

# 华宝中证 1000 指数证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：2024 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 2024 年 08 月 28 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
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	10
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	11
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	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>35</b>
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	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	62

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 .....	63
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>64</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	64
8.3 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
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>65</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>65</b>
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 .....	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	66
10.8 其他重大事件 .....	68
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>68</b>
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 .....	69
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>69</b>
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	47,828,934.57 份	
基金合同存续期	不定期	
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	37,666,710.71 份	10,162,223.86 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 $\times$ 95% + 同期银行活期存款利率（税后） $\times$ 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	张金良

## 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(2024 年 1 月 1 日-2024 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	-1,421,920.21	-445,589.87
本期利润	-5,433,011.51	-1,352,464.60
加权平均基金份额 本期利润	-0.1426	-0.1120
本期加权平均净 值利润率	-17.67%	-13.95%
本期基金份额净 值增长率	-15.42%	-15.54%
3.1.2 期末数	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	

据和指标		
期末可供分配利润	-68,295,654.40	-18,480,686.98
期末可供分配基金份额利润	-1.8132	-1.8186
期末基金资产净值	28,223,643.21	7,569,612.88
期末基金份额净值	0.7493	0.7449
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-24.75%	-30.32%

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	-7.70%	1.34%	-8.15%	1.36%	0.45%	-0.02%
过去三个月	-8.81%	1.40%	-9.51%	1.42%	0.70%	-0.02%
过去六个月	-15.42%	1.85%	-15.97%	1.87%	0.55%	-0.02%
过去一年	-24.23%	1.45%	-24.61%	1.47%	0.38%	-0.02%
过去三年	-29.37%	1.34%	-29.31%	1.36%	-0.06%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-24.75%	1.29%	-25.23%	1.31%	0.48%	-0.02%

华宝中证 1000 指数 C

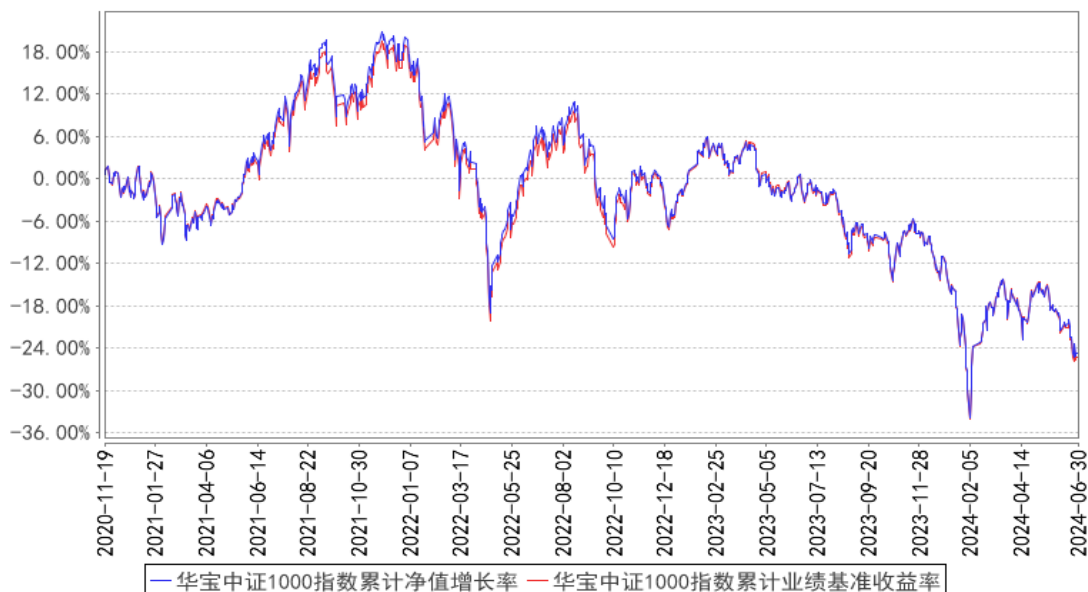
阶段	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①—③	②—④
----	-----	------	-------	--------	-----	-----

	值增长率①	增长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	-7.72%	1.35%	-8.15%	1.36%	0.43%	-0.01%
过去三个月	-8.88%	1.40%	-9.51%	1.42%	0.63%	-0.02%
过去六个月	-15.54%	1.85%	-15.97%	1.87%	0.43%	-0.02%
过去一年	-24.47%	1.45%	-24.61%	1.47%	0.14%	-0.02%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-30.32%	1.26%	-29.35%	1.28%	-0.97%	-0.02%

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）。

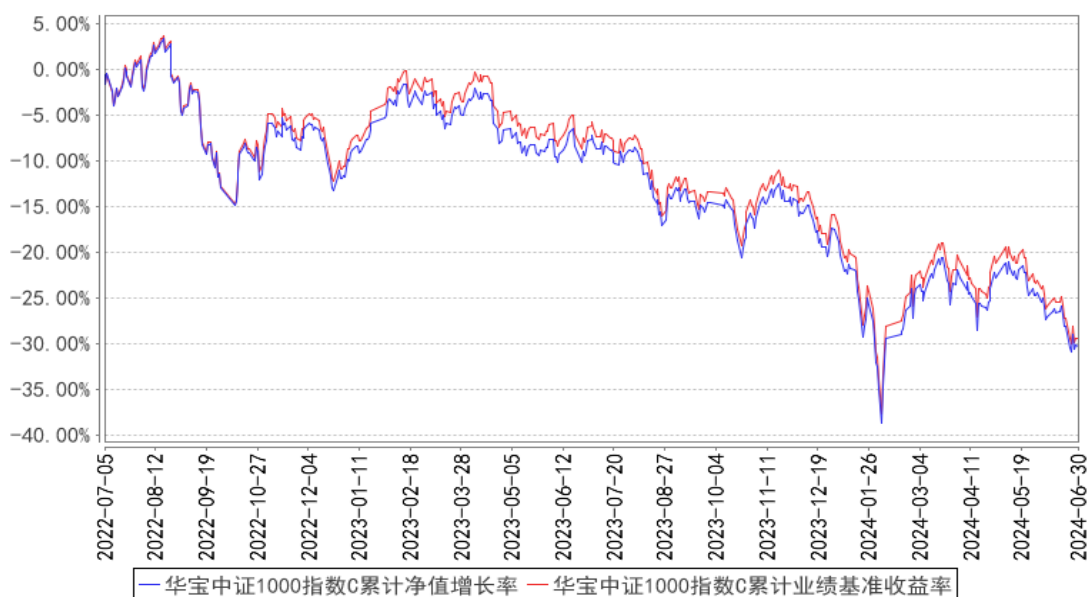
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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。截至本报告期末（2024 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 141 只，涵盖股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金、FOF 等。

#### 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	-	15 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

					<p>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。</p>
--	--	--	--	--	---

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合规守信情况的说明

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

2024 年上半年，外部环境变化带来的不利影响增多，国内有效需求不足，经济运行出现分化，新旧动能转换存在阵痛。A 股市场 1 月受资金面影响市场明显下行，中小市值指数领跌，拖累上证指数 2 月初一度跌破 2700 点，形成短期杀跌行情，2 月 6 日开始市场中小市值宽基指数成分股显现资金流入迹象，市场在一系列稳增长政策、资本市场政策和“国家队”入市的支撑下反弹，投资者情绪逐渐修复，之前跌幅明显的中证 1000 指数在反弹过程中涨幅也多于大中市值的宽基指数。5 月两市成交持续走弱，地缘局势持续发酵，反弹告一段落，6 月伊始，随着国内经济数据显示我国增长修复仍需稳增长政策加码，A 股换手率下行，受汇率及北向流出影响，沪深 300 指数和上证指数连续 6 周回落，市场风险偏好低迷。在资本市场严监管背景下，小盘微盘股波动放大。

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-15.42%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为-15.54%；同期业绩比较基准收益率为-15.97%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年中央要求宏观政策要持续用力、更加给力，及早储备并适时推出一批增量政策举措。因地制宜发展新质生产力，不断增强新动能新优势，深入挖掘内需潜力，以提振消费为重点扩大国内需求。在美联储降息周期的可见度提高下，国内再次降息降准的可能性增加，而市场无风险利率持续走低，中证 1000 为代表的中小盘指数对于市场的风险偏好及流动性边际变化反应敏感，在海外和宏观资金面因素改善的背景下，作为弹性品种有望受益于 A 股风险偏好提升。

#### 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、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

本基金本报告期亏损，未有应分未分的利润。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	2,278,942.51	3,348,279.85
结算备付金		3,920.82	3,334.71
存出保证金		1,882.11	2,080.80
交易性金融资产	6.4.7.2	33,656,499.40	42,615,179.57
其中：股票投资		33,656,499.40	42,615,179.57
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		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		79,034.08	191,309.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		36,020,278.92	46,160,184.38
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	491,590.17
应付赎回款		85,314.69	356,514.66
应付管理人报酬		15,289.21	19,121.21
应付托管费		3,057.83	3,824.25
应付销售服务费		1,951.39	2,552.31
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	6.4.7.6	121,409.71	215,597.64
负债合计		227,022.83	1,089,200.24
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	114,309,449.75	121,713,014.12
未分配利润	6.4.7.8	-78,516,193.66	-76,642,029.98
净资产合计		35,793,256.09	45,070,984.14
负债和净资产总计		36,020,278.92	46,160,184.38

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 47,828,934.57 份，其中华宝中证 1000 指数基金份额总额 37,666,710.71 份，基金份额净值 0.7493 元；华宝中证 1000 指数 C 基金份额总额 10,162,223.86 份，基金份额净值 0.7449 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-6,508,003.89	3,388,907.91
1. 利息收入		7,032.05	10,257.03
其中：存款利息收入	6.4.7.9	7,032.05	10,257.03
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,603,194.63	901,615.23
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,967,676.91	401,653.36
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	135,262.85
股利收益	6.4.7.15	364,482.28	364,699.02
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.16	-4,917,966.03	2,460,881.23
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	6,124.72	16,154.42
<b>减：二、营业总支出</b>		277,472.22	334,352.06
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	100,202.27	139,925.01
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	20,040.45	27,984.99
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	14,379.96	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	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	488.76
8. 其他费用	6.4.7.19	142,849.54	144,700.98
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		-6,785,476.11	3,054,555.85
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		-6,785,476.11	3,054,555.85
<b>五、其他综合收益的税后 净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-6,785,476.11	3,054,555.85

### 6.3 净资产变动表

会计主体：华宝中证 1000 指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	121,713,014.12	-	-76,642,029.98	45,070,984.14

二、本期期初净资产	121,713,014.12	-	-76,642,029.98	45,070,984.14
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-7,403,564.37	-	-1,874,163.68	-9,277,728.05
(一)、综合收益总额	-	-	-6,785,476.11	-6,785,476.11
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-7,403,564.37	-	4,911,312.43	-2,492,251.94
其中：1. 基金申购款	115,461,779.71	-	-76,575,174.27	38,886,605.44
2. 基金赎回款	-122,865,344.08	-	81,486,486.70	-41,378,857.38
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	114,309,449.75	-	-78,516,193.66	35,793,256.09
项目	上年度可比期间 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	123,117,970.14	-	-74,478,908.54	48,639,061.60
二、本期期初净资产	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净资产变动数(净资产减少以“-”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. 基金赎回款	-142,950,757.81	-	81,664,331.18	-61,286,426.63
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	123,778,303.01	-	-72,600,282.98	51,178,020.03

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>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 2024 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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 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。

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

产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	2,278,942.51
等于：本金	2,278,727.43
加：应计利息	215.08
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	2,278,942.51

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	43,773,789.10	-	33,656,499.40	-10,117,289.70
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	43,773,789.10	-	33,656,499.40	-10,117,289.70

### 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

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	12.97
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	28,632.20
其中：交易所市场	28,632.20
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	42,764.54
应付指数使用费	50,000.00
合计	121,409.71

### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	39,344,143.11	94,029,375.15
本期申购	5,757,525.30	13,760,318.54
本期赎回（以“-”号填列）	-7,434,957.70	-17,768,836.48
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	37,666,710.71	90,020,857.21

华宝中证 1000 指数 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,582,445.66	27,683,638.97
本期申购	42,549,068.52	101,701,461.17
本期赎回（以“-”号填列）	-43,969,290.32	-105,096,507.60
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	10,162,223.86	24,288,592.54

注：申购含红利再投以及转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

### 6.4.7.8 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	-69,855,166.45	10,680,783.08	-59,174,383.37
本期期初	-69,855,166.45	10,680,783.08	-59,174,383.37
本期利润	-1,421,920.21	-4,011,091.30	-5,433,011.51
本期基金份额交易产生的变动数	2,981,432.26	-171,251.38	2,810,180.88
其中：基金申购款	-10,300,062.05	1,145,362.72	-9,154,699.33
基金赎回款	13,281,494.31	-1,316,614.10	11,964,880.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-68,295,654.40	6,498,440.40	-61,797,214.00

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	-20,616,030.65	3,148,384.04	-17,467,646.61
本期期初	-20,616,030.65	3,148,384.04	-17,467,646.61
本期利润	-445,589.87	-906,874.73	-1,352,464.60
本期基金份额交易产生的变动数	2,580,933.54	-479,801.99	2,101,131.55
其中：基金申购款	-76,231,066.31	8,810,591.37	-67,420,474.94
基金赎回款	78,811,999.85	-9,290,393.36	69,521,606.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-18,480,686.98	1,761,707.32	-16,718,979.66

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入	6,281.53	
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	103.35	
其他	647.17	
合计	7,032.05	

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
卖出股票成交总额	9,202,860.06	
减：卖出股票成本总额	11,149,545.98	
减：交易费用	20,990.99	
买卖股票差价收入	-1,967,676.91	

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.13 贵金属投资收益

#### 6.4.7.13.1 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

### 6.4.7.14 衍生工具收益

#### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	364,482.28
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	364,482.28

### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-4,917,966.03
股票投资	-4,917,966.03
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	-
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	-4,917,966.03

### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	5,712.94
基金转换费收入	411.78
合计	6,124.72



- 注：1. 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。
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	17,901.52
信息披露费	24,863.02
证券出借违约金	-
银行费用	85.00
指数使用费	100,000.00
合计	142,849.54

#### 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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	100,202.27	139,925.01
其中：应支付销售机构的客户维护费	38,811.15	42,092.21
应支付基金管理人的净管理费	61,391.12	97,832.80

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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	20,040.45	27,984.99

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		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	427.55	427.55
合计	-	427.55	427.55
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		

方名称	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

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

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。

#### 6.4.10.5 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	2,278,942.51	6,281.53	2,875,712.37	7,705.58

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（2024 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	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300630	普利制药	2024 年 05 月 06 日	重大事项停牌	12.35	2024 年 7 月 8 日	9.88	2,100	43,686.91	25,935.00	-
002610	ST 爱康	2024 年 06 月 19 日	重大事项停牌	0.37	-	-	29,700	86,391.61	10,989.00	-
000982	中银绒业	2024 年 06 月 24 日	重大事项停牌	0.18	-	-	27,900	52,239.78	5,022.00	-

##### 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限定在限定的范围之内，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、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对风险管理部和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净资产的比例较低（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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,278,942.51	-	-	-	2,278,942.51
结算备付金	3,920.82	-	-	-	3,920.82
存出保证金	1,882.11	-	-	-	1,882.11
交易性金融资产	-	-	-	33,656,499.40	33,656,499.40
应收申购款	0.01	-	-	79,034.07	79,034.08
资产总计	2,284,745.45	-	-	33,735,533.47	36,020,278.92
负债					
应付赎回款	-	-	-	85,314.69	85,314.69
应付管理人报酬	-	-	-	15,289.21	15,289.21
应付托管费	-	-	-	3,057.83	3,057.83
应付销售服务费	-	-	-	1,951.39	1,951.39
其他负债	-	-	-	121,409.71	121,409.71
负债总计	-	-	-	227,022.83	227,022.83
利率敏感度缺口	2,284,745.45	-	-	33,508,510.64	35,793,256.09
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,348,279.85	-	-	-	3,348,279.85
结算备付金	3,334.71	-	-	-	3,334.71
存出保证金	2,080.80	-	-	-	2,080.80
交易性金融资产	-	-	-	42,615,179.57	42,615,179.57
应收申购款	199.87	-	-	191,109.58	191,309.45
资产总计	3,353,895.23	-	-	42,806,289.15	46,160,184.38
负债					
应付赎回款	-	-	-	356,514.66	356,514.66
应付管理人报酬	-	-	-	19,121.21	19,121.21
应付托管费	-	-	-	3,824.25	3,824.25
应付清算款	-	-	-	491,590.17	491,590.17
应付销售服务费	-	-	-	2,552.31	2,552.31
其他负债	-	-	-	215,597.64	215,597.64
负债总计	-	-	-	1,089,200.24	1,089,200.24
利率敏感度缺口	3,353,895.23	-	-	41,717,088.91	45,070,984.14

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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	33,656,499.40	94.03	42,615,179.57	94.55
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	33,656,499.40	94.03	42,615,179.57	94.55

#### 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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末 (2024 年 6 月 30 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
	1. 业绩比较基准上升 5%		1,763,547.18
2. 业绩比较基准下降 5%		-1,763,547.18	-2,226,356.08

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	-		
	-		
	-		
分析	风险价值 (单位: 人民币元)	本期末 (2024 年 6 月 30 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
	合计	-	0.00

#### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	33,614,553.40	42,512,543.65
第二层次	41,946.00	102,635.92
第三层次	-	-
合计	33,656,499.40	42,615,179.57

#### 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	33,656,499.40	93.44
	其中：股票	33,656,499.40	93.44
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	2,282,863.33	6.34
8	其他各项资产	80,916.19	0.22
9	合计	36,020,278.92	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	224,679.40	0.63
B	采矿业	1,232,985.04	3.44
C	制造业	21,712,438.16	60.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,099,508.12	3.07
E	建筑业	552,115.80	1.54
F	批发和零售业	1,168,568.24	3.26
G	交通运输、仓储和邮政业	1,027,697.28	2.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,535,429.28	9.88
J	金融业	962,636.35	2.69
K	房地产业	512,961.00	1.43
L	租赁和商务服务业	550,573.73	1.54
M	科学研究和技术服务业	258,248.92	0.72
N	水利、环境和公共设施管理业	290,809.96	0.81
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,713.10	0.32
R	文化、体育和娱乐业	375,211.02	1.05
S	综合	-	-
	合计	33,619,575.40	93.93

### 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	36,924.00	0.10
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	36,924.00	0.10

### 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	002456	欧菲光	21,400	167,134.00	0.47
2	601099	太平洋	44,700	136,335.00	0.38
3	300573	兴齐眼药	796	130,544.00	0.36
4	300476	胜宏科技	3,920	126,459.20	0.35
5	000426	兴业银锡	8,400	114,072.00	0.32
6	002085	万丰奥威	8,400	111,216.00	0.31
7	300339	润和软件	5,200	107,484.00	0.30
8	002318	久立特材	4,500	104,985.00	0.29
9	600312	平高电气	5,300	103,085.00	0.29
10	300346	南大光电	3,570	102,066.30	0.29
11	000766	通化金马	6,300	101,997.00	0.28
12	000528	柳工	9,000	100,710.00	0.28
13	601918	新集能源	10,200	99,450.00	0.28
14	002405	四维图新	15,600	97,032.00	0.27
15	688578	艾力斯	1,497	95,418.78	0.27
16	601677	明泰铝业	8,200	94,792.00	0.26
17	605111	新洁能	3,052	93,360.68	0.26

18	002130	沃尔核材	6,600	93,192.00	0.26
19	688235	百济神州	800	92,672.00	0.26
20	002126	银轮股份	5,300	92,273.00	0.26
21	601975	招商南油	25,500	91,545.00	0.26
22	002176	江特电机	11,200	91,280.00	0.26
23	601001	晋控煤业	5,500	90,860.00	0.25
24	605589	圣泉集团	4,400	89,276.00	0.25
25	600559	老白干酒	4,805	87,354.90	0.24
26	002139	拓邦股份	8,225	87,349.50	0.24
27	603005	晶方科技	4,276	87,144.88	0.24
28	300049	福瑞股份	1,700	85,578.00	0.24
29	603129	春风动力	600	85,404.00	0.24
30	688019	安集科技	642	80,763.60	0.23
31	600100	同方股份	15,400	78,386.00	0.22
32	000403	派林生物	2,933	78,193.78	0.22
33	688676	金盘科技	1,499	78,172.85	0.22
34	600761	安徽合力	3,600	77,904.00	0.22
35	002270	华明装备	3,500	77,840.00	0.22
36	300775	三角防务	2,500	76,500.00	0.21
37	301308	江波龙	800	75,792.00	0.21
38	300315	掌趣科技	18,100	75,477.00	0.21
39	600685	中船防务	2,700	75,330.00	0.21
40	600711	盛屯矿业	20,500	75,235.00	0.21
41	300762	上海瀚讯	4,092	73,287.72	0.20
42	688608	恒玄科技	500	73,190.00	0.20
43	000690	宝新能源	14,300	72,930.00	0.20
44	002182	宝武镁业	6,440	72,643.20	0.20
45	600285	羚锐制药	3,000	72,630.00	0.20
46	000415	渤海租赁	28,400	72,420.00	0.20
47	601333	广深铁路	22,200	71,928.00	0.20
48	000034	神州数码	3,100	70,959.00	0.20
49	300458	全志科技	2,961	69,613.11	0.19
50	688166	博瑞医药	1,961	68,635.00	0.19
51	000875	吉电股份	12,800	68,224.00	0.19
52	300083	创世纪	11,100	68,043.00	0.19
53	600323	瀚蓝环境	3,200	66,880.00	0.19
54	000422	湖北宜化	5,600	66,752.00	0.19
55	002312	川发龙蟒	9,900	66,627.00	0.19
56	300679	电连技术	1,645	66,178.35	0.18
57	600363	联创光电	2,400	66,048.00	0.18
58	688050	爱博医疗	900	65,988.00	0.18
59	300115	长盈精密	5,500	65,945.00	0.18
60	002402	和而泰	6,150	65,866.50	0.18

61	688076	诺泰生物	839	65,676.92	0.18
62	000543	皖能电力	7,400	65,490.00	0.18
63	300294	博雅生物	1,950	64,350.00	0.18
64	002389	航天彩虹	4,600	63,894.00	0.18
65	601126	四方股份	3,300	63,426.00	0.18
66	300627	华测导航	2,120	63,282.00	0.18
67	300459	汤姆猫	18,500	62,715.00	0.18
68	002837	英维克	2,929	62,651.31	0.18
69	600422	昆药集团	3,500	62,405.00	0.17
70	688327	云从科技	5,500	62,205.00	0.17
71	000581	威孚高科	3,800	61,864.00	0.17
72	601375	中原证券	18,100	61,721.00	0.17
73	688037	芯源微	688	61,232.00	0.17
74	603283	赛腾股份	800	61,120.00	0.17
75	605090	九丰能源	2,100	60,900.00	0.17
76	603556	海兴电力	1,300	60,879.00	0.17
77	002851	麦格米特	2,350	60,724.00	0.17
78	002807	江阴银行	16,100	60,697.00	0.17
79	688266	泽璟制药	1,118	60,617.96	0.17
80	002151	北斗星通	2,500	60,450.00	0.17
81	600771	广誉远	3,200	60,256.00	0.17
82	600908	无锡银行	11,300	60,116.00	0.17
83	601222	林洋能源	9,508	59,615.16	0.17
84	002332	仙琚制药	5,200	59,332.00	0.17
85	688568	中科星图	1,243	59,291.10	0.17
86	002245	蔚蓝锂芯	7,600	58,900.00	0.16
87	000682	东方电子	5,300	58,512.00	0.16
88	603393	新天然气	1,684	58,502.16	0.16
89	002145	中核钛白	17,805	58,400.40	0.16
90	600750	江中药业	2,520	58,237.20	0.16
91	688408	中信博	632	58,194.56	0.16
92	603083	剑桥科技	1,800	58,104.00	0.16
93	300666	江丰电子	1,200	57,072.00	0.16
94	300857	协创数据	1,000	57,000.00	0.16
95	000860	顺鑫农业	3,400	56,916.00	0.16
96	603505	金石资源	2,028	56,642.04	0.16
97	603300	华铁应急	10,360	56,565.60	0.16
98	688333	铂力特	1,165	56,444.25	0.16
99	301301	川宁生物	4,400	56,232.00	0.16
100	688278	特宝生物	1,047	56,066.85	0.16
101	688088	虹软科技	1,941	56,017.26	0.16
102	002222	福晶科技	2,475	55,761.75	0.16
103	600461	洪城环境	4,800	55,584.00	0.16

104	600338	西藏珠峰	6,000	55,440.00	0.15
105	300735	光弘科技	2,566	55,425.60	0.15
106	300633	开立医疗	1,400	55,412.00	0.15
107	600667	太极实业	9,700	55,387.00	0.15
108	002400	省广集团	11,400	55,290.00	0.15
109	000951	中国重汽	3,860	55,275.20	0.15
110	300298	三诺生物	2,180	55,241.20	0.15
111	603236	移远通信	1,180	55,141.40	0.15
112	600330	天通股份	8,080	54,944.00	0.15
113	002745	木林森	6,800	54,808.00	0.15
114	600452	涪陵电力	4,300	54,481.00	0.15
115	600821	金开新能	10,500	53,970.00	0.15
116	600331	宏达股份	9,300	53,847.00	0.15
117	002832	比音勒芬	2,220	53,657.40	0.15
118	300133	华策影视	8,700	53,418.00	0.15
119	600993	马应龙	2,000	53,340.00	0.15
120	000628	高新发展	1,200	53,244.00	0.15
121	300475	香农芯创	1,800	53,226.00	0.15
122	300456	赛微电子	3,340	53,005.80	0.15
123	300045	华力创通	3,000	52,950.00	0.15
124	600718	东软集团	6,400	52,928.00	0.15
125	600916	中国黄金	5,500	52,910.00	0.15
126	300672	国科微	1,000	52,840.00	0.15
127	688789	宏华数科	490	52,822.00	0.15
128	600572	康恩贝	11,800	52,746.00	0.15
129	002675	东诚药业	4,300	52,718.00	0.15
130	600201	生物股份	7,300	52,633.00	0.15
131	000035	中国天楹	11,600	52,548.00	0.15
132	002063	远光软件	10,008	52,441.92	0.15
133	300757	罗博特科	600	52,410.00	0.15
134	600728	佳都科技	14,100	52,311.00	0.15
135	002249	大洋电机	11,000	52,030.00	0.15
136	002773	康弘药业	2,400	51,960.00	0.15
137	300624	万兴科技	979	51,955.53	0.15
138	688027	国盾量子	344	51,944.00	0.15
139	300182	捷成股份	14,000	51,940.00	0.15
140	600123	兰花科创	5,800	51,910.00	0.15
141	002484	江海股份	3,916	51,887.00	0.14
142	000923	河钢资源	3,000	51,660.00	0.14
143	300738	奥飞数据	5,091	51,520.92	0.14
144	002317	众生药业	4,500	51,435.00	0.14
145	688498	源杰科技	392	51,348.08	0.14
146	000686	东北证券	9,200	51,336.00	0.14



147	300638	广和通	2,997	51,248.70	0.14
148	002015	协鑫能科	6,400	50,944.00	0.14
149	002221	东华能源	6,200	50,902.00	0.14
150	600587	新华医疗	3,230	50,840.20	0.14
151	300705	九典制药	1,900	50,806.00	0.14
152	300623	捷捷微电	2,930	50,689.00	0.14
153	600057	厦门象屿	7,426	50,496.80	0.14
154	002544	普天科技	2,700	50,463.00	0.14
155	603588	高能环境	8,032	50,440.96	0.14
156	300811	铂科新材	1,148	50,397.20	0.14
157	300525	博思软件	3,968	50,393.60	0.14
158	600877	电科芯片	4,700	50,384.00	0.14
159	002567	唐人神	9,350	50,116.00	0.14
160	600641	万业企业	4,240	49,820.00	0.14
161	300761	立华股份	2,200	49,808.00	0.14
162	300229	拓尔思	3,700	49,691.00	0.14
163	300777	中简科技	2,300	49,450.00	0.14
164	002100	天康生物	7,100	49,203.00	0.14
165	600601	方正科技	16,400	49,200.00	0.14
166	002701	奥瑞金	11,800	49,088.00	0.14
167	600850	电科数字	2,710	49,051.00	0.14
168	000970	中科三环	6,400	48,960.00	0.14
169	000762	西藏矿业	2,700	48,816.00	0.14
170	603477	巨星农牧	1,700	48,790.00	0.14
171	000902	新洋丰	4,100	48,667.00	0.14
172	603279	景津装备	2,240	48,585.60	0.14
173	600456	宝钛股份	1,900	48,507.00	0.14
174	002617	露笑科技	10,099	48,475.20	0.14
175	300075	数字政通	3,280	48,380.00	0.14
176	002747	埃斯顿	3,400	48,348.00	0.14
177	600216	浙江医药	4,400	48,312.00	0.13
178	603565	中谷物流	5,517	48,218.58	0.13
179	688639	华恒生物	631	48,202.09	0.13
180	300034	钢研高纳	3,026	48,083.14	0.13
181	601860	紫金银行	19,200	48,000.00	0.13
182	600064	南京高科	7,900	47,953.00	0.13
183	001696	宗申动力	4,500	47,880.00	0.13
184	002003	伟星股份	3,800	47,690.00	0.13
185	600269	赣粤高速	9,200	47,564.00	0.13
186	600596	新安股份	6,240	47,424.00	0.13
187	002036	联创电子	7,023	47,405.25	0.13
188	688016	心脉医疗	483	47,358.15	0.13
189	601137	博威合金	3,100	47,244.00	0.13

190	600552	凯盛科技	5,000	47,150.00	0.13
191	000927	中国铁物	19,800	47,124.00	0.13
192	688139	海尔生物	1,265	47,058.00	0.13
193	600420	国药现代	4,400	46,992.00	0.13
194	601678	滨化股份	13,500	46,980.00	0.13
195	000917	电广传媒	9,300	46,965.00	0.13
196	000758	中色股份	9,200	46,736.00	0.13
197	002541	鸿路钢构	2,750	46,667.50	0.13
198	600971	恒源煤电	3,900	46,566.00	0.13
199	601187	厦门银行	8,700	46,371.00	0.13
200	300068	南都电源	5,600	46,368.00	0.13
200	600602	云赛智联	4,200	46,368.00	0.13
201	300482	万孚生物	1,900	46,360.00	0.13
202	601777	力帆科技	12,000	46,080.00	0.13
203	002839	张家港行	11,400	45,828.00	0.13
204	600595	中孚实业	18,400	45,816.00	0.13
205	603323	苏农银行	9,510	45,743.10	0.13
206	300415	伊之密	2,200	45,716.00	0.13
207	600273	嘉化能源	6,400	45,696.00	0.13
208	603678	火炬电子	1,850	45,676.50	0.13
209	688062	迈威生物	1,573	45,522.62	0.13
210	603766	隆鑫通用	6,700	45,426.00	0.13
211	000012	南玻 A	9,000	45,360.00	0.13
212	600179	安通控股	19,400	45,202.00	0.13
213	300236	上海新阳	1,450	45,153.00	0.13
214	600246	万通发展	6,700	45,024.00	0.13
215	300457	赢合科技	2,525	45,020.75	0.13
216	600320	振华重工	13,100	44,802.00	0.13
217	600120	浙江东方	13,400	44,756.00	0.13
218	300036	超图软件	3,200	44,672.00	0.12
219	603871	嘉友国际	2,520	44,578.80	0.12
220	603027	千禾味业	3,349	44,541.70	0.12
221	002737	葵花药业	1,900	44,422.00	0.12
222	002335	科华数据	2,100	44,373.00	0.12
223	300101	振芯科技	3,000	44,310.00	0.12
224	600562	国睿科技	3,232	44,149.12	0.12
225	600633	浙数文化	5,000	44,050.00	0.12
226	688596	正帆科技	1,334	44,022.00	0.12
227	688575	亚辉龙	1,883	43,911.56	0.12
228	603599	广信股份	3,620	43,910.60	0.12
229	300327	中颖电子	2,230	43,886.40	0.12
230	002597	金禾实业	2,200	43,758.00	0.12
231	002237	恒邦股份	3,800	43,738.00	0.12

232	688318	财富趋势	554	43,716.14	0.12
233	000737	北方铜业	4,700	43,616.00	0.12
234	600116	三峡水利	6,300	43,470.00	0.12
235	002416	爱施德	4,900	43,365.00	0.12
236	002075	沙钢股份	11,500	43,355.00	0.12
237	002091	江苏国泰	6,360	43,311.60	0.12
238	600577	精达股份	10,900	43,273.00	0.12
239	001309	德明利	500	43,200.00	0.12
240	000650	仁和药业	7,300	43,070.00	0.12
241	300303	聚飞光电	8,840	42,962.40	0.12
242	688208	道通科技	1,779	42,945.06	0.12
243	600621	华鑫股份	3,500	42,910.00	0.12
244	600428	中远海特	7,000	42,840.00	0.12
245	600446	金证股份	4,300	42,699.00	0.12
246	000829	天音控股	4,700	42,676.00	0.12
247	600395	盘江股份	7,100	42,671.00	0.12
248	601778	晶科科技	18,700	42,636.00	0.12
249	600210	紫江企业	8,000	42,560.00	0.12
250	603997	继峰股份	4,150	42,454.50	0.12
251	300130	新国都	2,540	42,265.60	0.12
252	300026	红日药业	13,800	42,090.00	0.12
253	000657	中钨高新	4,604	42,080.56	0.12
254	002192	融捷股份	1,400	42,028.00	0.12
255	300319	麦捷科技	4,500	41,985.00	0.12
256	000685	中山公用	5,800	41,818.00	0.12
257	688116	天奈科技	1,808	41,728.64	0.12
258	002698	博实股份	3,400	41,718.00	0.12
259	300674	宇信科技	3,748	41,527.84	0.12
260	002020	京新药业	3,960	41,461.20	0.12
261	688018	乐鑫科技	420	41,445.60	0.12
262	002048	宁波华翔	3,200	41,408.00	0.12
263	002011	盾安环境	4,200	41,286.00	0.12
264	301039	中集车辆	4,800	41,280.00	0.12
265	600782	新钢股份	12,400	41,168.00	0.12
266	300910	瑞丰新材	940	41,096.80	0.11
267	002396	星网锐捷	3,100	40,951.00	0.11
268	600986	浙文互联	9,740	40,908.00	0.11
269	000420	吉林化纤	12,900	40,764.00	0.11
270	603220	中贝通信	1,500	40,740.00	0.11
271	688289	圣湘生物	2,316	40,715.28	0.11
272	000676	智度股份	6,700	40,669.00	0.11
273	600409	三友化工	8,100	40,662.00	0.11
274	600717	天津港	9,500	40,565.00	0.11

275	600072	中船科技	3,000	40,560.00	0.11
276	600459	贵研铂业	2,996	40,475.96	0.11
277	600976	健民集团	800	40,400.00	0.11
278	300747	锐科激光	2,276	40,399.00	0.11
279	603358	华达科技	1,400	40,390.00	0.11
280	688110	东芯股份	2,114	40,313.98	0.11
281	600645	中源协和	2,500	40,250.00	0.11
282	002171	楚江新材	6,100	40,199.00	0.11
283	002706	良信股份	5,850	40,131.00	0.11
284	603690	至纯科技	1,740	40,037.40	0.11
285	300284	苏交科	4,952	40,012.16	0.11
286	000801	四川九洲	4,000	40,000.00	0.11
287	300035	中科电气	4,700	39,997.00	0.11
288	603108	润达医疗	2,640	39,969.60	0.11
289	600328	中盐化工	5,790	39,719.40	0.11
290	600575	淮河能源	10,200	39,678.00	0.11
291	000028	国药一致	1,230	39,642.90	0.11
292	300244	迪安诊断	3,300	39,600.00	0.11
293	688123	聚辰股份	650	39,539.50	0.11
294	002004	华邦健康	10,400	39,520.00	0.11
295	300170	汉得信息	6,400	39,296.00	0.11
296	600252	中恒集团	18,100	39,277.00	0.11
297	002539	云图控股	5,500	39,215.00	0.11
298	002948	青岛银行	11,600	39,092.00	0.11
299	600295	鄂尔多斯	3,928	38,965.76	0.11
300	600864	哈投股份	8,200	38,950.00	0.11
301	001301	尚太科技	900	38,898.00	0.11
302	002351	漫步者	2,950	38,792.50	0.11
303	601028	玉龙股份	3,100	38,750.00	0.11
303	601963	重庆银行	5,000	38,750.00	0.11
304	688518	联赢激光	2,315	38,660.50	0.11
305	600267	海正药业	5,500	38,610.00	0.11
306	300773	拉卡拉	3,100	38,533.00	0.11
307	301050	雷电微力	800	38,528.00	0.11
308	603308	应流股份	3,100	38,502.00	0.11
309	600158	中体产业	5,000	38,450.00	0.11
310	000915	华特达因	1,270	38,303.20	0.11
311	600586	金晶科技	6,600	38,280.00	0.11
312	600037	歌华有线	6,400	38,272.00	0.11
313	300079	数码视讯	9,400	38,164.00	0.11
314	000969	安泰科技	4,800	38,064.00	0.11
315	002212	天融信	7,800	37,986.00	0.11
316	002099	海翔药业	7,400	37,814.00	0.11

317	300188	国投智能	3,400	37,774.00	0.11
318	002324	普利特	4,400	37,620.00	0.11
319	600688	上海石化	14,400	37,584.00	0.11
320	688409	富创精密	1,017	37,567.98	0.10
321	603267	鸿远电子	1,100	37,510.00	0.10
322	600888	新疆众和	5,300	37,471.00	0.10
323	002906	华阳集团	1,400	37,464.00	0.10
324	002061	浙江交科	10,260	37,449.00	0.10
325	000821	京山轻机	3,300	37,389.00	0.10
326	002123	梦网科技	5,300	37,259.00	0.10
327	300470	中密控股	1,100	37,191.00	0.10
328	603026	石大胜华	1,100	37,180.00	0.10
329	300678	中科信息	1,400	37,128.00	0.10
330	300618	寒锐钴业	1,400	37,030.00	0.10
331	002643	万润股份	3,700	37,000.00	0.10
332	600933	爱柯迪	2,500	36,975.00	0.10
333	002428	云南锗业	3,400	36,924.00	0.10
334	601311	骆驼股份	4,600	36,892.00	0.10
335	000681	视觉中国	3,200	36,800.00	0.10
336	688100	威胜信息	964	36,776.60	0.10
337	300166	东方国信	6,000	36,720.00	0.10
338	600138	中青旅	3,800	36,708.00	0.10
339	000727	冠捷科技	17,800	36,668.00	0.10
340	300576	容大感光	1,000	36,530.00	0.10
341	601702	华峰铝业	2,000	36,520.00	0.10
342	600720	中交设计	4,100	36,490.00	0.10
343	002154	报喜鸟	6,700	36,448.00	0.10
344	000552	甘肃能化	10,500	36,435.00	0.10
345	002174	游族网络	4,800	36,432.00	0.10
346	000555	神州信息	3,900	36,348.00	0.10
347	600480	凌云股份	3,680	36,174.40	0.10
348	300685	艾德生物	2,048	36,126.72	0.10
349	600557	康缘药业	2,300	36,110.00	0.10
350	601369	陕鼓动力	4,500	36,090.00	0.10
351	300109	新开源	3,111	36,025.38	0.10
352	600248	陕建股份	9,900	35,937.00	0.10
353	600125	铁龙物流	6,000	35,820.00	0.10
354	002079	苏州固锝	4,200	35,784.00	0.10
355	601718	际华集团	14,400	35,712.00	0.10
356	300343	联创股份	7,500	35,700.00	0.10
357	002023	海特高新	3,900	35,685.00	0.10
358	600259	广晟有色	1,300	35,542.00	0.10
359	002254	泰和新材	4,000	35,400.00	0.10

360	000429	粤高速 A	3,400	35,394.00	0.10
361	000049	德赛电池	1,505	35,292.25	0.10
362	300185	通裕重工	20,500	35,260.00	0.10
363	603063	禾望电气	2,300	35,259.00	0.10
364	300655	晶瑞电材	4,880	35,136.00	0.10
365	300783	三只松鼠	1,600	34,992.00	0.10
366	002214	大立科技	3,100	34,968.00	0.10
367	600597	光明乳业	4,500	34,965.00	0.10
368	002010	传化智联	9,100	34,944.00	0.10
369	601101	昊华能源	3,800	34,922.00	0.10
370	600063	皖维高新	9,900	34,848.00	0.10
371	600509	天富能源	6,300	34,713.00	0.10
372	600206	有研新材	3,900	34,710.00	0.10
373	002727	一心堂	2,300	34,707.00	0.10
374	300398	飞凯材料	2,820	34,686.00	0.10
375	002292	奥飞娱乐	5,800	34,684.00	0.10
376	002038	双鹭药业	4,700	34,639.00	0.10
377	600055	万东医疗	2,800	34,580.00	0.10
378	000090	天健集团	8,600	34,572.00	0.10
379	002276	万马股份	4,800	34,416.00	0.10
380	600507	方大特钢	9,200	34,408.00	0.10
381	002233	塔牌集团	4,700	34,357.00	0.10
382	002215	诺普信	4,600	34,270.00	0.10
382	002239	奥特佳	14,900	34,270.00	0.10
383	000811	冰轮环境	3,550	34,257.50	0.10
384	603699	纽威股份	2,000	34,240.00	0.10
385	002043	兔宝宝	3,300	34,221.00	0.10
386	603920	世运电路	1,730	34,150.20	0.10
387	688007	光峰科技	2,119	34,115.90	0.10
388	300077	国民技术	3,900	34,047.00	0.10
389	600635	大众公用	12,700	34,036.00	0.10
390	002446	盛路通信	6,020	34,013.00	0.10
391	002635	安洁科技	2,200	33,968.00	0.09
392	600197	伊力特	1,900	33,839.00	0.09
393	002183	怡亚通	11,900	33,796.00	0.09
394	600502	安徽建工	7,856	33,780.80	0.09
395	002815	崇达技术	3,600	33,768.00	0.09
396	603281	江瀚新材	1,500	33,675.00	0.09
397	000065	北方国际	3,242	33,619.54	0.09
398	688279	峰昭科技	303	33,602.70	0.09
399	688556	高测股份	2,826	33,601.14	0.09
400	002468	申通快递	4,000	33,600.00	0.09
401	688106	金宏气体	1,917	33,585.84	0.09

402	002761	浙江建投	4,300	33,583.00	0.09
403	600729	重庆百货	1,500	33,540.00	0.09
404	300693	盛弘股份	1,600	33,504.00	0.09
405	000582	北部湾港	4,500	33,480.00	0.09
406	688739	成大生物	1,381	33,475.44	0.09
407	600059	古越龙山	4,200	33,348.00	0.09
408	600266	城建发展	8,900	33,286.00	0.09
409	600006	东风股份	5,200	33,228.00	0.09
410	300151	昌红科技	2,100	33,222.00	0.09
411	688321	微芯生物	1,887	33,211.20	0.09
412	002840	华统股份	2,000	33,180.00	0.09
413	600211	西藏药业	1,018	33,166.44	0.09
414	000913	钱江摩托	2,100	33,096.00	0.09
415	300348	长亮科技	4,850	33,077.00	0.09
416	300855	图南股份	1,250	33,050.00	0.09
417	600961	株冶集团	3,500	33,040.00	0.09
418	002895	川恒股份	1,800	32,958.00	0.09
419	300598	诚迈科技	1,170	32,853.60	0.09
420	600478	科力远	8,700	32,799.00	0.09
421	300113	顺网科技	3,200	32,768.00	0.09
422	603368	柳药集团	1,870	32,725.00	0.09
423	600740	山西焦化	8,336	32,677.12	0.09
424	300570	太辰光	1,000	32,660.00	0.09
425	000810	创维数字	3,800	32,604.00	0.09
426	002354	天娱数科	10,900	32,591.00	0.09
427	688403	汇成股份	3,833	32,503.84	0.09
428	300180	华峰超纤	9,200	32,476.00	0.09
429	002421	达实智能	13,900	32,387.00	0.09
430	601952	苏垦农发	3,590	32,381.80	0.09
431	002315	焦点科技	1,200	32,352.00	0.09
432	000901	航天科技	3,693	32,350.68	0.09
433	600017	日照港	12,100	32,307.00	0.09
434	002726	龙大美食	4,924	32,301.44	0.09
435	600757	长江传媒	4,000	32,240.00	0.09
436	000848	承德露露	4,100	32,226.00	0.09
437	002006	精工科技	2,400	32,208.00	0.09
438	600531	豫光金铅	5,000	32,200.00	0.09
439	600012	皖通高速	2,300	32,131.00	0.09
440	603713	密尔克卫	600	32,112.00	0.09
441	600773	西藏城投	3,100	31,992.00	0.09
442	601163	三角轮胎	2,100	31,962.00	0.09
443	000603	盛达资源	2,700	31,941.00	0.09
444	600305	恒顺醋业	4,416	31,927.68	0.09

445	300463	迈克生物	2,800	31,864.00	0.09
446	002081	金螳螂	10,500	31,815.00	0.09
447	000966	长源电力	7,200	31,752.00	0.09
448	688183	生益电子	1,637	31,725.06	0.09
449	688798	艾为电子	560	31,707.20	0.09
450	000567	海德股份	5,645	31,668.45	0.09
451	300031	宝通科技	2,200	31,614.00	0.09
452	688083	中望软件	434	31,517.08	0.09
453	603197	保隆科技	1,000	31,500.00	0.09
454	603033	三维股份	2,690	31,473.00	0.09
455	601200	上海环境	3,700	31,450.00	0.09
456	603612	索通发展	2,460	31,389.60	0.09
457	600185	格力地产	7,380	31,365.00	0.09
458	300123	亚光科技	6,740	31,273.60	0.09
459	600550	保变电气	6,000	31,260.00	0.09
460	300432	富临精工	4,850	31,234.00	0.09
461	300065	海兰信	4,725	31,232.25	0.09
462	688503	聚和材料	1,111	31,219.10	0.09
463	603008	喜临门	1,800	31,194.00	0.09
464	000928	中钢国际	5,620	31,191.00	0.09
465	002226	江南化工	6,960	31,180.80	0.09
466	301035	润丰股份	700	31,178.00	0.09
467	002458	益生股份	3,600	31,176.00	0.09
468	000488	晨鸣纸业	9,000	31,140.00	0.09
469	002649	博彦科技	3,900	31,044.00	0.09
470	600797	浙大网新	6,700	31,021.00	0.09
471	601890	亚星锚链	4,400	31,020.00	0.09
472	002705	新宝股份	2,200	30,954.00	0.09
473	688192	迪哲医药	836	30,798.24	0.09
474	600996	贵广网络	4,000	30,720.00	0.09
475	603306	华懋科技	1,700	30,719.00	0.09
476	300770	新媒股份	920	30,709.60	0.09
477	300827	上能电气	1,372	30,677.92	0.09
478	603100	川仪股份	1,300	30,563.00	0.09
479	002467	二六三	9,130	30,494.20	0.09
480	601208	东材科技	4,200	30,492.00	0.09
481	600776	东方通信	3,100	30,473.00	0.09
482	002511	中顺洁柔	4,400	30,448.00	0.09
483	601528	瑞丰银行	6,440	30,396.80	0.08
484	000550	江铃汽车	1,400	30,394.00	0.08
485	600869	远东股份	8,700	30,363.00	0.08
486	002681	奋达科技	8,300	30,295.00	0.08
487	300634	彩讯股份	1,800	30,294.00	0.08



488	002960	青鸟消防	2,395	30,272.80	0.08
489	603128	华贸物流	5,240	30,234.80	0.08
490	300027	华谊兄弟	18,200	30,212.00	0.08
491	603919	金徽酒	1,660	30,162.20	0.08
492	002097	山河智能	5,000	30,150.00	0.08
492	600033	福建高速	9,000	30,150.00	0.08
493	603888	新华网	1,400	30,114.00	0.08
494	300224	正海磁材	3,250	30,095.00	0.08
495	000503	国新健康	4,500	30,015.00	0.08
496	300232	洲明科技	5,748	30,004.56	0.08
497	002847	盐津铺子	700	29,939.00	0.08
498	300379	东方通	3,700	29,896.00	0.08
499	300596	利安隆	1,100	29,843.00	0.08
500	300233	金城医药	2,000	29,840.00	0.08
501	600151	航天机电	6,600	29,832.00	0.08
502	601326	秦港股份	9,400	29,798.00	0.08
503	000990	诚志股份	4,000	29,760.00	0.08
504	300428	立中集团	1,600	29,744.00	0.08
505	300171	东富龙	2,500	29,725.00	0.08
506	300455	航天智装	2,400	29,664.00	0.08
507	600675	中华企业	12,000	29,640.00	0.08
508	603881	数据港	2,330	29,614.30	0.08
509	000600	建投能源	4,700	29,610.00	0.08
510	688559	海目星	900	29,601.00	0.08
511	300416	苏试试验	2,300	29,578.00	0.08
512	601519	大智慧	5,300	29,468.00	0.08
513	000837	秦川机床	4,000	29,440.00	0.08
514	300620	光库科技	800	29,424.00	0.08
515	002127	南极电商	11,300	29,380.00	0.08
516	300129	泰胜风能	4,300	29,326.00	0.08
517	300406	九强生物	1,900	29,222.00	0.08
518	688322	奥比中光	1,093	29,194.03	0.08
519	300841	康华生物	575	29,118.00	0.08
520	300352	北信源	7,575	29,088.00	0.08
520	601619	嘉泽新能	9,600	29,088.00	0.08
521	300393	中来股份	5,027	29,005.79	0.08
522	300366	创意信息	4,000	28,960.00	0.08
523	002626	金达威	2,000	28,900.00	0.08
523	600623	华谊集团	5,000	28,900.00	0.08
524	002583	海能达	7,100	28,897.00	0.08
525	600997	开滦股份	4,200	28,812.00	0.08
526	300856	科思股份	900	28,809.00	0.08
527	300725	药石科技	1,076	28,804.52	0.08

528	301095	广立微	700	28,784.00	0.08
529	301219	腾远钴业	750	28,695.00	0.08
530	002498	汉缆股份	8,700	28,623.00	0.08
531	003021	兆威机电	620	28,613.00	0.08
532	002605	姚记科技	1,400	28,588.00	0.08
533	603039	泛微网络	900	28,584.00	0.08
534	600007	中国国贸	1,300	28,548.00	0.08
535	300593	新雷能	2,860	28,428.40	0.08
536	688141	杰华特	1,759	28,425.44	0.08
537	688262	国芯科技	1,559	28,389.39	0.08
538	002777	久远银海	1,886	28,271.14	0.08
539	300602	飞荣达	1,869	28,240.59	0.08
540	300451	创业慧康	8,157	28,223.22	0.08
541	600389	江山股份	2,000	28,220.00	0.08
542	000767	晋控电力	12,100	28,193.00	0.08
543	688630	芯碁微装	449	28,093.93	0.08
544	600110	诺德股份	9,200	28,060.00	0.08
545	300260	新莱应材	1,340	28,059.60	0.08
546	001914	招商积余	2,800	28,056.00	0.08
547	600313	农发种业	5,000	27,950.00	0.08
548	301171	易点天下	1,900	27,930.00	0.08
549	002545	东方铁塔	4,100	27,921.00	0.08
550	002537	海联金汇	5,380	27,814.60	0.08
551	000950	重药控股	5,700	27,759.00	0.08
552	603936	博敏电子	3,300	27,720.00	0.08
553	002859	洁美科技	1,380	27,710.40	0.08
554	600710	苏美达	3,400	27,710.00	0.08
555	600649	城投控股	8,300	27,556.00	0.08
556	000756	新华制药	1,900	27,512.00	0.08
557	002274	华昌化工	3,700	27,454.00	0.08
558	600787	中储股份	5,700	27,417.00	0.08
559	002077	大港股份	2,300	27,416.00	0.08
560	000719	中原传媒	2,700	27,297.00	0.08
561	600458	时代新材	2,700	27,270.00	0.08
562	603876	鼎胜新材	2,940	27,253.80	0.08
563	688439	振华风光	410	27,244.50	0.08
564	301071	力量钻石	980	27,155.80	0.08
565	600496	精工钢构	10,600	27,136.00	0.08
566	300087	荃银高科	4,380	27,068.40	0.08
567	601801	皖新传媒	3,900	27,027.00	0.08
568	002550	千红制药	5,000	26,950.00	0.08
569	600508	上海能源	1,900	26,885.00	0.08
570	300772	运达股份	2,800	26,880.00	0.08

571	002928	华夏航空	4,225	26,786.50	0.07
572	002108	沧州明珠	8,742	26,750.52	0.07
573	600366	宁波韵升	5,100	26,622.00	0.07
574	600490	鹏欣资源	10,200	26,520.00	0.07
575	300687	赛意信息	1,900	26,448.00	0.07
576	000059	华锦股份	6,300	26,397.00	0.07
577	603866	桃李面包	5,200	26,364.00	0.07
578	688658	悦康药业	1,476	26,331.84	0.07
579	603583	捷昌驱动	1,292	26,330.96	0.07
580	603567	珍宝岛	2,500	26,325.00	0.07
581	300263	隆华科技	4,700	26,320.00	0.07
582	300257	开山股份	2,600	26,260.00	0.07
583	002929	润建股份	900	26,199.00	0.07
584	600751	海航科技	11,800	26,196.00	0.07
585	300409	道氏技术	3,060	26,193.60	0.07
586	600963	岳阳林纸	7,130	26,167.10	0.07
587	603533	掌阅科技	1,400	26,138.00	0.07
588	688598	金博股份	923	26,120.90	0.07
589	003006	百亚股份	1,100	26,070.00	0.07
590	002993	奥海科技	700	26,040.00	0.07
591	688362	甬矽电子	1,337	26,018.02	0.07
592	000735	罗牛山	6,000	25,980.00	0.07
593	603328	依顿电子	3,300	25,938.00	0.07
594	688366	昊海生科	420	25,905.60	0.07
595	600556	天下秀	7,100	25,844.00	0.07
596	002216	三全食品	2,350	25,803.00	0.07
597	603383	顶点软件	800	25,656.00	0.07
598	002390	信邦制药	7,700	25,487.00	0.07
599	002434	万里扬	5,200	25,480.00	0.07
600	605599	菜百股份	2,000	25,460.00	0.07
601	300671	富满微	1,000	25,420.00	0.07
602	688066	航天宏图	1,427	25,400.60	0.07
603	000088	盐田港	5,600	25,368.00	0.07
604	601969	海南矿业	4,000	25,360.00	0.07
605	300226	上海钢联	1,496	25,342.24	0.07
606	002925	盈趣科技	2,000	25,340.00	0.07
607	600966	博汇纸业	5,300	25,334.00	0.07
608	600477	杭萧钢构	10,870	25,327.10	0.07
609	002060	广东建工	7,400	25,308.00	0.07
610	688700	东威科技	962	25,214.02	0.07
611	688127	蓝特光学	1,371	25,212.69	0.07
612	300363	博腾股份	2,100	25,095.00	0.07
613	300726	宏达电子	1,100	25,080.00	0.07

614	605333	沪光股份	900	25,065.00	0.07
615	002258	利尔化学	3,120	25,022.40	0.07
616	605507	国邦医药	1,500	24,975.00	0.07
617	000795	英洛华	4,500	24,930.00	0.07
618	002219	新里程	13,400	24,924.00	0.07
619	603348	文灿股份	900	24,921.00	0.07
620	688158	优刻得	2,427	24,828.21	0.07
621	001270	铖昌科技	676	24,822.72	0.07
622	600775	南京熊猫	3,100	24,800.00	0.07
623	001287	中电港	1,500	24,795.00	0.07
624	002697	红旗连锁	5,340	24,724.20	0.07
625	600195	中牧股份	3,300	24,717.00	0.07
626	301031	中熔电气	300	24,660.00	0.07
627	603733	仙鹤股份	1,400	24,612.00	0.07
628	603043	广州酒家	1,540	24,593.80	0.07
629	300119	瑞普生物	1,800	24,516.00	0.07
630	600861	北京人力	1,500	24,480.00	0.07
631	300332	天壕能源	4,600	24,426.00	0.07
632	688239	航宇科技	700	24,360.00	0.07
633	600169	太原重工	13,300	24,339.00	0.07
634	000828	东莞控股	2,700	24,327.00	0.07
635	002125	湘潭电化	2,500	24,325.00	0.07
636	002349	精华制药	3,700	24,272.00	0.07
637	002985	北摩高科	1,100	24,233.00	0.07
638	300203	聚光科技	2,400	24,216.00	0.07
639	002191	劲嘉股份	6,700	24,187.00	0.07
640	300663	科蓝软件	2,450	24,181.50	0.07
641	600835	上海机电	2,100	24,171.00	0.07
642	301155	海力风电	600	24,138.00	0.07
643	600163	中闽能源	5,000	24,100.00	0.07
644	601908	京运通	9,500	24,035.00	0.07
645	000935	四川双马	2,000	24,020.00	0.07
646	688270	臻镭科技	920	24,012.00	0.07
647	301047	义翘神州	400	23,980.00	0.07
648	603638	艾迪精密	1,700	23,851.00	0.07
649	601595	上海电影	1,200	23,736.00	0.07
650	301087	可孚医疗	700	23,730.00	0.07
651	600073	光明肉业	4,300	23,693.00	0.07
652	300820	英杰电气	600	23,604.00	0.07
653	301015	百洋医药	1,000	23,530.00	0.07
654	002158	汉钟精机	1,400	23,408.00	0.07
655	600223	福瑞达	3,300	23,331.00	0.07
656	300261	雅本化学	4,400	23,320.00	0.07

656	600929	雪天盐业	4,400	23,320.00	0.07
657	300613	富瀚微	708	23,300.28	0.07
658	000048	京基智农	1,700	23,273.00	0.07
659	688368	晶丰明源	420	23,268.00	0.07
660	300587	天铁股份	5,757	23,258.28	0.06
661	301363	美好医疗	800	23,200.00	0.06
662	688696	极米科技	300	23,172.00	0.06
663	002101	广东鸿图	2,200	23,166.00	0.06
664	600812	华北制药	5,600	23,072.00	0.06
665	300323	华灿光电	5,300	23,055.00	0.06
666	600075	新疆天业	6,680	23,046.00	0.06
667	002250	联化科技	4,800	23,040.00	0.06
668	688690	纳微科技	1,325	23,015.25	0.06
669	300443	金雷股份	1,500	22,995.00	0.06
670	601606	长城军工	2,400	22,944.00	0.06
671	001213	中铁特货	5,800	22,910.00	0.06
671	601882	海天精工	1,000	22,910.00	0.06
672	600391	航发科技	1,500	22,875.00	0.06
673	688389	普门科技	1,404	22,829.04	0.06
674	688326	经纬恒润	398	22,817.34	0.06
675	300723	一品红	1,160	22,794.00	0.06
676	000627	天茂集团	13,000	22,750.00	0.06
677	002320	海峡股份	4,400	22,704.00	0.06
678	688388	嘉元科技	2,328	22,698.00	0.06
679	300085	银之杰	2,800	22,624.00	0.06
680	601107	四川成渝	4,300	22,575.00	0.06
681	605376	博迁新材	1,000	22,570.00	0.06
682	600335	国机汽车	3,900	22,503.00	0.06
683	605123	派克新材	400	22,472.00	0.06
684	600639	浦东金桥	2,200	22,462.00	0.06
685	002967	广电计量	1,900	22,420.00	0.06
685	600780	通宝能源	3,800	22,420.00	0.06
686	688190	云路股份	300	22,413.00	0.06
687	600874	创业环保	4,000	22,360.00	0.06
688	688298	东方生物	823	22,344.45	0.06
689	600449	宁夏建材	1,900	22,325.00	0.06
690	002283	天润工业	5,200	22,308.00	0.06
691	603896	寿仙谷	950	22,296.50	0.06
692	002051	中工国际	3,200	22,272.00	0.06
693	002585	双星新材	4,490	22,270.40	0.06
694	601921	浙版传媒	2,900	22,156.00	0.06
695	600648	外高桥	2,500	22,150.00	0.06
696	601038	一拖股份	1,400	22,134.00	0.06

697	002243	力合科创	4,000	22,120.00	0.06
698	601609	金田股份	3,900	22,074.00	0.06
699	688167	炬光科技	400	22,000.00	0.06
700	601515	东峰集团	6,020	21,973.00	0.06
701	600682	南京新百	4,400	21,956.00	0.06
702	300039	上海凯宝	4,100	21,935.00	0.06
703	002267	陕天然气	2,900	21,924.00	0.06
704	000061	农产品	4,500	21,870.00	0.06
705	601949	中国出版	3,700	21,867.00	0.06
706	603398	沐邦高科	1,400	21,854.00	0.06
707	603801	志邦家居	1,670	21,843.60	0.06
708	002204	大连重工	5,100	21,777.00	0.06
709	002053	云南能投	1,800	21,762.00	0.06
710	000712	锦龙股份	2,900	21,750.00	0.06
711	002194	武汉凡谷	2,700	21,735.00	0.06
712	603566	普莱柯	1,600	21,728.00	0.06
713	603730	岱美股份	2,181	21,679.14	0.06
714	601096	宏盛华源	5,300	21,677.00	0.06
715	603171	税友股份	800	21,632.00	0.06
716	002461	珠江啤酒	2,900	21,518.00	0.06
717	000498	山东路桥	4,100	21,443.00	0.06
718	000557	西部创业	5,700	21,432.00	0.06
719	002163	海南发展	3,900	21,372.00	0.06
720	002581	未名医药	2,200	21,230.00	0.06
721	300821	东岳硅材	3,100	21,204.00	0.06
722	600882	妙可蓝多	1,700	21,199.00	0.06
723	002987	京北方	2,009	21,154.77	0.06
724	688400	凌云光	1,266	21,116.88	0.06
725	301175	中科环保	4,800	21,072.00	0.06
726	002291	遥望科技	4,900	21,070.00	0.06
727	002242	九阳股份	2,000	20,960.00	0.06
728	002941	新疆交建	2,100	20,958.00	0.06
728	301238	瑞泰新材	1,400	20,958.00	0.06
729	000688	国城矿业	2,200	20,944.00	0.06
730	601069	西部黄金	1,800	20,934.00	0.06
731	002891	中宠股份	1,000	20,870.00	0.06
732	603118	共进股份	3,100	20,770.00	0.06
733	603187	海容冷链	1,780	20,754.80	0.06
734	002612	朗姿股份	1,500	20,730.00	0.06
735	000885	城发环境	1,700	20,689.00	0.06
736	600217	中再资环	5,500	20,680.00	0.06
737	688268	华特气体	400	20,644.00	0.06
738	002068	黑猫股份	2,900	20,590.00	0.06

739	000736	中交地产	2,300	20,424.00	0.06
740	300660	江苏雷利	800	20,416.00	0.06
741	688351	微电生理	926	20,409.04	0.06
742	000968	蓝焰控股	3,200	20,352.00	0.06
743	300527	中船应急	3,143	20,335.21	0.06
744	603466	风语筑	2,363	20,180.02	0.06
745	603025	大豪科技	1,460	20,177.20	0.06
746	300358	楚天科技	2,700	20,088.00	0.06
747	688339	亿华通	668	20,026.64	0.06
748	600643	爱建集团	5,300	19,981.00	0.06
749	002488	金固股份	4,550	19,974.50	0.06
750	000881	中广核技	3,100	19,964.00	0.06
751	688343	云天励飞	699	19,956.45	0.06
752	603299	苏盐井神	2,100	19,950.00	0.06
753	301153	中科江南	700	19,782.00	0.06
754	300737	科顺股份	4,600	19,780.00	0.06
755	688800	瑞可达	700	19,656.00	0.05
756	002746	仙坛股份	3,415	19,567.95	0.05
757	605020	永和股份	1,020	19,563.60	0.05
758	688707	振华新材	2,002	19,499.48	0.05
759	600225	卓朗科技	11,200	19,488.00	0.05
760	688586	江航装备	2,094	19,474.20	0.05
761	688097	博众精工	915	19,471.20	0.05
762	601869	长飞光纤	800	19,464.00	0.05
763	002646	天佑德酒	1,900	19,437.00	0.05
764	601033	永兴股份	1,200	19,428.00	0.05
765	603169	兰石重装	4,300	19,350.00	0.05
766	000672	上峰水泥	3,160	19,339.20	0.05
767	000791	甘肃能源	3,120	19,250.40	0.05
768	000869	张裕 A	900	19,215.00	0.05
769	600491	龙元建设	7,000	19,180.00	0.05
770	688508	芯朋微	527	19,166.99	0.05
771	000029	深深房 A	1,800	19,134.00	0.05
772	301316	慧博云通	1,300	19,084.00	0.05
773	603229	奥翔药业	1,895	19,044.75	0.05
774	002096	易普力	1,600	19,040.00	0.05
775	603595	东尼电子	924	19,025.16	0.05
776	301216	万凯新材	1,700	19,023.00	0.05
777	003012	东鹏控股	3,100	18,941.00	0.05
778	300369	绿盟科技	3,700	18,907.00	0.05
779	300143	盈康生命	2,500	18,825.00	0.05
779	301205	联特科技	300	18,825.00	0.05
780	603301	振德医疗	900	18,774.00	0.05

781	603212	赛伍技术	1,700	18,768.00	0.05
782	688048	长光华芯	600	18,744.00	0.05
783	000062	深圳华强	2,100	18,690.00	0.05
784	600783	鲁信创投	2,000	18,660.00	0.05
785	688502	茂莱光学	200	18,602.00	0.05
786	002041	登海种业	2,300	18,584.00	0.05
787	001337	四川黄金	800	18,568.00	0.05
788	600058	五矿发展	2,800	18,480.00	0.05
789	003040	楚天龙	1,500	18,450.00	0.05
790	603327	福蓉科技	1,430	18,432.70	0.05
791	600297	广汇汽车	26,600	18,354.00	0.05
792	603055	台华新材	1,800	18,234.00	0.05
793	301078	孩子王	3,600	18,216.00	0.05
793	600651	飞乐音响	6,600	18,216.00	0.05
794	002034	旺能环境	1,400	18,214.00	0.05
795	000597	东北制药	4,700	18,189.00	0.05
796	603297	永新光学	300	18,147.00	0.05
797	600662	外服控股	4,500	18,045.00	0.05
798	301291	明阳电气	600	18,030.00	0.05
799	300850	新强联	1,200	18,024.00	0.05
800	002378	章源钨业	3,140	18,023.60	0.05
801	688033	天宜上佳	2,982	17,892.00	0.05
802	002135	东南网架	4,500	17,820.00	0.05
803	688232	新点软件	900	17,748.00	0.05
804	605168	三人行	673	17,720.09	0.05
805	603636	南威软件	2,300	17,710.00	0.05
806	603915	国茂股份	1,720	17,698.80	0.05
807	301239	普瑞眼科	500	17,665.00	0.05
808	688091	上海谊众	780	17,620.20	0.05
809	603105	芯能科技	2,000	17,600.00	0.05
810	301080	百普赛斯	500	17,500.00	0.05
811	688031	星环科技	476	17,473.96	0.05
812	000025	特力A	1,300	17,472.00	0.05
812	002516	旷达科技	4,800	17,472.00	0.05
813	300183	东软载波	1,500	17,370.00	0.05
814	688711	宏微科技	1,078	17,312.68	0.05
815	002265	建设工业	2,000	17,260.00	0.05
816	688177	百奥泰	815	17,212.80	0.05
817	002302	西部建设	3,300	17,160.00	0.05
818	603906	龙蟠科技	2,200	17,138.00	0.05
819	600810	神马股份	2,760	17,112.00	0.05
820	600657	信达地产	5,600	17,080.00	0.05
821	300134	大富科技	2,500	17,050.00	0.05



822	688372	伟测科技	432	16,990.56	0.05
823	002190	成飞集成	1,200	16,944.00	0.05
824	000517	荣安地产	6,300	16,884.00	0.05
825	300267	尔康制药	8,100	16,848.00	0.05
826	002489	浙江永强	7,100	16,827.00	0.05
827	000718	苏宁环球	10,000	16,800.00	0.05
828	603162	海通发展	1,792	16,665.60	0.05
829	603985	恒润股份	1,400	16,660.00	0.05
830	300579	数字认证	850	16,575.00	0.05
831	600475	华光环能	1,900	16,549.00	0.05
832	688336	三生国健	809	16,463.15	0.05
833	600340	华夏幸福	15,400	16,324.00	0.05
834	300206	理邦仪器	1,900	16,321.00	0.05
835	300953	震裕科技	300	16,260.00	0.05
836	000030	富奥股份	3,300	16,203.00	0.05
837	600301	华锡有色	800	16,176.00	0.05
838	301498	乖宝宠物	300	16,140.00	0.05
839	688381	帝奥微	828	16,129.44	0.05
840	002913	奥士康	600	16,086.00	0.04
841	300702	天宇股份	900	16,047.00	0.04
842	688131	皓元医药	837	16,011.81	0.04
843	688023	安恒信息	400	16,004.00	0.04
844	600604	市北高新	4,600	15,916.00	0.04
845	301339	通行宝	800	15,912.00	0.04
846	603530	神马电力	600	15,894.00	0.04
847	002453	华软科技	3,700	15,873.00	0.04
848	688432	有研硅	1,637	15,862.53	0.04
849	605009	豪悦护理	400	15,776.00	0.04
850	688105	诺唯赞	787	15,747.87	0.04
851	002088	鲁阳节能	1,300	15,717.00	0.04
852	603609	禾丰股份	2,400	15,696.00	0.04
853	001338	永顺泰	1,600	15,680.00	0.04
854	301268	铭利达	1,000	15,550.00	0.04
855	000016	深康佳 A	7,300	15,549.00	0.04
856	688776	国光电气	280	15,512.00	0.04
857	003009	中天火箭	400	15,472.00	0.04
858	603123	翠微股份	2,600	15,444.00	0.04
859	688686	奥普特	241	15,431.23	0.04
860	688202	美迪西	592	15,421.60	0.04
861	301217	铜冠铜箔	1,600	15,360.00	0.04
862	603113	金能科技	2,800	15,316.00	0.04
863	688515	裕太微	262	15,196.00	0.04
864	601015	陕西黑猫	5,400	15,120.00	0.04

865	002534	西子洁能	1,500	15,015.00	0.04
866	688147	微导纳米	600	14,940.00	0.04
867	301367	怡和嘉业	240	14,928.00	0.04
868	002275	桂林三金	1,200	14,892.00	0.04
869	300768	迪普科技	1,250	14,812.50	0.04
870	301246	宏源药业	1,100	14,806.00	0.04
871	300382	斯莱克	2,500	14,775.00	0.04
872	000813	德展健康	7,100	14,768.00	0.04
873	301293	三博脑科	390	14,699.10	0.04
874	002314	南山控股	7,100	14,697.00	0.04
875	601886	江河集团	3,000	14,640.00	0.04
876	603989	艾华集团	1,030	14,481.80	0.04
877	002959	小熊电器	300	14,433.00	0.04
878	688484	南芯科技	389	14,431.90	0.04
879	002782	可立克	1,300	14,404.00	0.04
880	688261	东微半导	280	14,386.40	0.04
881	001323	慕思股份	500	14,385.00	0.04
882	300869	康泰医学	1,100	14,377.00	0.04
883	600903	贵州燃气	2,300	14,352.00	0.04
884	300080	易成新能	4,900	14,112.00	0.04
885	300894	火星人	1,100	14,102.00	0.04
886	601011	宝泰隆	8,800	14,080.00	0.04
887	603439	贵州三力	1,100	14,036.00	0.04
888	002978	安宁股份	500	13,930.00	0.04
889	688209	英集芯	1,115	13,837.15	0.04
890	603071	物产环能	1,100	13,783.00	0.04
891	603983	丸美股份	500	13,765.00	0.04
892	688380	中微半导	820	13,710.40	0.04
893	688001	华兴源创	604	13,638.32	0.04
894	603693	江苏新能	1,170	13,595.40	0.04
895	603718	海利生物	2,185	13,481.45	0.04
896	603013	亚普股份	1,000	13,470.00	0.04
897	688146	中船特气	451	13,462.35	0.04
898	688206	概伦电子	900	13,365.00	0.04
899	600691	阳煤化工	7,800	13,338.00	0.04
900	688392	骄成超声	314	13,326.16	0.04
901	301207	华兰疫苗	750	13,252.50	0.04
902	600618	氯碱化工	1,500	13,170.00	0.04
903	600610	中毅达	3,300	13,134.00	0.04
904	300446	航天智造	1,100	13,090.00	0.04
905	600400	红豆股份	6,000	13,020.00	0.04
906	688526	科前生物	883	12,971.27	0.04
907	002901	大博医疗	500	12,915.00	0.04

908	688185	康希诺	314	12,902.26	0.04
909	603719	良品铺子	1,100	12,837.00	0.04
910	603666	亿嘉和	808	12,750.24	0.04
911	000019	深粮控股	2,200	12,628.00	0.04
912	001258	立新能源	1,800	12,474.00	0.03
913	688352	颀中科技	1,092	12,459.72	0.03
914	601083	锦江航运	1,300	12,428.00	0.03
915	603877	太平鸟	900	12,357.00	0.03
916	688173	希荻微	1,118	12,331.54	0.03
917	301526	国际复材	3,700	12,321.00	0.03
918	000761	本钢板材	4,900	12,299.00	0.03
919	605222	起帆电缆	800	12,272.00	0.03
920	603995	甬金股份	700	12,264.00	0.03
921	300741	华宝股份	800	12,192.00	0.03
922	301348	蓝箭电子	400	12,156.00	0.03
923	002991	甘源食品	200	12,130.00	0.03
924	603938	三孚股份	1,020	11,985.00	0.03
925	603170	宝立食品	1,000	11,880.00	0.03
926	301089	拓新药业	400	11,868.00	0.03
927	002549	凯美特气	2,300	11,753.00	0.03
928	001308	康冠科技	520	11,700.00	0.03
929	300755	华致酒行	840	11,474.40	0.03
930	301327	华宝新能	200	11,460.00	0.03
931	688046	药康生物	1,120	11,446.40	0.03
932	300973	立高食品	400	11,236.00	0.03
933	601811	新华文轩	800	11,208.00	0.03
934	600811	东方集团	16,800	11,088.00	0.03
935	603098	森特股份	1,400	11,004.00	0.03
936	002651	利君股份	2,000	10,980.00	0.03
937	300140	节能环境	1,800	10,746.00	0.03
938	300887	谱尼测试	1,420	10,508.00	0.03
939	301069	凯盛新材	800	10,488.00	0.03
940	688383	新益昌	200	10,422.00	0.03
941	603093	南华期货	1,200	10,392.00	0.03
942	301487	盟固利	400	10,344.00	0.03
943	688128	中国电研	600	10,326.00	0.03
944	000058	深赛格	1,900	10,203.00	0.03
945	301325	曼恩斯特	240	10,180.80	0.03
946	001311	多利科技	420	10,155.60	0.03
947	688337	普源精电	400	10,088.00	0.03
948	002990	盛视科技	500	10,065.00	0.03
949	003039	顺控发展	800	10,024.00	0.03
950	001269	欧晶科技	360	10,008.00	0.03

951	002961	瑞达期货	900	9,855.00	0.03
952	688315	诺禾致源	900	9,828.00	0.03
953	002287	奇正藏药	500	9,790.00	0.03
954	002946	新乳业	1,100	9,636.00	0.03
955	603132	金徽股份	700	9,632.00	0.03
956	002911	佛燃能源	1,044	9,542.16	0.03
957	001322	箭牌家居	1,300	9,503.00	0.03
958	301371	敷尔佳	300	9,318.00	0.03
959	688531	日联科技	200	9,232.00	0.03
960	301511	德福科技	600	8,856.00	0.02
961	300860	锋尚文化	420	8,836.80	0.02
962	301559	中集环科	600	8,742.00	0.02
963	603489	八方股份	320	8,633.60	0.02
964	688680	海优新材	300	8,622.00	0.02
965	601068	中铝国际	2,000	8,420.00	0.02
966	301558	三态股份	1,000	8,390.00	0.02
967	301510	固高科技	300	8,325.00	0.02
968	600403	大有能源	3,100	7,998.00	0.02
969	601022	宁波远洋	900	7,938.00	0.02
970	688161	威高骨科	400	7,928.00	0.02
971	688152	麒麟信安	200	7,744.00	0.02
972	603057	紫燕食品	500	7,660.00	0.02
973	605011	杭州热电	300	7,299.00	0.02
974	301090	华润材料	1,100	7,238.00	0.02
975	001236	弘业期货	1,000	7,110.00	0.02
976	301262	海看股份	300	6,765.00	0.02
977	603103	横店影视	480	6,643.20	0.02
978	605365	立达信	400	6,348.00	0.02
979	301180	万祥科技	400	6,256.00	0.02
980	001376	百通能源	300	5,586.00	0.02
981	301177	迪阿股份	300	5,580.00	0.02
982	603075	热威股份	300	5,295.00	0.01
983	601279	英利汽车	1,400	5,222.00	0.01
984	688433	华曙高科	245	5,110.70	0.01
985	000982	中银绒业	27,900	5,022.00	0.01
986	301381	赛维时代	200	4,546.00	0.01
987	301376	致欧科技	200	4,234.00	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

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	300630	普利制药	2,100	25,935.00	0.07
2	002610	ST 爱康	29,700	10,989.00	0.03

## 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	000766	通化金马	110,313.00	0.24
2	300049	福瑞股份	93,537.00	0.21
3	002270	华明装备	73,360.00	0.16
4	000581	威孚高科	66,462.00	0.15
5	603283	赛腾股份	64,206.00	0.14
6	300115	长盈精密	61,832.00	0.14
7	300857	协创数据	59,600.00	0.13
8	600461	洪城环境	58,745.00	0.13
9	688498	源杰科技	55,424.88	0.12
10	300045	华力创通	54,960.00	0.12
11	000628	高新发展	54,612.00	0.12
12	300757	罗博特科	53,807.00	0.12
13	688076	诺泰生物	52,584.15	0.12
14	688062	迈威生物	51,374.18	0.11
15	300415	伊之密	50,490.00	0.11
16	300705	九典制药	49,802.00	0.11
17	000970	中科三环	49,637.00	0.11
18	601778	晶科科技	48,807.00	0.11
19	688333	铂力特	48,496.00	0.11
20	002456	欧菲光	48,232.00	0.11

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	601567	三星医疗	187,258.00	0.42
2	688617	惠泰医疗	178,910.00	0.40
3	002436	兴森科技	146,170.00	0.32
4	603979	金诚信	145,980.86	0.32
5	300002	神州泰岳	139,915.00	0.31
6	000921	海信家电	133,799.00	0.30
7	300054	鼎龙股份	131,591.40	0.29
8	600872	中炬高新	129,392.00	0.29
9	000818	航锦科技	108,799.00	0.24
10	603179	新泉股份	108,707.20	0.24
11	603087	甘李药业	103,823.00	0.23
12	600777	ST 新潮	100,773.00	0.22

13	300765	新诺威	96,666.86	0.21
14	300567	精测电子	92,873.00	0.21
15	002261	拓维信息	91,983.00	0.20
16	600483	福能股份	86,151.78	0.19
17	300803	指南针	85,029.00	0.19
18	603298	杭叉集团	83,434.96	0.19
19	002984	森麒麟	81,517.40	0.18
20	600612	老凤祥	79,462.00	0.18

注：卖出金额不包括相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	7,108,831.84
卖出股票收入（成交）总额	9,202,860.06

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

本基金未投资股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

##### 7.11.2 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 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 欧菲光集团股份有限公司因内幕交易, 内部制度不完善; 于 2023 年 12 月 29 日收到深圳证监局监管谈话、谈话提醒的处罚措施。

华宝中证 1000 指数截止 2024 年 06 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 浙江万丰奥威汽轮股份有限公司因公司在答复投资者提问时, 存在误导性陈述; 于 2024 年 04 月 19 日收到浙江证监局警示, 记入诚信档案的处罚措施。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析, 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	1,882.11
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	79,034.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	80,916.19

### 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

金额单位: 人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300630	普利制药	25,935.00	0.07	重大事项停牌
2	002610	ST 爱康	10,989.00	0.03	重大事项停牌

### 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	3,427	10,991.16	0.00	0.00	37,666,710.71	100.00
华宝中证 1000 指数 C	1,461	6,955.66	54,650.78	0.54	10,107,573.08	99.46
合计	4,888	9,784.97	54,650.78	0.11	47,774,283.79	99.89

### 8.2 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	1.09	0.0000
	华宝中证 1000 指数 C	55,586.23	0.5470
	合计	55,587.32	0.1162

### 8.3 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	华宝中证 1000 指数	0



本开放式基金	华宝中证 1000 指数 C	0~10
	合计	0~10

## § 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	39,344,143.11	11,582,445.66
本报告期基金总申购份额	5,757,525.30	42,549,068.52
减：本报告期基金总赎回份额	7,434,957.70	43,969,290.32
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	37,666,710.71	10,162,223.86

## § 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，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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

目前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：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，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 (%)	
财通证券	2	15,971,970.90	97.92	15,024.61	97.93	-
招商证券	2	339,721.00	2.08	317.90	2.07	-
长城证券	3	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
大和证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国投证券	3	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

海通证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	3	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	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	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金国际	1	-	-	-	-	-
中山证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
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： 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需 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：华福证券；退租交易单元：申港证券。

### 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	2024-01-19
2	华宝基金关于旗下部分基金新增上海大智慧基金销售有限公司为代销机构的通知	基金管理人网站	2024-02-29
3	华宝基金管理有限公司旗下部分基金年度报告提示性公告	上海证券报，证券日报，证券时报，中国证券报	2024-03-29
4	华宝中证 1000 指数证券投资基金 2023 年年度报告	基金管理人网站	2024-03-29
5	华宝基金关于华宝中证 1000 指数证券投资基金 C 类新增华泰证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站，证券日报	2024-04-18
6	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	2024-04-19
7	华宝中证 1000 指数证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2024-04-19
8	华宝基金关于旗下部分基金新增华福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	2024-05-20
9	华宝基金关于旗下部分基金新增湘财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	2024-06-21
10	华宝中证 1000 指数证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2024-06-28
11	华宝中证 1000 指数证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2024-06-28

## § 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

2024 年 8 月 30 日