

华宝中证 1000 指数证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 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、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。本报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	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	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	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	10
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	11
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	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	18
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61

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	62
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	62
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	62
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12 投资组合报告附注	62
§ 8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末上市基金前十名持有人	63
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
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	64
§ 9 开放式基金份额变动	64
§ 10 重大事件揭示	65
10.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4 基金投资策略的改变	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
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	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
10.8 其他重大事件	67
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§ 12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录	69
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝中证 1000 指数证券投资基金	
基金简称	华宝中证 1000 指数	
场内简称	中证 1000 基金	
基金主代码	162413	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 11 月 19 日	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	51,790,568.84 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的 证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2015 年 6 月 8 日	
下属分级基金的基 金简称	华宝中证 1000 指数	华宝中证 1000 指数 C
下属分级基金的交 易代码	162413	016033
报告期末下属分级 基金的份额总额	37,965,029.41 份	13,825,539.43 份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常情况下，本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。
投资策略	本基金原则上采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整。在正常情况下，本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。在标的指数成份股发生变动、增发、配股、分红等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时，由于

	交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致本基金无法及时完成投资组合同步调整的情况下，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周雷	王小飞
	联系电话	021-38505888	021-60637103
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050	021-60637228
传真		021-38505777	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		黄孔威	田国立

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司、基金管理人	北京市西城区太平桥大街 17 号、中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

§ 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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	华宝中证 1000 指数	华宝中证 1000 指数 C
本期已实现收益	421,649.83	172,024.79

本期利润	2,076,741.98	977,813.87
加权平均基金份额本期利润	0.0497	0.0686
本期加权平均净值利润率	4.93%	6.82%
本期基金份额净值增长率	4.71%	4.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
期末可供分配利润	-66,755,811.42	-24,352,193.78
期末可供分配基金份额利润	-1.7584	-1.7614
期末基金资产净值	37,543,897.27	13,634,122.76
期末基金份额净值	0.9889	0.9862
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-0.69%	-7.75%

注：1. 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，本期利润等于本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宝中证 1000 指数

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	0.97%	0.99%	0.59%	0.99%	0.38%	0.00%
过去三个月	-3.55%	0.87%	-3.77%	0.87%	0.22%	0.00%
过去六个月	4.71%	0.83%	4.87%	0.84%	-0.16%	-0.01%
过去一年	-6.48%	1.04%	-5.27%	1.05%	-1.21%	-0.01%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起 至今	-0.69%	1.23%	-0.83%	1.25%	0.14%	-0.02%

华宝中证 1000 指数 C

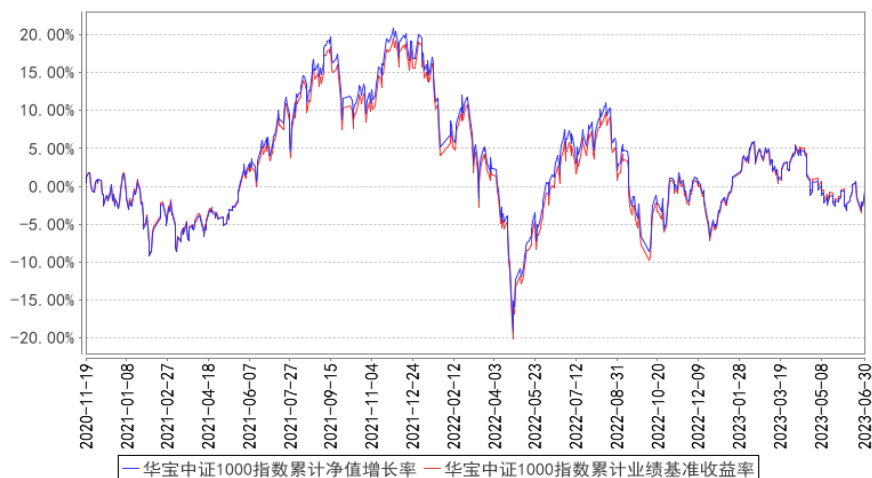
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标准 差④	①-③	②-④
过去一个月	0.95%	0.99%	0.59%	0.99%	0.36%	0.00%
过去三个月	-3.62%	0.87%	-3.77%	0.87%	0.15%	0.00%
过去六个月	4.56%	0.83%	4.87%	0.84%	-0.31%	-0.01%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起 至今	-7.75%	1.04%	-6.30%	1.05%	-1.45%	-0.01%

注：（1）基金业绩基准：中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%；

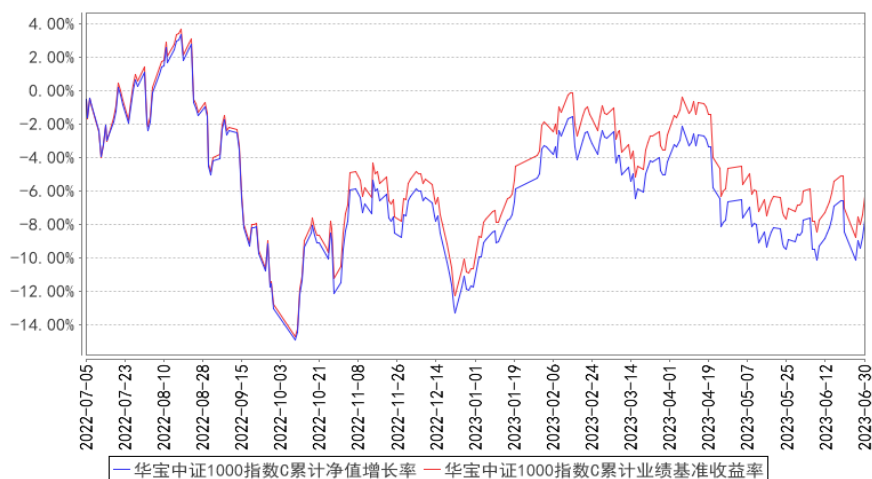
（2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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

华宝中证1000指数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



华宝中证1000指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至 2021 年 05 月 19 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华宝基金管理有限公司（公司原名“华宝兴业基金管理有限公司”）于 2003 年 2 月 12 日经中国证监会批准设立，2003 年 3 月 7 日在国家工商总局注册登记并正式开业，是国内首批中外合资基金管理公司。成立之初，公司注册资本为 1 亿元人民币，2007 年经中国证监会批准，公司注册资本增加至 1.5 亿元人民币。2017 年公司名称变更为“华宝基金管理有限公司”。目前公司股东为华宝信托有限责任公司、美国华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.）和江苏省铁路集团有限公司，持有股权占比分别

为 51%、29%、20%。公司在北京和深圳设有分公司，在香港设有子公司——华宝资产管理(香港)有限公司。截至本报告期末（2023 年 06 月 30 日），本公司正在管理运作的公开募集证券投资基金共 139 只。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
丰晨成	本基金基金经理	2020-11-19	-	14 年	硕士。2009 年 7 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任助理产品经理、数量分析师、投资经理助理、投资经理等职务。2015 年 11 月起任华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2016 年 8 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2018 年 4 月至 2021 年 1 月任华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2018 年 6 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2018 年 8 月至 2020 年 11 月任华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金经理，2020 年 11 月起任华宝中证 1000 指数证券投资基金基金经理，2022 年 2 月起任华宝中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2022 年 9 月至 2023 年 3 月任华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，2022 年 12 月起任华宝中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

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

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝中证 1000 指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风

险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

以中证 1000 为代表的小市值风格指数在年初市场延续了去年末开放政策引发的经济复苏预期，北向资金持续流入走出了阶段性的行情，小盘股表现抢眼，2 月受美债利率攀升使得北向资金流入放缓，市场振荡，随着数字经济主题的深化以及 ChatGPT 概念的发酵，AI 主题成为引领市场热点的主线，带动 TMT 板块的反攻，同时新能源板块的走弱显示市场依旧在资金切换的存量博弈中。在经济复苏初期适逢宏观资金面合理充裕，小盘风格走强，4 月下旬受上证指数冲关 3400 未果后快速“变脸”，避险情绪升温影响出现明显回落，加之五六月公布的统计数据对国内经济复苏进程的预期有了修正，人民币汇率疲软，北向流出，指数跟随大盘回落。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额 A 类净值增长率为 4.71%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为 4.56%；同期业绩比较基准收益率为 4.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年中央把“扩大内需、提振信心、防范风险”作为经济工作的重点；“经济运行持续好转、内生动力持续增强、社会预期持续改善、风险隐患持续化解”这“四个持续”是目标，继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策，发挥总量和结构性货币政策工具作用，推动经济实现质的有效提升和量的合理增长。7月22日中证1000指数期货和期权正式在中金所上市，丰富了小盘股投资的市场风险管理工具。从国内外市场来看，大小盘作为市场的主要风格，存在非常明显的轮动效应。从过去10年的历史回顾看，大盘股和中小盘股的相对强弱是以四年左右的时间呈现出周期律的强弱变化，以2021年2月为界，抱团投资达到了一个历史极值，大盘风格“抱团股散”重新切换到了小盘风格占优。在复苏的过程中、保就业的背景下，尤其需要对中小企业尤其是制造业的扶持；多层次资本市场的建设、北交所的设立、全面注册制落地，也是对中小企业融资支持的题中之意，只要经济复苏中，宏观流动性依然呵护，政策的倾斜叠加流动性的宽松，小市值股票作为在此环境下吸引市场资金关注的一个有差异度的独立版块，容易走出一轮慢且有趋势的行情，在这个时点我们对以中证1000指数为代表的小市值风格抱有乐观判断。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。基金在投资新品种时，由估值委员会评价现有估值政策和程序的适用性。参与估值的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值各方之间不存在重大利益冲突。

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

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期，本基金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。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝中证 1000 指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,875,712.37	3,792,863.02
结算备付金		18,456.91	409,864.16
存出保证金		15,630.36	199,246.28
交易性金融资产	6.4.7.2	48,479,289.38	44,554,892.62
其中：股票投资		48,479,289.38	44,554,892.62
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		42,413.85	36,456.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	6,366.00	-
资产总计		51,437,868.87	48,993,322.45
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		48,252.97	78,712.01
应付管理人报酬		21,041.76	21,600.89
应付托管费		4,208.34	4,320.18
应付销售服务费		3,375.52	2,408.96
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	182,970.25	247,218.81
负债合计		259,848.84	354,260.85
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	123,778,303.01	123,117,970.14
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-72,600,282.98	-74,478,908.54
净资产合计		51,178,020.03	48,639,061.60
负债和净资产总计		51,437,868.87	48,993,322.45

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 51,790,568.84 份，其中华宝中证 1000 指数基金份额总额 37,965,029.41 份，基金份额净值 0.9889 元；华宝中证 1000 指数 C 基金份额总额 13,825,539.43 份，基金份额净值 0.9862 元。

6.2 利润表

会计主体：华宝中证 1000 指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		3,388,907.91	-7,957,943.15
1. 利息收入		10,257.03	5,893.83
其中：存款利息收入	6.4.7.13	10,257.03	5,893.83
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		901,615.23	-2,861,636.98
其中：股票投资收益	6.4.7.14	401,653.36	-3,117,578.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	135,262.85	-
股利收益	6.4.7.19	364,699.02	255,941.81
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（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	2,460,881.23	-5,125,722.98
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	16,154.42	23,522.98
减：二、营业总支出		334,352.06	278,157.44
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	139,925.01	100,825.17
2. 托管费	6.4.10.2.2	27,984.99	20,165.05
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	21,252.32	-
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		488. 76	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	144, 700. 98	157, 167. 22
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3, 054, 555. 85	-8, 236, 100. 59
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3, 054, 555. 85	-8, 236, 100. 59
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3, 054, 555. 85	-8, 236, 100. 59

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华宝中证 1000 指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	123, 117, 970. 14	-	-74, 478, 908. 54	48, 639, 061. 60
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）	123, 117, 970. 14	-	-74, 478, 908. 54	48, 639, 061. 60
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	660, 332. 87	-	1, 878, 625. 56	2, 538, 958. 43
（一）、综合收益总额	-	-	3, 054, 555. 85	3, 054, 555. 85
（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）	660, 332. 87	-	-1, 175, 930. 29	-515, 597. 42
其中：1. 基金申购款	143, 611, 090. 68	-	-82, 840, 261. 47	60, 770, 829. 21
2. 基金赎回	-142, 950, 757. 8	-	81, 664, 331. 18	-61, 286, 426. 63

回款	1			
(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)	123,778,303.01	-	-72,600,282.98	51,178,020.03
项目	上年度可比期间 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)	107,408,959.29	-	-53,709,252.90	53,699,706.39
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)	107,408,959.29	-	-53,709,252.90	53,699,706.39
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-21,331,275.94	-	5,714,578.27	-15,616,697.67
(一)、综合收益总额	-	-	-8,236,100.59	-8,236,100.59
(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)	-21,331,275.94	-	13,950,678.86	-7,380,597.08
其中: 1. 基金申购款	54,581,305.33	-	-32,331,932.30	22,249,373.03
2. 基金赎回款	-75,912,581.27	-	46,282,611.16	-29,629,970.11
(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)	86,077,683.35	-	-47,994,674.63	38,083,008.72

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

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

根据《关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金转型后基金名称、基金简称变更的公告》,华宝中证 1000 指数分级证券投资基金于 2020 年 11 月 19 日起更名为华宝中证 1000 指数证券投资基金。

根据本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2022 年 6 月 24 日发布的《华宝基金管理有限公司关于华宝中证 1000 指数证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》以及更新后的《华宝中证 1000 指数证券投资基金基金合同》的有关规定,自 2022 年 7 月 1

日起，本基金增设 C 类基金份额。本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，且不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝中证 1000 指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、存托凭证和其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金采用完全复制法进行指数化投资，股票资产跟踪的标的指数为中证 1000 指数，投资于中证 1000 指数成份股和备选成份股的市值不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，应保持不低于基金资产净值 5% 的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券。本基金力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%、年跟踪误差不超过 4%，本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×95%+银行同业存款收益率×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2023 年 8 月 29 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、《资产管理产品相关会计处理规定》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（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝中证 1000 指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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 2023 年 6 月 30 日的

财务状况以及 2023 年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

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

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

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	2,875,712.37
等于：本金	2,875,406.80
加：应计利息	305.57
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	2,875,712.37

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	49,051,820.22	-	48,479,289.38	-572,530.84

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	49,051,820.22	-	48,479,289.38	-572,530.84

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本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

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应收利息	-
其他应收款	6,366.00
待摊费用	-
合计	6,366.00

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	10.64
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	88,328.63
其中：交易所市场	88,328.63
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	44,630.98
应付指数使用费	50,000.00
合计	182,970.25

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华宝中证 1000 指数

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	42,492,020.01	101,551,966.25
本期申购	6,859,781.01	16,394,182.31
本期赎回（以“-”号填列）	-11,386,771.61	-27,212,746.09
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	37,965,029.41	90,733,402.47

华宝中证 1000 指数 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,023,033.68	21,566,003.89
本期申购	53,226,521.47	127,216,908.37
本期赎回（以“-”号填列）	-48,424,015.72	-115,738,011.72
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	13,825,539.43	33,044,900.54

6.4.7.8 其他综合收益

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

华宝中证 1000 指数

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-75,097,619.67	13,674,581.75	-61,423,037.92
本期利润	421,649.83	1,655,092.15	2,076,741.98
本期基金份额交易产生的变动数	7,920,158.42	-1,763,367.68	6,156,790.74
其中：基金申购款	-12,105,578.12	2,602,678.17	-9,502,899.95
基金赎回款	20,025,736.54	-4,366,045.85	15,659,690.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-66,755,811.42	13,566,306.22	-53,189,505.20

华宝中证 1000 指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-15,960,415.55	2,904,544.93	-13,055,870.62

本期利润	172,024.79	805,789.08	977,813.87
本期基金份额交易产生的变动数	-8,563,803.02	1,231,081.99	-7,332,721.03
其中：基金申购款	-93,999,584.28	20,662,222.76	-73,337,361.52
基金赎回款	85,435,781.26	-19,431,140.77	66,004,640.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-24,352,193.78	4,941,416.00	-19,410,777.78

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入	7,705.58	
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	2,448.53	
其他	102.92	
合计	10,257.03	

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
卖出股票成交总额	41,647,122.00	
减：卖出股票成本总额	41,118,815.41	
减：交易费用	126,653.23	
买卖股票差价收入	401,653.36	

6.4.7.11.2 股票投资收益——证券出借差价收入

6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	

股指期货投资收益	135,262.85
----------	------------

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	364,699.02
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	364,699.02

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	2,396,081.23
股票投资	2,396,081.23
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	64,800.00
权证投资	-
期货投资	64,800.00
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	2,460,881.23

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	9,788.42
其他	6,366.00
合计	16,154.42

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
银行费用	70.00
指数使用费	100,000.00
合计	144,700.98

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，本基金并无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	139,925.01	100,825.17
其中：支付销售机构的客户维护费	42,092.21	40,949.61

注：支付基金管理人华宝基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	27,984.99	20,165.05

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司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

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝中证 1000 指数	华宝中证 1000 指数 C	合计
华宝基金	-	9,859.00	9,859.00
合计	-	9,859.00	9,859.00
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝中证 1000 指数	华宝中证 1000 指数 C	合计
合计	-	-	-

注：销售服务费每日计提，按月支付。A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.3% 年费率计提。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下： $H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$ ，H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费 E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行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

本基金本报告期内及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

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

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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本报告期末及上年度末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

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

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	2,875,712.37	7,705.58	2,338,826.27	5,583.05

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 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

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股	停牌	停牌	期末	复	复牌	数量	期末	期末	备注
------	---	----	----	----	---	----	----	----	----	----

码	票名称	日期	原因	估值单价	牌日期	开盘单价	(股)	成本总额	估值总额	
300346	南大光电	2023年6月26日	重大事项停牌	34.39	2023年07月06日	35.60	3,170	107,151.16	109,016.30	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪中证 1000 指数。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“以实现与跟踪指数相同”的风险收益目标。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司在经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；合规审计部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为风险管理部和合规审计部对各岗位、各部门、

各项业务全面实施和监督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对风险管理部和合规审计部的工作予以直接指导。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于大型股份制商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于本报告期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例较低（含债券投资比例为零），因此无重大信用风险（上年度末：同）。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于本报告期末，除附注中列示的卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基

金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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

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

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

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

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

动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,875,712.37	-	-	-	2,875,712.37
结算备付金	18,456.91	-	-	-	18,456.91
存出保证金	15,630.36	-	-	-	15,630.36
交易性金融资产	-	-	-	48,479,289.38	48,479,289.38
应收申购款	209.83	-	-	42,204.02	42,413.85
其他资产	-	-	-	6,366.00	6,366.00
资产总计	2,910,009.47	-	-	48,527,859.40	51,437,868.87
负债					
应付赎回款	-	-	-	48,252.97	48,252.97
应付管理人报酬	-	-	-	21,041.76	21,041.76
应付托管费	-	-	-	4,208.34	4,208.34
应付销售服务费	-	-	-	3,375.52	3,375.52
其他负债	-	-	-	182,970.25	182,970.25
负债总计	-	-	-	259,848.84	259,848.84
利率敏感度缺口	2,910,009.47	-	-	48,268,010.56	51,178,020.03
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,792,863.02	-	-	-	3,792,863.02

结算备付金	409,864.16	-	-	-	409,864.16
存出保证金	11,950.28	-	-	187,296.00	199,246.28
交易性金融资产	-	-	-	44,554,892.62	44,554,892.62
应收申购款	10.01	-	-	36,446.36	36,456.37
资产总计	4,214,687.47	-	-	44,778,634.98	48,993,322.45
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	78,712.01	78,712.01
应付管理人报酬	-	-	-	21,600.89	21,600.89
应付托管费	-	-	-	4,320.18	4,320.18
应付销售服务费	-	-	-	2,408.96	2,408.96
其他负债	-	-	-	247,218.81	247,218.81
负债总计	-	-	-	354,260.85	354,260.85
利率敏感度缺口	4,214,687.47	-	-	44,424,374.13	48,639,061.60

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

于本报告期末，本基金未持有交易性债券投资(上年度末：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	48,479,289.38	94.73	44,554,892.62	91.60
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	-	-	-	-
合计	48,479,289.38	94.73	44,554,892.62	91.60

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	2,531,614.84	2,396,819.34
	2. 业绩比较基准下降 5%	-2,531,614.84	-2,396,819.34

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	48,370,273.08	44,554,892.62
第二层次	109,016.30	-
第三层次	-	-
合计	48,479,289.38	44,554,892.62

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关证券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：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	48,479,289.38	94.25
	其中：股票	48,479,289.38	94.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	2,894,169.28	5.63
8	其他各项资产	64,410.21	0.13
9	合计	51,437,868.87	100.00

注：本基金本报告期末“固定收益投资”、“买入返售金融资产”、“银行存款和结算备付金合计”等项目的列报金额已包含对应的“应计利息”和“减值准备”（若有），“其他资产”中的“应收利息”指本基金截至本报告期末已过付息期但尚未收到的利息金额（下同）。

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	397,931.40	0.78
B	采矿业	1,358,226.20	2.65
C	制造业	32,097,135.06	62.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,383,538.96	2.70
E	建筑业	989,412.12	1.93
F	批发和零售业	1,335,260.00	2.61
G	交通运输、仓储和邮政业	885,104.25	1.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,667,835.29	11.07
J	金融业	1,149,479.36	2.25
K	房地产业	956,422.60	1.87
L	租赁和商务服务业	327,494.36	0.64
M	科学研究和技术服务业	590,255.04	1.15
N	水利、环境和公共设施管理业	440,939.84	0.86
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	20,398.00	0.04
Q	卫生和社会工作	345,704.00	0.68
R	文化、体育和娱乐业	500,935.90	0.98
S	综合	33,217.00	0.06
	合计	48,479,289.38	94.73

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

本基金本报告期末未持有积极投资部分的股票投资。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300502	新易盛	7,035	478,168.95	0.93
2	603345	安井食品	1,500	220,200.00	0.43
3	300002	神州泰岳	14,500	203,000.00	0.40
4	002517	恺英网络	12,700	199,898.00	0.39
5	002405	四维图新	17,100	198,018.00	0.39
6	002436	兴森科技	12,100	187,550.00	0.37
7	002558	巨人网络	10,400	186,472.00	0.36
8	002472	双环传动	5,100	185,130.00	0.36
9	300394	天孚通信	1,660	177,337.80	0.35
10	600872	中炬高新	4,600	169,234.00	0.33
11	600129	太极集团	2,800	166,572.00	0.33
12	300315	掌趣科技	21,000	163,800.00	0.32
13	002044	美年健康	22,800	162,108.00	0.32
14	688037	芯源微	888	151,803.60	0.30
15	002176	江特电机	12,600	150,192.00	0.29
16	300339	润和软件	5,800	138,968.00	0.27
17	600100	同方股份	17,100	138,852.00	0.27
18	002261	拓维信息	7,100	137,101.00	0.27
19	300054	鼎龙股份	5,440	134,531.20	0.26
20	000818	航锦科技	4,000	133,480.00	0.26
21	300567	精测电子	1,400	133,210.00	0.26
22	688017	绿的谐波	820	133,168.00	0.26
23	600559	老白干酒	5,305	130,025.55	0.25
24	000860	顺鑫农业	3,800	128,022.00	0.25
25	002865	钧达股份	839	127,972.67	0.25
26	601099	太平洋	49,400	127,452.00	0.25
27	600771	广誉远	3,600	126,972.00	0.25
28	600777	新潮能源	49,500	125,235.00	0.24
29	300777	中简科技	2,600	122,876.00	0.24
30	300068	南都电源	6,300	121,968.00	0.24
31	688598	DR 金博股	700	120,050.00	0.23
32	300459	汤姆猫	18,000	116,820.00	0.23
33	002402	和而泰	6,750	114,615.00	0.22
34	600711	盛屯矿业	23,400	113,724.00	0.22
35	603129	春风动力	700	113,330.00	0.22
36	002389	航天彩虹	5,100	113,271.00	0.22

37	002262	恩华药业	3,636	112,097.88	0.22
38	000690	宝新能源	15,800	110,916.00	0.22
39	002747	埃斯顿	3,900	109,200.00	0.21
40	300346	南大光电	3,170	109,016.30	0.21
41	688556	高测股份	2,020	107,342.80	0.21
42	300573	兴齐眼药	500	106,900.00	0.21
43	000032	深桑达 A	3,200	105,280.00	0.21
44	002126	银轮股份	5,900	104,430.00	0.20
45	300476	胜宏科技	4,320	104,155.20	0.20
46	002851	麦格米特	2,850	103,939.50	0.20
47	300229	拓尔思	4,000	103,880.00	0.20
48	002456	欧菲光	18,500	103,600.00	0.20
49	688050	爱博医疗	500	102,665.00	0.20
50	300114	中航电测	2,050	100,757.50	0.20
51	605589	圣泉集团	4,600	100,004.00	0.20
52	601677	明泰铝业	7,200	99,936.00	0.20
53	002145	中核钛白	16,905	99,570.45	0.19
54	600338	西藏珠峰	5,400	98,604.00	0.19
55	600363	联创光电	2,600	96,460.00	0.19
56	603728	鸣志电器	1,200	96,360.00	0.19
57	002139	拓邦股份	7,325	95,591.25	0.19
58	300666	江丰电子	1,400	95,144.00	0.19
59	300456	赛微电子	3,840	94,003.20	0.18
60	603179	新泉股份	2,140	93,924.60	0.18
61	600583	海油工程	15,900	93,015.00	0.18
62	600072	中船科技	3,300	92,961.00	0.18
63	002174	游族网络	5,500	92,400.00	0.18
64	000762	西藏矿业	3,100	91,853.00	0.18
65	000921	海信家电	3,400	91,630.00	0.18
66	002151	北斗星通	2,600	91,416.00	0.18
67	002312	川发龙蟒	11,200	91,056.00	0.18
68	000034	神州数码	3,400	90,406.00	0.18
69	300393	中来股份	6,427	90,235.08	0.18
70	600685	中船防务	3,000	89,850.00	0.18
71	002484	江海股份	4,216	89,758.64	0.18
72	600633	浙数文化	5,500	89,155.00	0.17
73	600641	万业企业	4,640	88,577.60	0.17
74	002617	露笑科技	11,199	88,248.12	0.17
75	603027	千禾味业	4,149	87,626.88	0.17
76	688235	百济神州	800	87,288.00	0.17
77	300633	开立医疗	1,600	87,200.00	0.17
78	301071	力量钻石	1,980	87,120.00	0.17
79	002335	科华数据	2,400	86,280.00	0.17

80	300458	全志科技	3,161	86,137.25	0.17
81	002832	比音勒芬	2,420	85,692.20	0.17
82	600572	康恩贝	12,500	85,625.00	0.17
83	688066	航天宏图	1,403	85,442.70	0.17
84	601222	林洋能源	10,408	85,241.52	0.17
85	002318	久立特材	5,000	85,150.00	0.17
86	600452	DR 涪陵电	4,000	85,120.00	0.17
87	002610	爱康科技	33,200	84,992.00	0.17
88	002541	鸿路钢构	2,950	84,989.50	0.17
89	300036	超图软件	3,500	82,985.00	0.16
90	603588	高能环境	8,832	82,755.84	0.16
91	002837	英维克	2,761	82,664.34	0.16
92	300803	指南针	1,700	82,603.00	0.16
93	002212	天融信	8,500	82,450.00	0.16
94	603979	金诚信	2,634	81,917.40	0.16
95	300034	钢研高纳	2,079	81,891.81	0.16
96	002317	众生药业	4,800	81,552.00	0.16
97	688019	安集科技	494	81,426.02	0.16
98	600587	新华医疗	2,300	81,259.00	0.16
99	300775	三角防务	2,400	81,072.00	0.16
100	300170	汉得信息	7,000	80,780.00	0.16
101	601975	招商南油	28,100	80,366.00	0.16
102	002544	普天科技	3,500	80,150.00	0.16
103	603063	禾望电气	2,600	79,950.00	0.16
104	603236	移远通信	1,380	79,639.80	0.16
105	002063	远光软件	9,090	78,901.20	0.15
106	600422	昆药集团	3,800	78,736.00	0.15
107	603599	广信股份	2,900	78,532.00	0.15
108	002254	泰和新材	3,200	78,304.00	0.15
109	300294	博雅生物	2,150	78,002.00	0.15
110	002015	协鑫能科	5,800	77,894.00	0.15
111	600761	安徽合力	3,900	77,727.00	0.15
112	600877	电科芯片	5,200	77,688.00	0.15
113	002219	新里程	17,100	77,292.00	0.15
114	000875	吉电股份	14,300	77,077.00	0.15
115	600201	生物股份	8,100	77,031.00	0.15
116	300188	美亚柏科	3,700	76,923.00	0.15
117	002396	星网锐捷	3,400	76,806.00	0.15
118	603305	旭升集团	2,752	76,698.24	0.15
119	603279	景津装备	2,440	76,518.40	0.15
120	002085	万丰奥威	11,000	76,230.00	0.15
121	002706	良信股份	6,750	75,937.50	0.15
122	000422	湖北宜化	6,600	75,768.00	0.15

123	002245	蔚蓝锂芯	6,900	75,555.00	0.15
124	002332	仙琚制药	5,700	75,525.00	0.15
125	300747	锐科激光	2,476	75,468.48	0.15
126	600330	天通股份	6,280	74,857.60	0.15
127	600225	卓朗科技	12,200	74,786.00	0.15
128	300638	广和通	3,297	74,775.96	0.15
129	688617	惠泰医疗	200	74,750.00	0.15
130	300075	数字政通	3,000	74,640.00	0.15
131	600110	诺德股份	10,300	74,572.00	0.15
132	000917	电广传媒	10,200	74,562.00	0.15
133	600312	平高电气	6,000	74,340.00	0.15
134	603005	晶方科技	3,676	74,255.20	0.15
135	601375	中原证券	20,000	74,200.00	0.14
136	002276	万马股份	6,100	73,871.00	0.14
137	688700	东威科技	740	73,800.20	0.14
138	301236	软通动力	2,700	73,467.00	0.14
139	000951	中国重汽	4,360	73,466.00	0.14
140	300332	天壕环境	6,400	73,408.00	0.14
141	002291	遥望科技	5,600	73,360.00	0.14
142	605111	新洁能	1,680	73,113.60	0.14
143	688088	虹软科技	1,700	72,675.00	0.14
144	600596	新安股份	6,640	72,575.20	0.14
145	002182	云海金属	3,300	72,567.00	0.14
146	300451	创业慧康	8,657	72,545.66	0.14
147	002984	森麒麟	2,300	72,358.00	0.14
148	300627	华测导航	2,220	72,083.40	0.14
149	002036	联创电子	7,423	72,077.33	0.14
150	300166	东方国信	6,400	71,936.00	0.14
151	601678	滨化股份	15,500	71,920.00	0.14
152	600977	中国电影	5,100	71,655.00	0.14
153	300083	创世纪	9,800	71,638.00	0.14
154	300674	宇信科技	4,048	71,568.64	0.14
155	600456	宝钛股份	2,100	71,064.00	0.14
156	002424	贵州百灵	7,900	70,942.00	0.14
157	688139	海尔生物	1,377	70,874.19	0.14
158	300327	中颖电子	2,530	70,738.80	0.14
159	600057	厦门象屿	8,126	70,696.20	0.14
160	002675	东诚药业	4,800	70,608.00	0.14
161	300693	盛弘股份	1,900	70,148.00	0.14
162	000686	东北证券	10,100	70,094.00	0.14
163	600478	科力远	9,800	69,972.00	0.14
164	688023	安恒信息	400	69,884.00	0.14
165	300773	拉卡拉	4,000	69,760.00	0.14

166	002605	姚记科技	1,500	69,645.00	0.14
167	002643	万润股份	4,000	69,640.00	0.14
168	600602	云赛智联	4,600	69,276.00	0.14
169	000426	兴业银锡	7,800	69,264.00	0.14
170	600389	江山股份	2,900	68,875.00	0.13
171	300855	图南股份	1,950	68,874.00	0.13
172	002099	海翔药业	8,000	68,720.00	0.13
173	600557	康缘药业	2,500	68,650.00	0.13
174	002727	一心堂	2,600	68,640.00	0.13
175	002079	苏州固锝	4,700	68,620.00	0.13
176	688110	东芯股份	1,900	68,590.00	0.13
177	688262	国芯科技	1,684	68,521.96	0.13
178	600446	金证股份	4,700	68,338.00	0.13
179	600323	瀚蓝环境	3,600	68,148.00	0.13
180	688333	铂力特	644	68,096.56	0.13
181	300379	东方通	3,300	67,881.00	0.13
182	300655	晶瑞电材	3,400	67,694.00	0.13
183	603690	至纯科技	1,940	67,589.60	0.13
184	000821	京山轻机	3,300	67,518.00	0.13
185	603678	火炬电子	1,950	67,197.00	0.13
186	300298	三诺生物	2,480	67,059.20	0.13
187	002777	久远银海	1,886	66,896.42	0.13
188	600273	嘉化能源	7,100	66,882.00	0.13
189	300672	国科微	800	66,680.00	0.13
190	300133	华策影视	9,400	66,646.00	0.13
191	003031	中瓷电子	500	66,560.00	0.13
192	000810	创维数字	4,100	66,297.00	0.13
193	300130	新国都	2,340	66,292.20	0.13
194	601399	国机重装	20,800	66,144.00	0.13
195	603565	中谷物流	6,117	66,063.60	0.13
196	600483	福能股份	5,700	65,835.00	0.13
197	688639	华恒生物	725	65,598.00	0.13
198	000528	柳工	8,300	65,570.00	0.13
199	002222	福晶科技	2,350	65,189.00	0.13
200	002585	双星新材	5,190	65,186.40	0.13
201	002351	漫步者	3,150	65,142.00	0.13
202	002011	盾安环境	4,700	65,001.00	0.13
203	002698	博实股份	3,700	64,713.00	0.13
204	600395	盘江股份	9,300	64,635.00	0.13
205	600055	万东医疗	3,100	64,573.00	0.13
206	300432	富临精工	5,550	64,491.00	0.13
207	601567	三星医疗	5,100	64,413.00	0.13
208	002324	普利特	4,500	64,215.00	0.13

209	600151	航天机电	7,200	64,152.00	0.13
210	601908	京运通	10,600	64,130.00	0.13
211	603298	杭叉集团	2,720	64,056.00	0.13
212	603308	应流股份	3,500	64,050.00	0.13
213	000657	中钨高新	6,604	63,992.76	0.13
214	300101	振芯科技	3,300	63,987.00	0.13
215	300035	中科电气	5,300	63,706.00	0.12
216	300065	海兰信	5,125	63,498.75	0.12
217	300593	新雷能	2,760	63,231.60	0.12
218	300185	通裕重工	22,600	63,054.00	0.12
219	600612	老凤祥	900	62,892.00	0.12
220	688083	中望软件	434	62,882.26	0.12
221	301035	润丰股份	800	62,856.00	0.12
222	600116	三峡水利	6,900	62,652.00	0.12
223	000403	派林生物	3,133	62,534.68	0.12
224	000681	视觉中国	3,400	62,526.00	0.12
225	300525	博思软件	4,068	62,403.12	0.12
226	603713	密尔克卫	700	62,363.00	0.12
227	002292	奥飞娱乐	6,200	61,876.00	0.12
228	002446	盛路通信	6,520	61,614.00	0.12
229	300079	数码视讯	10,100	61,610.00	0.12
230	688707	振华新材	2,000	61,580.00	0.12
231	300236	上海新阳	1,550	61,457.50	0.12
232	603300	华铁应急	11,260	61,367.00	0.12
233	002123	梦网科技	4,600	61,134.00	0.12
234	600986	浙文互联	9,540	61,056.00	0.12
235	300679	电连技术	1,845	60,977.25	0.12
236	002649	博彦科技	4,300	60,759.00	0.12
237	600933	爱柯迪	2,600	60,554.00	0.12
238	688608	恒玄科技	500	60,515.00	0.12
239	603876	鼎胜新材	3,140	60,256.60	0.12
240	600586	金晶科技	7,800	60,216.00	0.12
241	603477	巨星农牧	1,800	60,030.00	0.12
242	002217	合力泰	17,000	60,010.00	0.12
243	600179	安通控股	21,500	59,985.00	0.12
244	002701	奥瑞金	13,300	59,983.00	0.12
245	000503	国新健康	5,000	59,950.00	0.12
246	600821	金开新能	8,700	59,943.00	0.12
247	601965	中国汽研	2,900	59,885.00	0.12
248	601208	东材科技	4,700	59,690.00	0.12
249	603197	保隆科技	1,100	59,675.00	0.12
250	600750	江中药业	2,720	59,649.60	0.12
251	000035	中国天楹	13,000	59,540.00	0.12

252	603997	继峰股份	4,150	59,345.00	0.12
253	002130	沃尔核材	7,300	59,276.00	0.12
254	600267	海正药业	5,200	59,176.00	0.12
255	688106	金宏气体	2,172	59,078.40	0.12
256	300109	新开源	2,374	59,041.38	0.12
257	002597	金禾实业	2,500	59,000.00	0.12
258	300343	联创股份	8,300	58,764.00	0.11
259	601212	白银有色	21,600	58,752.00	0.11
260	300457	赢合科技	3,325	58,719.50	0.11
261	300303	聚飞光电	9,340	58,468.40	0.11
262	301050	雷电微力	900	58,437.00	0.11
263	600993	马应龙	2,100	58,401.00	0.11
264	603100	川仪股份	1,500	58,290.00	0.11
265	688016	心脉医疗	324	58,281.12	0.11
266	300226	上海钢联	1,796	58,190.40	0.11
267	000028	国药一致	1,330	58,001.30	0.11
268	002807	江阴银行	15,700	57,933.00	0.11
269	600908	无锡银行	10,800	57,888.00	0.11
270	600916	中国黄金	4,900	57,869.00	0.11
271	600963	岳阳林纸	7,830	57,707.10	0.11
272	600064	南京高科	8,700	57,507.00	0.11
273	002004	华邦健康	11,500	57,500.00	0.11
274	000682	东方电子	5,900	57,348.00	0.11
275	600037	歌华有线	6,900	57,339.00	0.11
276	600562	国睿科技	3,532	57,218.40	0.11
277	300077	国民技术	4,300	57,190.00	0.11
278	601001	晋控煤业	6,100	57,096.00	0.11
279	600578	京能电力	14,600	57,086.00	0.11
280	600197	伊力特	2,100	57,057.00	0.11
281	300725	药石科技	1,176	56,953.68	0.11
282	002100	天康生物	6,900	56,925.00	0.11
283	300260	新莱应材	1,440	56,908.80	0.11
284	301039	中集车辆	4,300	56,889.00	0.11
285	300031	宝通科技	2,300	56,856.00	0.11
286	600850	电科数字	2,410	56,851.90	0.11
287	601890	亚星锚链	4,900	56,742.00	0.11
288	600120	浙江东方	14,800	56,684.00	0.11
289	300827	上能电气	1,572	56,670.60	0.11
290	600206	有研新材	4,300	56,502.00	0.11
291	688568	中科星图	700	56,406.00	0.11
292	300232	洲明科技	6,148	56,192.72	0.11
293	600185	格力地产	8,180	56,114.80	0.11
294	002006	精工科技	2,600	56,082.00	0.11

295	300416	苏试试验	2,600	56,056.00	0.11
296	688425	铁建重工	11,604	55,815.24	0.11
297	688331	荣昌生物	1,000	55,750.00	0.11
298	300687	赛意信息	2,000	55,560.00	0.11
299	600063	皖维高新	11,000	55,550.00	0.11
300	688388	嘉元科技	2,062	55,509.04	0.11
301	300470	中密控股	1,200	55,464.00	0.11
302	688518	联赢激光	1,983	55,246.38	0.11
303	600869	远东股份	10,000	55,200.00	0.11
304	603306	华懋科技	1,900	55,138.00	0.11
305	600158	中体产业	5,400	54,864.00	0.11
306	000543	皖能电力	8,300	54,780.00	0.11
307	688278	特宝生物	1,247	54,755.77	0.11
308	000065	北方国际	3,642	54,702.84	0.11
309	601126	四方股份	3,600	54,684.00	0.11
310	002020	京新药业	4,260	54,613.20	0.11
311	002038	双鹭药业	5,400	54,486.00	0.11
312	688027	国盾量子	344	54,462.08	0.11
313	601137	博威合金	3,500	54,460.00	0.11
314	600320	振华重工	14,400	53,712.00	0.10
315	300726	宏达电子	1,200	53,664.00	0.10
316	600216	浙江医药	4,900	53,655.00	0.10
317	688408	中信博	632	53,296.56	0.10
318	002091	江苏国泰	7,060	53,232.40	0.10
319	300271	华宇软件	4,800	53,184.00	0.10
320	600123	兰花科创	6,500	53,170.00	0.10
321	600285	羚锐制药	3,300	52,998.00	0.10
322	600248	陕建股份	11,100	52,947.00	0.10
323	300762	上海瀚讯	4,492	52,870.84	0.10
324	002567	唐人神	7,950	52,867.50	0.10
325	601860	紫金银行	21,000	52,710.00	0.10
326	300203	聚光科技	2,600	52,702.00	0.10
327	688339	亿华通	620	52,700.00	0.10
328	002839	张家港行	12,400	52,452.00	0.10
329	300910	瑞丰新材	1,040	52,312.00	0.10
330	601519	大智慧	7,300	52,268.00	0.10
331	600277	亿利洁能	16,120	52,228.80	0.10
332	600797	浙大网新	7,300	52,122.00	0.10
333	688266	泽璟制药	1,118	52,042.90	0.10
334	600420	国药现代	4,600	51,934.00	0.10
335	300398	飞凯材料	3,020	51,913.80	0.10
336	002434	万里扬	5,800	51,910.00	0.10
337	000676	智度股份	7,400	51,874.00	0.10

338	688158	优刻得	2,746	51,844.48	0.10
339	688559	海目星	1,100	51,711.00	0.10
340	000555	神州信息	4,200	51,660.00	0.10
341	600577	精达股份	12,200	51,484.00	0.10
342	603128	华贸物流	5,640	51,380.40	0.10
343	605090	九丰能源	2,300	51,359.00	0.10
344	300406	九强生物	2,200	51,326.00	0.10
345	000811	冰轮环境	3,250	51,220.00	0.10
346	600720	祁连山	4,500	51,165.00	0.10
347	603368	柳药集团	2,070	51,149.70	0.10
348	000969	安泰科技	5,400	51,138.00	0.10
349	002737	葵花药业	2,100	51,114.00	0.10
349	688133	泰坦科技	600	51,114.00	0.10
350	600211	西藏药业	860	51,084.00	0.10
351	002847	盐津铺子	600	51,030.00	0.10
351	600428	中远海特	8,100	51,030.00	0.10
352	002413	雷科防务	9,700	50,731.00	0.10
353	600459	贵研铂业	3,296	50,428.80	0.10
354	002002	鸿达兴业	22,500	50,400.00	0.10
355	000902	新洋丰	4,900	50,372.00	0.10
356	603008	喜临门	2,000	50,360.00	0.10
357	002061	浙江交科	11,260	50,219.60	0.10
358	300171	东富龙	2,200	50,050.00	0.10
359	600688	上海石化	16,000	49,760.00	0.10
360	000650	仁和药业	8,100	49,734.00	0.10
361	300587	天铁股份	6,457	49,718.90	0.10
362	002773	康弘药业	2,600	49,712.00	0.10
363	603505	金石资源	2,128	49,688.80	0.10
364	300685	艾德生物	2,048	49,684.48	0.10
365	300443	金雷股份	1,400	49,630.00	0.10
366	300369	绿盟科技	4,000	49,480.00	0.10
367	688739	成大生物	1,500	49,440.00	0.10
368	300820	英杰电气	600	49,428.00	0.10
369	300087	荃银高科	4,780	49,425.20	0.10
370	600252	中恒集团	20,000	49,400.00	0.10
371	600477	杭萧钢构	12,070	49,366.30	0.10
372	002467	二六三	9,930	49,352.10	0.10
373	601311	骆驼股份	5,300	49,184.00	0.10
374	002960	青鸟消防	2,695	49,075.95	0.10
375	688239	航宇科技	700	48,965.00	0.10
376	600621	华鑫股份	4,600	48,898.00	0.10
377	600266	城建发展	9,600	48,768.00	0.10
378	688007	光峰科技	2,338	48,747.30	0.10

379	002060	粤水电	7,400	48,692.00	0.10
380	300323	华灿光电	7,100	48,635.00	0.10
381	600552	凯盛科技	4,100	48,544.00	0.09
382	605168	三人行	564	48,470.16	0.09
383	600776	东方通信	3,400	48,450.00	0.09
384	000685	中山公用	6,400	48,448.00	0.09
385	002171	楚江新材	6,800	48,416.00	0.09
386	000915	华特达因	1,370	48,347.30	0.09
387	688033	天宜上佳	2,526	48,297.12	0.09
388	002048	宁波华翔	3,600	48,240.00	0.09
389	601918	新集能源	11,300	48,025.00	0.09
390	600740	山西焦化	9,336	47,893.68	0.09
391	603393	新天然气	1,784	47,882.56	0.09
392	000582	北部湾港	6,300	47,880.00	0.09
393	002906	华阳集团	1,400	47,866.00	0.09
394	603118	共进股份	3,600	47,844.00	0.09
395	002214	大立科技	3,500	47,775.00	0.09
396	600059	古越龙山	4,600	47,748.00	0.09
397	000758	中色股份	10,100	47,672.00	0.09
398	002124	天邦食品	10,500	47,670.00	0.09
399	300623	捷捷微电	2,630	47,655.60	0.09
400	600098	广州发展	7,700	47,586.00	0.09
401	688321	微芯生物	2,100	47,544.00	0.09
402	002216	三全食品	3,050	47,519.00	0.09
403	601777	力帆科技	13,300	47,481.00	0.09
404	000539	粤电力 A	6,500	47,450.00	0.09
405	002428	云南锗业	3,900	47,424.00	0.09
406	000090	天健集团	9,400	47,376.00	0.09
407	600313	农发种业	5,500	47,355.00	0.09
408	000982	中银绒业	31,100	47,272.00	0.09
409	600729	重庆百货	1,500	47,160.00	0.09
410	002400	省广集团	9,800	47,138.00	0.09
411	000829	天音控股	5,200	47,008.00	0.09
412	300463	迈克生物	3,100	46,872.00	0.09
413	600210	紫江企业	8,800	46,816.00	0.09
414	603033	三维股份	2,300	46,805.00	0.09
415	600888	新疆众和	5,900	46,728.00	0.09
416	601200	上海环境	4,900	46,501.00	0.09
417	600635	大众公用	14,000	46,480.00	0.09
418	601952	苏垦农发	3,990	46,443.60	0.09
419	603043	广州酒家	1,640	46,346.40	0.09
420	002233	塔牌集团	6,000	46,320.00	0.09
421	301155	海力风电	600	46,248.00	0.09

422	603888	新华网	1,400	45,948.00	0.09
423	002583	海能达	7,900	45,899.00	0.09
424	002581	未名医药	2,400	45,816.00	0.09
425	002726	龙大美食	5,524	45,793.96	0.09
426	000989	九芝堂	3,305	45,741.20	0.09
427	002237	恒邦股份	4,200	45,738.00	0.09
428	688578	艾力斯	1,697	45,734.15	0.09
429	600502	安徽建工	8,656	45,703.68	0.09
430	002239	奥特佳	17,100	45,657.00	0.09
431	300224	正海磁材	3,550	45,653.00	0.09
432	600645	中源协和	2,700	45,630.00	0.09
433	600717	天津港	10,300	45,629.00	0.09
434	601369	陕鼓动力	5,000	45,550.00	0.09
435	000928	中钢国际	4,720	45,548.00	0.09
436	603906	龙蟠科技	2,500	45,375.00	0.09
437	600773	西藏城投	3,600	45,360.00	0.09
438	000851	高鸿股份	8,300	45,152.00	0.09
439	688711	宏微科技	770	44,921.80	0.09
440	000901	航天科技	4,193	44,865.10	0.09
441	601949	中国出版	3,800	44,840.00	0.09
442	000966	长源电力	8,000	44,640.00	0.09
443	600331	宏达股份	9,400	44,556.00	0.09
444	000923	河钢资源	3,300	44,550.00	0.09
445	002191	劲嘉股份	7,400	44,548.00	0.09
446	600366	宁波韵升	5,000	44,350.00	0.09
447	688091	上海谊众	600	44,178.00	0.09
448	002258	利尔化学	3,420	44,152.20	0.09
449	603801	志邦家居	1,336	44,114.72	0.09
450	300263	隆华科技	5,300	44,096.00	0.09
451	000767	晋控电力	13,900	44,063.00	0.09
452	002390	信邦制药	9,900	43,857.00	0.09
453	000735	罗牛山	6,700	43,818.00	0.09
454	603348	文灿股份	1,000	43,810.00	0.09
455	002859	洁美科技	1,580	43,766.00	0.09
456	600496	精工钢构	11,700	43,641.00	0.09
457	600305	恒顺醋业	4,016	43,613.76	0.09
458	603032	德新科技	1,260	43,520.40	0.09
459	688800	瑞可达	700	43,505.00	0.09
460	000627	天茂集团	14,500	43,500.00	0.08
461	605123	派克新材	400	43,460.00	0.08
462	603323	苏农银行	10,310	43,405.10	0.08
463	000059	华锦股份	6,900	43,401.00	0.08
464	300348	长亮科技	4,150	43,326.00	0.08

465	688326	经纬恒润	300	43,317.00	0.08
466	300358	楚天科技	2,900	43,297.00	0.08
467	600490	鹏欣资源	11,700	43,056.00	0.08
468	300131	英唐智控	8,200	43,050.00	0.08
469	688167	炬光科技	400	43,020.00	0.08
470	300027	华谊兄弟	15,400	42,966.00	0.08
471	002051	中工国际	3,600	42,948.00	0.08
472	301047	义翘神州	500	42,850.00	0.08
473	300811	铂科新材	720	42,796.80	0.08
474	002108	沧州明珠	9,442	42,772.26	0.08
475	603018	华设集团	4,888	42,770.00	0.08
476	002453	华软科技	4,000	42,760.00	0.08
477	603881	数据港	1,892	42,740.28	0.08
478	601963	重庆银行	5,400	42,714.00	0.08
479	000488	晨鸣纸业	8,800	42,680.00	0.08
480	000049	德赛电池	1,205	42,512.40	0.08
481	603169	兰石重装	5,700	42,408.00	0.08
482	600882	妙可蓝多	1,900	42,332.00	0.08
483	300634	彩讯股份	1,600	42,240.00	0.08
484	300409	道氏技术	3,360	42,235.20	0.08
485	600996	贵广网络	4,300	42,226.00	0.08
486	300770	新媒股份	920	42,191.20	0.08
487	002967	广电计量	2,100	42,189.00	0.08
488	002003	伟星股份	4,500	42,120.00	0.08
489	603896	寿仙谷	950	42,085.00	0.08
490	300366	创意信息	3,400	42,024.00	0.08
491	002163	海南发展	4,200	42,000.00	0.08
492	000913	钱江摩托	2,300	41,929.00	0.08
493	603566	普莱柯	1,800	41,850.00	0.08
494	300233	金城医药	2,200	41,822.00	0.08
495	688696	极米科技	300	41,817.00	0.08
496	300123	亚光科技	5,740	41,787.20	0.08
497	600246	万通发展	7,300	41,756.00	0.08
498	300738	奥飞数据	4,091	41,728.20	0.08
499	300352	北信源	8,275	41,706.00	0.08
500	603108	润达医疗	2,240	41,619.20	0.08
501	603533	掌阅科技	1,500	41,580.00	0.08
502	000727	冠捷科技	19,600	41,552.00	0.08
503	300428	立中集团	1,800	41,508.00	0.08
504	600811	东方集团	18,500	41,440.00	0.08
505	002626	金达威	2,200	41,338.00	0.08
506	600835	上海机电	2,400	41,232.00	0.08
507	000712	锦龙股份	3,300	41,184.00	0.08

508	001269	欧晶科技	560	41,176.80	0.08
509	688166	博瑞医药	1,865	41,011.35	0.08
510	600391	航发科技	1,700	40,987.00	0.08
511	603612	索通发展	2,360	40,898.80	0.08
512	300671	富满微	1,000	40,860.00	0.08
513	301031	中熔电气	300	40,713.00	0.08
514	000848	承德露露	4,600	40,710.00	0.08
515	300497	富祥药业	3,188	40,678.88	0.08
516	300596	利安隆	1,000	40,670.00	0.08
517	601619	嘉泽新能	8,900	40,495.00	0.08
518	002539	云图控股	4,500	40,410.00	0.08
519	002488	金固股份	5,850	40,365.00	0.08
520	002068	黑猫股份	3,400	40,358.00	0.08
521	601019	山东出版	4,400	40,348.00	0.08
522	300737	科顺股份	4,400	40,304.00	0.08
523	002537	海联金汇	5,980	40,245.40	0.08
524	000600	建投能源	5,200	40,196.00	0.08
525	300007	汉威科技	1,900	40,185.00	0.08
526	300613	富瀚微	708	40,171.92	0.08
527	002158	汉钟精机	1,600	39,936.00	0.08
528	300772	运达股份	3,100	39,928.00	0.08
529	688131	皓元医药	700	39,886.00	0.08
530	002416	爱施德	5,400	39,852.00	0.08
531	002041	登海种业	2,600	39,702.00	0.08
532	600531	豫光金铅	6,300	39,690.00	0.08
533	688686	奥普特	241	39,639.68	0.08
534	603187	海容冷链	1,980	39,580.20	0.08
535	002023	海特高新	4,300	39,560.00	0.08
536	603212	赛伍技术	1,900	39,539.00	0.08
537	301087	可孚医疗	800	39,440.00	0.08
538	002948	青岛银行	12,600	39,438.00	0.08
539	300856	科思股份	500	39,385.00	0.08
540	688676	金盘科技	1,300	39,377.00	0.08
541	600682	南京新百	4,900	39,249.00	0.08
542	600017	日照港	13,100	39,169.00	0.08
543	688261	东微半导	280	39,163.60	0.08
544	002101	广东鸿图	2,000	39,160.00	0.08
545	002639	雪人股份	4,700	39,151.00	0.08
546	603766	隆鑫通用	7,400	39,072.00	0.08
547	600223	福瑞达	3,800	38,988.00	0.08
548	688270	臻镭科技	600	38,958.00	0.08
549	688018	乐鑫科技	300	38,946.00	0.08
550	600675	中华企业	13,200	38,940.00	0.08

551	002498	汉缆股份	9,700	38,897.00	0.08
552	603567	珍宝岛	2,600	38,896.00	0.08
553	002226	江南化工	7,660	38,836.20	0.08
554	600491	龙元建设	7,700	38,808.00	0.08
555	600125	铁龙物流	6,400	38,656.00	0.08
556	600328	中盐化工	4,290	38,610.00	0.08
557	688298	东方生物	1,023	38,587.56	0.08
558	601801	皖新传媒	4,100	38,499.00	0.08
559	600458	时代新材	3,200	38,368.00	0.07
560	600864	哈投股份	7,500	38,325.00	0.07
561	300180	华峰超纤	10,600	38,266.00	0.07
562	002612	朗姿股份	1,600	38,048.00	0.07
563	300151	昌红科技	2,100	38,010.00	0.07
564	600295	鄂尔多斯	4,228	37,925.16	0.07
565	000688	国城矿业	2,500	37,925.00	0.07
566	300841	康华生物	575	37,886.75	0.07
567	600360	华微电子	5,500	37,840.00	0.07
568	688048	长光华芯	400	37,808.00	0.07
569	000016	深康佳 A	8,000	37,760.00	0.07
570	688232	新点软件	700	37,667.00	0.07
571	605376	博迁新材	1,200	37,656.00	0.07
572	600335	国机汽车	3,300	37,620.00	0.07
573	002215	诺普信	5,000	37,550.00	0.07
574	002611	东方精工	6,540	37,539.60	0.07
575	002243	力合科创	4,400	37,444.00	0.07
576	002895	川恒股份	1,900	37,430.00	0.07
577	300119	瑞普生物	2,100	37,380.00	0.07
578	000736	中交地产	2,600	37,310.00	0.07
579	002283	天润工业	5,800	37,236.00	0.07
580	603105	芯能科技	2,200	37,158.00	0.07
581	300630	普利制药	1,900	37,145.00	0.07
582	000795	英洛华	4,900	37,142.00	0.07
583	000567	海德股份	2,893	37,088.26	0.07
584	002421	达实智能	10,500	36,960.00	0.07
585	300598	诚迈科技	800	36,936.00	0.07
586	300382	斯莱克	2,800	36,932.00	0.07
587	300723	一品红	1,260	36,918.00	0.07
588	600340	华夏幸福	16,700	36,907.00	0.07
589	688575	亚辉龙	2,000	36,900.00	0.07
590	300319	麦捷科技	4,300	36,808.00	0.07
591	000756	新华制药	1,700	36,686.00	0.07
591	600775	南京熊猫	3,400	36,686.00	0.07
592	603636	南威软件	2,500	36,675.00	0.07

593	601882	海天精工	1,100	36,630.00	0.07
594	002097	山河智能	5,500	36,575.00	0.07
595	300039	上海凯宝	5,300	36,570.00	0.07
596	601028	玉龙股份	3,400	36,550.00	0.07
597	688680	海优新材	300	36,546.00	0.07
598	603666	亿嘉和	808	36,481.20	0.07
599	000927	中国铁物	13,100	36,418.00	0.07
600	002556	辉隆股份	5,000	36,300.00	0.07
601	000603	盛达资源	3,000	36,270.00	0.07
602	601011	宝泰隆	10,100	36,259.00	0.07
603	600075	新疆天业	7,680	36,172.80	0.07
604	002218	拓日新能	7,500	36,000.00	0.07
605	603171	税友股份	900	35,982.00	0.07
606	600610	中毅达	3,100	35,929.00	0.07
607	002697	红旗连锁	6,140	35,857.60	0.07
608	600649	城投控股	9,100	35,763.00	0.07
609	601606	长城军工	2,600	35,542.00	0.07
610	688389	普门科技	1,511	35,493.39	0.07
611	301078	孩子王	3,100	35,433.00	0.07
612	300696	爱乐达	1,440	35,424.00	0.07
613	001696	宗申动力	5,000	35,400.00	0.07
614	300662	科锐国际	1,000	35,370.00	0.07
615	002125	湘潭电化	2,800	35,308.00	0.07
616	300085	银之杰	3,000	35,280.00	0.07
617	600742	一汽富维	4,296	35,184.24	0.07
618	688277	天智航	1,905	35,128.20	0.07
619	003021	兆威机电	400	35,092.00	0.07
620	300821	东岳硅材	3,600	35,064.00	0.07
621	600971	恒源煤电	4,500	35,055.00	0.07
622	688123	聚辰股份	650	34,918.00	0.07
623	002043	兔宝宝	3,200	34,912.00	0.07
624	600006	东风汽车	5,900	34,869.00	0.07
625	002106	莱宝高科	4,100	34,850.00	0.07
626	300377	赢时胜	4,300	34,830.00	0.07
627	002573	清新环境	6,300	34,713.00	0.07
628	688100	威胜信息	1,164	34,698.84	0.07
629	600812	华北制药	6,200	34,658.00	0.07
630	300663	科蓝软件	2,550	34,654.50	0.07
631	000036	华联控股	8,410	34,649.20	0.07
632	002550	千红制药	6,700	34,572.00	0.07
633	300869	康泰医学	1,500	34,440.00	0.07
634	002840	华统股份	2,200	34,408.00	0.07
635	002242	九阳股份	2,300	34,385.00	0.07

636	300158	振东制药	6,000	34,380.00	0.07
637	600966	博汇纸业	5,800	34,336.00	0.07
638	000950	重药控股	5,100	34,323.00	0.07
639	600073	上海梅林	4,700	34,310.00	0.07
640	603919	金徽酒	1,460	34,280.80	0.07
641	300102	乾照光电	5,200	34,216.00	0.07
642	300973	立高食品	500	34,210.00	0.07
643	600108	亚盛集团	11,300	34,126.00	0.07
644	605507	国邦医药	1,600	34,032.00	0.07
645	002928	华夏航空	4,025	34,011.25	0.07
646	600787	中储股份	6,300	33,957.00	0.07
647	001301	尚太科技	600	33,786.00	0.07
648	002733	雄韬股份	1,950	33,715.50	0.07
649	601528	瑞丰银行	6,940	33,659.00	0.07
650	002987	京北方	1,535	33,647.20	0.07
651	000552	甘肃能化	10,100	33,633.00	0.07
652	603936	博敏电子	2,800	33,600.00	0.07
653	603985	恒润股份	1,600	33,552.00	0.07
654	000990	诚志股份	4,400	33,528.00	0.07
655	688202	美迪西	392	33,418.00	0.07
656	002349	精华制药	3,700	33,411.00	0.07
657	600929	雪天盐业	4,200	33,348.00	0.07
658	002440	闰土股份	4,996	33,323.32	0.07
659	300284	苏交科	5,552	33,312.00	0.07
660	002206	海利得	6,200	33,232.00	0.06
661	600770	综艺股份	5,900	33,217.00	0.06
662	002489	浙江永强	8,200	33,210.00	0.06
663	002545	东方铁塔	4,700	33,182.00	0.06
664	300761	立华股份	1,800	33,174.00	0.06
665	688798	艾为电子	560	33,124.00	0.06
666	002635	安洁科技	2,400	33,120.00	0.06
667	301095	广立微	400	33,060.00	0.06
668	600789	鲁抗医药	5,140	32,998.80	0.06
669	300639	凯普生物	3,293	32,995.86	0.06
670	603871	嘉友国际	2,100	32,991.00	0.06
671	002135	东南网架	5,100	32,946.00	0.06
672	688148	芳源股份	2,700	32,940.00	0.06
673	603229	奥翔药业	1,568	32,896.64	0.06
674	002367	康力电梯	3,600	32,868.00	0.06
675	600480	凌云股份	4,180	32,854.80	0.06
676	603098	森特股份	1,600	32,800.00	0.06
677	002234	民和股份	1,800	32,778.00	0.06
678	300527	中船应急	3,443	32,708.50	0.06

679	000557	西部创业	6,200	32,674.00	0.06
680	688586	江航装备	2,346	32,632.86	0.06
681	300080	易成新能	6,400	32,576.00	0.06
682	301238	瑞泰新材	1,600	32,544.00	0.06
683	300401	花园生物	2,800	32,536.00	0.06
684	600172	黄河旋风	7,600	32,528.00	0.06
685	002017	东信和平	2,470	32,381.70	0.06
686	688268	华特气体	400	32,292.00	0.06
687	002274	华昌化工	4,300	32,207.00	0.06
688	000801	四川九洲	4,400	32,120.00	0.06
689	300767	震安科技	1,264	32,055.04	0.06
690	600163	中闽能源	5,700	31,806.00	0.06
691	301219	腾远钴业	850	31,756.00	0.06
692	300143	盈康生命	2,800	31,752.00	0.06
693	002194	武汉凡谷	2,900	31,697.00	0.06
694	603959	百利科技	2,756	31,694.00	0.06
695	300900	广联航空	1,100	31,691.00	0.06
696	600710	苏美达	3,700	31,672.00	0.06
697	300206	理邦仪器	2,100	31,668.00	0.06
698	300887	谱尼测试	800	31,664.00	0.06
699	301216	万凯新材	1,900	31,597.00	0.06
700	000672	上峰水泥	3,460	31,589.80	0.06
701	600058	五矿发展	3,200	31,456.00	0.06
702	301080	百普赛斯	500	31,410.00	0.06
703	300765	新诺威	2,432	31,348.48	0.06
704	603733	仙鹤股份	1,500	31,275.00	0.06
705	600449	宁夏建材	2,000	31,120.00	0.06
706	600955	维远股份	1,600	31,088.00	0.06
707	600751	海航科技	13,100	31,047.00	0.06
708	000088	盐田港	6,400	31,040.00	0.06
709	603595	东尼电子	724	31,001.68	0.06
710	300055	万邦达	4,300	30,960.00	0.06
711	000560	我爱我家	11,680	30,952.00	0.06
712	300455	航天智装	2,700	30,915.00	0.06
713	600508	上海能源	2,100	30,828.00	0.06
714	300735	光弘科技	2,866	30,666.20	0.06
715	300894	火星人	1,200	30,648.00	0.06
716	002055	得润电子	3,200	30,592.00	0.06
717	688508	芯朋微	527	30,560.73	0.06
718	600648	外高桥	2,700	30,537.00	0.06
719	301015	百洋医药	1,100	30,536.00	0.06
720	301069	凯盛新材	1,200	30,528.00	0.06
720	301308	江波龙	300	30,528.00	0.06

721	600169	太原重工	12,300	30,504.00	0.06
722	000612	焦作万方	6,300	30,492.00	0.06
723	000652	泰达股份	7,400	30,488.00	0.06
724	002979	雷赛智能	1,280	30,412.80	0.06
725	002929	润建股份	700	30,387.00	0.06
726	002741	光华科技	1,800	30,384.00	0.06
727	601886	江河集团	3,400	30,226.00	0.06
728	601929	吉视传媒	16,400	30,176.00	0.06
729	000498	山东路桥	4,700	30,174.00	0.06
730	300477	合纵科技	6,460	30,168.20	0.06
731	601702	华峰铝业	2,200	30,096.00	0.06
732	300267	尔康制药	9,300	30,039.00	0.06
733	600284	浦东建设	4,900	29,988.00	0.06
734	603583	捷昌驱动	1,392	29,983.68	0.06
735	600575	淮河能源	11,700	29,952.00	0.06
736	603113	金能科技	3,700	29,933.00	0.06
737	002204	大连重工	5,800	29,812.00	0.06
738	603363	傲农生物	3,250	29,802.50	0.06
739	600639	浦东金桥	2,400	29,784.00	0.06
740	000718	苏宁环球	10,900	29,757.00	0.06
741	000006	深振业 A	6,800	29,716.00	0.06
742	688198	佰仁医疗	280	29,710.80	0.06
743	600308	华泰股份	7,980	29,685.60	0.06
744	603730	岱美股份	1,878	29,672.40	0.06
745	603301	振德医疗	1,000	29,620.00	0.06
746	002664	信质集团	2,100	29,568.00	0.06
747	000566	海南海药	5,900	29,500.00	0.06
748	300953	震裕科技	400	29,452.00	0.06
749	603489	八方股份	420	29,450.40	0.06
750	301239	普瑞眼科	300	29,424.00	0.06
751	002941	新疆交建	1,900	29,412.00	0.06
752	002759	天际股份	2,100	29,358.00	0.06
753	603010	万盛股份	2,700	29,349.00	0.06
754	000048	京基智农	1,500	29,280.00	0.06
755	002746	仙坛股份	3,715	29,274.20	0.06
756	002461	珠江啤酒	3,300	29,073.00	0.06
757	600643	爱建集团	5,800	29,000.00	0.06
758	300768	迪普科技	1,750	28,997.50	0.06
759	601515	东风股份	6,620	28,995.60	0.06
760	002320	海峡股份	4,800	28,992.00	0.06
761	603328	依顿电子	3,500	28,980.00	0.06
762	605020	永和股份	1,120	28,907.20	0.06
763	002190	成飞集成	1,300	28,782.00	0.06

764	603466	风语筑	2,063	28,675.70	0.06
765	002815	崇达技术	2,300	28,635.00	0.06
766	000935	四川双马	1,700	28,628.00	0.06
767	600217	中再资环	6,000	28,620.00	0.06
768	002307	北新路桥	5,700	28,500.00	0.06
769	002932	明德生物	1,100	28,479.00	0.06
770	000828	东莞控股	3,100	28,365.00	0.06
771	002646	天佑德酒	2,100	28,329.00	0.06
772	003012	东鹏控股	3,500	28,315.00	0.06
773	001213	中铁特货	6,400	28,224.00	0.06
774	600810	神马股份	3,960	28,155.60	0.06
775	000061	农产品	4,700	28,153.00	0.06
776	600691	阳煤化工	8,900	28,035.00	0.05
777	600662	外服控股	4,900	28,028.00	0.05
778	000881	中广核技	3,400	27,982.00	0.05
779	603915	国茂股份	1,320	27,957.60	0.05
780	603920	世运电路	1,430	27,927.90	0.05
781	601609	金田股份	4,300	27,907.00	0.05
782	688733	壹石通	900	27,864.00	0.05
783	688383	新益昌	200	27,844.00	0.05
784	600550	保变电气	5,500	27,720.00	0.05
785	002201	正威新材	2,912	27,693.12	0.05
786	300134	大富科技	2,700	27,675.00	0.05
787	002088	鲁阳节能	1,500	27,660.00	0.05
788	603387	基蛋生物	2,142	27,610.38	0.05
789	002549	凯美特气	2,400	27,600.00	0.05
790	300792	壹网壹创	1,000	27,570.00	0.05
791	002310	东方园林	16,200	27,540.00	0.05
792	300653	正海生物	800	27,512.00	0.05
793	600997	开滦股份	4,600	27,462.00	0.05
794	300579	数字认证	950	27,455.00	0.05
795	601015	陕西黑猫	6,200	27,404.00	0.05
796	603123	翠微股份	2,800	27,272.00	0.05
797	000968	蓝焰控股	3,600	27,216.00	0.05
798	600783	鲁信创投	2,100	27,153.00	0.05
799	002993	奥海科技	800	27,136.00	0.05
800	688238	和元生物	2,400	27,096.00	0.05
801	002810	山东赫达	1,500	27,000.00	0.05
802	002534	西子洁能	1,600	26,880.00	0.05
803	688499	利元亨	420	26,678.40	0.05
804	002516	旷达科技	5,500	26,620.00	0.05
805	301090	华润材料	2,100	26,502.00	0.05
806	300183	东软载波	1,600	26,416.00	0.05

807	603995	甬金股份	1,100	26,301.00	0.05
808	000062	深圳华强	2,300	26,266.00	0.05
809	603396	金辰股份	400	26,240.00	0.05
810	002589	瑞康医药	7,700	26,180.00	0.05
811	000546	ST 金圆	4,100	26,117.00	0.05
812	300607	拓斯达	1,736	26,092.08	0.05
813	000789	万年青	3,350	25,962.50	0.05
814	600007	中国国贸	1,400	25,928.00	0.05
815	300602	飞荣达	1,669	25,852.81	0.05
816	600657	信达地产	6,100	25,803.00	0.05
817	600874	创业环保	4,400	25,784.00	0.05
818	688526	科前生物	1,083	25,764.57	0.05
819	002645	华宏科技	2,100	25,746.00	0.05
820	002314	南山控股	7,800	25,740.00	0.05
821	002302	西部建设	3,600	25,704.00	0.05
822	601069	西部黄金	2,000	25,680.00	0.05
823	600990	四创电子	810	25,628.40	0.05
824	688789	宏华数科	290	25,615.70	0.05
825	301217	铜冠铜箔	1,800	25,614.00	0.05
826	300191	潜能恒信	1,400	25,592.00	0.05
827	600984	建设机械	5,660	25,583.20	0.05
828	603609	禾丰股份	2,800	25,480.00	0.05
829	002267	陕天然气	3,200	25,344.00	0.05
830	688085	三友医疗	965	25,340.90	0.05
831	002034	旺能环境	1,600	25,296.00	0.05
832	603877	太平鸟	1,000	25,280.00	0.05
833	600523	贵航股份	1,760	25,273.60	0.05
834	688366	昊海生科	300	25,266.00	0.05
835	688206	概伦电子	900	25,236.00	0.05
836	000791	甘肃能源	4,820	25,208.60	0.05
837	601921	浙版传媒	2,900	25,201.00	0.05
838	002959	小熊电器	300	25,050.00	0.05
839	002481	双塔食品	5,600	24,976.00	0.05
840	600184	光电股份	1,900	24,947.00	0.05
841	600696	岩石股份	1,000	24,890.00	0.05
842	600604	市北高新	5,300	24,804.00	0.05
843	603416	信捷电气	600	24,786.00	0.05
844	301089	拓新药业	400	24,776.00	0.05
845	603281	江瀚新材	800	24,704.00	0.05
846	301165	锐捷网络	400	24,688.00	0.05
847	601101	昊华能源	4,200	24,444.00	0.05
848	301267	华夏眼科	400	24,380.00	0.05
849	300702	天宇股份	1,000	24,270.00	0.05

850	002768	国恩股份	1,000	24,190.00	0.05
851	002891	中宠股份	1,000	24,140.00	0.05
852	688337	普源精电	400	24,104.00	0.05
853	000885	城发环境	1,800	23,958.00	0.05
854	688315	诺禾致源	900	23,895.00	0.05
855	603989	艾华集团	1,130	23,797.80	0.05
856	301327	华宝新能	300	23,733.00	0.05
857	603520	司太立	1,420	23,685.60	0.05
858	003040	楚天龙	1,300	23,582.00	0.05
859	002285	世联行	9,200	23,552.00	0.05
860	300783	三只松鼠	1,200	23,448.00	0.05
861	603060	国检集团	2,224	23,263.04	0.05
862	688776	国光电气	280	23,206.40	0.05
863	002991	甘源食品	300	23,010.00	0.04
864	300091	金通灵	7,720	23,005.60	0.04
865	002913	奥士康	600	22,908.00	0.04
866	002435	长江健康	4,700	22,889.00	0.04
867	600746	江苏索普	3,500	22,855.00	0.04
868	601700	风范股份	4,300	22,833.00	0.04
869	002344	海宁皮城	4,800	22,704.00	0.04
870	600581	八一钢铁	5,600	22,680.00	0.04
871	603719	良品铺子	900	22,509.00	0.04
872	603718	海利生物	2,385	22,490.55	0.04
873	002053	云南能投	2,000	22,440.00	0.04
874	000761	本钢板材	5,600	22,400.00	0.04
875	600876	凯盛新能	1,400	22,344.00	0.04
876	000597	东北制药	4,300	22,317.00	0.04
877	688660	电气风电	4,000	22,280.00	0.04
878	603055	台华新材	2,000	22,220.00	0.04
879	601330	绿色动力	3,000	22,170.00	0.04
880	002990	盛视科技	600	22,080.00	0.04
881	688127	蓝特光学	1,251	22,055.13	0.04
882	600400	红豆股份	6,700	21,976.00	0.04
883	603299	苏盐井神	2,200	21,956.00	0.04
884	300208	青岛中程	2,650	21,942.00	0.04
885	688190	云路股份	300	21,900.00	0.04
886	002838	道恩股份	1,300	21,840.00	0.04
887	000737	北方铜业	4,000	21,560.00	0.04
888	002782	可立克	1,400	21,406.00	0.04
889	301206	三元生物	600	20,994.00	0.04
890	688356	键凯科技	197	20,990.35	0.04
891	300204	舒泰神	2,100	20,895.00	0.04
892	002641	公元股份	3,700	20,868.00	0.04

893	000550	江铃汽车	1,500	20,760.00	0.04
894	301060	兰卫医学	1,200	20,748.00	0.04
895	000517	荣安地产	6,800	20,740.00	0.04
896	003006	百亚股份	1,200	20,736.00	0.04
897	688173	希荻微	900	20,592.00	0.04
898	301175	中科环保	3,300	20,559.00	0.04
899	002677	浙江美大	1,940	20,544.60	0.04
900	000029	深深房 A	1,900	20,539.00	0.04
901	603439	贵州三力	1,200	20,472.00	0.04
902	003032	传智教育	1,400	20,398.00	0.04
903	002636	金安国纪	2,200	20,306.00	0.04
904	001338	永顺泰	1,100	20,284.00	0.04
905	603938	三孚股份	1,020	20,185.80	0.04
906	000025	特力 A	1,100	20,097.00	0.04
907	002378	章源钨业	3,440	20,020.80	0.04
908	001258	立新能源	2,100	19,929.00	0.04
909	603071	物产环能	1,200	19,908.00	0.04
910	603601	再升科技	4,640	19,812.80	0.04
911	000813	德展健康	6,700	19,698.00	0.04
912	688233	神工股份	621	19,611.18	0.04
913	688318	财富趋势	196	19,594.12	0.04
914	603429	集友股份	2,208	19,562.88	0.04
915	603983	丸美股份	600	19,410.00	0.04
916	688330	宏力达	553	19,399.24	0.04
917	603916	苏博特	1,460	19,330.40	0.04
918	603025	大豪科技	1,560	19,281.60	0.04
919	002978	安宁股份	600	19,266.00	0.04
920	001270	铖昌科技	220	19,206.00	0.04
921	002950	奥美医疗	1,850	19,203.00	0.04
922	605009	豪悦护理	400	19,200.00	0.04
923	600935	华塑股份	5,100	19,125.00	0.04
924	300755	华致酒行	840	18,874.80	0.04
925	600510	黑牡丹	3,100	18,817.00	0.04
926	002946	新乳业	1,300	18,655.00	0.04
927	000030	富奥股份	3,700	18,648.00	0.04
928	605222	起帆电缆	900	18,594.00	0.04
929	000019	深粮控股	2,500	18,550.00	0.04
930	300485	赛升药业	1,800	18,414.00	0.04
931	003009	中天火箭	300	18,075.00	0.04
932	002918	蒙娜丽莎	1,170	18,064.80	0.04
933	002651	利君股份	2,300	17,871.00	0.03
934	603693	江苏新能	1,270	17,780.00	0.03
935	600841	动力新科	2,900	17,690.00	0.03

936	605338	巴比食品	700	17,675.00	0.03
937	688161	威高骨科	400	17,324.00	0.03
938	600569	安阳钢铁	8,700	17,313.00	0.03
939	603013	亚普股份	1,100	17,248.00	0.03
940	603208	江山欧派	468	17,044.56	0.03
941	300860	锋尚文化	300	16,632.00	0.03
942	605333	沪光股份	1,000	16,540.00	0.03
943	002695	煌上煌	1,500	16,035.00	0.03
944	603297	永新光学	200	15,980.00	0.03
945	600370	三房巷	5,900	15,812.00	0.03
946	002724	海洋王	1,800	15,624.00	0.03
947	301171	易点天下	700	15,470.00	0.03
948	688128	中国电研	600	15,300.00	0.03
949	003039	顺控发展	900	15,264.00	0.03
950	605388	均瑶健康	1,200	15,252.00	0.03
951	600618	氯碱化工	1,700	15,249.00	0.03
952	301301	川宁生物	1,700	15,232.00	0.03
953	300942	易瑞生物	1,200	14,988.00	0.03
954	301207	华兰疫苗	450	14,967.00	0.03
955	000011	深物业 A	1,600	14,864.00	0.03
956	301367	怡和嘉业	100	14,834.00	0.03
957	600403	大有能源	3,600	14,796.00	0.03
958	600903	贵州燃气	1,700	14,705.00	0.03
959	688153	唯捷创芯	200	14,632.00	0.03
960	688699	明微电子	290	14,592.80	0.03
961	002961	瑞达期货	1,000	14,410.00	0.03
962	688001	华兴源创	400	14,168.00	0.03
963	603093	南华期货	1,300	14,157.00	0.03
964	605007	五洲特纸	900	13,644.00	0.03
965	605199	葫芦娃	900	13,626.00	0.03
966	000058	深赛格	2,200	13,596.00	0.03
967	001322	箭牌家居	800	13,392.00	0.03
968	301363	美好医疗	300	13,197.00	0.03
969	603053	成都燃气	1,300	13,091.00	0.03
970	605008	长鸿高科	900	12,834.00	0.03
971	688368	晶丰明源	100	12,721.00	0.02
972	301268	铭利达	300	12,561.00	0.02
973	601068	中铝国际	2,300	12,328.00	0.02
974	001236	弘业期货	800	12,264.00	0.02
975	301200	大族数控	300	11,964.00	0.02
976	002287	奇正藏药	500	11,950.00	0.02
977	001308	康冠科技	420	11,533.20	0.02
978	301177	迪阿股份	300	11,529.00	0.02

979	002911	佛燃能源	880	11,316.80	0.02
980	605369	拱东医疗	200	11,208.00	0.02
981	300981	中红医疗	732	11,089.80	0.02
982	688399	硕世生物	200	11,040.00	0.02
983	601022	宁波远洋	1,000	10,390.00	0.02
984	001323	慕思股份	300	10,188.00	0.02
985	605296	神农集团	460	9,853.20	0.02
986	603235	天新药业	300	9,408.00	0.02
987	603530	神马电力	600	9,330.00	0.02
988	603132	金徽股份	800	9,072.00	0.02
989	601279	英利汽车	1,600	8,864.00	0.02
990	603103	横店影视	480	8,083.20	0.02
991	603057	紫燕食品	300	7,539.00	0.01
992	301180	万祥科技	400	7,012.00	0.01
993	301316	慧博云通	300	6,855.00	0.01
994	603170	宝立食品	300	6,378.00	0.01
995	605365	立达信	400	5,992.00	0.01
996	688046	药康生物	300	5,817.00	0.01

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

本基金本报告期末未持有积极部分的股票投资。

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	603345	安井食品	228,170.00	0.47
2	300502	新易盛	215,276.00	0.44
3	300002	神州泰岳	187,050.00	0.38
4	002405	四维图新	176,715.00	0.36
5	002176	江特电机	152,588.00	0.31
6	000933	神火股份	151,484.00	0.31
7	688516	奥特维	144,564.47	0.30
8	600559	老白干酒	140,701.00	0.29
9	002463	沪电股份	132,137.00	0.27
10	688037	芯源微	127,431.00	0.26
11	002240	盛新锂能	125,874.00	0.26
12	000423	东阿阿胶	121,587.00	0.25
13	002044	美年健康	120,479.00	0.25
14	600872	中炬高新	120,236.00	0.25
15	002436	兴森科技	118,413.00	0.24
16	300118	东方日升	107,813.00	0.22
17	000818	航锦科技	107,557.00	0.22

18	300459	汤姆猫	107,222.00	0.22
19	300339	润和软件	106,949.00	0.22
20	300068	南都电源	106,798.00	0.22

注：买入金额不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002463	沪电股份	359,808.00	0.74
2	000933	神火股份	308,191.00	0.63
3	000423	东阿阿胶	298,560.00	0.61
4	002240	盛新锂能	273,334.00	0.56
5	300395	菲利华	236,544.50	0.49
6	300118	东方日升	226,613.00	0.47
7	688516	奥特维	213,133.58	0.44
8	002432	九安医疗	210,387.00	0.43
9	300438	鹏辉能源	200,948.00	0.41
10	300487	蓝晓科技	194,380.00	0.40
11	002405	四维图新	185,770.00	0.38
12	300502	新易盛	175,877.00	0.36
13	603338	浙江鼎力	164,463.00	0.34
14	600481	双良节能	158,081.00	0.33
15	600416	湘电股份	154,451.00	0.32
16	600559	老白干酒	146,998.00	0.30
17	000893	亚钾国际	145,441.00	0.30
18	002176	江特电机	141,907.00	0.29
19	300459	汤姆猫	137,690.00	0.28
20	002487	大金重工	133,788.00	0.28

注：卖出金额不包括相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	42,647,130.94
卖出股票收入（成交）总额	41,647,122.00

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资于股指期货多头进行现货替代，在期指负基差时通过长期持有而获得负基差逐渐收敛的好处，利用股指期货提高投资效率，更有效地实现本基金的投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 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**

华宝中证 1000 指数截止 2023 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，中炬高新技术实业(集团)股份有限公司因披露重大诉讼事项、控股股东司法拍卖事项；于 2023 年 02 月 01 日收到上海证券交易所监管工作函的处罚措施。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和视为，认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响，因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内，本基金投资的前十名证券的其余的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	15,630.36
2	应收清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	42,413.85
6	其他应收款	6,366.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	64,410.21

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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

本基金本报告期末未持有积极投资部分的股票投资。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
华宝中证 1000 指数	3,623	10,478.89	2,077,746.60	5.47	35,887,282.81	94.53
华宝中证 1000 指数 C	607	22,776.84	4,915,188.89	35.55	8,910,350.54	64.45
合计	4,230	12,243.63	6,992,935.49	13.50	44,797,633.35	86.50

8.2 期末上市基金前十名持有人

华宝中证 1000 指数

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	傅文琪	456,537.00	39.37
2	祝东华	100,540.00	8.67

3	杨玉锋	79,623.00	6.87
4	陈秀萍	41,846.00	3.61
5	张绍桓	36,509.00	3.15
6	孙大威	35,466.00	3.06
7	杨应该	26,181.00	2.26
8	王跃文	25,681.00	2.21
9	张高渝	23,264.00	2.01
10	赵磊	20,922.00	1.80
11	刘萍	20,922.00	1.80

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	华宝中证 1000 指数	0.00	0.0000
	华宝中证 1000 指数 C	935.45	0.0068
	合计	935.45	0.0018

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝中证 1000 指数	华宝中证 1000 指数 C
基金合同生效日 (2020 年 11 月 19 日) 基金份额总额	41,884,507.09	-
本报告期期初基金份额总额	42,492,020.01	9,023,033.68
本报告期基金总申购份额	6,859,781.01	53,226,521.47
减：本报告期基金总赎回份额	11,386,771.61	48,424,015.72
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	37,965,029.41	13,825,539.43
-------------	---------------	---------------

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、基金管理人的重大人事变动
本报告期内，基金管理人无重大人事变动。
- 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动
本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

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、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：自 2022 年 12 月 23 日起至本报告期末。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关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 (%)	

东方证券	2	41,465,293.14	49.23	38,616.40	49.27	-
光大证券	1	30,896,140.36	36.68	28,776.90	36.72	-
财通证券	2	11,506,945.38	13.66	10,645.67	13.58	-
大和证券	1	359,107.00	0.43	330.83	0.42	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	3	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海 证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
高盛（中 国）证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-

山西证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金国际	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准：资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需 要，并能为本基金提供全面的信息服 务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

(2) 选择程序：(a) 服务评价；(b) 拟定备选交易单元；(c) 签约。

2、本报告期租用的证券公司交易单元新增的有：中邮证券、江海证券、华鑫证券、财通证券、大和证券；退租交易单元：宏信证券。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	华宝基金关于旗下部分基金新增东方财富证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-01-09
2	华宝基金关于旗下部分基金新增兴业银行股份有限公司(银银平台)为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-01-13
3	华宝中证 1000 指数证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2023-01-19
4	华宝基金关于旗下部分基金新增南京证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-03-01
5	华宝中证 1000 指数证券投资基金 2022 年年度报告	基金管理人网站	2023-03-31
6	华宝基金关于旗下部分基金新增兴业证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-04-19
7	华宝基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-04-22
8	华宝中证 1000 指数证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2023-04-23
9	华宝基金关于旗下部分基金新增平安银行股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-05-05
10	华宝基金关于旗下部分基金新增麦高证券有限责任公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-05-08
11	华宝基金关于旗下部分基金新增上海陆享基金销售有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-05-10
12	华宝基金关于旗下部分基金新增上海证券有限责任公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-06-20
13	华宝基金关于旗下部分基金新增德邦证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-06-29

§ 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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

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

12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

12.3 查阅方式

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

华宝基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日