248.71
应付赎回款		-
应付管理人报酬		22,214.05
应付托管费		4,442.80
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	31,182.40
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	363,864.75
负债合计		431,571.41
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	42,602,182.00
未分配利润	7.4.7.10	11,369,176.62
所有者权益合计		53,971,358.62
负债和所有者权益总计		54,402,930.03

注：1. 报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2669 元，基金份额总额 42,602,182.00 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2021 年 3 月 15 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 3 月 15 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 3 月 15 日（基金合同 生效日）至 2021 年 12 月 31 日
一、收入		6,969,198.36
1. 利息收入		115,407.22
其中：存款利息收入	7.4.7.11	115,390.63
债券利息收入		16.59
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-

证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,854,871.45
其中：股票投资收益	7.4.7.12	2,646,716.43
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	14,764.77
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
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	193,390.25
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	3,763,089.05
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	235,830.64
减：二、费用		1,171,273.19
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	184,340.35
2. 托管费	7.4.10.2.2	36,868.02
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	654,664.82
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	295,400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,797,925.17
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,797,925.17

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 3 月 15 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 15 日（基金合同生效日）至 2021 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）	222,602,182.00	-	222,602,182.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,797,925.17	5,797,925.17
三、本期基金份额交易产生的基	-180,000,000.00	5,571,251.45	-174,428,748.55

金净值变动数 (净值减少以 “-”号填列)			
其中: 1. 基金申 购款	84,000,000.00	11,895,237.32	95,895,237.32
2. 基金赎 回款	-264,000,000.00	-6,323,985.87	-270,323,985.87
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)	42,602,182.00	11,369,176.62	53,971,358.62

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:

韩勇

房伟力

赵景云

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

华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金(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[2021]第 235 号《关于准予华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,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 222,600,550.00 元(含募集股票市值),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(2021)第 0294 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 3 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 222,602,182.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,632.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为招商证券股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2021]118 号核准,本基金 222,602,182.00 份基金份额于 2021 年 3 月 24 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资

基金基金合同》的有关规定，本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准或注册发行的股票)、存托凭证、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；本基金参与融资业务时，在任何交易日日终，持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。本基金力争日均跟踪偏离度控制在 0.2%以内，年化跟踪误差控制在 2%以内。本基金的业绩比较基准为中证 1000 指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2022 年 3 月 30 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<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数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。

本财务报表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 2021 年 3 月 15 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 3 月 15 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间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。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 3 月 15 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日。

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。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款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，在资产负债表中以交易性金融负债列示。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

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配；基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可对超额收益进行分配；本基金的收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使还原后基金份额净值低于面值。基金收益分配比例为收益评价日符合上述分红条件的基金超额收益的 100%，基金收益分配每年至多 4 次；若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

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) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《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》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(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

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第14号—收入》，本基金在编制2021年3月15日(基金合同生效日)至2021年12月31日止期间的财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税

政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

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 2021年12月31日
活期存款	1,643,084.32
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	1,643,084.32

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	48,712,552.23	52,473,708.28	3,761,156.05
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	9,600.00	1,600.00
	银行间市场	-	-
	合计	9,600.00	1,600.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	48,720,552.23	52,483,308.28	3,762,756.05

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期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

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从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 2021 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	758.63
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	8.36
应收债券利息	0.93
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	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	24.31
合计	792.23

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	31,182.40
银行间市场应付交易费用	-
合计	31,182.40

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	170,000.00
应退退补款	193,864.75
合计	363,864.75

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 15 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	222,602,182.00	222,602,182.00
本期申购	84,000,000.00	84,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-264,000,000.00	-264,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	42,602,182.00	42,602,182.00

注：1. 投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

2. 本基金自 2021 年 3 月 5 日至 2021 年 3 月 9 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 222,600,550.00 元，折合为 222,600,550.00 份基金份额。根据《华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 1,632.00 元在本基金成立后，折合为 1,632.00 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及《华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资

基金开放日常申购、赎回业务的公告》的相关规定，本基金于 2021 年 3 月 15 日（基金合同生效日）至 2021 年 3 月 23 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购、赎回业务自 2021 年 3 月 24 日起开始办理。

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	2,034,836.12	3,763,089.05	5,797,925.17
本期基金份额交易产生的变动数	2,360,301.07	3,210,950.38	5,571,251.45
其中：基金申购款	3,779,279.86	8,115,957.46	11,895,237.32
基金赎回款	-1,418,978.79	-4,905,007.08	-6,323,985.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,395,137.19	6,974,039.43	11,369,176.62

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 3 月 15 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	107,952.14
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	5,230.32
其他	2,208.17
合计	115,390.63

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,255,459.88
股票投资收益——赎回差价收入	391,256.55
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	2,646,716.43

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 3 月 15 日（基金合同生效日）至 2021 年 12

	月 31 日
卖出股票成交总额	182,184,575.02
减：卖出股票成本总额	179,929,115.14
买卖股票差价收入	2,255,459.88

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日
赎回基金份额对价总额	270,323,985.87
减：现金支付赎回款总额	179,064,958.87
减：赎回股票成本总额	90,867,770.45
赎回差价收入	391,256.55

7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——申购差价收入。

7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

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
	2021年3月15日（基金合同生效日）至2021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	14,764.77
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	14,764.77

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
	2021年3月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	78,380.43
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	63,600.00
减：应收利息总额	15.66
买卖债券差价收入	14,764.77

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	193,390.25
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	193,390.25

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年3月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日

1. 交易性金融资产	3,762,756.05
股票投资	3,761,156.05
债券投资	1,600.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	333.00
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	3,763,089.05

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日
基金赎回费收入	-
替代损益	188,549.31
现金认购款利息	47,281.33
合计	235,830.64

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代股票的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日
交易所市场交易费用	654,664.82
银行间市场交易费用	-
合计	654,664.82

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日
审计费用	50,000.00
信息披露费	100,000.00
证券出借违约金	-

注册登记费（中登上海）	125,000.00
IOPV 计算与发布费用	20,000.00
其他费用	400.00
合计	295,400.00

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

截至财务报表报出日，本基金并无须作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
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、基金销售机构
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、申购赎回代理券商、基金销售机构
PineBridge Investment LLC	基金管理人的股东
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
柏瑞爱建资产管理（上海）有限公司	基金管理人的控股子公司

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。

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 2021年3月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
招商证券	470,582,163.94	100.00

7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年3月15日（基金合同生效日）至2021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 (%)
招商证券	430,714.51	100.00	31,182.40	100.00

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。

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 2021年3月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	184,340.35
其中：支付销售机构的客户维护费	-

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

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月15日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	36,868.02

注：支付基金托管人招商证券的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

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

注：本基金本报告期内未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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金本报告期内转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

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

注：本基金本报告期内转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内，基金管理人未投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
华泰证券股份有限公司	5,502,662.00	12.9164

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

注：本基金本报告期内无关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021 年 3 月 15 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 张）	总金额
华泰联合证券、招商证券	600941	中国移动	网上配售	1,000	57,580.00
华泰联合证券、招商证券	601728	中国电信	网上配售	10,000	45,300.00
华泰联合证券	600905	三峡能源	网上配售	11,000	29,150.00
招商证券	001201	东瑞股份	网下申购	265	16,795.70
招商证券	001288	运机集团	网下申购	432	6,285.60
华泰联合证券	001234	泰慕士	网下申购	286	4,727.58

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末(2021 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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
600941	中国移动	2021年12月27日	2022年1月5日	新股未上市	57.58	57.58	1,000	57,580.00	57,580.00	-
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股未上市	16.53	16.53	286	4,727.58	4,727.58	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
123133.SZ	佩蒂转债	2021年12月22日	2022年1月21日	配债未上市	100.00	100.00	40	4,000.00	4,000.00	-

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。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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
600072	中船科技	2021年12月29日	拟筹划重大资产重组	14.65	2022年1月13日	16.12	2,600	32,766.71	38,090.00	-

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

注：本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金为被动式指数基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，主要投资于标的指数成份股和备选成份股。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，力争实现保持基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指公司的风险管理组织架构包括董事会下设的风险管理与审计委员会、公司管理层的风险控制委员会、风险管理部和合规法律部以及公司各业务部门，董事会对建立基金风险管理内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去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同类风险损失的频度。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特征，通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，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人招商证券股份有限公司开立交通银行的托管帐户，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-
AAA 以下	9,600.00
未评级	-
合计	9,600.00

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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》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 2021 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 0.19%。

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。

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。

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

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

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

备付金、存出保证金和债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年12 月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,643,084.32	-	-	-	-	-	-1,643,084.32
结算备付金	16,838.11	-	-	-	-	-	16,838.11
存出保证金	49,014.88	-	-	-	-	-	49,014.88
交易性金融资产	-	-	-	-	9,600.00	52,473,708.28	52,483,308.28
应收利息	-	-	-	-	-	792.23	792.23
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-209,892.21	209,892.21
资产总计	1,708,937.31	-	-	-	9,600.00	52,684,392.72	54,402,930.03
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	618.70	618.70
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	22,214.05	22,214.05
应付托管费	-	-	-	-	-	4,442.80	4,442.80
应付证券清算款	-	-	-	-	-	9,248.71	9,248.71
应付交易费用	-	-	-	-	-	31,182.40	31,182.40
其他负债	-	-	-	-	-	-363,864.75	363,864.75
负债总计	-	-	-	-	-	-431,571.41	431,571.41
利率敏感度缺口	1,708,937.31	-	-	-	9,600.00	52,252,821.31	53,971,358.62

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

注：于2021年12月31日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为0.02%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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的股票，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。

本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金主要投资于指数的成份股及其备选成份股，其投资比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；本基金参与融资业务时，在任何交易日日终，持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。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，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 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	52,473,708.28	97.23
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	-618.70	—
合计	52,473,089.58	97.23

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 1000 指数以外的其他市场变量保持不变	
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（2021 年 12 月 31 日）	

分析	中证 1000 指数上升 5%	2, 519, 494. 17
	中证 1000 指数下降 5%	-2, 519, 494. 17

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) 基金申购款

于 2021 年 3 月 15 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间,本基金申购基金份额的对价总额为 95,895,237.32 元,其中包括以股票支付的申购款 29,720,977.00 元和以现金支付的申购款 66,174,260.32 元。

(2) 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 2021 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 52,378,910.70 元,属于第二层次的余额为 104,397.58 元,无属于第三层次的余额。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 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。

(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。

(3) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(3)除基金申购款和公允价值和执行新金融工具准则外，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	52,473,708.28	96.45
	其中：股票	52,473,708.28	96.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,600.00	0.02
	其中：债券	9,600.00	0.02
	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	1,659,922.43	3.05
8	其他各项资产	259,699.32	0.48
9	合计	54,402,930.03	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	386,967.00	0.72
B	采矿业	1,421,601.00	2.63
C	制造业	37,267,867.57	69.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,370,754.00	2.54
E	建筑业	783,288.00	1.45
F	批发和零售业	1,424,346.00	2.64
G	交通运输、仓储和邮政业	857,864.00	1.59
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,792,301.20	8.88
J	金融业	770,210.00	1.43
K	房地产业	926,674.00	1.72
L	租赁和商务服务业	351,540.00	0.65
M	科学研究和技术服务业	645,539.60	1.20
N	水利、环境和公共设施管理业	782,230.80	1.45
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	163,072.00	0.30
R	文化、体育和娱乐业	332,174.00	0.62
S	综合	44,744.00	0.08
	合计	52,321,173.17	96.94

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	19,903.26	0.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	57,580.00	0.11
J	金融业	58,831.36	0.11
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	16,220.49	0.03
S	综合	-	-
	合计	152,535.11	0.28

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300012	华测检测	12,600	338,562.00	0.63
2	603236	移远通信	1,400	285,460.00	0.53
3	603026	石大胜华	1,400	277,186.00	0.51
4	002176	江特电机	12,600	261,576.00	0.48
5	300672	国科微	1,400	259,700.00	0.48
6	300850	新强联	1,400	249,914.00	0.46
7	002240	盛新锂能	4,200	243,390.00	0.45
8	300073	当升科技	2,800	243,236.00	0.45
9	600499	科达制造	9,800	243,236.00	0.45
10	002497	雅化集团	8,400	240,744.00	0.45
11	002625	光启技术	9,800	235,298.00	0.44
12	601058	赛轮轮胎	15,400	227,766.00	0.42
13	300390	天华超净	2,800	226,800.00	0.42
14	002850	科达利	1,400	224,476.00	0.42
15	688116	天奈科技	1,500	223,935.00	0.41
16	002326	永太科技	4,200	215,082.00	0.40
17	002756	永兴材料	1,400	207,228.00	0.38

18	002036	联创电子	8,400	203,784.00	0.38
19	300568	星源材质	5,519	202,712.87	0.38
20	300725	药石科技	1,400	199,038.00	0.37
21	002402	和而泰	7,000	192,010.00	0.36
22	002407	多氟多	4,200	188,958.00	0.35
23	601677	明泰铝业	4,200	185,178.00	0.34
24	002192	融捷股份	1,400	182,210.00	0.34
25	300118	东方日升	5,600	181,832.00	0.34
26	600771	广誉远	4,200	180,852.00	0.34
27	688388	嘉元科技	1,400	175,770.00	0.33
28	000591	太阳能	15,400	172,480.00	0.32
29	600711	盛屯矿业	15,400	165,242.00	0.31
30	600096	云天化	8,400	164,808.00	0.31
31	000831	五矿稀土	4,200	163,884.00	0.30
32	600110	诺德股份	10,200	162,690.00	0.30
33	002463	沪电股份	9,800	162,484.00	0.30
34	000860	顺鑫农业	4,200	160,356.00	0.30
35	600338	西藏珠峰	4,200	158,172.00	0.29
36	300604	长川科技	2,740	157,550.00	0.29
37	002436	兴森科技	11,200	156,800.00	0.29
38	600882	妙可蓝多	2,800	156,800.00	0.29
39	600559	老白干酒	5,600	156,464.00	0.29
40	000818	航锦科技	4,200	155,862.00	0.29
41	002245	蔚蓝锂芯	5,600	154,056.00	0.29
42	002585	双星新材	5,600	151,648.00	0.28
43	002610	爱康科技	32,200	151,340.00	0.28
44	300767	震安科技	1,440	150,264.00	0.28
45	603005	晶方科技	2,720	149,844.80	0.28
46	000762	西藏矿业	2,800	148,764.00	0.28
47	000155	川能动力	5,600	148,568.00	0.28
48	300769	德方纳米	300	147,348.00	0.27
49	300679	电连技术	2,800	147,000.00	0.27
50	688122	西部超导	1,500	145,410.00	0.27
51	002597	金禾实业	2,800	143,780.00	0.27
52	603606	东方电缆	2,800	143,248.00	0.27
53	300726	宏达电子	1,400	140,084.00	0.26
54	600641	万业企业	4,200	139,734.00	0.26
55	300487	蓝晓科技	1,400	137,690.00	0.26
56	300775	三角防务	2,800	136,892.00	0.25
57	000423	东阿阿胶	2,800	136,500.00	0.25
58	002456	欧菲光	14,000	135,800.00	0.25
59	002531	天顺风能	7,000	135,730.00	0.25

60	000683	远兴能源	18,200	132,860.00	0.25
61	300438	鹏辉能源	2,800	132,272.00	0.25
62	002139	拓邦股份	7,000	130,830.00	0.24
63	300346	南大光电	2,800	130,032.00	0.24
64	002312	川发龙蟒	9,800	128,184.00	0.24
65	002617	露笑科技	8,400	127,680.00	0.24
66	300339	润和软件	5,600	127,512.00	0.24
67	688139	海尔生物	1,400	127,148.00	0.24
68	300035	中科电气	4,200	127,050.00	0.24
69	300476	胜宏科技	4,200	127,050.00	0.24
70	300748	金力永磁	2,800	125,692.00	0.23
71	000516	ST 国医	11,200	123,536.00	0.23
72	600416	湘电股份	5,600	122,584.00	0.23
73	300083	创世纪	8,400	119,952.00	0.22
74	601222	林洋能源	9,800	118,874.00	0.22
75	600773	西藏城投	4,200	118,692.00	0.22
76	600873	梅花生物	15,400	118,118.00	0.22
77	002025	航天电器	1,400	117,530.00	0.22
78	002558	巨人网络	9,800	117,306.00	0.22
79	002389	航天彩虹	4,200	116,760.00	0.22
80	002484	江海股份	4,200	114,744.00	0.21
81	000875	吉电股份	12,600	114,534.00	0.21
82	300151	昌红科技	2,800	114,520.00	0.21
83	688598	金博股份	320	113,612.80	0.21
84	300671	富满微	1,400	113,470.00	0.21
85	688390	固德威	240	110,299.20	0.20
86	002151	北斗星通	2,800	109,900.00	0.20
87	300502	新易盛	2,800	109,704.00	0.20
88	688066	航天宏图	1,500	109,050.00	0.20
89	002747	埃斯顿	4,200	108,990.00	0.20
90	300861	美畅股份	1,400	108,878.00	0.20
91	002727	一心堂	2,800	107,828.00	0.20
92	300294	博雅生物	2,800	107,380.00	0.20
93	603678	火炬电子	1,400	105,910.00	0.20
94	002145	中核钛白	8,400	105,756.00	0.20
95	300685	艾德生物	1,400	105,714.00	0.20
96	600596	新安股份	4,200	104,958.00	0.19
97	000933	神火股份	11,500	104,535.00	0.19
98	603596	伯特利	1,500	104,400.00	0.19
99	603906	龙蟠科技	2,800	103,712.00	0.19
100	300682	朗新科技	2,800	103,684.00	0.19
101	000829	天音控股	5,600	103,264.00	0.19

102	601908	京运通	11,200	102,704.00	0.19
103	300054	鼎龙股份	4,200	102,228.00	0.19
104	300567	精测电子	1,400	101,402.00	0.19
105	600100	同方股份	16,800	101,304.00	0.19
106	600456	宝钛股份	1,400	100,492.00	0.19
107	002318	久立特材	5,600	100,128.00	0.19
108	002706	良信股份	5,600	99,792.00	0.18
109	603027	千禾味业	4,140	99,691.20	0.18
110	002643	万润股份	4,200	99,288.00	0.18
111	300327	中颖电子	1,460	99,134.00	0.18
112	603588	高能环境	5,640	99,094.80	0.18
113	601258	庞大集团	60,200	98,728.00	0.18
114	300855	图南股份	1,400	98,686.00	0.18
115	002738	中矿资源	1,400	98,504.00	0.18
116	603039	泛微网络	1,400	97,678.00	0.18
117	300451	创业慧康	8,700	97,266.00	0.18
118	600151	航天机电	7,000	96,950.00	0.18
119	002091	江苏国泰	7,000	96,110.00	0.18
120	600179	安通控股	25,200	96,012.00	0.18
121	600850	电科数字	2,800	95,564.00	0.18
122	000503	国新健康	5,600	94,640.00	0.18
123	002258	利尔化学	2,800	94,444.00	0.17
124	300373	扬杰科技	1,400	94,052.00	0.17
125	603896	寿仙谷	1,600	92,800.00	0.17
126	688033	天宜上佳	2,800	92,540.00	0.17
127	300395	菲利华	1,400	92,036.00	0.17
128	601567	三星医疗	5,600	91,336.00	0.17
129	603520	司太立	1,400	91,000.00	0.17
130	600330	天通股份	5,600	90,888.00	0.17
131	600587	新华医疗	2,800	90,160.00	0.17
132	002851	麦格米特	2,800	89,656.00	0.17
133	300598	诚迈科技	1,400	89,586.00	0.17
134	600777	新潮能源	39,200	89,376.00	0.17
135	601375	中原证券	18,200	89,362.00	0.17
136	601678	滨化股份	11,200	89,264.00	0.17
137	300458	全志科技	1,400	88,592.00	0.16
138	603688	石英股份	1,400	88,354.00	0.16
139	600323	瀚蓝环境	4,200	88,116.00	0.16
140	300623	捷捷微电	2,800	88,088.00	0.16
141	688266	泽璟制药	1,498	88,082.40	0.16
142	601126	四方股份	4,200	87,780.00	0.16
143	002626	金达威	2,800	87,724.00	0.16

144	300662	科锐国际	1,400	87,094.00	0.16
145	600577	精达股份	11,700	87,048.00	0.16
146	600363	联创光电	2,800	86,912.00	0.16
147	300777	中简科技	1,400	86,632.00	0.16
148	300079	数码视讯	9,800	86,534.00	0.16
149	002810	山东赫达	1,400	86,198.00	0.16
150	300457	赢合科技	2,800	86,016.00	0.16
151	601311	骆驼股份	5,600	85,848.00	0.16
152	300087	荃银高科	2,800	85,120.00	0.16
153	300036	超图软件	2,800	84,140.00	0.16
154	300770	新媒股份	1,400	84,000.00	0.16
155	300709	精研科技	1,400	83,930.00	0.16
156	300298	三诺生物	2,800	83,748.00	0.16
157	002063	远光软件	8,400	83,496.00	0.15
158	601399	国机重装	21,000	82,950.00	0.15
159	300747	锐科激光	1,400	82,754.00	0.15
160	300379	东方通	2,800	82,684.00	0.15
161	600277	亿利洁能	15,680	82,633.60	0.15
162	300185	通裕重工	22,900	82,440.00	0.15
163	300432	富临精工	2,800	82,320.00	0.15
164	603348	文灿股份	1,400	81,774.00	0.15
165	000049	德赛电池	1,400	81,648.00	0.15
166	300233	金城医药	2,800	81,452.00	0.15
167	300773	拉卡拉	2,800	81,256.00	0.15
168	600273	嘉化能源	7,000	80,990.00	0.15
169	300034	钢研高纳	1,400	80,640.00	0.15
170	600993	马应龙	2,800	80,528.00	0.15
171	300393	中来股份	4,200	79,968.00	0.15
172	603565	中谷物流	2,800	79,492.00	0.15
173	300068	南都电源	5,600	79,296.00	0.15
174	300203	聚光科技	2,800	79,128.00	0.15
175	600990	四创电子	1,400	78,638.00	0.15
176	000403	派林生物	2,800	78,484.00	0.15
177	000650	仁和药业	8,400	78,288.00	0.15
178	601777	力帆科技	12,600	77,994.00	0.14
179	603128	华贸物流	5,700	77,976.00	0.14
180	600583	海油工程	16,900	77,909.00	0.14
181	688106	金宏气体	2,800	77,868.00	0.14
182	600562	国睿科技	4,200	77,196.00	0.14
183	300624	万兴科技	1,400	77,154.00	0.14
184	300031	宝通科技	2,800	77,140.00	0.14
185	600210	紫江企业	8,400	77,112.00	0.14

186	002906	华阳集团	1,400	76,944.00	0.14
187	600986	浙文互联	9,100	76,713.00	0.14
188	300638	广和通	1,400	76,300.00	0.14
189	000035	中国天楹	12,600	75,726.00	0.14
190	600252	中恒集团	19,600	75,656.00	0.14
191	603068	博通集成	1,400	74,984.00	0.14
192	002541	鸿路钢构	1,400	74,956.00	0.14
193	000893	亚钾国际	2,800	74,620.00	0.14
194	002171	楚江新材	5,600	74,256.00	0.14
195	600366	宁波韵升	5,600	73,976.00	0.14
196	002332	仙琚制药	5,600	73,920.00	0.14
197	300666	江丰电子	1,400	73,612.00	0.14
198	600211	西藏药业	1,400	73,304.00	0.14
199	300055	万邦达	5,600	72,912.00	0.14
200	601369	陕鼓动力	5,600	72,912.00	0.14
201	601208	东材科技	4,200	72,870.00	0.14
202	002413	雷科防务	9,800	72,814.00	0.13
203	600459	贵研铂业	2,860	72,787.00	0.13
204	300696	爱乐达	1,400	72,716.00	0.13
205	002123	梦网科技	4,200	72,240.00	0.13
206	002041	登海种业	2,800	72,212.00	0.13
207	300188	美亚柏科	4,200	72,198.00	0.13
208	603301	振德医疗	1,400	71,918.00	0.13
209	300224	正海磁材	4,200	71,736.00	0.13
210	600977	中国电影	5,600	71,736.00	0.13
211	600057	厦门象屿	8,400	71,316.00	0.13
212	002832	比音勒芬	2,800	71,260.00	0.13
213	605111	新洁能	400	71,240.00	0.13
214	000902	新洋丰	4,200	70,938.00	0.13
215	000951	中国重汽	4,200	70,938.00	0.13
216	300171	东富龙	1,400	70,756.00	0.13
217	688408	中信博	400	70,604.00	0.13
218	002126	银轮股份	5,600	70,336.00	0.13
219	601666	平煤股份	8,400	70,308.00	0.13
220	300755	华致酒行	1,400	70,112.00	0.13
221	603305	旭升股份	1,400	69,832.00	0.13
222	603583	捷昌驱动	1,400	69,482.00	0.13
223	300737	科顺股份	4,260	69,225.00	0.13
224	002099	海翔药业	8,400	69,216.00	0.13
225	603129	春风动力	400	69,200.00	0.13
226	002015	协鑫能科	4,200	69,132.00	0.13
227	300456	赛微电子	2,800	68,768.00	0.13

228	300792	壹网壹创	1,400	68,600.00	0.13
229	300131	英唐智控	8,400	68,376.00	0.13
230	600483	福能股份	4,200	68,376.00	0.13
231	002960	青鸟消防	1,400	67,970.00	0.13
232	300409	道氏技术	2,800	67,900.00	0.13
233	002097	山河智能	7,000	67,690.00	0.13
234	300398	飞凯材料	2,800	67,648.00	0.13
235	002984	森麒麟	1,900	67,583.00	0.13
236	000657	中钨高新	4,200	67,536.00	0.13
237	300323	华灿光电	5,600	67,536.00	0.13
238	600378	昊华科技	1,400	67,480.00	0.13
239	603713	密尔克卫	500	67,390.00	0.12
240	688050	爱博医疗	320	67,273.60	0.12
241	600305	恒顺醋业	4,200	66,990.00	0.12
242	300674	宇信科技	2,800	66,920.00	0.12
243	600812	华北制药	5,600	66,752.00	0.12
244	600055	万东医疗	2,800	66,668.00	0.12
245	300369	绿盟科技	4,200	66,612.00	0.12
246	300027	华谊兄弟	16,800	66,528.00	0.12
247	002544	杰赛科技	2,800	66,472.00	0.12
248	603187	海容冷链	1,400	66,430.00	0.12
249	002675	东诚药业	4,200	66,276.00	0.12
250	000917	电广传媒	9,800	66,248.00	0.12
251	600963	岳阳林纸	8,400	66,192.00	0.12
252	601212	白银有色	21,700	66,185.00	0.12
253	601137	博威合金	2,800	66,080.00	0.12
254	600295	鄂尔多斯	2,800	66,052.00	0.12
255	600682	南京新百	5,600	65,856.00	0.12
256	300348	长亮科技	4,200	65,814.00	0.12
257	600877	声光电科	4,200	65,772.00	0.12
258	603098	森特股份	1,400	65,758.00	0.12
259	002262	恩华药业	4,200	65,730.00	0.12
260	600685	中船防务	2,800	65,324.00	0.12
261	600116	三峡水利	5,600	65,296.00	0.12
262	688339	亿华通	240	65,004.00	0.12
263	603279	景津装备	1,400	64,932.00	0.12
264	600586	金晶科技	7,000	64,820.00	0.12
265	300702	天宇股份	1,340	64,789.00	0.12
266	002839	张家港行	11,200	64,512.00	0.12
267	300627	华测导航	1,400	64,400.00	0.12
268	603308	应流股份	2,880	64,281.60	0.12
269	300319	麦捷科技	4,200	64,260.00	0.12

270	002182	云海金属	2,800	64,232.00	0.12
271	600688	上海石化	15,400	64,218.00	0.12
272	600612	老凤祥	1,400	64,190.00	0.12
273	300065	海兰信	4,200	64,092.00	0.12
274	600206	有研新材	3,900	63,882.00	0.12
275	300659	中孚信息	1,400	63,490.00	0.12
276	600129	太极集团	2,800	62,888.00	0.12
277	300596	利安隆	1,400	62,664.00	0.12
278	603690	至纯科技	1,300	62,595.00	0.12
279	300470	中密控股	1,400	62,538.00	0.12
280	002639	雪人股份	4,200	62,454.00	0.12
281	002022	科华生物	4,200	62,328.00	0.12
282	300101	振芯科技	2,800	62,104.00	0.12
283	002239	奥特佳	16,800	61,320.00	0.11
284	600740	山西焦化	9,800	60,858.00	0.11
285	000426	兴业矿业	8,400	60,816.00	0.11
286	603179	新泉股份	1,400	60,592.00	0.11
287	688023	安恒信息	240	60,177.60	0.11
288	603979	金诚信	2,800	60,144.00	0.11
289	600063	皖维高新	9,800	60,074.00	0.11
290	300616	尚品宅配	1,400	60,046.00	0.11
291	000969	安泰科技	5,600	59,976.00	0.11
292	600966	博汇纸业	5,800	59,972.00	0.11
293	002100	天康生物	5,600	59,920.00	0.11
294	002581	未名医药	2,800	59,780.00	0.11
295	300326	凯利泰	5,600	59,696.00	0.11
296	600246	万通发展	5,600	59,696.00	0.11
297	300663	科蓝软件	2,800	59,388.00	0.11
298	002324	普利特	4,200	59,304.00	0.11
299	002807	江阴银行	15,400	59,290.00	0.11
300	000727	冠捷科技	19,600	58,996.00	0.11
301	600267	海正药业	4,200	58,758.00	0.11
302	600621	华鑫股份	4,200	58,128.00	0.11
303	600185	格力地产	8,400	58,044.00	0.11
304	603989	艾华集团	1,400	57,960.00	0.11
305	002130	沃尔核材	7,000	57,750.00	0.11
306	002261	拓维信息	7,000	57,750.00	0.11
307	300768	迪普科技	1,400	57,750.00	0.11
308	600389	江山股份	1,400	57,568.00	0.11
309	600075	新疆天业	7,000	57,540.00	0.11
310	002214	大立科技	2,900	57,246.00	0.11
311	002837	英维克	1,400	57,246.00	0.11

312	300236	上海新阳	1,400	57,190.00	0.11
313	002023	海特高新	4,200	57,162.00	0.11
314	603733	仙鹤股份	1,400	57,134.00	0.11
315	002773	康弘药业	2,800	56,980.00	0.11
316	300226	上海钢联	1,400	56,910.00	0.11
317	002254	泰和新材	2,900	56,869.00	0.11
318	002079	苏州固锝	4,200	56,700.00	0.11
319	300579	数字认证	1,400	56,700.00	0.11
320	002216	三全食品	2,800	56,588.00	0.10
321	000546	金圆股份	4,200	56,406.00	0.10
322	300552	万集科技	1,400	56,406.00	0.10
323	600452	涪陵电力	2,800	56,392.00	0.10
324	600481	双良节能	5,600	56,336.00	0.10
325	000672	上峰水泥	2,800	56,196.00	0.10
326	002291	星期六	2,800	55,888.00	0.10
327	002539	云图控股	4,200	55,734.00	0.10
328	600223	鲁商发展	4,200	55,650.00	0.10
329	300406	九强生物	2,800	55,496.00	0.10
330	300803	指南针	1,400	55,398.00	0.10
331	688166	博瑞医药	1,500	55,065.00	0.10
332	000016	深康佳 A	8,400	55,020.00	0.10
333	002698	博实股份	4,200	54,768.00	0.10
334	605117	德业股份	200	54,758.00	0.10
335	688007	光峰科技	1,594	54,753.90	0.10
336	002108	沧州明珠	7,000	54,740.00	0.10
337	603008	喜临门	1,400	54,642.00	0.10
338	603599	广信股份	1,400	54,600.00	0.10
339	300783	三只松鼠	1,400	54,558.00	0.10
340	600490	鹏欣资源	11,200	54,544.00	0.10
341	603915	国茂股份	1,400	54,460.00	0.10
342	000976	华铁股份	9,800	54,390.00	0.10
343	300394	天孚通信	1,480	54,168.00	0.10
344	002556	辉隆股份	4,200	54,054.00	0.10
345	603919	金徽酒	1,400	54,054.00	0.10
346	002425	凯撒文化	5,600	53,984.00	0.10
347	000612	焦作万方	7,000	53,970.00	0.10
348	601001	晋控煤业	5,600	53,816.00	0.10
349	002217	合力泰	15,400	53,746.00	0.10
350	603826	坤彩科技	1,400	53,592.00	0.10
351	000555	神州信息	4,200	53,424.00	0.10
352	601028	玉龙股份	2,800	53,312.00	0.10
353	603368	柳药股份	2,800	53,312.00	0.10

354	002274	华昌化工	4,200	53,214.00	0.10
355	600635	大众公用	14,000	53,060.00	0.10
356	002222	福晶科技	2,800	53,004.00	0.10
357	300761	立华股份	1,400	52,934.00	0.10
358	002928	华夏航空	4,200	52,920.00	0.10
359	300355	蒙草生态	9,800	52,920.00	0.10
360	002283	天润工业	5,600	52,864.00	0.10
361	600320	振华重工	14,000	52,780.00	0.10
362	603876	鼎胜新材	1,400	52,710.00	0.10
363	000767	晋控电力	14,000	52,640.00	0.10
364	600761	安徽合力	4,200	52,542.00	0.10
365	600123	兰花科创	5,600	52,472.00	0.10
366	002567	唐人神	7,000	52,290.00	0.10
367	601965	中国汽研	2,800	52,108.00	0.10
368	002859	洁美科技	1,400	52,080.00	0.10
369	300377	赢时胜	4,200	51,954.00	0.10
370	603229	奥翔药业	1,420	51,702.20	0.10
371	603881	数据港	1,400	51,688.00	0.10
372	600876	洛阳玻璃	1,400	51,646.00	0.10
373	601519	大智慧	7,000	51,590.00	0.10
374	300287	飞利信	8,400	51,492.00	0.10
375	600059	古越龙山	4,200	51,366.00	0.10
376	300352	北信源	8,400	51,240.00	0.09
377	300821	东岳硅材	2,800	51,184.00	0.09
378	000059	华锦股份	7,000	50,960.00	0.09
379	603960	克来机电	1,400	50,932.00	0.09
380	002335	科华数据	1,400	50,904.00	0.09
381	600360	华微电子	5,600	50,848.00	0.09
382	601918	新集能源	11,200	50,848.00	0.09
383	300123	亚光科技	5,600	50,792.00	0.09
384	002612	朗姿股份	1,600	50,736.00	0.09
385	300303	聚飞光电	8,400	50,736.00	0.09
386	002498	汉缆股份	9,800	50,666.00	0.09
387	002276	万马股份	5,600	50,456.00	0.09
388	605376	博迁新材	600	50,418.00	0.09
389	002428	云南锗业	4,200	50,400.00	0.09
390	300075	数字政通	2,800	50,400.00	0.09
391	300102	乾照光电	5,600	50,344.00	0.09
392	002400	省广集团	9,800	50,274.00	0.09
393	300723	一品红	1,400	50,260.00	0.09
394	600742	一汽富维	4,200	50,232.00	0.09
395	000789	万年青	4,100	50,102.00	0.09

396	601952	苏垦农发	4,200	50,022.00	0.09
397	002226	江南化工	8,400	49,980.00	0.09
398	000735	罗牛山	7,000	49,910.00	0.09
399	002206	海利得	5,600	49,728.00	0.09
400	300222	科大智能	4,200	49,602.00	0.09
401	300114	中航电测	2,800	49,504.00	0.09
402	002163	海南发展	4,200	49,350.00	0.09
403	600552	凯盛科技	4,200	49,224.00	0.09
404	002488	金固股份	5,600	49,168.00	0.09
405	002237	恒邦股份	4,200	49,098.00	0.09
406	002649	博彦科技	4,200	49,056.00	0.09
407	300613	富瀚微	300	48,915.00	0.09
408	300184	力源信息	7,000	48,580.00	0.09
409	002135	东南网架	4,200	48,552.00	0.09
410	002106	莱宝高科	4,200	48,342.00	0.09
411	600491	龙元建设	7,000	48,230.00	0.09
412	688100	威胜信息	1,400	48,202.00	0.09
413	603936	博敏电子	2,800	48,160.00	0.09
414	300170	汉得信息	5,600	48,104.00	0.09
415	603298	杭叉集团	2,800	48,020.00	0.09
416	000795	英洛华	5,600	47,880.00	0.09
417	603323	苏农银行	9,800	47,726.00	0.09
418	002481	双塔食品	5,600	47,712.00	0.09
419	600496	精工钢构	11,200	47,712.00	0.09
420	002635	安洁科技	2,800	47,684.00	0.09
421	600797	浙大网新	7,000	47,600.00	0.09
422	688586	江航装备	1,400	47,460.00	0.09
423	000682	东方电子	5,600	47,432.00	0.09
424	002190	成飞集成	1,400	47,278.00	0.09
425	002467	二六三	9,800	47,236.00	0.09
426	600578	京能电力	14,000	47,040.00	0.09
427	600984	建设机械	4,200	47,040.00	0.09
428	002611	东方精工	8,400	46,872.00	0.09
429	000543	皖能电力	8,400	46,704.00	0.09
430	300872	天阳科技	1,400	46,704.00	0.09
431	600422	昆药集团	4,200	46,410.00	0.09
432	000627	天茂集团	14,000	46,340.00	0.09
433	002912	中新赛克	1,400	46,326.00	0.09
434	002737	葵花药业	2,800	46,088.00	0.09
435	600328	中盐化工	2,800	45,948.00	0.09
436	300158	振东制药	5,600	45,864.00	0.08
437	300497	富祥药业	2,800	45,724.00	0.08

438	603113	金能科技	2,800	45,640.00	0.08
439	688018	乐鑫科技	240	45,609.60	0.08
440	000848	承德露露	4,200	45,570.00	0.08
441	603590	康辰药业	1,400	45,486.00	0.08
442	000615	奥园美谷	4,200	45,276.00	0.08
443	002449	国星光电	4,200	45,276.00	0.08
444	600105	永鼎股份	8,400	45,108.00	0.08
445	002833	弘亚数控	1,400	45,052.00	0.08
446	000582	北部湾港	5,600	45,024.00	0.08
447	603997	继峰股份	2,800	45,024.00	0.08
448	300657	弘信电子	2,720	44,907.20	0.08
449	600770	综艺股份	5,600	44,744.00	0.08
450	300633	开立医疗	1,400	44,702.00	0.08
451	000927	中国铁物	12,600	44,604.00	0.08
452	601011	宝泰隆	8,400	44,436.00	0.08
453	002310	东方园林	14,900	44,402.00	0.08
454	002534	西子洁能	1,400	44,366.00	0.08
455	000034	神州数码	2,800	44,324.00	0.08
456	300219	鸿利智汇	2,800	44,268.00	0.08
457	600285	羚锐制药	2,800	44,240.00	0.08
458	300091	金通灵	7,000	44,170.00	0.08
459	603959	百利科技	2,800	44,128.00	0.08
460	000712	锦龙股份	2,800	44,100.00	0.08
461	002746	仙坛股份	4,200	44,058.00	0.08
462	002987	京北方	1,400	43,988.00	0.08
463	002726	龙大美食	4,200	43,932.00	0.08
464	600720	祁连山	4,200	43,680.00	0.08
465	603212	赛伍技术	1,400	43,582.00	0.08
466	600420	国药现代	4,200	43,554.00	0.08
467	000676	智度股份	5,600	43,512.00	0.08
468	000901	航天科技	4,200	43,386.00	0.08
469	601619	嘉泽新能	8,400	43,344.00	0.08
470	002421	达实智能	11,200	43,232.00	0.08
471	000811	冰轮环境	2,800	43,092.00	0.08
472	000539	粤电力 A	7,000	43,050.00	0.08
473	300085	银之杰	2,800	42,896.00	0.08
474	300263	隆华科技	4,200	42,840.00	0.08
475	603718	海利生物	2,800	42,840.00	0.08
476	300397	天和防务	2,800	42,812.00	0.08
477	600864	哈投股份	7,000	42,770.00	0.08
478	300053	欧比特	4,200	42,714.00	0.08
479	000915	华特达因	1,400	42,644.00	0.08

480	603801	志邦家居	1,400	42,588.00	0.08
481	000921	海信家电	2,800	42,420.00	0.08
482	600217	中再资环	5,600	42,392.00	0.08
483	002446	盛路通信	7,000	42,350.00	0.08
484	002891	中宠股份	1,400	42,336.00	0.08
485	600428	中远海特	8,400	42,336.00	0.08
486	300007	汉威科技	1,400	42,308.00	0.08
487	300180	华峰超纤	8,400	42,252.00	0.08
488	600531	豫光金铅	7,000	42,210.00	0.08
489	300735	光弘科技	2,800	42,196.00	0.08
490	002636	金安国纪	2,800	42,140.00	0.08
491	603258	电魂网络	1,400	42,000.00	0.08
492	600789	鲁抗医药	5,600	41,944.00	0.08
493	000030	富奥股份	5,600	41,552.00	0.08
494	300078	思创医惠	5,600	41,328.00	0.08
495	300639	凯普生物	1,400	41,314.00	0.08
496	000793	华闻集团	14,000	41,160.00	0.08
497	300130	新国都	2,800	41,104.00	0.08
498	000966	长源电力	5,600	41,048.00	0.08
499	002759	天际股份	1,400	41,020.00	0.08
500	002055	得润电子	2,800	40,908.00	0.08
501	600662	外服控股	5,700	40,812.00	0.08
502	001696	宗申动力	5,600	40,712.00	0.08
503	300423	昇辉科技	2,800	40,628.00	0.08
504	300800	力合科技	1,400	40,572.00	0.08
505	688037	芯源微	240	40,512.00	0.08
506	600477	杭萧钢构	9,800	40,474.00	0.07
507	600750	江中药业	2,800	40,460.00	0.07
508	300590	移为通信	1,400	40,390.00	0.07
509	000801	四川九洲	4,200	40,278.00	0.07
510	300401	花园生物	2,800	40,264.00	0.07
511	603686	福龙马	2,800	40,208.00	0.07
512	600169	太原重工	14,000	40,180.00	0.07
513	002020	京新药业	4,220	40,132.20	0.07
514	002293	罗莱生活	2,800	40,124.00	0.07
515	002918	蒙娜丽莎	1,400	40,082.00	0.07
516	000923	河钢资源	2,800	40,040.00	0.07
517	601890	亚星锚链	4,300	39,947.00	0.07
518	603693	江苏新能	1,400	39,844.00	0.07
519	300267	尔康制药	8,400	39,816.00	0.07
520	688158	优刻得	1,500	39,780.00	0.07
521	002537	海联金汇	5,600	39,760.00	0.07

522	300177	中海达	4,200	39,732.00	0.07
523	000560	我爱我家	12,600	39,564.00	0.07
524	300143	盈康生命	2,800	39,536.00	0.07
525	600108	亚盛集团	11,200	39,536.00	0.07
526	600103	青山纸业	14,000	39,480.00	0.07
527	300206	理邦仪器	2,800	39,424.00	0.07
528	002913	奥士康	500	39,210.00	0.07
529	600391	航发科技	1,400	39,200.00	0.07
530	000688	国城矿业	2,800	39,144.00	0.07
531	000928	中钢国际	4,200	39,060.00	0.07
532	603877	太平鸟	1,400	39,032.00	0.07
533	300322	硕贝德	2,800	38,864.00	0.07
534	600458	时代新材	2,800	38,780.00	0.07
535	002777	久远银海	1,400	38,710.00	0.07
536	300149	睿智医药	2,800	38,668.00	0.07
537	300867	圣元环保	1,400	38,598.00	0.07
538	603766	隆鑫通用	7,000	38,570.00	0.07
539	688526	科前生物	1,400	38,542.00	0.07
540	300762	上海瀚讯	1,400	38,388.00	0.07
541	601163	三角轮胎	2,800	38,388.00	0.07
542	002545	东方铁塔	4,200	38,304.00	0.07
543	000823	超声电子	2,800	38,136.00	0.07
544	600072	中船科技	2,600	38,090.00	0.07
545	603466	风语筑	1,400	38,080.00	0.07
546	600197	伊力特	1,400	37,968.00	0.07
547	002967	广电计量	1,400	37,912.00	0.07
548	002218	拓日新能	5,600	37,856.00	0.07
549	000910	大亚圣象	2,800	37,548.00	0.07
550	300232	洲明科技	4,200	37,548.00	0.07
551	600751	海航科技	12,600	37,548.00	0.07
552	603108	润达医疗	2,800	37,548.00	0.07
553	300205	天喻信息	2,800	37,464.00	0.07
554	601827	三峰环境	4,200	37,464.00	0.07
555	002158	汉钟精机	1,400	37,282.00	0.07
556	601609	金田铜业	4,300	37,195.00	0.07
557	300020	银江技术	4,200	37,170.00	0.07
558	000088	盐田港	7,000	37,100.00	0.07
559	688508	芯朋微	320	37,075.20	0.07
560	002651	利君股份	2,800	37,044.00	0.07
561	603025	大豪科技	1,400	36,946.00	0.07
562	300428	立中集团	1,400	36,820.00	0.07
563	688277	天智航	1,400	36,750.00	0.07

564	603429	集友股份	1,400	36,540.00	0.07
565	600512	腾达建设	11,200	36,512.00	0.07
566	601606	长城军工	2,800	36,372.00	0.07
567	002516	旷达科技	5,600	36,344.00	0.07
568	601015	陕西黑猫	5,600	36,288.00	0.07
569	002979	雷赛智能	1,400	36,218.00	0.07
570	002768	国恩股份	1,400	36,204.00	0.07
571	603033	三维股份	1,400	36,204.00	0.07
572	603610	麒盛科技	1,400	36,204.00	0.07
573	002930	宏川智慧	1,400	36,190.00	0.07
574	600783	鲁信创投	2,800	36,176.00	0.07
575	600125	铁龙物流	7,000	36,120.00	0.07
576	600326	西藏天路	5,600	36,120.00	0.07
577	002614	奥佳华	2,800	36,064.00	0.07
578	300191	潜能恒信	1,400	36,064.00	0.07
579	600503	华丽家族	11,200	36,064.00	0.07
580	603916	苏博特	1,400	36,064.00	0.07
581	603378	亚士创能	1,400	36,022.00	0.07
582	600343	航天动力	2,600	35,880.00	0.07
583	300194	福安药业	7,000	35,840.00	0.07
584	000061	农产品	5,600	35,784.00	0.07
585	603533	掌阅科技	1,400	35,714.00	0.07
586	000903	云内动力	9,800	35,672.00	0.07
587	002035	华帝股份	5,600	35,616.00	0.07
588	603018	华设集团	4,260	35,613.60	0.07
589	603363	傲农生物	2,800	35,560.00	0.07
590	000900	现代投资	8,400	35,448.00	0.07
591	002292	奥飞娱乐	5,600	35,448.00	0.07
592	000592	平潭发展	11,200	35,392.00	0.07
593	300134	大富科技	2,800	35,392.00	0.07
594	300127	银河磁体	1,400	35,350.00	0.07
595	000603	盛达资源	2,800	35,224.00	0.07
596	300602	飞荣达	1,400	35,154.00	0.07
597	002518	科士达	1,400	35,140.00	0.07
598	605199	葫芦娃	1,400	34,888.00	0.06
599	600502	安徽建工	8,400	34,860.00	0.06
600	600810	神马股份	2,800	34,860.00	0.06
601	000597	东北制药	5,600	34,832.00	0.06
602	600581	八一钢铁	5,600	34,776.00	0.06
603	603601	再升科技	2,800	34,748.00	0.06
604	600590	泰豪科技	4,200	34,734.00	0.06
605	600308	华泰股份	5,600	34,664.00	0.06

606	601929	吉视传媒	15,400	34,650.00	0.06
607	300525	博思软件	1,480	34,602.40	0.06
608	002895	川恒股份	1,400	34,566.00	0.06
609	002961	瑞达期货	1,400	34,496.00	0.06
610	603393	新天然气	1,400	34,482.00	0.06
611	300311	任子行	4,200	34,314.00	0.06
612	600557	康缘药业	2,800	34,272.00	0.06
613	600846	同济科技	4,200	34,272.00	0.06
614	600523	贵航股份	1,400	34,160.00	0.06
615	000935	四川双马	1,400	34,020.00	0.06
616	600073	上海梅林	4,200	33,978.00	0.06
617	300366	创意信息	2,800	33,936.00	0.06
618	600098	广州发展	4,200	33,936.00	0.06
619	300429	强力新材	2,800	33,880.00	0.06
620	002043	兔宝宝	2,800	33,824.00	0.06
621	002550	千红制药	7,000	33,810.00	0.06
622	300477	合纵科技	4,200	33,810.00	0.06
623	300119	瑞普生物	1,400	33,768.00	0.06
624	300349	金卡智能	2,800	33,740.00	0.06
625	603043	广州酒家	1,400	33,684.00	0.06
626	300378	鼎捷软件	1,400	33,600.00	0.06
627	300292	吴通控股	8,400	33,516.00	0.06
628	000851	高鸿股份	5,600	33,488.00	0.06
629	300653	正海生物	500	33,385.00	0.06
630	603728	鸣志电器	1,400	33,194.00	0.06
631	300307	慈星股份	4,200	33,054.00	0.06
632	300047	天源迪科	4,200	33,012.00	0.06
633	603920	世运电路	1,480	33,004.00	0.06
634	002285	世联行	8,400	32,928.00	0.06
635	600114	东睦股份	2,800	32,900.00	0.06
636	688222	成都先导	1,400	32,886.00	0.06
637	600284	浦东建设	5,200	32,864.00	0.06
638	603337	杰克股份	1,400	32,830.00	0.06
639	002351	漫步者	2,800	32,816.00	0.06
640	300266	兴源环境	8,400	32,760.00	0.06
641	603730	岱美股份	1,400	32,648.00	0.06
642	002437	誉衡药业	11,200	32,592.00	0.06
643	300045	华力创通	2,800	32,564.00	0.06
644	002733	雄韬股份	1,400	32,382.00	0.06
645	000931	中关村	4,200	32,214.00	0.06
646	688389	普门科技	1,400	32,200.00	0.06
647	688127	蓝特光学	1,400	32,186.00	0.06

648	603508	思维列控	1,400	32,172.00	0.06
649	002042	华孚时尚	7,000	31,990.00	0.06
650	300145	中金环境	9,800	31,948.00	0.06
651	002298	中电兴发	4,200	31,878.00	0.06
652	002605	姚记科技	1,400	31,822.00	0.06
653	300738	奥飞数据	1,400	31,780.00	0.06
654	000667	美好置业	18,200	31,668.00	0.06
655	002243	力合科创	2,800	31,612.00	0.06
656	300132	青松股份	2,800	31,612.00	0.06
657	300441	鲍斯股份	2,800	31,612.00	0.06
658	600017	日照港	11,200	31,472.00	0.06
659	600550	保变电气	5,600	31,304.00	0.06
660	600331	宏达股份	9,800	31,262.00	0.06
661	002061	浙江交科	5,600	31,248.00	0.06
662	000006	深振业 A	7,000	31,220.00	0.06
663	002232	启明信息	1,400	31,164.00	0.06
664	300523	辰安科技	1,400	30,940.00	0.06
665	603566	普莱柯	1,400	30,940.00	0.06
666	688086	紫晶存储	1,400	30,800.00	0.06
667	300684	中石科技	1,400	30,716.00	0.06
668	002515	金字火腿	5,600	30,688.00	0.06
669	600261	阳光照明	7,000	30,660.00	0.06
670	002573	清新环境	4,200	30,576.00	0.06
671	002955	鸿合科技	1,400	30,548.00	0.06
672	600395	盘江股份	4,200	30,534.00	0.06
673	300109	新开源	1,400	30,520.00	0.06
674	300455	康拓红外	2,800	30,436.00	0.06
675	000989	九芝堂	2,800	30,408.00	0.06
676	000036	华联控股	7,000	30,380.00	0.06
677	002194	武汉凡谷	2,800	30,352.00	0.06
678	300208	青岛中程	2,800	30,352.00	0.06
679	600715	文投控股	9,100	30,303.00	0.06
680	002201	正威新材	1,440	30,268.80	0.06
681	000652	泰达股份	7,000	30,170.00	0.06
682	300365	恒华科技	2,800	30,100.00	0.06
683	600604	市北高新	5,600	30,072.00	0.06
684	002489	浙江永强	8,400	29,988.00	0.06
685	600997	开滦股份	4,200	29,904.00	0.06
686	300439	美康生物	1,400	29,834.00	0.06
687	002522	浙江众成	4,200	29,820.00	0.06
688	002697	红旗连锁	5,600	29,792.00	0.06
689	002803	吉宏股份	1,400	29,722.00	0.06

690	600337	美克家居	8,400	29,484.00	0.05
691	000557	西部创业	7,000	29,470.00	0.05
692	000566	海南海药	5,600	29,400.00	0.05
693	002646	天佑德酒	1,400	29,386.00	0.05
694	002741	光华科技	1,400	29,372.00	0.05
695	601330	绿色动力	2,800	29,232.00	0.05
696	000032	深桑达 A	1,400	29,036.00	0.05
697	300229	拓尔思	2,800	28,980.00	0.05
698	300527	中船应急	2,800	28,952.00	0.05
699	300572	安车检测	1,400	28,910.00	0.05
700	603387	基蛋生物	1,440	28,886.40	0.05
701	300302	同有科技	2,800	28,812.00	0.05
702	300368	汇金股份	2,800	28,756.00	0.05
703	000791	甘肃电投	4,200	28,728.00	0.05
704	603612	索通发展	1,400	28,728.00	0.05
705	300673	佩蒂股份	1,400	28,672.00	0.05
706	603609	禾丰股份	2,800	28,672.00	0.05
707	002251	步步高	4,200	28,644.00	0.05
708	300006	莱美药业	4,200	28,644.00	0.05
709	300531	优博讯	1,400	28,602.00	0.05
710	000950	重药控股	5,600	28,560.00	0.05
711	000958	东方能源	5,600	28,560.00	0.05
712	300664	鹏鹞环保	4,200	28,560.00	0.05
713	000600	建投能源	5,600	28,504.00	0.05
714	000828	东莞控股	2,800	28,504.00	0.05
715	000813	德展健康	7,000	28,490.00	0.05
716	002309	中利集团	4,200	28,392.00	0.05
717	600748	上实发展	7,000	28,350.00	0.05
718	300215	电科院	2,800	28,084.00	0.05
719	600775	南京熊猫	2,800	27,860.00	0.05
720	600975	新五丰	4,100	27,839.00	0.05
721	603060	国检集团	1,440	27,792.00	0.05
722	002664	长鹰信质	1,400	27,790.00	0.05
723	601588	北辰实业	11,200	27,776.00	0.05
724	300318	博晖创新	2,800	27,748.00	0.05
725	600480	凌云股份	2,800	27,748.00	0.05
726	300831	派瑞股份	1,400	27,650.00	0.05
727	300510	金冠股份	4,200	27,594.00	0.05
728	000810	创维数字	2,800	27,580.00	0.05
729	002589	瑞康医药	7,000	27,510.00	0.05
730	600710	苏美达	4,200	27,468.00	0.05
731	600565	迪马股份	11,200	27,328.00	0.05

732	600694	大商股份	1,400	27,314.00	0.05
733	000070	特发信息	4,200	27,300.00	0.05
734	002609	捷顺科技	2,800	27,300.00	0.05
735	600602	云赛智联	4,200	27,300.00	0.05
736	300846	首都在线	1,800	27,216.00	0.05
737	000710	贝瑞基因	1,400	27,160.00	0.05
738	000507	珠海港	4,200	27,132.00	0.05
739	600971	恒源煤电	4,200	27,132.00	0.05
740	002647	仁东控股	2,800	27,048.00	0.05
741	600933	爱柯迪	1,400	26,992.00	0.05
742	000881	中广核技	2,800	26,964.00	0.05
743	600548	深高速	2,700	26,946.00	0.05
744	601158	重庆水务	4,200	26,922.00	0.05
745	300110	华仁药业	5,600	26,880.00	0.05
746	600575	淮河能源	11,200	26,880.00	0.05
747	601515	东风股份	3,300	26,829.00	0.05
748	603587	地素时尚	1,400	26,824.00	0.05
749	002215	诺普信	4,200	26,796.00	0.05
750	300520	科大国创	1,400	26,768.00	0.05
751	603118	共进股份	2,800	26,768.00	0.05
752	603299	苏盐井神	2,800	26,768.00	0.05
753	300284	苏交科	4,200	26,754.00	0.05
754	000882	华联股份	14,000	26,740.00	0.05
755	002376	新北洋	2,800	26,404.00	0.05
756	000936	华西股份	4,200	26,334.00	0.05
757	000968	蓝焰控股	2,800	26,180.00	0.05
758	300238	冠昊生物	1,400	25,942.00	0.05
759	300039	上海凯宝	4,200	25,872.00	0.05
760	601700	风范股份	4,200	25,830.00	0.05
761	002320	海峡股份	4,300	25,800.00	0.05
762	603222	济民医疗	1,400	25,760.00	0.05
763	300016	北陆药业	2,800	25,704.00	0.05
764	300190	维尔利	4,200	25,620.00	0.05
765	603313	梦百合	1,480	25,618.80	0.05
766	300386	飞天诚信	1,400	25,606.00	0.05
767	300183	东软载波	1,400	25,522.00	0.05
768	603169	兰石重装	2,800	25,508.00	0.05
769	002461	珠江啤酒	2,800	25,480.00	0.05
770	605388	均瑶健康	1,400	25,466.00	0.05
771	002547	春兴精工	5,600	25,424.00	0.05
772	600569	安阳钢铁	8,400	25,116.00	0.05
773	603636	南威软件	2,800	25,032.00	0.05

774	002782	可立克	1,400	25,018.00	0.05
775	000567	海德股份	1,400	24,990.00	0.05
776	300252	金信诺	2,800	24,976.00	0.05
777	002479	富春环保	4,200	24,948.00	0.05
778	601963	重庆银行	2,800	24,920.00	0.05
779	002542	中化岩土	8,400	24,780.00	0.05
780	300276	三丰智能	5,600	24,584.00	0.05
781	300204	舒泰神	1,400	24,570.00	0.05
782	601949	中国出版	4,200	24,528.00	0.05
783	300080	易成新能	4,200	24,444.00	0.05
784	002204	大连重工	5,600	24,360.00	0.05
785	002582	好想你	2,800	24,360.00	0.05
786	600855	航天长峰	1,400	24,332.00	0.05
787	600335	国机汽车	2,800	24,304.00	0.05
788	002677	浙江美大	1,400	24,290.00	0.05
789	300634	彩讯股份	1,400	24,262.00	0.04
790	000048	京基智农	1,400	24,234.00	0.04
791	002034	旺能环境	1,400	24,178.00	0.04
792	002717	岭南股份	7,000	24,150.00	0.04
793	000697	炼石航空	2,800	24,136.00	0.04
794	000065	北方国际	2,800	24,024.00	0.04
795	002234	民和股份	1,400	24,024.00	0.04
796	300910	瑞丰新材	300	23,955.00	0.04
797	002662	京威股份	5,600	23,856.00	0.04
798	000761	本钢板材	5,600	23,520.00	0.04
799	002301	齐心集团	2,800	23,436.00	0.04
800	300607	拓斯达	1,460	23,360.00	0.04
801	002378	章源钨业	2,800	23,296.00	0.04
802	002367	康力电梯	2,900	23,287.00	0.04
803	603105	芯能科技	1,400	23,268.00	0.04
804	002641	公元股份	4,200	23,016.00	0.04
805	002838	道恩股份	1,400	22,960.00	0.04
806	002950	奥美医疗	1,400	22,890.00	0.04
807	000550	江铃汽车	1,400	22,834.00	0.04
808	002695	煌上煌	1,400	22,834.00	0.04
809	002277	友阿股份	7,000	22,820.00	0.04
810	300255	常山药业	2,800	22,764.00	0.04
811	603489	八方股份	100	22,560.00	0.04
812	600184	光电股份	1,400	22,442.00	0.04
813	002792	通宇通讯	1,400	22,400.00	0.04
814	603328	依顿电子	2,800	22,400.00	0.04
815	300740	水羊股份	1,400	22,246.00	0.04

816	002435	长江健康	4,200	22,134.00	0.04
817	603439	贵州三力	1,400	22,092.00	0.04
818	300328	宜安科技	2,800	21,980.00	0.04
819	300388	节能国祯	2,800	21,980.00	0.04
820	002929	润建股份	600	21,684.00	0.04
821	600032	浙江新能	1,400	21,644.00	0.04
822	000601	韶能股份	4,200	21,504.00	0.04
823	300765	新诺威	1,400	21,476.00	0.04
824	000796	凯撒旅业	2,800	21,364.00	0.04
825	000639	西王食品	4,200	21,336.00	0.04
826	002017	东信和平	1,400	21,238.00	0.04
827	002973	侨银股份	1,400	21,154.00	0.04
828	002596	海南瑞泽	5,600	21,112.00	0.04
829	600894	广日股份	2,800	21,112.00	0.04
830	300066	三川智慧	4,200	21,084.00	0.04
831	002562	兄弟科技	4,200	20,958.00	0.04
832	000025	特力A	1,400	20,944.00	0.04
833	600510	黑牡丹	2,800	20,944.00	0.04
834	600929	雪天盐业	2,800	20,888.00	0.04
835	002798	帝欧家居	1,400	20,818.00	0.04
836	605008	长鸿高科	1,400	20,678.00	0.04
837	002267	陕天然气	2,800	20,636.00	0.04
838	002672	东江环保	2,800	20,608.00	0.04
839	603359	东珠生态	1,440	20,592.00	0.04
840	002344	海宁皮城	4,200	20,580.00	0.04
841	002228	合兴包装	5,600	20,440.00	0.04
842	600622	光大嘉宝	7,000	20,440.00	0.04
843	603808	歌力思	1,400	20,426.00	0.04
844	002383	合众思壮	2,800	20,272.00	0.04
845	600007	中国国贸	1,400	20,160.00	0.04
846	002303	美盈森	5,600	20,104.00	0.04
847	000913	钱江摩托	1,400	19,866.00	0.04
848	600800	渤海化学	4,200	19,866.00	0.04
849	600825	新华传媒	4,200	19,824.00	0.04
850	600874	创业环保	2,800	19,796.00	0.04
851	688505	复旦张江	1,400	19,740.00	0.04
852	300448	浩云科技	2,800	19,712.00	0.04
853	300805	电声股份	1,400	19,544.00	0.04
854	000019	深粮控股	2,800	19,488.00	0.04
855	600624	复旦复华	2,800	19,404.00	0.04
856	688365	光云科技	1,400	19,404.00	0.04
857	600746	江苏索普	1,400	19,320.00	0.04

858	600916	中国黄金	1,400	19,222.00	0.04
859	003012	东鹏控股	1,400	19,208.00	0.04
860	688055	龙腾光电	2,800	19,180.00	0.04
861	603093	南华期货	1,400	19,012.00	0.04
862	000058	深赛格	2,800	18,844.00	0.03
863	002530	金财互联	2,800	18,480.00	0.03
864	300485	赛升药业	1,400	18,466.00	0.03
865	601886	江河集团	2,800	18,452.00	0.03
866	600449	宁夏建材	1,500	18,045.00	0.03
867	301039	中集车辆	1,400	17,962.00	0.03
868	002307	北新路桥	4,200	17,934.00	0.03
869	000544	中原环保	2,800	17,920.00	0.03
870	002755	奥赛康	1,400	17,822.00	0.03
871	600686	金龙汽车	2,800	17,584.00	0.03
872	002314	南山控股	5,600	17,472.00	0.03
873	600618	氯碱化工	1,400	17,374.00	0.03
874	000498	山东路桥	2,800	17,304.00	0.03
875	601069	西部黄金	1,400	17,206.00	0.03
876	002616	长青集团	2,800	17,024.00	0.03
877	600738	丽尚国潮	2,800	17,024.00	0.03
878	002941	新疆交建	1,400	16,926.00	0.03
879	603626	科森科技	1,400	16,926.00	0.03
880	000011	深物业A	1,400	16,324.00	0.03
881	601528	瑞丰银行	1,400	15,792.00	0.03
882	002911	佛燃能源	1,400	15,680.00	0.03
883	600996	贵广网络	2,800	15,596.00	0.03
884	002969	嘉美包装	2,700	15,363.00	0.03
885	601595	上海电影	1,400	15,148.00	0.03
886	600636	国新文化	1,400	15,036.00	0.03
887	000885	城发环境	1,400	14,840.00	0.03
888	000797	中国武夷	5,600	14,616.00	0.03
889	603053	成都燃气	1,400	14,546.00	0.03
890	002793	罗欣药业	1,400	14,518.00	0.03
891	603869	新智认知	1,400	14,028.00	0.03
892	000918	嘉凯城	5,600	13,944.00	0.03
893	601686	友发集团	1,400	13,720.00	0.03
894	600054	黄山旅游	1,400	13,678.00	0.03
895	600248	陕西建工	2,800	13,440.00	0.02
896	601921	浙版传媒	1,300	12,519.00	0.02
897	601858	中国科传	1,400	12,348.00	0.02
898	603887	城地香江	1,420	11,530.40	0.02
899	603815	交建股份	1,400	11,158.00	0.02

900	601279	英利汽车	1,400	10,626.00	0.02
901	000517	荣安地产	4,200	10,332.00	0.02

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600927	永安期货	1,568	58,831.36	0.11
2	600941	中国移动	1,000	57,580.00	0.11
3	603230	内蒙新华	627	16,220.49	0.03
4	001296	长江材料	256	15,175.68	0.03
5	001234	泰慕士	286	4,727.58	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300725	药石科技	1,613,205.16	2.99
2	300677	英科医疗	1,383,045.00	2.56
3	002402	和而泰	1,284,048.00	2.38
4	002409	雅克科技	1,259,390.00	2.33
5	000516	ST 国医	1,237,682.00	2.29
6	000733	振华科技	1,209,634.00	2.24
7	000799	酒鬼酒	1,182,896.00	2.19
8	300724	捷佳伟创	1,178,042.00	2.18
9	300363	博腾股份	1,129,161.00	2.09
10	603185	上机数控	1,094,378.00	2.03
11	603613	国联股份	1,082,048.00	2.00
12	002497	雅化集团	1,064,025.00	1.97
13	002706	良信股份	1,048,770.77	1.94
14	300073	当升科技	1,025,195.00	1.90
15	000591	太阳能	1,020,703.00	1.89
16	603127	昭衍新药	1,016,713.80	1.88
17	002025	航天电器	1,009,469.00	1.87
18	002541	鸿路钢构	999,559.00	1.85
19	002407	多氟多	981,398.00	1.82
20	601636	旗滨集团	975,820.00	1.81

注：不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300725	药石科技	1,390,317.40	2.58

2	000733	振华科技	1,346,672.00	2.50
3	000799	酒鬼酒	1,325,380.00	2.46
4	300677	英科医疗	1,283,024.00	2.38
5	002409	雅克科技	1,253,850.56	2.32
6	300363	博腾股份	1,250,441.00	2.32
7	000516	ST 国医	1,168,520.00	2.17
8	300724	捷佳伟创	1,139,446.60	2.11
9	002402	和而泰	1,109,530.00	2.06
10	002706	良信股份	970,927.00	1.80
11	002025	航天电器	963,953.00	1.79
12	002541	鸿路钢构	908,024.00	1.68
13	300073	当升科技	906,890.00	1.68
14	000591	太阳能	894,487.00	1.66
15	002497	雅化集团	864,792.00	1.60
16	002180	纳思达	850,182.00	1.58
17	002407	多氟多	838,666.00	1.55
18	300083	创世纪	816,804.00	1.51
19	300037	新宙邦	816,136.00	1.51
20	300379	东方通	779,504.40	1.44

注：不考虑相关交易费用。

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	288,862,910.82
卖出股票收入（成交）总额	182,184,575.02

注：不考虑相关交易费用。

8.5 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）	9,600.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,600.00	0.02

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

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	113635	升 21 转债	40	5,600.00	0.01
2	123133	佩蒂转债	40	4,000.00	0.01

8.7 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

注：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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

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

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

本基金本报告期末投资的前十名证券中，江特电机（002176）于 2021 年 12 月 10 日公告收到了中国证监会的《立案告知书》，因涉嫌信息披露违法违规，中国证监会决定对公司立案。对该证券投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

报告期内基金投资的前十名其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情况，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

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	49,014.88
2	应收证券清算款	209,892.21
3	应收股利	-
4	应收利息	792.23
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	259,699.32

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：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。

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	600941	中国移动	57,580.00	0.11	新股未上市
2	001234	泰慕士	4,727.58	0.01	新股未上市

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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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

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 (%)

877	48,577.17	34,155,682.00	80.17	8,446,500.00	19.83
-----	-----------	---------------	-------	--------------	-------

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中国中投证券有限责任公司	11,619,300.00	27.27
2	华泰证券股份有限公司	5,502,200.00	12.92
3	中国中金财富证券有限公司转融通担保证券明细账户	4,140,300.00	9.72
4	中信证券股份有限公司	3,641,088.00	8.55
5	广发证券股份有限公司	3,582,500.00	8.41
6	申万宏源证券有限公司	2,302,300.00	5.40
7	方正证券股份有限公司	1,490,032.00	3.50
8	上海喔赢投资有限公司	1,210,000.00	2.84
9	海通证券股份有限公司	577,100.00	1.35
10	付宇	391,600.00	0.92

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.00	0.0000

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情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年3月15日）基金份额总额	222,602,182.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	84,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	264,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-

本报告期末基金份额总额	42,602,182.00
-------------	---------------

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内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

基金管理人的重大人事变动：
 2021 年 5 月 19 日，经公司董事会批准陈晖女士不再担任公司督察长，刘万方先生担任公司督察长并不再担任公司副总经理。
 2021 年 12 月 9 日，经公司董事会批准满黎先生担任公司副总经理。
 上述人事变动已按相关规定备案、公告。
 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、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 50,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 1 年的审计服务。

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

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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	
招商证券	6	470,582,163.94	100.00%	430,714.51	100.00%	-

华泰证券	2	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：

- 1) 资金雄厚，信誉良好。
- 2) 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。
- 3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。
- 5) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序 基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

3、上述交易单元均系本报告期内租用。

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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	78,380.43	100.00%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

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	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021年12月25日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于调整公司旗下公募基金风险等级相关事项的公告	证监会规定报刊和网站	2021年12月15日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于聘任副总经理的公告	证监会规定报刊和网站	2021年12月10日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021年10月23日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下	证监会规定报刊和网站	2021年10月12日

	基金参与海银基金销售有限公司费率优惠活动的公告		
6	华泰柏瑞基金关于网上直销直连招商银行支付服务的补充提示性公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 9 月 27 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于直销赎回转认（申）购业务增加适用基金范围及费率优惠的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 9 月 22 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 9 月 4 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 8 月 18 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 8 月 12 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于新增办公地址的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 8 月 9 日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于提醒客户及时更新身份证件及非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 6 月 22 日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 6 月 3 日
14	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与珠海盈米基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 6 月 2 日
15	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 5 月 21 日
16	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浙商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 4 月 30 日
17	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止上海尚善基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 4 月 27 日
18	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与蚂蚁（杭州）基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 4 月 20 日
19	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 4 月 17 日
20	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号指数基金指引》修	证监会规定报刊和网站	2021 年 3 月 27 日

	改基金合同和托管协议的公告		
21	华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	证监会规定报刊和网站	2021 年 3 月 19 日
22	华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 3 月 19 日
23	华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 3 月 19 日
24	华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 3 月 16 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20210716-20211231;	0.00	19,359,600.00	7,740,300.00	11,619,300.00	27.27
	2	20210312-20210507-20210715;	0.00	78,255,500.00	74,614,412.00	3,641,088.00	8.55

产品特有风险

本基金报告期内有单一持有人持有基金份额超过 20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

13.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层
托管人住所

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。

客户服务热线：400-888-0001（免长途费） 021-3878 4638

公司网址：www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司

2022 年 3 月 31 日