

华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券
投资基金
2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 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 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期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 8 月 29 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 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 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	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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	66
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
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	67

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	68
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	68
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	68
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	68
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
7.12 投资组合报告附注	68
§ 8 基金份额持有人信息	69
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
8.2 期末上市基金前十名持有人	69
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	70
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情况	70
§ 9 开放式基金份额变动	70
§ 10 重大事件揭示	70
10.1 基金份额持有人大会决议	70
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	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
10.4 基金投资策略的改变	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
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	71
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
10.8 其他重大事件	72
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	72
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	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	73
§ 12 备查文件目录	73
12.1 备查文件目录	73
12.2 存放地点	73
12.3 查阅方式	73

§ 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 1000ETF (扩位证券简称: 中证 1000 指数 ETF)
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	63,602,182.00 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

注: 本基金于 2022 年 7 月 28 日扩位证券简称由“1000ETF 基金”变更为“中证 1000 指数 ETF”。

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	1、股票的投资策略; 2、存托凭证的投资策略; 3、债券投资策略; 4、股指期货的投资策略; 5、资产支持证券的投资策略; 6、融资及转融通证券出借业务
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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金中期报告备置地点	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
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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,929,064.82
本期利润	-6,246,727.39
加权平均基金份额本期利润	-0.1285
本期加权平均净值利润率	-12.00%
本期基金份额净值增长率	-12.03%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	4,256,475.38
期末可供分配基金份额利润	0.0669
期末基金资产净值	70,886,902.07
期末基金份额净值	1.1145
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	11.45%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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。

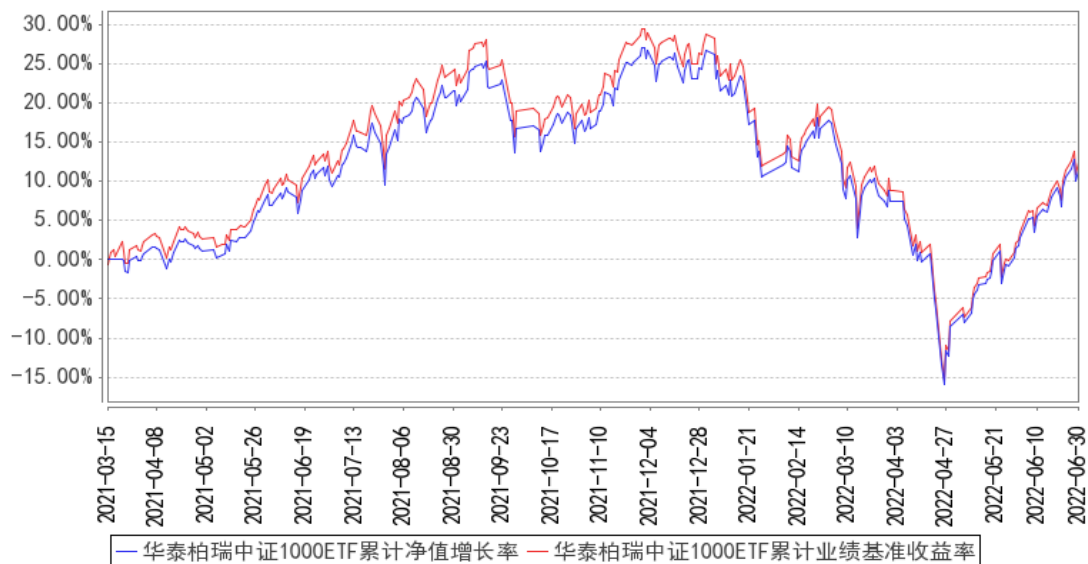
3.2 基金净值表现

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	9.90%	1.27%	10.11%	1.31%	-0.21%	-0.04%
过去三个月	3.71%	2.01%	3.30%	2.06%	0.41%	-0.05%
过去六个月	-12.03%	1.84%	-12.67%	1.88%	0.64%	-0.04%
过去一年	-0.50%	1.55%	-1.24%	1.59%	0.74%	-0.04%
自基金合同生效起至今	11.45%	1.41%	12.46%	1.46%	-1.01%	-0.05%

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 日至 2022 年 6 月 30 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。

§ 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、华泰柏瑞亨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、华泰柏瑞景气汇选三年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深云计算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科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞聚优智选一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞匠心汇选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 指数增强型证券投资基金、华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞恒泽混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、华泰柏瑞匠心臻选混合型证券投资基金。截至 2022 年 6 月 30 日, 公司基金管理规模为 2750.48 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	-	7 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。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。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。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。2022 年 1 月起任华泰柏瑞中证沪

					港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月起任华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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。任职日期和离任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合规守信情况的说明

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。

4.3.2 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

2022 年上半年 A 股市场波动较大，先抑后扬，多数行业表现一般，未录得正收益。煤炭、交通运输、综合板块的表现较好，涨跌幅分别为 31.38%、-0.71%、-1.46%。整体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板的涨跌幅分别为-9.22%、-12.30%、-12.67%和-15.41%。从市场风格来看，价值风格表现优于成长风格，期间沪深 300 价值指数和沪深 300 成长指数的涨跌幅分别为-6.52%和-13.14%，中证 500 价值相对中证 500 成长亦同样获得了显著的超额收益。

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 0.045%，期间日跟踪误差为 0.056%，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 1.1145 元；本报告期基金份额净值增长率为-12.03%，业绩比较基准收益率为-12.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上海新冠疫情的爆发使得国内经济短期内受到影响，中美利差开始倒挂，市场情绪恐慌，迎来短暂的股债汇三杀，上证指数最低收于 2863 点。4 月底至今的反弹，在稳增长措施不断发力以及国内疫情逐步得到控制的背景下，市场交易最差的时期已经过去，经济迎来修复。5 月，经济基本面有所恢复，工业增加值出现正增长，设备制造业受益于物流打通和供应链修复，改善幅度较大。复工复产推动企业加快赶工，出口大超预期。疫情对消费的负面影响约为 4 月的 70%，未来有望继续修复。4 月之前房地产由于政策预期的反转，如期看到基本面的大幅改善，地产成交数据降幅大幅收窄。汽车销售 5 月改善，新能源车 6 月同比继续高增长。猪肉周期底部回升以及成品油价格上升带来的输入性通胀压力下，预计下半年国内通胀中枢或将小幅抬升，温和通胀的环境下利率中枢难以大幅下行。

从配置的角度，中国经济从衰退到复苏，美国经济从过热到衰退，中美经济周期持续错位，使得中国市场走出了相对独立的行情。从年初至今市场交易逻辑来看，房地产和消费的交易逻辑是正相关的，受到“稳增长预期兑现”或者“复苏预期”的牵引；从投资主线来看，依然关注下半年稳增长政策的落地以及复苏逻辑两条主线。受此影响，大盘股或将更加受益。

4.6 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。

4.7 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，在符合有关基金收益分配条件的前提下，本基金收益每年最多分配 4 次，每次基金收益分配数额由基金管理人根据实际情况确定。基于本基金的性质和特点，本基金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基金份额净值低于面值。截止本报告期末，本基金未进行利润分配，本基金可分配收益为 4,256,475.38 元。

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

无。

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

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,980,000.25	1,643,084.32
结算备付金		42,405.13	16,838.11
存出保证金		24,086.14	49,014.88
交易性金融资产	6.4.7.2	67,178,045.75	52,483,308.28
其中：股票投资		67,143,843.93	52,473,708.28
基金投资		-	-
债券投资		34,201.82	9,600.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		1,583,730.80	209,892.21
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	75,616.24	792.23
资产总计		71,883,884.31	54,402,930.03
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		119,811.72	618.70
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	9,248.71
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		23,363.87	22,214.05
应付托管费		4,672.77	4,442.80
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	849,133.88	395,047.15
负债合计		996,982.24	431,571.41
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	63,602,182.00	42,602,182.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	7,284,720.07	11,369,176.62
净资产合计		70,886,902.07	53,971,358.62
负债和净资产总计		71,883,884.31	54,402,930.03

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1145 元，基金份额总额 63,602,182.00 份。

6.2 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 3 月 15 日（基金合 同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-5,943,494.50	2,002,687.30
1. 利息收入		11,746.23	102,448.12
其中：存款利息收入	6.4.7.13	11,746.23	102,440.75
债券利息收入		-	7.37
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）		-1,741,831.25	150,744.87
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-2,147,531.63	1,601.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	8,421.94	7,203.68
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	397,278.44	141,939.63
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失	6.4.7.20	-4,317,662.57	1,744,983.98

以“-”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)	6.4.7.21	104,253.09	4,510.33
减: 二、营业总支出		303,232.89	725,416.87
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	128,721.12	68,949.06
2. 托管费	6.4.10.2.2	25,744.25	13,789.84
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	148,767.52	642,677.97
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-6,246,727.39	1,277,270.43
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-6,246,727.39	1,277,270.43
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-6,246,727.39	1,277,270.43

6.3 净资产(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: 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	42,602,182.00	-	11,369,176.62	53,971,358.62
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本 期初 净 资 产(基 金 净 值)	42,602,182.00	-	11,369,176.62	53,971,358.62
三、本 期 增 减 变 动 额(减 少以“- ” 号 填 列)	21,000,000.00	-	-4,084,456.55	16,915,543.45
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	-6,246,727.39	-6,246,727.39
(二)、 本 期 基 金 份 额 交 易 产 生 的 基 金 净 值 变 动 数 (净 值 减 少 以 “-” 号 填 列)	21,000,000.00	-	2,162,270.84	23,162,270.84
其中:1. 基 金 申 购 款	39,000,000.00	-	3,726,332.53	42,726,332.53
2 .基 金 赎 回 款	-18,000,000.00	-	-1,564,061.69	-19,564,061.69
(三)、 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)	-	-	-	-
(四)、 其 他 综 合 收 益 结 转 留	-	-	-	-

存收益				
四、本期期末净资产(基金净值)	63,602,182.00	-	7,284,720.07	70,886,902.07
项目	上年度可比期间			
	2021年3月15日(基金合同生效日)至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	222,602,182.00	-	-	222,602,182.00
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	222,602,182.00	-	-	222,602,182.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-204,000,000.00	-	2,234,427.38	-201,765,572.62
(一)、综合收益总额	-	-	1,277,270.43	1,277,270.43
(二)、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)	-204,000,000.00	-	957,156.95	-203,042,843.05
其中:1.	24,000,000.00	-	192,968.17	24,192,968.17

基金申购款				
2. 基金赎回款	-228,000,000.00	-	764,188.78	-227,235,811.22
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	18,602,182.00	-	2,234,427.38	20,836,609.38

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：

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

6.4 报表附注

6.4.1 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 8 月 30 日批准报出。

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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

除 6.4.5 的会计政策变更外,其他项目与上年度一致。

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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《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》及《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”),财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外,中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》,本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表,对本基金财务报表的影响列示如下:

(a) 金融工具

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式,将金融工具分类为以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金考虑自身业务模式,以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日,本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

新金融工具准则要求对于以摊余成本计量的金融资产,以预期信用损失为基础确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息,以发生违约的风险为权重,计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额,确认预期信用损失。金融资产减值计量方式的变更对于本基金的影响不重大。

根据新金融工具准则的相关规定,本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额,2021 年度的比较财务报表未重列。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日,本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收

利息和应收证券清算款，金额分别为 1,643,084.32 元、16,838.11 元、49,014.88 元、792.23 元和 209,892.21 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收清算款，金额分别为 1,643,842.95 元、16,846.47 元、49,039.19 元、0.00 元和 209,892.21 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 52,483,308.28 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 52,483,309.21 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 9,248.71 元、22,214.05 元、4,442.80 元、31,182.40 元和 193,864.75 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 9,248.71 元、22,214.05 元、4,442.80 元、31,182.40 元和 193,864.75 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融负债为交易性金融负债，金额为 618.70 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融负债为交易性金融负债，金额为 618.70 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，本基金无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(b) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、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。

(c) 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。

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2022 年 6 月 30 日	
活期存款	2,980,000.25	
等于：本金	2,979,280.71	
加：应计利息	719.54	
减：坏账准备	-	
定期存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
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	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
合计	2,980,000.25	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	2022 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	67,712,134.53	-	67,143,843.93	-568,290.60	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	34,200.00	1.82	34,201.82	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	34,200.00	1.82	34,201.82	-
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	67,746,334.53	1.82	67,178,045.75	-568,290.60	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

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

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：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。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有债权。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应收利息	—
其他应收款	—

待摊费用	75,616.24
合计	75,616.24

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30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	-
应付交易费用	41,100.23
其中：交易所市场	41,100.23
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	94,383.76
应退退补款	713,649.89
合计	849,133.88

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	42,602,182.00	42,602,182.00
本期申购	39,000,000.00	39,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-18,000,000.00	-18,000,000.00
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	63,602,182.00	63,602,182.00

注：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。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 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
本期期初	4,395,137.19	6,974,039.43	11,369,176.62
本期利润	-1,929,064.82	-4,317,662.57	-6,246,727.39
本期基金份额交易产生的变动数	1,790,403.01	371,867.83	2,162,270.84
其中：基金申购款	3,451,285.17	275,047.36	3,726,332.53
基金赎回款	-1,660,882.16	96,820.47	-1,564,061.69

本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,256,475.38	3,028,244.69	7,284,720.07

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
活期存款利息收入		10,981.56
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		468.14
其他		296.53
合计		11,746.23

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-1,859,657.54
股票投资收益——赎回差价收入		-287,874.09
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		-2,147,531.63

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
卖出股票成交总额		22,020,763.31
减：卖出股票成本总额		23,797,851.41
减：交易费用		82,569.44
买卖股票差价收入		-1,859,657.54

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
赎回基金份额对价总额		19,564,061.69
减：现金支付赎回款总额		13,008,301.69
减：赎回股票成本总额		6,843,634.09
减：交易费用		-
赎回差价收入		-287,874.09

6.4.7.14.4 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。

6.4.7.14.5 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。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	12.62
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	8,409.32
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	8,421.94

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	42,221.77
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	33,800.00
减：应计利息总额	11.73
减：交易费用	0.72
买卖债券差价收入	8,409.32

6.4.7.15.3 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。

6.4.7.15.4 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。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 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。

6.4.7.17.2 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。

6.4.7.17.3 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。

6.4.7.17.4 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。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 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。

6.4.7.18.2 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。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	397,278.44
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	397,278.44

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-4,317,662.57
股票投资	-4,316,062.57
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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-4,317,662.57

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	104,253.09
合计	104,253.09

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。

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
注册登记费	74,383.76
IOPV 计算发布费	9,916.99
合计	148,767.52

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。

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
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人
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
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年3月15日（基金合同生效日） 至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 （%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 （%）
招商证券	60,395,914.31	100.00	380,671,862.76	100.00

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期与上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
招商证券	55,558.39	100.00	41,100.23	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2021年3月15日（基金合同生效日）至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
招商证券	348,573.11	100.00	45,807.09	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。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 3 月 15 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	128,721.12	68,949.06
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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 3 月 15 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	25,744.25	13,789.84

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：

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本期与上年度可比期间无发生关联方销售服务费。

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

注：本基金本期与上年度可比期间未发生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 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

6.4.10.4.1 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：本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

6.4.10.4.2 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：本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内与上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

6.4.10.5.2 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 2022年6月30日		上年度末 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（%）	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	5,789,262.00	9.1023	5,502,662.00	12.9164

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入。

6.4.10.7 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 2022年1月1日至2022年6月30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
招商证券	001323	慕思股份	网下申购	496	19,309.28
上年度可比期间 2021年3月15日（基金合同生效日）至2021年6月30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
招商证券	001201	东瑞股份	网下申购	265	16,795.70
华泰联合证券	600905	三峡能源	网上申购	11,000	29,150.00

6.4.10.8 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

注：本报告期内本基金未实行利润分配。

6.4.12 期末(2022 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

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
110087	天业转债	2022 年 6 月 23 日	1 个月内(含)	配债未上市	100.00	100.00	150	15,000.00	15,000.53	-
118008	海优转债	2022 年 6 月 23 日	1 个月内(含)	配债未上市	100.00	100.00	20	2,000.00	2,000.11	-
123148	上能转债	2022 年 6 月 14 日	1 个月内(含)	配债未上市	100.00	100.00	32	3,200.00	3,200.36	-
123149	通裕转债	2022 年 6 月 20 日	1 个月内(含)	配债未上市	100.00	100.00	110	11,000.00	11,000.80	-
123150	九强转债	2022 年 6 月 30 日	1 个月内(含)	配债未上市	100.00	100.00	30	3,000.00	3,000.02	-

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。

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
000881	中广核技	2022 年 6 月 28 日	重大事项停牌	9.02	-	-	3,400	33,529.15	30,668.00	-

注：本基金截至 2022 年 6 月 30 日止持有以上因拟披露重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在该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

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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 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。

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。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商证券股份有限公司开立于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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	34,201.82	9,600.00
未评级	-	-
合计	34,201.82	9,600.00

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

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 2022 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部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，因此账面余额即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》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 6.4.12。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 2022 年 6 月 30 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 0.09%。

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。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30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	2,980,000.25	-	-	-	-	-	2,980,000.25
结算备付金	42,405.13	-	-	-	-	-	42,405.13
存出保证金	24,086.14	-	-	-	-	-	24,086.14
交易性金融资产	-	-	-	-	34,201.82	67,143,843.93	67,178,045.75
应收清算款	-	-	-	-	-	1,583,730.80	1,583,730.80
其他资产	-	-	-	-	-	75,616.24	75,616.24
资产总计	3,046,491.52	-	-	-	34,201.82	68,803,190.97	71,883,884.31
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	119,811.72	119,811.72
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	23,363.87	23,363.87
应付托管费	-	-	-	-	-	4,672.77	4,672.77
其他负债	-	-	-	-	-	849,133.88	849,133.88
负债总计	-	-	-	-	-	996,982.24	996,982.24
利率敏感度缺口	3,046,491.52	-	-	-	34,201.82	67,806,208.73	70,886,902.07
上年度末 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

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

注：于 2022 年 6 月 30 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 0.05%(2021 年 12 月 31 日：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(2021 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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	67,143,843.93	94.72	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	-119,811.72	-0.17	-618.70	-
合计	67,024,032.21	94.55	52,473,089.58	97.23

注：其他包含：可退替代款。

6.4.13.4.3.2 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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	中证 1000 指数上升 5%	3,280,235.91	2,519,494.17
	中证 1000 指数下降 5%	-3,280,235.91	-2,519,494.17

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	67,113,175.93	52,378,910.70
第二层次	64,869.82	104,397.58
第三层次	-	-
合计	67,178,045.75	52,483,308.28

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 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(2021 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	67,143,843.93	93.41
	其中：股票	67,143,843.93	93.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	34,201.82	0.05
	其中：债券	34,201.82	0.05
	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	3,022,405.38	4.20
8	其他各项资产	1,683,433.18	2.34
9	合计	71,883,884.31	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	457,849.00	0.65
B	采矿业	2,342,705.00	3.30
C	制造业	47,429,187.28	66.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,805,832.80	2.55
E	建筑业	1,339,379.00	1.89
F	批发和零售业	1,819,988.00	2.57
G	交通运输、仓储和邮政业	1,122,150.36	1.58
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,358,986.20	7.56
J	金融业	1,468,085.00	2.07
K	房地产业	1,304,613.00	1.84
L	租赁和商务服务业	351,759.00	0.50
M	科学研究和技术服务业	633,061.00	0.89
N	水利、环境和公共设施管理业	882,510.20	1.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	30,135.00	0.04
Q	卫生和社会工作	211,428.00	0.30
R	文化、体育和娱乐业	471,464.00	0.67
S	综合	70,000.00	0.10
	合计	67,099,132.84	94.66

7.2.2 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	44,711.09	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	44,711.09	0.06

7.2.3 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。

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002176	江特电机	18,900	473,256.00	0.67
2	002738	中矿资源	4,180	387,109.80	0.55
3	002405	四维图新	25,200	379,764.00	0.54
4	300568	星源材质	12,600	365,904.00	0.52
5	603236	移远通信	2,510	335,486.60	0.47
6	002850	科达利	2,100	333,900.00	0.47

7	002192	融捷股份	2,100	322,770.00	0.46
8	603606	东方电缆	4,000	306,400.00	0.43
9	600873	梅花生物	26,000	293,280.00	0.41
10	688116	天奈科技	1,700	288,116.00	0.41
11	000683	远兴能源	27,300	286,923.00	0.40
12	603688	石英股份	2,000	265,220.00	0.37
13	300438	鹏辉能源	4,200	258,090.00	0.36
14	002312	川发龙蟒	14,700	253,722.00	0.36
15	002432	九安医疗	4,200	252,252.00	0.36
16	605111	新洁能	1,980	249,103.80	0.35
17	300118	东方日升	8,400	246,372.00	0.35
18	601677	明泰铝业	9,960	237,048.00	0.33
19	000762	西藏矿业	4,200	234,906.00	0.33
20	600559	老白干酒	8,000	229,520.00	0.32
21	000933	神火股份	16,800	219,744.00	0.31
22	600596	新安股份	10,060	217,799.00	0.31
23	002463	沪电股份	14,700	216,972.00	0.31
24	000818	航锦科技	6,300	213,570.00	0.30
25	000422	湖北宜化	10,500	213,255.00	0.30
26	600771	广誉远	6,000	210,900.00	0.30
27	601099	太平洋	70,300	210,197.00	0.30
28	300725	药石科技	2,100	207,879.00	0.29
29	600872	中炬高新	6,000	207,660.00	0.29
30	300775	三角防务	4,200	202,230.00	0.29
31	002472	双环传动	6,300	200,592.00	0.28
32	002402	和而泰	10,500	200,130.00	0.28
33	002610	爱康科技	48,300	199,962.00	0.28
34	600882	妙可蓝多	4,200	196,560.00	0.28
35	002245	蔚蓝锂芯	8,400	194,964.00	0.28
36	300861	美畅股份	2,100	194,649.00	0.27
37	000591	太阳能	23,100	192,885.00	0.27
38	300604	长川科技	4,240	191,436.00	0.27
39	300343	联创股份	12,600	191,394.00	0.27
40	300458	全志科技	6,300	189,567.00	0.27
41	002436	兴森科技	16,800	189,336.00	0.27
42	688063	派能科技	600	187,320.00	0.26
43	300850	新强联	2,100	186,963.00	0.26
44	300395	菲利华	4,150	186,750.00	0.26
45	000155	川能动力	8,400	186,060.00	0.26
46	300432	富临精工	8,400	184,800.00	0.26
47	002597	金禾实业	4,200	181,986.00	0.26
48	300035	中科电气	6,300	176,085.00	0.25

49	300613	富瀚微	2,070	175,536.00	0.25
50	002487	大金重工	4,200	175,266.00	0.25
51	300593	新雷能	4,200	174,342.00	0.25
52	002531	天顺风能	10,500	173,145.00	0.24
53	600338	西藏珠峰	6,000	172,200.00	0.24
54	300672	国科微	2,100	171,696.00	0.24
55	600711	盛屯矿业	22,000	170,720.00	0.24
56	603005	晶方科技	6,000	170,340.00	0.24
57	002456	欧菲光	25,200	169,092.00	0.24
58	000860	顺鑫农业	6,300	168,966.00	0.24
59	300502	新易盛	6,300	165,060.00	0.23
60	002044	美年健康	29,400	163,758.00	0.23
61	601666	平煤股份	12,000	163,080.00	0.23
62	600110	诺德股份	14,000	162,680.00	0.23
63	002036	联创电子	10,500	161,280.00	0.23
64	603596	伯特利	2,000	160,360.00	0.23
65	000423	东阿阿胶	4,200	155,190.00	0.22
66	300748	金力永磁	4,200	154,560.00	0.22
67	002747	埃斯顿	6,300	154,350.00	0.22
68	603063	禾望电气	4,000	153,800.00	0.22
69	002585	双星新材	8,400	151,956.00	0.21
70	600416	湘电股份	8,000	151,680.00	0.21
71	300671	富满微	2,100	151,326.00	0.21
72	300346	南大光电	4,200	151,116.00	0.21
73	300294	博雅生物	4,200	150,990.00	0.21
74	300339	润和软件	8,400	150,780.00	0.21
75	600777	新潮能源	56,300	150,321.00	0.21
76	300373	扬杰科技	2,100	149,625.00	0.21
77	688598	金博股份	500	147,350.00	0.21
78	002484	江海股份	6,300	147,042.00	0.21
79	002025	航天电器	2,100	146,622.00	0.21
80	000875	吉电股份	21,000	145,950.00	0.21
81	300083	创世纪	12,600	144,900.00	0.20
82	000893	亚钾国际	4,200	144,522.00	0.20
83	688388	嘉元科技	1,700	144,279.00	0.20
84	300393	中来股份	8,400	142,800.00	0.20
85	002617	露笑科技	12,600	142,758.00	0.20
86	601001	晋控煤业	8,000	142,000.00	0.20
87	688066	航天宏图	1,800	141,840.00	0.20
88	002541	鸿路钢构	4,200	140,280.00	0.20
89	002706	良信股份	8,400	138,852.00	0.20
90	688139	海尔生物	1,900	138,377.00	0.20

91	600179	安通控股	36,200	138,284.00	0.20
92	603666	亿嘉和	2,000	137,200.00	0.19
93	600481	双良节能	8,000	134,800.00	0.19
94	002145	中核钛白	18,890	134,685.70	0.19
95	002558	巨人网络	14,700	134,505.00	0.19
96	300054	鼎龙股份	6,300	133,371.00	0.19
97	002151	北斗星通	4,200	132,552.00	0.19
98	002643	万润股份	6,300	131,418.00	0.19
99	002761	浙江建投	4,200	129,654.00	0.18
100	300068	南都电源	8,400	128,856.00	0.18
101	002139	拓邦股份	10,500	128,835.00	0.18
102	300726	宏达电子	2,100	128,457.00	0.18
103	300487	蓝晓科技	2,100	128,100.00	0.18
104	300666	江丰电子	2,100	128,100.00	0.18
105	300803	指南针	2,100	123,438.00	0.17
106	300767	震安科技	2,100	122,178.00	0.17
107	600389	江山股份	2,000	121,460.00	0.17
108	300776	帝尔激光	700	120,960.00	0.17
109	600206	有研新材	6,200	119,908.00	0.17
110	300233	金城医药	4,200	119,826.00	0.17
111	300457	赢合科技	4,200	119,322.00	0.17
112	600456	宝钛股份	2,000	118,800.00	0.17
113	300298	三诺生物	4,200	118,020.00	0.17
114	603826	坤彩科技	2,000	117,720.00	0.17
115	601375	中原证券	28,100	117,177.00	0.17
116	300077	国民技术	6,300	117,054.00	0.17
117	600641	万业企业	6,000	117,000.00	0.17
118	601222	林洋能源	14,000	116,900.00	0.16
119	601258	庞大集团	84,100	116,899.00	0.16
120	605376	博迁新材	2,000	116,600.00	0.16
121	002389	航天彩虹	6,300	115,668.00	0.16
122	300476	胜宏科技	6,300	115,668.00	0.16
123	601908	京运通	14,400	115,488.00	0.16
124	300653	正海生物	2,050	114,800.00	0.16
125	002091	江苏国泰	10,500	112,875.00	0.16
126	600483	福能股份	8,000	112,560.00	0.16
127	600100	同方股份	25,200	112,140.00	0.16
128	688050	爱博医疗	500	112,100.00	0.16
129	603588	高能环境	9,640	111,149.20	0.16
130	600151	航天机电	10,000	111,100.00	0.16
131	600277	亿利洁能	22,100	110,500.00	0.16
132	002851	麦格米特	4,200	110,292.00	0.16

133	300638	广和通	4,150	109,933.50	0.16
134	603599	广信股份	3,900	109,785.00	0.15
135	300409	道氏技术	4,200	109,116.00	0.15
136	300662	科锐国际	2,100	108,969.00	0.15
137	600273	嘉化能源	10,000	108,600.00	0.15
138	600378	昊华科技	2,800	107,856.00	0.15
139	300827	上能电气	2,100	107,415.00	0.15
140	603348	文灿股份	2,000	107,200.00	0.15
141	300772	运达股份	4,200	106,848.00	0.15
142	000902	新洋丰	6,300	106,407.00	0.15
143	600063	皖维高新	14,000	106,120.00	0.15
144	002832	比音勒芬	4,200	105,840.00	0.15
145	300682	朗新科技	4,200	105,798.00	0.15
146	002182	云海金属	4,200	105,336.00	0.15
147	002807	江阴银行	23,100	104,643.00	0.15
148	300327	中颖电子	2,100	104,601.00	0.15
149	300623	捷捷微电	4,200	104,160.00	0.15
150	000982	中银绒业	46,200	103,026.00	0.15
151	000810	创维数字	6,300	102,123.00	0.14
152	601399	国机重装	31,500	102,060.00	0.14
153	603338	浙江鼎力	2,000	101,400.00	0.14
154	000090	天健集团	14,700	101,283.00	0.14
155	300777	中简科技	2,100	101,220.00	0.14
156	000546	金圆股份	6,300	101,178.00	0.14
157	300203	聚光科技	4,200	100,968.00	0.14
158	600366	宁波韵升	8,000	100,800.00	0.14
159	002318	久立特材	6,300	100,737.00	0.14
160	002539	云图控股	6,300	100,737.00	0.14
161	002626	金达威	4,200	100,128.00	0.14
162	000829	天音控股	8,400	100,044.00	0.14
163	002839	张家港行	18,900	99,981.00	0.14
164	601777	力帆科技	18,000	99,900.00	0.14
165	000035	中国天楹	18,900	99,225.00	0.14
166	002258	利尔化学	4,200	99,204.00	0.14
167	600123	兰花科创	6,000	98,700.00	0.14
168	002171	楚江新材	10,500	97,965.00	0.14
169	600850	电科数字	5,220	97,405.20	0.14
170	600055	万东医疗	4,000	97,320.00	0.14
171	300185	通裕重工	33,600	96,432.00	0.14
172	002727	一心堂	4,200	96,306.00	0.14
173	002126	银轮股份	8,400	96,180.00	0.14
174	300398	飞凯材料	4,200	96,012.00	0.14

175	600583	海油工程	23,100	95,865.00	0.14
176	601678	滨化股份	16,000	95,840.00	0.14
177	300443	金雷股份	2,100	95,718.00	0.14
178	603713	密尔克卫	700	95,690.00	0.13
179	603565	中谷物流	6,028	95,664.36	0.13
180	601567	三星医疗	7,200	95,616.00	0.13
181	002544	普天科技	4,200	95,550.00	0.13
182	600330	天通股份	8,000	95,280.00	0.13
183	002906	华阳集团	2,100	95,151.00	0.13
184	000049	德赛电池	2,100	94,710.00	0.13
185	688301	奕瑞科技	200	94,608.00	0.13
186	000657	中钨高新	6,300	94,500.00	0.13
187	600328	中盐化工	4,000	94,200.00	0.13
188	002079	苏州固锔	6,300	93,996.00	0.13
189	603678	火炬电子	2,000	93,620.00	0.13
190	600993	马应龙	4,000	93,200.00	0.13
191	688520	神州细胞	1,800	93,114.00	0.13
192	300596	利安隆	2,100	92,631.00	0.13
193	300459	汤姆猫	25,100	92,368.00	0.13
194	300696	爱乐达	2,100	92,295.00	0.13
195	000403	派林生物	4,200	92,232.00	0.13
196	300755	华致酒行	2,100	92,085.00	0.13
197	600977	中国电影	8,000	92,000.00	0.13
198	002324	普利特	6,300	91,224.00	0.13
199	600246	万通发展	10,000	91,000.00	0.13
200	603129	春风动力	800	90,976.00	0.13
201	300451	创业慧康	12,600	90,720.00	0.13
202	300567	精测电子	2,100	90,720.00	0.13
203	600908	无锡银行	16,100	90,643.00	0.13
204	603876	鼎胜新材	2,000	90,400.00	0.13
205	002085	万丰奥威	16,800	90,216.00	0.13
206	002163	海南发展	6,300	89,901.00	0.13
207	600363	联创光电	4,000	89,840.00	0.13
208	300639	凯普生物	4,200	89,796.00	0.13
209	002726	龙大美食	8,400	89,544.00	0.13
210	002567	唐人神	10,500	89,355.00	0.13
211	000426	兴业矿业	12,600	89,334.00	0.13
212	600562	国睿科技	6,000	89,100.00	0.13
213	601311	骆驼股份	8,000	89,040.00	0.13
214	600577	精达股份	16,000	88,800.00	0.13
215	002041	登海种业	4,200	88,578.00	0.12
216	300034	钢研高纳	2,100	88,578.00	0.12

217	300679	电连技术	2,000	88,380.00	0.12
218	600057	厦门象屿	10,000	87,900.00	0.12
219	600129	太极集团	4,000	87,880.00	0.12
220	300855	图南股份	2,100	87,759.00	0.12
221	002099	海翔药业	12,600	87,318.00	0.12
222	600172	黄河旋风	10,000	87,200.00	0.12
223	000915	华特达因	2,100	86,835.00	0.12
224	300598	诚迈科技	2,100	86,709.00	0.12
225	300101	振芯科技	4,200	86,688.00	0.12
226	600502	安徽建工	12,000	86,400.00	0.12
227	600986	浙文互联	14,000	86,240.00	0.12
228	601231	环旭电子	6,000	86,160.00	0.12
229	300587	天铁股份	4,200	85,806.00	0.12
230	002262	恩华药业	6,300	85,680.00	0.12
231	603027	千禾味业	4,920	85,116.00	0.12
232	002675	东诚药业	6,300	85,050.00	0.12
233	688033	天宜上佳	4,000	84,960.00	0.12
234	603301	振德医疗	2,000	84,100.00	0.12
235	600323	瀚蓝环境	4,100	84,050.00	0.12
236	601952	苏垦农发	6,000	83,940.00	0.12
237	600612	老凤祥	2,000	83,560.00	0.12
238	300761	立华股份	2,100	83,475.00	0.12
239	601212	白银有色	30,100	83,076.00	0.12
240	300737	科顺股份	6,300	83,034.00	0.12
241	600211	西藏药业	2,000	83,020.00	0.12
242	002291	星期六	4,200	82,992.00	0.12
243	600252	中恒集团	28,100	82,895.00	0.12
244	688608	恒玄科技	600	82,560.00	0.12
245	300065	海兰信	6,300	82,530.00	0.12
246	002332	仙琚制药	8,400	82,488.00	0.12
247	002216	三全食品	4,200	82,278.00	0.12
248	300036	超图软件	4,200	82,068.00	0.12
249	000951	中国重汽	6,300	81,837.00	0.12
250	603505	金石资源	2,000	81,820.00	0.12
251	300747	锐科激光	2,100	81,690.00	0.12
252	002100	天康生物	8,400	81,648.00	0.12
253	601918	新集能源	16,000	81,600.00	0.12
254	002413	雷科防务	14,700	81,585.00	0.12
255	002038	双鹭药业	8,400	81,564.00	0.12
256	000582	北部湾港	10,500	81,480.00	0.11
257	002428	云南锗业	6,300	81,396.00	0.11
258	603979	金诚信	4,200	81,102.00	0.11

259	300655	晶瑞电材	4,200	81,060.00	0.11
260	603690	至纯科技	2,000	80,600.00	0.11
261	000650	仁和药业	12,600	80,388.00	0.11
262	600116	三峡水利	8,000	80,320.00	0.11
263	603128	华贸物流	8,000	80,240.00	0.11
264	300773	拉卡拉	4,200	80,052.00	0.11
265	300770	新媒股份	2,100	79,443.00	0.11
266	300151	昌红科技	4,200	79,380.00	0.11
267	300894	火星人	2,100	78,519.00	0.11
268	000917	电广传媒	14,700	78,057.00	0.11
269	600645	中源协和	4,000	77,880.00	0.11
270	603896	寿仙谷	2,000	77,560.00	0.11
271	601208	东材科技	6,000	77,520.00	0.11
272	600305	恒顺醋业	6,000	77,400.00	0.11
273	600821	金开新能	12,000	77,280.00	0.11
274	300821	东岳硅材	4,200	77,196.00	0.11
275	600267	海正药业	6,000	76,860.00	0.11
276	600773	西藏城投	3,900	76,830.00	0.11
277	601369	陕鼓动力	8,000	76,800.00	0.11
278	300456	赛微电子	4,200	76,776.00	0.11
279	300079	数码视讯	14,700	76,734.00	0.11
280	600210	紫江企业	12,000	76,680.00	0.11
281	300573	兴齐眼药	500	76,660.00	0.11
282	603520	司太立	2,720	76,486.40	0.11
283	002810	山东赫达	2,100	76,419.00	0.11
284	000016	深康佳 A	12,600	76,230.00	0.11
285	603229	奥翔药业	2,000	76,120.00	0.11
286	600185	格力地产	12,000	75,720.00	0.11
287	300170	汉得信息	8,400	75,684.00	0.11
288	600586	金晶科技	10,000	75,500.00	0.11
289	000503	国新健康	8,400	75,432.00	0.11
290	000969	安泰科技	8,400	74,928.00	0.11
291	002698	博实股份	6,300	74,529.00	0.11
292	002015	协鑫能科	4,200	74,508.00	0.11
293	300075	数字政通	4,200	74,424.00	0.10
294	600720	祁连山	6,000	74,400.00	0.10
295	002928	华夏航空	6,300	74,151.00	0.10
296	600422	昆药集团	6,100	74,115.00	0.10
297	300470	中密控股	2,100	74,109.00	0.10
298	600621	华鑫股份	5,100	74,052.00	0.10
299	603363	傲农生物	4,000	74,040.00	0.10
300	300379	东方通	4,200	73,962.00	0.10

301	600496	精工钢构	16,000	73,920.00	0.10
302	603906	龙蟠科技	2,000	73,880.00	0.10
303	002063	远光软件	10,500	73,815.00	0.10
304	002556	辉隆股份	6,300	73,710.00	0.10
305	603612	索通发展	2,000	73,700.00	0.10
306	600888	新疆众和	8,000	73,600.00	0.10
307	603008	喜临门	2,000	73,400.00	0.10
308	002123	梦网科技	6,300	73,332.00	0.10
309	300133	华策影视	14,700	73,206.00	0.10
310	603187	海容冷链	2,000	73,100.00	0.10
311	002061	浙江交科	10,500	73,080.00	0.10
312	300401	花园生物	4,200	72,828.00	0.10
313	300709	精研科技	2,460	72,791.40	0.10
314	002446	盛路通信	10,500	72,765.00	0.10
315	600869	远东股份	14,100	72,615.00	0.10
316	600761	安徽合力	6,100	72,590.00	0.10
317	002400	省广集团	14,700	72,471.00	0.10
318	600459	贵研铂业	4,000	72,440.00	0.10
319	002581	未名医药	4,200	72,408.00	0.10
320	002217	合力泰	23,100	72,303.00	0.10
321	300627	华测导航	2,100	72,219.00	0.10
322	600295	鄂尔多斯	4,000	72,200.00	0.10
323	002639	雪人股份	6,300	72,198.00	0.10
324	603098	森特股份	2,000	71,720.00	0.10
325	002545	东方铁塔	6,300	71,694.00	0.10
326	002239	奥特佳	23,500	71,675.00	0.10
327	000627	天茂集团	21,000	71,610.00	0.10
328	000735	罗牛山	10,500	71,610.00	0.10
329	300229	拓尔思	6,300	71,505.00	0.10
330	603323	苏农银行	14,000	71,400.00	0.10
331	300171	东富龙	2,100	71,211.00	0.10
332	601028	玉龙股份	4,000	71,040.00	0.10
333	000758	中色股份	14,700	71,001.00	0.10
334	002895	川恒股份	2,100	71,001.00	0.10
335	601137	博威合金	4,000	70,800.00	0.10
336	300303	聚飞光电	14,700	70,560.00	0.10
337	000767	晋控电力	18,900	70,497.00	0.10
338	300224	正海磁材	4,600	70,380.00	0.10
339	002254	泰和新材	4,200	70,350.00	0.10
340	600916	中国黄金	6,000	70,200.00	0.10
341	600770	综艺股份	8,000	70,000.00	0.10
342	600688	上海石化	22,000	69,960.00	0.10

343	600740	山西焦化	12,000	69,840.00	0.10
344	300236	上海新阳	2,100	69,510.00	0.10
345	300428	立中集团	2,100	69,405.00	0.10
346	300326	凯利泰	8,400	69,384.00	0.10
347	300841	康华生物	600	69,264.00	0.10
348	600685	中船防务	4,200	69,258.00	0.10
349	300087	荃银高科	4,200	69,132.00	0.10
350	002222	福晶科技	4,200	68,880.00	0.10
351	002635	安洁科技	4,200	68,754.00	0.10
352	002537	海联金汇	8,400	68,712.00	0.10
353	600491	龙元建设	10,000	68,200.00	0.10
354	688266	泽璟制药	1,898	68,119.22	0.10
355	600610	中毅达	4,000	68,000.00	0.10
356	600552	凯盛科技	6,000	67,980.00	0.10
357	603919	金徽酒	2,000	67,980.00	0.10
358	688202	美迪西	200	67,922.00	0.10
359	300792	壹网壹创	2,100	67,914.00	0.10
360	601519	大智慧	10,500	67,830.00	0.10
361	603306	华懋科技	2,000	67,800.00	0.10
362	300031	宝通科技	4,200	67,620.00	0.10
363	600163	中闽能源	8,000	67,600.00	0.10
364	600320	振华重工	20,100	67,536.00	0.10
365	603995	甬金股份	2,000	67,320.00	0.09
366	002261	拓维信息	10,500	67,305.00	0.09
367	300027	华谊兄弟	21,000	67,200.00	0.09
368	300685	艾德生物	2,100	67,200.00	0.09
369	600877	声光电科	6,000	67,080.00	0.09
370	603583	捷昌驱动	2,000	66,780.00	0.09
371	000727	冠捷科技	29,400	66,738.00	0.09
372	601963	重庆银行	8,400	66,696.00	0.09
373	600477	杭萧钢构	14,000	66,640.00	0.09
374	000672	上峰水泥	4,200	66,276.00	0.09
375	300369	绿盟科技	6,300	66,276.00	0.09
376	300355	蒙草生态	16,800	66,192.00	0.09
377	600059	古越龙山	6,000	66,000.00	0.09
378	600635	大众公用	20,000	66,000.00	0.09
379	000688	国城矿业	4,200	65,898.00	0.09
380	300674	宇信科技	4,200	65,856.00	0.09
381	600158	中体产业	8,000	65,840.00	0.09
382	002276	万马股份	8,400	65,688.00	0.09
383	600933	爱柯迪	4,000	65,520.00	0.09
384	002984	森麒麟	2,100	65,331.00	0.09

385	002108	沧州明珠	10,500	65,310.00	0.09
386	000612	焦作万方	10,500	65,205.00	0.09
387	600248	陕西建工	12,000	65,160.00	0.09
388	603308	应流股份	4,000	65,120.00	0.09
389	300663	科蓝软件	4,200	65,016.00	0.09
390	601126	四方股份	4,000	64,840.00	0.09
391	601965	中国汽研	4,000	64,840.00	0.09
392	002335	科华数据	2,100	64,785.00	0.09
393	300477	合纵科技	8,400	64,680.00	0.09
394	002130	沃尔核材	10,500	64,470.00	0.09
395	002023	海特高新	6,300	64,449.00	0.09
396	002649	博彦科技	6,300	64,323.00	0.09
397	002518	科士达	2,100	64,260.00	0.09
398	300102	乾照光电	8,400	64,092.00	0.09
399	000034	神州数码	4,200	63,924.00	0.09
400	600075	新疆天业	10,000	63,900.00	0.09
401	600360	华微电子	8,000	63,520.00	0.09
402	000712	锦龙股份	4,200	63,378.00	0.09
403	300323	华灿光电	8,400	63,252.00	0.09
404	300633	开立医疗	2,100	63,063.00	0.09
405	600223	鲁商发展	6,000	62,880.00	0.09
406	002773	康弘药业	4,200	62,748.00	0.09
407	600578	京能电力	20,000	62,600.00	0.09
408	002498	汉缆股份	14,700	62,475.00	0.09
409	000059	华锦股份	10,500	62,160.00	0.09
410	603279	景津装备	2,000	62,020.00	0.09
411	600490	鹏欣资源	16,100	61,985.00	0.09
412	600966	博汇纸业	8,000	61,920.00	0.09
413	002237	恒邦股份	6,300	61,740.00	0.09
414	603298	杭叉集团	4,000	61,720.00	0.09
415	688696	极米科技	200	61,574.00	0.09
416	600963	岳阳林纸	10,200	61,506.00	0.09
417	002274	华昌化工	6,300	61,362.00	0.09
418	605338	巴比食品	2,000	61,020.00	0.09
419	000848	承德露露	6,300	60,984.00	0.09
420	000498	山东路桥	6,300	60,858.00	0.09
421	002467	二六三	14,700	60,858.00	0.09
422	300348	长亮科技	6,300	60,858.00	0.09
423	300702	天宇股份	2,140	60,797.40	0.09
424	300287	飞利信	14,700	60,711.00	0.09
425	603305	旭升股份	2,000	60,440.00	0.09
426	002135	东南网架	6,300	60,291.00	0.09

427	600197	伊力特	2,000	60,200.00	0.08
428	002550	千红制药	10,500	60,165.00	0.08
429	600682	南京新百	6,000	60,120.00	0.08
430	000851	高鸿股份	12,600	60,102.00	0.08
431	000681	视觉中国	4,200	60,018.00	0.08
432	300616	尚品宅配	2,100	59,745.00	0.08
433	000921	海信家电	4,200	59,556.00	0.08
434	600420	国药现代	6,000	59,400.00	0.08
435	002612	朗姿股份	2,100	59,388.00	0.08
436	600643	爱建集团	10,000	59,300.00	0.08
437	600797	浙大网新	10,000	59,200.00	0.08
438	300208	青岛中程	4,200	59,094.00	0.08
439	300055	万邦达	6,300	58,968.00	0.08
440	300377	赢时胜	6,300	58,968.00	0.08
441	300180	华峰超纤	14,700	58,947.00	0.08
442	002226	江南化工	10,500	58,905.00	0.08
443	600557	康缘药业	4,000	58,760.00	0.08
444	300523	辰安科技	2,100	58,569.00	0.08
445	300284	苏交科	8,400	58,548.00	0.08
446	603489	八方股份	300	58,347.00	0.08
447	300352	北信源	12,600	58,212.00	0.08
448	688158	优刻得	4,000	58,120.00	0.08
449	300319	麦捷科技	6,300	58,086.00	0.08
450	603179	新泉股份	2,000	58,000.00	0.08
451	600452	涪陵电力	4,980	57,817.80	0.08
452	002859	洁美科技	2,100	57,792.00	0.08
453	300184	力源信息	10,500	57,750.00	0.08
454	301035	润丰股份	700	57,715.00	0.08
455	600955	维远股份	2,000	57,680.00	0.08
456	002746	仙坛股份	6,300	57,645.00	0.08
457	002960	青鸟消防	2,100	57,519.00	0.08
458	002283	天润工业	8,400	57,372.00	0.08
459	000989	九芝堂	6,300	57,330.00	0.08
460	002020	京新药业	6,300	57,330.00	0.08
461	603018	华设集团	6,000	57,300.00	0.08
462	600750	江中药业	4,000	57,280.00	0.08
463	000901	航天科技	6,300	57,267.00	0.08
464	000923	河钢资源	4,200	57,246.00	0.08
465	002190	成飞集成	2,100	57,120.00	0.08
466	600266	城建发展	14,000	57,120.00	0.08
467	002759	天际股份	2,100	57,078.00	0.08
468	600696	岩石股份	2,000	56,920.00	0.08

469	300394	天孚通信	2,100	56,847.00	0.08
470	300158	振东制药	8,400	56,700.00	0.08
471	300188	美亚柏科	4,200	56,616.00	0.08
472	603033	三维股份	2,510	56,575.40	0.08
473	002488	金固股份	8,400	56,532.00	0.08
474	300723	一品红	2,100	56,490.00	0.08
475	300263	隆华科技	6,300	56,448.00	0.08
476	300497	富祥药业	4,200	56,448.00	0.08
477	600812	华北制药	8,400	56,448.00	0.08
478	603989	艾华集团	2,000	56,400.00	0.08
479	600108	亚盛集团	16,100	56,350.00	0.08
480	002421	达实智能	16,800	56,280.00	0.08
481	603387	基蛋生物	3,936	56,127.36	0.08
482	300900	广联航空	2,100	56,070.00	0.08
483	000682	东方电子	8,400	55,944.00	0.08
484	600675	中华企业	18,200	55,692.00	0.08
485	600742	一汽富维	6,000	55,680.00	0.08
486	002310	东方园林	23,100	55,671.00	0.08
487	002293	罗莱生活	4,200	55,314.00	0.08
488	000592	平潭发展	21,000	55,230.00	0.08
489	600657	信达地产	8,000	55,120.00	0.08
490	300131	英唐智控	10,500	55,020.00	0.08
491	300232	洲明科技	8,400	54,768.00	0.08
492	000088	盐田港	10,500	54,705.00	0.08
493	002611	东方精工	10,500	54,600.00	0.08
494	002201	正威新材	2,100	54,495.00	0.08
495	603936	博敏电子	4,000	54,480.00	0.08
496	000036	华联控股	12,600	54,432.00	0.08
497	000927	中国铁物	18,900	54,432.00	0.08
498	600639	浦东金桥	4,000	54,360.00	0.08
499	600810	神马股份	6,000	54,000.00	0.08
500	603801	志邦家居	2,000	53,960.00	0.08
501	002768	国恩股份	2,100	53,928.00	0.08
502	000976	华铁股份	12,600	53,802.00	0.08
503	603881	数据港	2,000	53,700.00	0.08
504	002481	双塔食品	6,300	53,487.00	0.08
505	002214	大立科技	4,200	53,424.00	0.08
506	600125	铁龙物流	10,000	53,400.00	0.08
507	688516	奥特维	200	53,390.00	0.08
508	002891	中宠股份	2,100	53,382.00	0.08
509	300039	上海凯宝	8,400	53,256.00	0.08
510	000065	北方国际	6,300	53,235.00	0.08

511	603212	赛伍技术	2,000	53,220.00	0.08
512	603733	仙鹤股份	2,000	53,200.00	0.08
513	002206	海利得	8,400	53,088.00	0.07
514	688278	特宝生物	1,800	53,064.00	0.07
515	600783	鲁信创投	4,000	53,040.00	0.07
516	601702	华峰铝业	4,000	52,800.00	0.07
517	600395	盘江股份	6,000	52,620.00	0.07
518	300783	三只松鼠	2,100	52,605.00	0.07
519	300579	数字认证	2,100	52,500.00	0.07
520	600575	淮河能源	16,800	52,416.00	0.07
521	002440	闰土股份	6,500	52,390.00	0.07
522	600789	鲁抗医药	8,000	52,320.00	0.07
523	002055	得润电子	4,200	52,248.00	0.07
524	300219	鸿利智汇	6,000	52,200.00	0.07
525	002314	南山控股	12,600	52,164.00	0.07
526	300123	亚光科技	8,400	52,080.00	0.07
527	002837	英维克	2,100	51,954.00	0.07
528	000555	神州信息	4,600	51,888.00	0.07
529	002912	中新赛克	2,100	51,786.00	0.07
530	002838	道恩股份	2,100	51,576.00	0.07
531	002106	莱宝高科	6,300	51,534.00	0.07
532	600649	城投控股	12,000	51,360.00	0.07
533	603529	爱玛科技	980	51,332.40	0.07
534	603429	集友股份	3,980	51,182.80	0.07
535	603916	苏博特	2,000	50,980.00	0.07
536	300177	中海达	6,300	50,967.00	0.07
537	000935	四川双马	2,100	50,862.00	0.07
538	300222	科大智能	6,300	50,778.00	0.07
539	600984	建设机械	7,830	50,738.40	0.07
540	000966	长源电力	8,400	50,736.00	0.07
541	300205	天喻信息	4,200	50,694.00	0.07
542	603043	广州酒家	2,000	50,440.00	0.07
543	600864	哈投股份	10,000	50,300.00	0.07
544	000543	皖能电力	12,600	50,274.00	0.07
545	601011	宝泰隆	12,000	50,160.00	0.07
546	600285	羚锐制药	4,000	50,120.00	0.07
547	603299	苏盐井神	4,000	50,120.00	0.07
548	600512	腾达建设	16,100	50,071.00	0.07
549	600876	洛阳玻璃	2,000	50,040.00	0.07
550	002307	北新路桥	8,400	49,980.00	0.07
551	300266	兴源环境	12,600	49,518.00	0.07
552	002218	拓日新能	8,400	49,476.00	0.07

553	000006	深振业 A	10,500	49,455.00	0.07
554	000025	特力 A	2,100	49,455.00	0.07
555	600169	太原重工	20,000	49,200.00	0.07
556	601619	嘉泽新能	12,000	49,200.00	0.07
557	601929	吉视传媒	24,000	49,200.00	0.07
558	300657	弘信电子	4,220	49,036.40	0.07
559	002589	瑞康医药	12,600	49,014.00	0.07
560	002158	汉钟精机	2,100	48,825.00	0.07
561	002573	清新环境	8,400	48,804.00	0.07
562	600751	海航科技	18,000	48,780.00	0.07
563	002043	兔宝宝	4,200	48,720.00	0.07
564	600017	日照港	16,000	48,640.00	0.07
565	603636	南威软件	4,000	48,600.00	0.07
566	600072	中船科技	4,000	48,560.00	0.07
567	002449	国星光电	6,000	48,540.00	0.07
568	000795	英洛华	6,300	48,510.00	0.07
569	600691	阳煤化工	12,000	48,480.00	0.07
570	603959	百利科技	4,000	48,480.00	0.07
571	603766	隆鑫通用	10,500	48,405.00	0.07
572	000560	我爱我家	16,800	48,384.00	0.07
573	000615	奥园美谷	6,300	47,943.00	0.07
574	600073	上海梅林	6,000	47,820.00	0.07
575	300143	盈康生命	4,200	47,670.00	0.07
576	300738	奥飞数据	4,160	47,632.00	0.07
577	600428	中远海特	10,000	47,600.00	0.07
578	300226	上海钢联	2,100	47,565.00	0.07
579	600971	恒源煤电	6,000	47,400.00	0.07
580	600326	西藏天路	8,100	47,385.00	0.07
581	000603	盛达资源	4,200	47,376.00	0.07
582	300149	睿智医药	4,200	47,376.00	0.07
583	300271	华宇软件	6,300	47,376.00	0.07
584	600523	贵航股份	2,000	47,000.00	0.07
585	002425	凯撒文化	8,400	46,956.00	0.07
586	600331	宏达股份	14,000	46,900.00	0.07
587	300020	银江技术	6,300	46,809.00	0.07
588	601015	陕西黑猫	8,000	46,800.00	0.07
589	600604	市北高新	8,000	46,720.00	0.07
590	000676	智度股份	8,400	46,704.00	0.07
591	301071	力量钻石	300	46,539.00	0.07
592	601606	长城军工	4,000	46,440.00	0.07
593	002833	弘亚数控	2,780	46,370.40	0.07
594	600746	江苏索普	4,000	46,320.00	0.07

595	601890	亚星锚链	6,000	46,320.00	0.07
596	300085	银之杰	4,200	46,158.00	0.07
597	000030	富奥股份	8,400	46,032.00	0.06
598	603718	海利生物	4,000	45,920.00	0.06
599	601686	友发集团	6,000	45,840.00	0.06
600	002645	华宏科技	2,100	45,822.00	0.06
601	600997	开滦股份	6,000	45,720.00	0.06
602	300191	潜能恒信	2,100	45,696.00	0.06
603	600308	华泰股份	8,000	45,680.00	0.06
604	000789	万年青	4,200	45,528.00	0.06
605	603396	金辰股份	500	45,515.00	0.06
606	002489	浙江永强	12,500	45,500.00	0.06
607	300423	昇辉科技	4,200	45,444.00	0.06
608	603566	普莱柯	1,700	45,441.00	0.06
609	688586	江航装备	1,700	45,237.00	0.06
610	300311	任子行	6,300	45,234.00	0.06
611	600103	青山纸业	18,000	45,180.00	0.06
612	603337	杰克股份	2,100	45,108.00	0.06
613	601609	金田股份	6,000	45,060.00	0.06
614	300525	博思软件	2,100	45,045.00	0.06
615	600776	东方通信	4,000	45,000.00	0.06
616	600581	八一钢铁	8,000	44,960.00	0.06
617	603105	芯能科技	4,000	44,720.00	0.06
618	300659	中孚信息	2,100	44,667.00	0.06
619	000903	云内动力	14,700	44,541.00	0.06
620	600284	浦东建设	6,000	44,460.00	0.06
621	002194	武汉凡谷	4,200	44,436.00	0.06
622	002717	岭南股份	14,700	44,247.00	0.06
623	603113	金能科技	4,000	44,240.00	0.06
624	688526	科前生物	1,700	44,183.00	0.06
625	000539	粤电力 A	10,500	44,100.00	0.06
626	600550	保变电气	8,100	43,983.00	0.06
627	300867	圣元环保	2,100	43,932.00	0.06
628	000968	蓝焰控股	4,200	43,890.00	0.06
629	300735	光弘科技	4,200	43,890.00	0.06
630	688617	惠泰医疗	200	43,816.00	0.06
631	000811	冰轮环境	4,200	43,806.00	0.06
632	000070	特发信息	6,300	43,785.00	0.06
633	300267	尔康制药	12,600	43,722.00	0.06
634	300397	天和防务	4,200	43,722.00	0.06
635	603025	大豪科技	2,000	43,680.00	0.06
636	002251	步步高	6,300	43,659.00	0.06

637	603997	继峰股份	4,000	43,520.00	0.06
638	601827	三峰环境	6,100	43,432.00	0.06
639	000823	超声电子	4,200	43,428.00	0.06
640	003040	楚天龙	2,100	43,176.00	0.06
641	600729	重庆百货	2,000	43,140.00	0.06
642	002034	旺能环境	2,100	43,113.00	0.06
643	000828	东莞控股	4,200	43,050.00	0.06
644	002516	旷达科技	8,400	43,008.00	0.06
645	600602	云赛智联	6,000	42,960.00	0.06
646	300078	思创医惠	8,400	42,924.00	0.06
647	000801	四川九洲	6,300	42,903.00	0.06
648	002979	雷赛智能	2,100	42,882.00	0.06
649	002097	山河智能	6,300	42,777.00	0.06
650	603393	新天然气	2,000	42,720.00	0.06
651	688019	安集科技	200	42,584.00	0.06
652	600343	航天动力	4,000	42,560.00	0.06
653	002437	誉衡药业	16,800	42,504.00	0.06
654	603728	鸣志电器	2,000	42,460.00	0.06
655	300091	金通灵	10,400	42,432.00	0.06
656	002697	红旗连锁	8,400	42,420.00	0.06
657	605123	派克新材	300	42,216.00	0.06
658	300080	易成新能	8,400	42,168.00	0.06
659	600531	豫光金铅	8,000	42,160.00	0.06
660	000652	泰达股份	10,500	42,000.00	0.06
661	000950	重药控股	8,400	42,000.00	0.06
662	603915	国茂股份	2,000	41,980.00	0.06
663	688083	中望软件	200	41,884.00	0.06
664	002741	光华科技	2,100	41,853.00	0.06
665	002987	京北方	2,100	41,601.00	0.06
666	300973	立高食品	400	41,580.00	0.06
667	002930	宏川智慧	2,100	41,517.00	0.06
668	000931	中关村	6,300	41,328.00	0.06
669	002298	中电兴发	6,300	41,328.00	0.06
670	688007	光峰科技	1,700	41,310.00	0.06
671	601882	海天精工	2,000	41,220.00	0.06
672	603960	克来机电	2,000	41,100.00	0.06
673	002285	世联行	12,600	41,076.00	0.06
674	688166	博瑞医药	1,700	41,055.00	0.06
675	301050	雷电微力	400	40,624.00	0.06
676	605090	九丰能源	2,000	40,540.00	0.06
677	002243	力合科创	4,200	40,530.00	0.06
678	600587	新华医疗	2,000	40,500.00	0.06

679	603877	太平鸟	2,000	40,480.00	0.06
680	300145	中金环境	14,700	40,425.00	0.06
681	000557	西部创业	8,400	40,404.00	0.06
682	002646	天佑德酒	2,100	40,215.00	0.06
683	300127	银河磁体	2,100	40,089.00	0.06
684	600335	国机汽车	4,000	40,040.00	0.06
685	300590	移为通信	2,950	40,031.50	0.06
686	000507	珠海港	6,300	40,005.00	0.06
687	001696	宗申动力	6,300	39,879.00	0.06
688	300429	强力新材	4,200	39,858.00	0.06
689	600662	外服控股	5,900	39,825.00	0.06
690	002967	广电计量	2,100	39,774.00	0.06
691	688680	海优新材	200	39,740.00	0.06
692	603686	福龙马	4,000	39,680.00	0.06
693	000928	中钢国际	6,300	39,501.00	0.06
694	603108	润达医疗	4,000	39,400.00	0.06
695	002292	奥飞娱乐	8,400	39,396.00	0.06
696	002918	蒙娜丽莎	2,100	39,312.00	0.06
697	600458	时代新材	4,000	39,200.00	0.06
698	600775	南京熊猫	4,000	39,200.00	0.06
699	600590	泰豪科技	6,000	39,180.00	0.06
700	300762	上海瀚讯	3,520	39,177.60	0.06
701	000061	农产品	6,300	39,060.00	0.06
702	600217	中再资环	8,000	39,040.00	0.06
703	000048	京基智农	2,100	38,997.00	0.06
704	688085	三友医疗	1,800	38,970.00	0.05
705	688016	心脉医疗	200	38,962.00	0.05
706	301047	义翘神州	300	38,919.00	0.05
707	605007	五洲特纸	2,000	38,880.00	0.05
708	603328	依顿电子	6,100	38,735.00	0.05
709	603609	禾丰股份	4,000	38,520.00	0.05
710	000910	大亚圣象	4,200	38,514.00	0.05
711	603466	风语筑	2,000	38,480.00	0.05
712	600391	航发科技	2,000	38,420.00	0.05
713	603601	再升科技	6,040	38,414.40	0.05
714	603693	江苏新能	2,000	38,400.00	0.05
715	000566	海南海药	8,400	38,388.00	0.05
716	300307	慈星股份	6,300	38,367.00	0.05
717	688127	蓝特光学	1,700	38,182.00	0.05
718	000958	电投产融	8,400	38,136.00	0.05
719	002662	京威股份	10,500	38,115.00	0.05
720	688578	艾力斯	1,800	37,980.00	0.05

721	002961	瑞达期货	2,100	37,884.00	0.05
722	300007	汉威科技	2,100	37,779.00	0.05
723	301089	拓新药业	300	37,686.00	0.05
724	601588	北辰实业	16,100	37,674.00	0.05
725	300548	博创科技	2,100	37,422.00	0.05
726	600565	迪马股份	16,100	37,352.00	0.05
727	603010	万盛股份	2,000	37,300.00	0.05
728	300292	吴通控股	10,500	37,275.00	0.05
729	605369	拱东医疗	300	37,260.00	0.05
730	600337	美克家居	12,100	37,026.00	0.05
731	600748	上实发展	10,000	37,000.00	0.05
732	000913	钱江摩托	2,100	36,876.00	0.05
733	300322	硕贝德	4,200	36,792.00	0.05
734	300119	瑞普生物	2,100	36,729.00	0.05
735	002204	大连重工	8,400	36,708.00	0.05
736	003012	东鹏控股	4,200	36,708.00	0.05
737	002035	华帝股份	6,300	36,666.00	0.05
738	002733	雄韬股份	2,100	36,561.00	0.05
739	688333	铂力特	200	36,546.00	0.05
740	300815	玉禾田	2,100	36,519.00	0.05
741	603258	电魂网络	1,800	36,450.00	0.05
742	002614	奥佳华	4,200	36,372.00	0.05
743	300406	九强生物	2,100	36,309.00	0.05
744	603071	物产环能	2,000	36,280.00	0.05
745	600105	永鼎股份	10,000	36,100.00	0.05
746	002664	长鹰信质	2,100	36,078.00	0.05
747	300455	康拓红外	4,200	35,994.00	0.05
748	300366	创意信息	4,200	35,910.00	0.05
749	002320	海峡股份	6,300	35,847.00	0.05
750	600694	大商股份	2,000	35,800.00	0.05
751	002522	浙江众成	6,300	35,784.00	0.05
752	002782	可立克	2,100	35,784.00	0.05
753	300328	宜安科技	4,200	35,700.00	0.05
754	688100	威胜信息	1,700	35,683.00	0.05
755	002461	珠江啤酒	4,200	35,616.00	0.05
756	600480	凌云股份	4,000	35,560.00	0.05
757	002351	漫步者	4,200	35,532.00	0.05
758	000791	甘肃电投	6,300	35,469.00	0.05
759	000600	建投能源	8,400	35,448.00	0.05
760	600710	苏美达	6,000	35,400.00	0.05
761	300276	三丰智能	8,400	35,364.00	0.05
762	688133	泰坦科技	200	35,328.00	0.05

763	600510	黑牡丹	4,000	35,320.00	0.05
764	605199	葫芦娃	2,000	35,300.00	0.05
765	002215	诺普信	6,300	35,217.00	0.05
766	688106	金宏气体	1,800	35,190.00	0.05
767	002847	盐津铺子	400	35,176.00	0.05
768	002605	姚记科技	2,100	34,965.00	0.05
769	300006	莱美药业	8,400	34,860.00	0.05
770	000813	德展健康	10,100	34,845.00	0.05
771	000597	东北制药	6,300	34,650.00	0.05
772	603920	世运电路	2,000	34,600.00	0.05
773	300378	鼎捷软件	2,100	34,587.00	0.05
774	300602	飞荣达	2,100	34,440.00	0.05
775	603368	柳药集团	2,000	34,440.00	0.05
776	605388	均瑶健康	2,000	34,340.00	0.05
777	300109	新开源	2,100	34,272.00	0.05
778	300134	大富科技	4,200	34,230.00	0.05
779	002534	西子洁能	2,100	34,209.00	0.05
780	000936	华西股份	6,300	34,083.00	0.05
781	002378	章源钨业	4,200	33,936.00	0.05
782	300768	迪普科技	2,100	33,915.00	0.05
783	601886	江河集团	4,000	33,800.00	0.05
784	000550	江铃汽车	2,100	33,768.00	0.05
785	002234	民和股份	2,100	33,474.00	0.05
786	600929	雪天盐业	3,600	33,408.00	0.05
787	000517	荣安地产	10,500	33,390.00	0.05
788	301080	百普赛斯	200	33,378.00	0.05
789	688017	绿的谐波	280	33,320.00	0.05
790	600800	渤海化学	8,100	33,291.00	0.05
791	688389	普门科技	1,900	33,231.00	0.05
792	600990	四创电子	800	33,080.00	0.05
793	603595	东尼电子	800	33,032.00	0.05
794	000697	炼石航空	4,200	33,012.00	0.05
795	002651	利君股份	4,200	32,970.00	0.05
796	300382	斯莱克	2,100	32,907.00	0.05
797	002737	葵花药业	2,100	32,844.00	0.05
798	002941	新疆交建	2,100	32,550.00	0.05
799	002609	捷顺科技	4,200	32,466.00	0.05
800	000019	深粮控股	4,200	32,382.00	0.05
801	003031	中瓷电子	500	32,300.00	0.05
802	300045	华力创通	4,200	32,214.00	0.05
803	603533	掌阅科技	2,000	32,200.00	0.05
804	601158	重庆水务	6,000	32,100.00	0.05

805	688298	东方生物	280	31,962.00	0.05
806	301217	铜冠铜箔	2,100	31,941.00	0.05
807	600114	东睦股份	4,000	31,920.00	0.05
808	000601	韶能股份	6,300	31,752.00	0.04
809	002042	华孚时尚	8,400	31,752.00	0.04
810	300527	中船应急	4,200	31,752.00	0.04
811	600569	安阳钢铁	12,100	31,702.00	0.04
812	603587	地素时尚	2,000	31,700.00	0.04
813	605136	丽人丽妆	2,000	31,640.00	0.04
814	000032	深桑达 A	2,100	31,458.00	0.04
815	002367	康力电梯	4,200	31,374.00	0.04
816	601330	绿色动力	4,000	31,320.00	0.04
817	300510	金冠股份	6,300	31,185.00	0.04
818	000567	海德股份	2,100	31,080.00	0.04
819	300183	东软载波	2,100	31,059.00	0.04
820	002435	长江健康	6,300	30,807.00	0.04
821	002677	浙江美大	2,100	30,807.00	0.04
822	000881	中广核技	3,400	30,668.00	0.04
823	601700	风范股份	6,000	30,660.00	0.04
824	300368	汇金股份	4,200	30,618.00	0.04
825	000761	本钢板材	8,400	30,240.00	0.04
826	600715	文投控股	12,000	30,240.00	0.04
827	002777	久远银海	2,100	30,198.00	0.04
828	003032	传智教育	2,100	30,135.00	0.04
829	000710	贝瑞基因	2,100	30,114.00	0.04
830	300765	新诺威	2,100	29,967.00	0.04
831	603222	济民医疗	2,720	29,920.00	0.04
832	002641	公元股份	6,200	29,884.00	0.04
833	603626	科森科技	4,000	29,720.00	0.04
834	603118	共进股份	4,000	29,680.00	0.04
835	002232	启明信息	2,100	29,610.00	0.04
836	688023	安恒信息	200	29,532.00	0.04
837	600007	中国国贸	2,000	29,500.00	0.04
838	002344	海宁皮城	6,300	29,421.00	0.04
839	300132	青松股份	4,200	29,400.00	0.04
840	300365	恒华科技	4,200	29,400.00	0.04
841	002376	新北洋	3,800	29,374.00	0.04
842	002267	陕天然气	4,200	29,358.00	0.04
843	603013	亚普股份	2,100	29,337.00	0.04
844	300684	中石科技	2,100	29,295.00	0.04
845	300531	优博讯	2,100	29,190.00	0.04
846	688037	芯源微	200	28,994.00	0.04

847	002303	美盈森	8,400	28,980.00	0.04
848	601949	中国出版	6,000	28,920.00	0.04
849	300215	电科院	4,200	28,854.00	0.04
850	300740	水羊股份	2,100	28,854.00	0.04
851	000918	嘉凯城	12,500	28,750.00	0.04
852	688222	成都先导	1,800	28,728.00	0.04
853	300846	首都在线	2,100	28,392.00	0.04
854	000011	深物业 A	2,100	28,371.00	0.04
855	300441	鲍斯股份	4,200	28,350.00	0.04
856	300130	新国都	2,300	28,198.00	0.04
857	300204	舒泰神	2,100	28,182.00	0.04
858	603508	思维列控	2,100	28,119.00	0.04
859	002530	金财互联	4,200	28,056.00	0.04
860	605008	长鸿高科	2,000	28,040.00	0.04
861	300872	天阳科技	2,100	27,993.00	0.04
862	000639	西王食品	6,300	27,846.00	0.04
863	002803	吉宏股份	2,100	27,825.00	0.04
864	300607	拓斯达	2,100	27,762.00	0.04
865	002301	齐心集团	4,200	27,720.00	0.04
866	600184	光电股份	2,000	27,680.00	0.04
867	601515	东风股份	5,980	27,567.80	0.04
868	600996	贵广网络	4,000	27,520.00	0.04
869	300318	博晖创新	4,200	27,468.00	0.04
870	601069	西部黄金	2,000	27,160.00	0.04
871	603610	麒盛科技	2,000	27,020.00	0.04
872	600261	阳光照明	8,000	26,960.00	0.04
873	600874	创业环保	4,000	26,920.00	0.04
874	300114	中航电测	2,300	26,864.00	0.04
875	300634	彩讯股份	2,100	26,670.00	0.04
876	603169	兰石重装	4,000	26,520.00	0.04
877	002950	奥美医疗	2,100	26,502.00	0.04
878	600032	浙江新能	1,800	26,370.00	0.04
879	603439	贵州三力	2,000	26,240.00	0.04
880	603730	岱美股份	2,000	26,220.00	0.04
881	300255	常山药业	4,200	26,166.00	0.04
882	002724	海洋王	2,100	26,103.00	0.04
883	002695	煌上煌	2,100	25,977.00	0.04
884	300485	赛升药业	2,100	25,935.00	0.04
885	003006	百亚股份	2,100	25,914.00	0.04
886	300439	美康生物	2,100	25,494.00	0.04
887	002792	通宇通讯	2,100	25,326.00	0.04
888	002017	东信和平	2,100	25,305.00	0.04

889	603055	台华新材	2,000	25,120.00	0.04
890	600098	广州发展	4,000	25,040.00	0.04
891	600618	氯碱化工	2,000	25,000.00	0.04
892	688277	天智航	1,700	24,463.00	0.03
893	301029	怡合达	300	24,450.00	0.03
894	688198	佰仁医疗	200	24,384.00	0.03
895	600449	宁夏建材	2,000	24,340.00	0.03
896	603359	东珠生态	2,000	24,160.00	0.03
897	603060	国检集团	2,000	24,100.00	0.03
898	603313	梦百合	2,000	24,000.00	0.03
899	603567	珍宝岛	2,000	23,740.00	0.03
900	300386	飞天诚信	2,100	23,667.00	0.03
901	603378	亚士创能	2,000	23,320.00	0.03
902	301090	华润材料	2,100	22,911.00	0.03
903	688399	硕世生物	200	22,804.00	0.03
904	301039	中集车辆	2,100	22,743.00	0.03
905	688018	乐鑫科技	200	22,480.00	0.03
906	600855	航天长峰	2,000	22,460.00	0.03
907	688055	龙腾光电	4,000	21,560.00	0.03
908	300206	理邦仪器	2,100	21,525.00	0.03
909	603093	南华期货	2,000	21,180.00	0.03
910	688366	昊海生科	200	21,156.00	0.03
911	600935	华塑股份	4,000	20,960.00	0.03
912	001213	中铁特货	4,200	20,622.00	0.03
913	688339	亿华通	200	19,676.00	0.03
914	000885	城发环境	2,100	19,530.00	0.03
915	600548	深高速	2,000	19,080.00	0.03
916	002911	佛燃能源	2,100	19,068.00	0.03
917	002636	金安国纪	2,100	18,963.00	0.03
918	603053	成都燃气	2,000	18,680.00	0.03
919	688408	中信博	200	18,496.00	0.03
920	600841	动力新科	2,000	17,320.00	0.02
921	688505	复旦张江	1,700	17,255.00	0.02
922	601528	瑞丰银行	2,000	16,120.00	0.02
923	688365	光云科技	1,700	15,810.00	0.02
924	600903	贵州燃气	2,000	15,580.00	0.02
925	601921	浙版传媒	2,000	15,560.00	0.02
926	688508	芯朋微	200	14,900.00	0.02
927	000058	深赛格	2,300	13,938.00	0.02
928	601279	英利汽车	2,000	13,660.00	0.02
929	688568	中科星图	200	13,552.00	0.02
930	688233	神工股份	200	11,240.00	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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601089	福元医药	1,621	34,122.05	0.05
2	001268	联合精密	382	10,589.04	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	002405	四维图新	381,417.00	0.71
2	002432	九安医疗	279,378.00	0.52
3	300568	星源材质	262,455.00	0.49
4	002176	江特电机	259,452.00	0.48
5	002738	中矿资源	242,851.00	0.45
6	000422	湖北宜化	241,695.00	0.45
7	002850	科达利	191,896.00	0.36
8	300343	联创股份	188,403.00	0.35
9	000683	远兴能源	182,172.00	0.34
10	002472	双环传动	181,943.00	0.34
11	601099	太平洋	179,643.00	0.33
12	300776	帝尔激光	178,772.00	0.33
13	300593	新雷能	176,025.00	0.33
14	300012	华测检测	170,058.00	0.32
15	002497	雅化集团	165,051.00	0.31
16	002192	融捷股份	164,921.00	0.31
17	002044	美年健康	154,250.00	0.29
18	600872	中炬高新	149,565.00	0.28
19	300458	全志科技	148,493.00	0.28
20	002487	大金重工	148,335.00	0.27

注：不考虑相关交易费用。

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	300012	华测检测	450,775.00	0.84
2	002497	雅化集团	440,101.00	0.82
3	002240	盛新锂能	397,693.00	0.74
4	300073	当升科技	353,783.00	0.66
5	300390	天华超净	345,311.00	0.64
6	600096	云天化	315,999.00	0.59
7	002756	永兴材料	307,655.00	0.57

8	002407	多氟多	275,330.00	0.51
9	002625	光启技术	261,001.00	0.48
10	300769	德方纳米	249,794.40	0.46
11	000831	五矿稀土	217,588.00	0.40
12	002326	永太科技	207,405.00	0.38
13	601058	赛轮轮胎	207,278.00	0.38
14	603026	石大胜华	201,711.00	0.37
15	600499	科达制造	199,750.00	0.37
16	300568	星源材质	181,396.19	0.34
17	300850	新强联	179,815.40	0.33
18	688122	西部超导	154,352.00	0.29
19	600456	宝钛股份	135,231.00	0.25
20	300679	电连技术	128,375.00	0.24

注：不考虑相关交易费用。

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	38,620,208.80
卖出股票收入（成交）总额	22,020,763.31

注：不考虑相关交易费用。

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）	34,201.82	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	34,201.82	0.05

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	110087	天业转债	150	15,000.53	0.02
2	123149	通裕转债	110	11,000.80	0.02
3	123148	上能转债	32	3,200.36	0.00

4	123150	九强转债	30	3,000.02	0.00
5	118008	海优转债	20	2,000.11	0.00

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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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。

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

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

报告期内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的情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 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情形。

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	24,086.14
2	应收清算款	1,583,730.80
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	1,683,433.18

7.12.4 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。

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

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。

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

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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

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 (%)
928	68,536.83	52,005,982.00	81.77	11,596,200.00	18.23

8.2 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	中国国际金融股份有限公司	15,759,600.00	24.78
2	BARCLAYS BANK PLC	6,600,000.00	10.38
3	华泰证券股份有限公司	5,788,800.00	9.10
4	广发证券股份有限公司	4,218,700.00	6.63
5	野村新加坡有限公司—自有资金	4,200,000.00	6.60
6	中国国际金融股份有限公司	4,067,000.00	6.39
7	申万宏源证券有限公司	2,762,500.00	4.34
8	方正证券股份有限公司	2,636,332.00	4.15
9	中信证券股份有限公司	2,310,588.00	3.63

10	兴银理财有限责任公司—兴银理财增盈稳享封闭式 8 号固收类理财产品	1,502,200.00	2.36
----	-----------------------------------	--------------	------

8.3 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

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、基金投资和研发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

§ 9 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
本报告期期初基金份额总额	42,602,182.00
本报告期基金总申购份额	39,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	18,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	63,602,182.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

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

2022 年 3 月 15 日，公司股东批准 Kirk Chester SWEENEY 先生担任公司董事，Anthony Gerard Fasso 先生不再担任公司董事。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、公募基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 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。

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

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。

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 (%)	
招商证券	6	60,395,914.31	100.00	55,558.39	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。

4、本报告期内，无变更租用证券公司交易单元的情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的	成交金额	占当期债券回购成交总额的	成交金额	占当期权证成交总额的

		比例 (%)		比例 (%)		比例 (%)
招商证券	42,221.77	100.00	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 6 月 17 日
2	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	2022 年 6 月 17 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资北交所上市股票的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 4 月 29 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可转换公司债券的关联交易的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 4 月 23 日
5	关于同意中国国际金融股份有限公司为华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 4 月 13 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加工商银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 1 月 4 日
7	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	2022 年 1 月 1 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

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	20220613-20220630;	0.00	15,759,600.00	0.00	15,759,600.00	24.78
-	2	20220101-20220610;	11,619,300.00	4,140,300.00	15,759,600.00	0.00	0.00

产品特有风险

本基金报告期内有单一机构持有基金份额超过 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 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

12.2 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

12.3 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 8 月 30 日