

华宝中证 1000 指数证券投资基金(原华宝 中证 1000 指数分级证券投资基金) 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 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：2021 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 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已经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	6
2.1 基金基本情况（转型后）	6
2.1 基金基本情况（转型前）	6
2.2 基金产品说明（转型后）	7
2.2 基金产品说明（转型前）	7
2.3 基金管理人和基金托管人	8
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料(转型后)	8
2.5 其他相关资料(转型前)	8
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	9
3.1 主要会计数据和财务指标(转型后)	9
3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)	9
3.2 基金净值表现（转型后）	10
3.2 基金净值表现（转型前）	12
3.3 其他指标	13
3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型后）	13
3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型前）	13
§ 4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	17
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.....	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	20
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	21
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	22
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	错误!未定义书签。
4.10 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.....	22
§ 5 托管人报告	22
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	22
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.....	22
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	22
§ 6 审计报告（转型后）	22
6.1 审计报告基本信息	22
6.2 审计报告的基本内容	22
§ 6 审计报告（转型前）	24
6.1 审计报告基本信息	24

6.2 审计报告的基本内容	24
§ 7 年度财务报表（转型后）	26
7.1 资产负债表	26
7.2 利润表	28
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	28
7.4 报表附注	29
§ 7 年度财务报表（转型前）	53
7.1 资产负债表	53
7.2 利润表	54
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	55
7.4 报表附注	57
§ 8 投资组合报告（转型后）	85
8.1 期末基金资产组合情况	85
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	86
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	87
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	111
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	112
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	112
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	112
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	112
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	112
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	112
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	113
8.12 投资组合报告附注	113
§ 8 投资组合报告（转型前）	114
8.1 期末基金资产组合情况	114
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	114
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	错误!未定义书签。
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	140
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	141
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	141
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	141
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	141
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	142
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	142
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	142
8.12 投资组合报告附注	142
§ 9 基金份额持有人信息（转型后）	143
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	143
9.2 期末上市基金前十名持有人	错误!未定义书签。
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	143
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	143
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	

144

§ 9 基金份额持有人信息（转型前）	144
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	144
9.2 期末上市基金前十名持有人	144
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	145
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	145
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	145
§ 10 开放式基金份额变动（转型后）	145
§ 10 开放式基金份额变动（转型前）	145
§ 11 重大事件揭示	146
11.1 基金份额持有人大会决议	146
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	146
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	147
11.4 基金投资策略的改变	147
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	147
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	147
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后).....	147
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前).....	151
11.8 其他重大事件（转型后）	155
11.8 其他重大事件（转型前）	156
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	162
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	162
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	162
§ 13 备查文件目录	162
13.1 备查文件目录	162
13.2 存放地点	162
13.3 查阅方式	163

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

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	1000 指数
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	38,828,508.58 份
基金合同存续期	不定期

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金		
基金简称	华宝中证 1000 指数分级		
场内简称	1000 分级		
基金主代码	162413		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 6 月 4 日		
基金管理人	华宝基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份 额总额	41,884,507.09 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 06 月 16 日		
下属分级基金的基 金简称	1000A	1000B	华宝中证 1000 指数分级
下属分级基金的场 内简称	1000A	1000B	1000 分级

下属分级基金的交易代码	150263	150264	162413
报告期末下属分级基金的份额总额	一份	一份	41,884,507.09 份

2.2 基金产品说明（转型后）

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。

2.2 基金产品说明（转型前）

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，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。		
下属分级基金的风险收益	华宝中证	华宝中证	本基金为股票型指数基金，具有较高预

特征	1000A 份额具有较低风险、收益相对稳定的特征。	1000B 份额具有较高风险、较高预期收益的特征。	期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
----	---------------------------	---------------------------	--

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周雷	李申
	联系电话	021-38505888	021-60637102
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050、021-38924558	021-60637111
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		XIAOYI HELEN HUANG	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金年度报告备置地点	本基金年报置备地点包括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(转型后)

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

2.5 其他相关资料(转型前)

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标(转型后)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年 11 月 19 日（基金合同生效日）-2020 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-806,024.66
本期利润	-257,707.12
加权平均基金份额本期利润	-0.0063
本期加权平均净值利润率	-0.64%
本期基金份额净值增长率	-0.59%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末
期末可供分配利润	-65,673,713.72
期末可供分配基金份额利润	-1.6914
期末基金资产净值	38,436,006.14
期末基金份额净值	0.9899
3.1.3 累计期末指标	2020 年末
基金份额累计净值增长率	-0.59%

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

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

3、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。

3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年 1 月 1 日-2020 年 11 月 18 日	2019 年	2018 年
本期已实现收益	19,281.83	-5,759,941.35	-11,514,960.51
本期利润	10,102,934.91	11,127,077.44	-22,718,230.72
加权平均基金份额本期利润	0.2107	0.1879	-0.3617
本期加权平均净值利润率	19.76%	23.38%	-43.49%

本期基金份额净值增长率	21.19%	27.28%	-35.99%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年 11 月 18 日	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	-70,012,687.01	-96,177,604.95	-108,584,959.73
期末可供分配基金份额利润	-1.6716	-1.6766	-1.8043
期末基金资产净值	41,710,550.26	47,140,075.82	40,186,333.58
期末基金份额净值	0.9958	0.8217	0.6678
3.1.3 累计期末指标	2020 年 11 月 18 日	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	-58.33%	-65.62%	-72.99%

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

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

3、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（转型后）

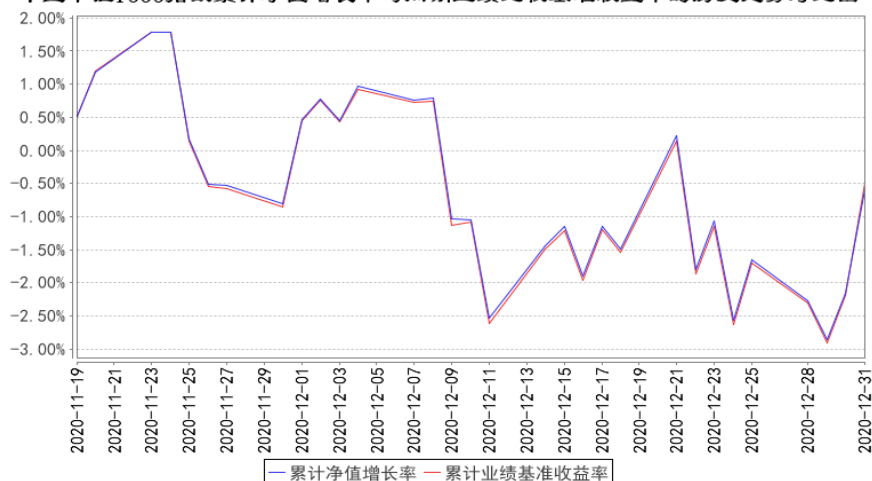
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-%	-%	-%	-%	-%	-%
过去六个月	-%	-%	-%	-%	-%	-%

过去一年	-%	-%	-%	-%	-%	-%
过去三年	-%	-%	-%	-%	-%	-%
过去五年	-%	-%	-%	-%	-%	-%
自基金合同生效起至今	-0.59%	0.99%	-0.50%	1.00%	-0.09%	-0.01%

3.2.2 自基金转型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

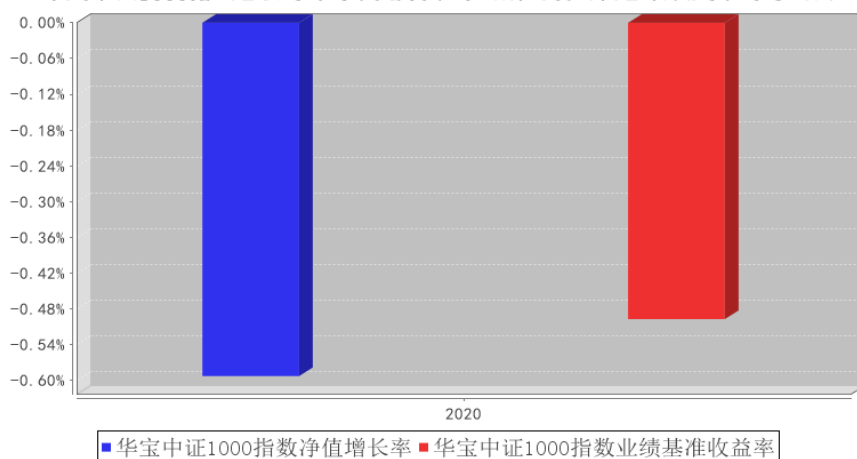
华宝中证1000指数累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金转型日 2020 年 11 月 19 日

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率率的比较

华宝中证1000指数基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：基金转型日 2020 年 11 月 19 日

3.2 基金净值表现（转型前）

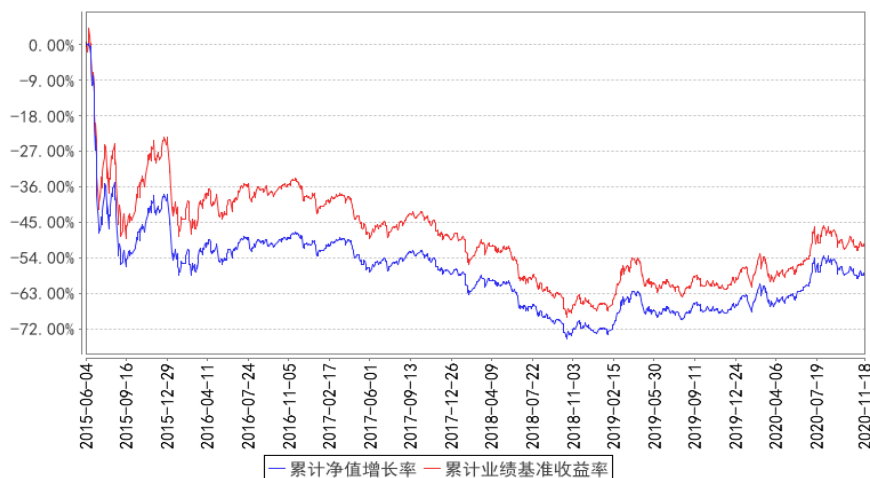
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-10.35%	1.29%	-9.33%	1.36%	-1.02%	-0.07%
过去六个月	14.33%	1.47%	13.38%	1.51%	0.95%	-0.04%
过去一年	29.34%	1.61%	27.39%	1.64%	1.95%	-0.03%
过去三年	-4.84%	1.51%	-7.25%	1.54%	2.41%	-0.03%
过去五年	-27.67%	1.54%	-30.73%	1.56%	3.06%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-58.33%	1.79%	-51.01%	1.82%	-7.32%	-0.03%

注：过去三个月为 2020 年 8 月 19 日至 2020 年 11 月 18 日，过去六个月为 2020 年 5 月 19 日至 2020 年 11 月 18 日，过去一年为 2019 年 11 月 19 日至 2020 年 11 月 18 日，过去三年为 2017 年 11 月 19 日至 2020 年 11 月 18 日，过去五年为 2015 年 11 月 19 日至 2020 年 11 月 18 日，自基金合同生效起至今为 2015 年 6 月 4 日至 2020 年 11 月 18 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

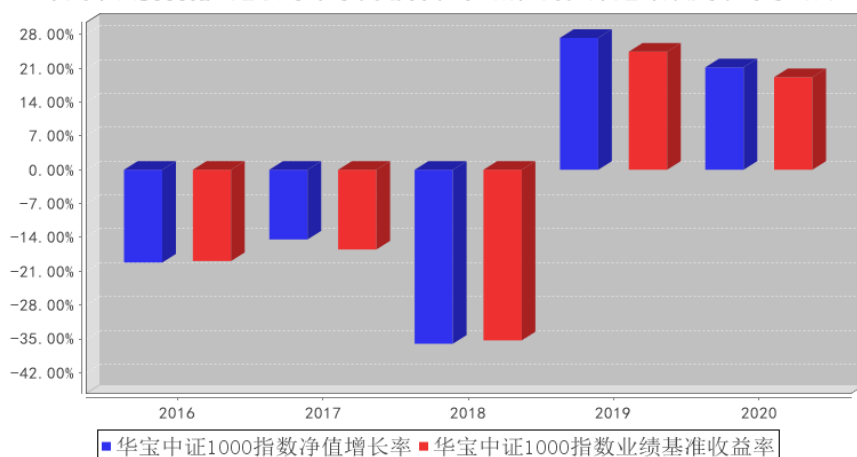
华宝中证1000指数累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宝中证1000指数基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型后）

本基金本期未实施利润分配。

3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型前）

本基金过去三年未实施利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人是在 2003 年 3 月 7 日正式成立的合资基金管理公司，截至本报告期末（2020 年 12 月 31 日），正在管理运作的证券投资基金分别为：华宝宝康债券投资基金、华宝宝康消费品证券投资基金、华宝宝康灵活配置证券投资基金、华宝多策略增长开放式证券投资基金、华宝现金宝货币市场基金、华宝动力组合混合型证券投资基金、华宝收益增长混合型证券投资基金、华宝先进成长混合型证券投资基金、华宝行业精选混合型证券投资基金、华宝海外中国成长混合型证券投资基金、华宝大盘精选混合型证券投资基金、华宝增强收益债券型证券投资基金、华宝中证 100 指数证券投资基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝新兴产业混合型证券投资基金、华宝可转债债券型证券投资基金、华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金 (LOF)、华宝医药生物优选混合型证券投资基金、华宝资源优选混合型证券投资基金、华宝现金添益交易型货币市场基金、华宝服务优选混合型证券投资基金、华宝创新优选混合型证券投资基金、华宝生态中国混合型证券投资基金、华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金、华宝高端制造股票型证券投资基金、华宝品质生活股票型证券投资基金、华宝稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、华宝事件驱动混合型证券投资基金、华宝国策导向混合型证券投资基金、华宝中证医疗指数证券投资基金、华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金、华宝中证 1000 指数证券投资基金、华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、华宝万物互联灵活配置混合型证券投资基金、华宝转型升级灵活配置混合型证券投资基金、华宝核心优势灵活配置混合型证券投资基金、华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金 (LOF)、华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金 (LOF)、华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金、华宝未来主导产业灵活配置混合型证券投资基金、华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金、华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF)、华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金、华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、华宝港股通恒生中国 (香港上市) 25 指数证券投资基金 (LOF)、华宝智慧产业灵活配置混合型证券投资基金、华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金、华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金、华宝价值发现混合型证券投资基金、华宝港股通恒生香港 35 指数证券投资基金 (LOF)、华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、华宝港股通香港精选混合型证券投资基金、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、华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金、华宝绿色主题混合型证券投资基金、华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金 (LOF)、华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金 (LOF)、华宝科技先锋混合型证券投资基金、华宝宝裕纯债债券型证券投资基金、华宝中短债债券型发起式证券投资基金、华宝大健康混合型证券投资基金、华宝稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、华宝宝盛纯债债券型证券投资基金、华宝宝怡纯债债券型证券投资基金、华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金、华宝消费升级混合型证券投资基金、华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金、华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金 (LOF)、华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华宝政策性金融债债券型证券投资基金、华宝浮动净值型发起式货币市场基金、华宝绿色领先股票型证券投资基金、华宝宝润纯债债券型证券投资基金、华宝宝惠纯债 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华宝致远混合型证券投资基金 (QDII)、华宝中证消费龙头指数证券投资基金 (LOF)、华宝成长策略混合型证券投资基金、华宝红利精选混合型证券投资基金、华宝宝利纯债 86 个月定期开放债券型证券投资基金、华宝中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金、华宝研究精选混合型证券投资基金、华宝中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、华宝新兴成长混合型证券投资基金、华宝英国富时 100 指数发起式证券投资基金、华宝竞争优势混合型证券投资基金、华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
丰晨成	本基金基金经理、上证 180 价值 ETF、华宝上证 180 价值 ETF 联接、华宝中证全指证券公司 ETF、华	2020 年 11 月 19 日	-	11 年	硕士。2009 年加入华宝基金管理有限公司，先后担任助理产品经理、数量分析师、投资经理助理、投资经理等职务，现任指数研发投资部基金经理。2015 年 11 月起任上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2016 年 8 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2018 年 4 月至 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。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

	宝中证 500 增强、华宝券商 ETF 联接基金经理				华宝中证 1000 指数证券投资基金基金经理。
--	----------------------------	--	--	--	-------------------------

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
丰晨成	本基金基金经理、上证 180 价值 ETF、华宝上证 180 价值 ETF 联接、华宝中证全指证券公司 ETF、华宝中证 500 增强、华宝券商 ETF 联接、华宝中证 1000 指数基金经理	2018 年 8 月 24 日	2020 年 11 月 19 日	11 年	硕士。2009 年加入华宝基金管理有限公司，先后担任助理产品经理、数量分析师、投资经理助理、投资经理等职务，现任指数研发投资部基金经理。2015 年 11 月起任上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2016 年 8 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2018 年 4 月至 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。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。
张奇	本基金的基金经理助理、华宝红利	2017 年 4 月 6 日	2020 年 6 月 23 日	10 年	硕士。曾任毕博管理咨询有限公司业务顾问，德邦证券股份有限公司量化投资部投资经理、董事副总经理。2014 年 10 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任量化投资部、指数研发投资部高级数量分析师、基金

	<p>精选混合基金经理</p>			<p>经理助理等职务，现任指数研发投资部基金经理。2015 年 4 月至 2020 年 6 月任上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。2015 年 5 月至 2018 年 11 月兼任华宝上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。2015 年 5 月至 2019 年 1 月任上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2017 年 4 月至 2019 年 1 月任华宝中证医疗指数分级证券投资基金、华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2017 年 4 月至 2020 年 6 月任华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金经理助理。2018 年 11 月 2020 年 6 月任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。2019 年 1 月 2020 年 6 月任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2020 年 6 月起任华宝红利精选混合型证券投资基金基金经理。</p>
--	-----------------	--	--	--

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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（转型后）

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。

4.1.3 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（转型前）

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、《华宝基金管理有限公司华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》及《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 公平交易制度和控制方法

基金管理人从研究分析、授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节出发制定了公司内部的公平交易制度以确保公司所有投资组合在各个环节得到公平的对待。公平

交易制度和控制方法适用公司管理所有投资组合（包括公募基金、特定客户资产管理组合），对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

研究分析方面，公司使用统一的投资研究管理系统，并规定所有与投资业务相关的研究报告和股票入库信息必须在该系统中发表和存档。同时，该系统对所有投资组合经理设置相同的使用权限。

授权和投资决策方面，投资组合经理在其权限范围内的投资决策保持独立，并对其投资决策的结果负责。通过各个系统的权限设置使投资组合经理仅能看到自己的组合情况。

交易执行方面，所有投资组合的投资指令必须通过交易系统分发和执行。对于交易所公开竞价交易，交易系统内置公平交易执行程序。公司内部制度规定此类交易指令需执行公平交易程序，由交易部负责人负责执行。针对其他不能通过系统执行公平交易程序且必须以公司名义统一进行交易的指令，公司内部制定相关制度流程以确保此类交易的公允分配。同时，公司根据法规要求在交易系统中设置一系列投资禁止与限制指标对公平交易的执行进行事前控制，主要包括限制公司旗下组合自身及组合间反向交易、对敲交易、银行间关联方交易等。

事后监督，公司的风险管理部作为独立第三方对所有投资行为进行事后监督，主要监督的事项包括以下内容。

1) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析。

2) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合所有交易所二级市场交易进行 1 日、3 日、5 日同向交易价差分析。

3) 对公司管理的不同投资组合的所有银行间债券买卖和回购交易进行分析。监督的内容包括以下几点，同一投资组合短期内对同一债券的反向交易，债券买卖到期收益率与中债登估价收益率之间的差异，回购利率与当日市场平均利率之间的差异。对上述监督内容存在异常的情况要求投资组合经理进行合理性解释。

4) 对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程的公允性进行监督。

4.3.2 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

资产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。

4.3.3 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

回顾 2020 年，面对严峻复杂的国际形势，新冠肺炎疫情对经济的严重冲击下，在统筹国内国际两个大局、统筹疫情防控和经济社会发展的实践下，三大攻坚战取得决定性成就，我国成为全球唯一实现经济正增长的主要经济体，国内经济的强大韧性成为资本市场的有力支撑。中美第一阶段贸易协议后美对华各方面的角力及限制，因为中国率先从疫情中复苏，难挡国际资本对中国市场的热情，北水的动向日益成为一种风向标，从一个侧面印证了 A 股市场投资者结构更多样化，资本市场参与者在国际投资者话语权逐渐提高的过程中，投资理念与国外市场正逐渐融合。2020 年，疫情成为资本市场的黑天鹅事件，其发展直接影响着市场各主题行业板块表现的相对变化，行业层面景气度较高的食品饮料、医药、新能源、电子等表现较强，而疫情受损的金融、基建等偏弱。作为 A 股市场小盘股的典型代表，中证 1000 指数上半年经历了春节前后和 3 月中下旬两次疫情冲击下的短期冲击，也经历了 2 月跟随市场“宅家牛”反弹而上升，4-7 月随着恐慌情绪减弱和复工复产有效推进，货币流动性助推的一波向上，8 月之后中证 1000 指数处于振荡为主的格局，市场风格偏向白马股，使得小盘股指数重心处于下移。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

本报告期内，本基金由华宝中证 1000 指数分级证券投资基金转型为华宝中证 1000 指数证券投资基金，2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 18 日，华宝中证 1000 指数分级证券投资基金净值增长率为 21.19%，同期业绩比较基准收益率为 19.16%。2020 年 11 月 19 日至 2020 年 12 月 31 日，

华宝中证 1000 指数证券投资基金净值增长率为-0.59%，同期业绩比较基准收益率为-0.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年，随着疫苗的陆续推出，疫情对全球经济的影响必将逐步弱化，全球经济共振复苏的预期提升。2021 年是“十四五”的开局之年，大量的产业政策或将密集出台，推动国内的经济循环以及产业的发展。资金面上，由于海外充裕的流动性及中国优质资产的吸引力使得全球资金加速流向 A 股市场，另一方面国内货币政策“不急转向”的稳健操作使得市场对政策风险的担心得到缓解，再加上居民财富的持续转移，A 股逐步走向机构化、长期化、成熟化。但全球流动性泛滥造成的通胀压力等外部不确定因素预计仍将给 A 股市场带来一定的扰动。2021 年或将大概率延续结构性行情。中证 1000 指数表征的小盘股在经历了 15 年以来小盘股的估值逐渐回归正常并向着大中市值估值水平逐渐收敛，年末中证 1000 指数的 PE (TTM) 估值 42 倍左右，从历史回顾来看，大盘股和中小盘股的相对强弱具有周期性，我们认为 2021 年小盘股可能存在阶段性机会或超跌反弹行情。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

公司自 2003 年 3 月成立以来始终注重合规性和业务风险控制。加强对基金运作的内部操作风险控制、保障基金份额持有人的利益始终是公司制定各项内部制度、流程的指导思想。公司合规审计部门对公司遵守各项法规和管理制度及公司所管理的各基金履行合同义务的情况进行核查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向监管部门、公司管理层及上级公司出具相关报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

（一）规范员工行为操守，加强职业道德教育和风险教育。公司通过对新员工集中组织岗前培训、签署《个人承诺书》等形式，明确员工的行为准则，防范道德风险。并在具体工作中坚持加强法规培训，努力培养员工的风险意识、合法合规意识。

（二）完善公司制度体系。公司一方面坚持制度的刚性，不轻易改变、简化已确立的流程。要求从一般员工、部门经理到业务总监，每个人都必须清楚自己的权力和职责，承担相应责任。另一方面，伴随市场变革和产品创新，公司的业务和管理方式也发生着变化。在长期的业务实践中，公司借鉴和吸收海外股东、国内同行经验，在符合公司基本制度的前提下，根据业务的发展不时调整。允许各级员工在职责范围内设计和调整自己的业务流程，涉及其它部门或领域的，由相应级别的负责人在符合公司已有制度的基础上协调和批准。公司根据法律法规的变化、监管要求和业务情况不断调整和细化市场、营运、投资研究各方面的分工和业务规则，并根据内部控制委员会和合规审计部门提出的意见、建议调整或改善了前、中、后台的业务流程。

(三) 有重点地全面开展内部审计稽核工作。2020 年, 合规审计部门按计划对公司营运、投资、市场部门进行了业务审计、依据各项监管规定对公司相关内部流程进行了评估、根据监管要求开展了涉及投研、运营、销售等方面的专项自查; 并与相关部门进行沟通, 形成后续跟踪和业务上相互促进的良性循环, 不断提高工作质量。

在今后的工作中, 本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念, 完善内控制度, 提高工作水平, 努力防范和控制各种风险, 保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会, 定期评价现行估值政策和程序, 在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况后及时修订估值方法。基金在投资新品种时, 由估值委员会评价现有估值政策和程序的适用性。

(1) 日常估值流程

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

(2) 特殊业务估值流程

根据中国证券监督管理委员会[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、中国证券投资基金业协会《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》、《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》等有关规定及本公司的估值制度, 对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况, 量化投资部根据估值委员会确定的对停牌股票或异常交易股票估值调整的方法(比如: 指数收益法)进行估值, 并兼顾行业研究员基于上市公司估值模型计算结果所提出的估值建议或意见。必要时基金经理也会就估值模型及估值方法的确定提出建议和意见, 但由估值委员会做最终决策。

上述参与估值流程的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力, 参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.8 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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告（转型后）

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2021）审字第 61471289_B53 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
--------	------

审计报告收件人	华宝中证 1000 指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了华宝中证 1000 指数证券投资基金的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年 11 月 19 日（修订后的基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的华宝中证 1000 指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华宝中证 1000 指数证券投资基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 11 月 19 日（修订后的基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华宝中证 1000 指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>华宝中证 1000 指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估华宝中证 1000 指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督华宝中证 1000 指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

	<p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对华宝中证 1000 指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华宝中证 1000 指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	陈露	许培菁
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2021 年 03 月 26 日	

§ 6 审计报告（转型前）

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2021）审字第 61471289_B29 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了华宝中证 1000 指数分级证券投资基金的财务报表，包括 2020 年 11 月 18 日（基金合同失效日前日）的资产负债表，2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 18 日（基金合同失效日前日）止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变

	<p>动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的华宝中证 1000 指数分级证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2020 年 11 月 18 日（基金合同失效日前日）的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 18 日（基金合同失效日前日）止期间的经营成果和净值变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
<p>强调事项</p>	<p>—</p>
<p>其他事项</p>	<p>—</p>
<p>其他信息</p>	<p>华宝中证 1000 指数分级证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估华宝中证 1000 指数分级证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督华宝中证 1000 指数分级证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p>

	<p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对华宝中证 1000 指数分级证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华宝中证 1000 指数分级证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	陈露 许培菁
会计师事务所的地址	中国 北京
审计报告日期	2021 年 3 月 26 日

§ 7 年度财务报表（转型后）

7.1 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：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	2,464,173.25
结算备付金		-
存出保证金		3,665.20
交易性金融资产	7.4.7.2	36,383,719.57
其中：股票投资		36,383,719.57
基金投资		-

债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		197,770.00
应收利息	7.4.7.5	265.12
应收股利		-
应收申购款		9,974.22
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		39,059,567.36
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年12月31日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		426,114.79
应付管理人报酬		10,000.89
应付托管费		1,726.71
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	24,356.31
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	161,362.52
负债合计		623,561.22
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	92,794,990.81
未分配利润	7.4.7.10	-54,358,984.67
所有者权益合计		38,436,006.14
负债和所有者权益总计		39,059,567.36

注：(1) 报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9899 元，基金份额总额 38,828,508.58 份。

(2) 本基金修订后的基金合同于 2020 年 11 月 19 日生效。

7.2 利润表

会计主体：华宝中证 1000 指数证券投资基金

本报告期：2020 年 11 月 19 日（修订后的基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 11 月 19 日（修订后的 基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		-150,247.95
1. 利息收入		1,073.83
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,073.83
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）		-701,255.58
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-699,849.99
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	-1,405.59
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	548,317.54
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,616.26
减：二、费用		107,459.17
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	23,675.01
2. 托管费	7.4.10.2.2	4,735.00
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	22,193.23
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	7.4.7.20	56,855.93
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-257,707.12
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-257,707.12

7.3 所有者权益（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：2020 年 11 月 19 日（修订后基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 11 月 19 日（修订后基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	100,098,448.68	-58,387,898.42	41,710,550.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-257,707.12	-257,707.12
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-7,303,457.87	4,286,620.87	-3,016,837.00
其中：1. 基金申购款	825,039.77	-485,476.08	339,563.69
2. 基金赎回款	-8,128,497.64	4,772,096.95	-3,356,400.69
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	92,794,990.81	-54,358,984.67	38,436,006.14

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华宝中证 1000 指数证券投资基金（以下简称“本基金”），原华宝中证 1000 指数分级证券投资基金（原名为华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金），经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]第 664 号《关于准予华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资

基金注册的批复》核准，由华宝基金管理有限公司（原华宝兴业基金管理有限公司，已于 2017 年 10 月 17 日办理完成工商变更登记）依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 330,638,859.16 元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2015）第 673 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 330,711,104.54 份基金份额，其中认购资金利息折合 72,245.38 份基金份额。本基金通过场内、场外两种方式公开发售，按照每份基金份额 1.00 元计算，本基金募集期间含本息共募集 330,711,104.54 份基金份额，其中场外认购的基金份额为 271,827,940.54 份、场内认购的基金份额为 58,883,164.00 份。

2020 年 10 月 9 日至 2020 年 10 月 18 日，华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，会议审议通过了《关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》，同意华宝中证 1000 指数分级证券投资基金转型为华宝中证 1000 指数证券投资基金，取消分级运作机制，基金名称相应变更为“华宝中证 1000 指数证券投资基金”并修订《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》。上述基金转型事项已于 2020 年 10 月 19 日经持有人大会表决通过生效，自 2020 年 11 月 19 日起，《华宝中证 1000 指数证券投资基金基金合同》生效，《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》同日失效，华宝中证 1000 指数分级证券投资基金正式变更为华宝中证 1000 指数证券投资基金。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。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。

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）。本基金可以按照法律法规和监管部门的有关规定进行融资以及参与融资融券出借等相关业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于中证 1000 指数成份股及其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）或到期日在一年以内的政府债券。

本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。

本财务报表已于 2021 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）和在财务报表附注 7.4.4 所列示依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 11 月 19 日（修订后的基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2020 年 11 月 19 日（修订后的基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额，在转

融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时计入转融通证券出借业务利息收入；

(6) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(7) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(9) 股指/国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(10) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(11) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(12) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(13) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金在符合有关基金分红条件的前提下可进行收益分配，每次收益分配比例等具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若

投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；红利再投资方式免收再投资的费用；如投资人在不同销售机构选择的分红方式不同，登记机构将以投资人最后一次选择的分红方式为准。登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，参照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。具体权益分配程序等有关事项参照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

(1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。

(3) 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行

规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

（4）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

（5）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	2,464,173.25
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	2,464,173.25

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	37,306,172.68	36,383,719.57	-922,453.11
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	37,306,172.68	36,383,719.57	-922,453.11

7.4.7.3 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
----	-------------------------

应收活期存款利息	263.24
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.01
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	1.87
合计	265.12

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	24,356.31
银行间市场应付交易费用	-
合计	24,356.31

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,362.52
应付证券出借违约金	-
预提费用	110,000.00
应付指数使用费	50,000.00
合计	161,362.52

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年11月19日（修订后的基金合同生效日）至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	41,884,507.09	100,098,448.68
2020年11月19日（基金合同生效日）至2020年12月31日基金份额折算调整	-	-
2020年11月19日（基金合同	-	-

生效日)至 2020 年 12 月 31 日未领取红利份额折算调整(若有)		
2020 年 11 月 19 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日集中申购募集资金本金及利息	-	-
2020 年 11 月 19 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	345,225.65	825,039.77
本期赎回(以“-”号填列)	-3,401,224.16	-8,128,497.64
本期末	38,828,508.58	92,794,990.81

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
修订后基金合同生效日	-70,012,687.01	11,624,788.59	-58,387,898.42
本期利润	-806,024.66	548,317.54	-257,707.12
本期基金份额交易产生的变动数	5,144,997.95	-858,377.08	4,286,620.87
其中：基金申购款	-582,001.33	96,525.25	-485,476.08
基金赎回款	5,726,999.28	-954,902.33	4,772,096.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-65,673,713.72	11,314,729.05	-54,358,984.67

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 11 月 19 日(修订后的基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,054.48
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	12.39
其他	6.96
合计	1,073.83

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年11月19日(修订后的基金合同生效日)至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-699,849.99
股票投资收益——赎回差价收入	-

股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-699,849.99

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 11 月 19 日（修订后的基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	8,384,921.05
减：卖出股票成本总额	9,084,771.04
买卖股票差价收入	-699,849.99

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 11 月 19 日（修订后的基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	-1,405.59
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	-1,405.59

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 11 月 19 日（修订后的基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	548,317.54
股票投资	548,317.54
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	548,317.54

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 11 月 19 日（修订后的基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	1,616.26
合计	1,616.26

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。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 11 月 19 日（修订后的基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	22,193.23
银行间市场交易费用	-
合计	22,193.23

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 11 月 19 日（修订后的基金合同生效日） 至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	2,351.28
信息披露费	5,874.97
证券出借违约金	-
银行费用	205.00
指数使用费	48,424.68
合计	56,855.93

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.1.2 债券交易

7.4.10.1.3 债券回购交易

7.4.10.1.4 权证交易

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 11 月 19 日（修订后的基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	23,675.01
其中：支付销售机构的客户维护费	10,236.73

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 11 月 19 日（修订后的基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,735.00

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.3 销售服务费

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期末未发生转融通证券出借业务。

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内基金管理人无运用自有资金投资本基金的情况。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 11 月 19 日（修订后的基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	2,464,173.25	1,054.48

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.8 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末(2020 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票	停牌日	停牌原	期末	复牌日	复牌	数量	期末	期末	备注
------	----	-----	-----	----	-----	----	----	----	----	----

码	名称	期	因	估值单 价	期	开盘单价	(股)	成本总额	估值总额	
002115	三维 通信	2020 年 12 月 24 日	重大事 项	6.09	2021 年 01 月 06 日	6.03	3,600	36,880.36	21,924.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，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，将风险控制可在承受的范围之内。

7.4.13.2 信用风险

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

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

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，本基金无债券投资。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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，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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

7.4.13.3.2 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)。

本基金所持证券均在证券交易所上市，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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,464,173.25	-	-	-	2,464,173.25
存出保证金	3,665.20	-	-	-	3,665.20
交易性金融资产	-	-	-	36,383,719.57	36,383,719.57

应收利息	-	-	-	265.12	265.12
应收申购款	1.00	-	-	9,973.22	9,974.22
应收证券清算款	-	-	-	197,770.00	197,770.00
资产总计	2,467,839.45	-	-	36,591,727.91	39,059,567.36
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	426,114.79	426,114.79
应付管理人报酬	-	-	-	10,000.89	10,000.89
应付托管费	-	-	-	1,726.71	1,726.71
应付交易费用	-	-	-	24,356.31	24,356.31
其他负债	-	-	-	161,362.52	161,362.52
负债总计	-	-	-	623,561.22	623,561.22
利率敏感度缺口	2,467,839.45	-	-	35,968,166.69	38,436,006.14

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市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。本基金投资于中证 1000 指数成份股及其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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	36,383,719.57	94.66
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—
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	36,383,719.57	94.66

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金转型尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、存出保证金、应收证券清算款、应收利息、应收申购款以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 36,361,795.57 元，第二层次的余额为人民币 21,924.00 元，无划分为第三层次的余额。

(ii) 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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期末发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2) 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

(3) 其他事项

截至资产负债表日，本基金基金资产净值存在连续超过二十个工作日低于 5,000 万元的情形。

§ 7 年度财务报表（转型前）

7.1 资产负债表

会计主体：华宝中证 1000 指数分级证券投资基金

报告截止日：2020 年 11 月 18 日（基金合同失效日前日）

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 11 月 18 日(基 金合同失效日前日)	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	2,687,186.00	2,706,235.67
结算备付金		20,818.39	-
存出保证金		3,124.12	1,145.30
交易性金融资产	7.4.7.2	39,433,707.46	44,173,304.38
其中：股票投资		39,433,707.46	44,169,009.82
基金投资		-	-
债券投资		-	4,294.56
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,326,540.05	525,551.83
应收利息	7.4.7.5	21,222.01	597.65
应收股利		-	-
应收申购款		4,712.73	12,079.36
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		43,497,310.76	47,418,914.19
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末

		2020 年 11 月 18 日(基金合同失效日前日)	2019 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,641,353.79	97,574.29
应付管理人报酬		21,525.22	39,237.02
应付托管费		4,735.55	8,632.16
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	15,775.29	13,140.25
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	103,370.65	120,254.65
负债合计		1,786,760.50	278,838.37
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	100,098,448.68	137,101,021.14
未分配利润	7.4.7.10	-58,387,898.42	-89,960,945.32
所有者权益合计		41,710,550.26	47,140,075.82
负债和所有者权益总计		43,497,310.76	47,418,914.19

注：报告截止日 2020 年 11 月 18 日（基金合同失效日前日），基金份额净值 0.9958 元，基金份额总额 41,884,507.09 份。

7.2 利润表

会计主体：华宝中证 1000 指数分级证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 18 日（基金合同失效日前日）

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 18 日（基金合同失效 日前日）	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		11,022,898.18	12,092,764.70
1. 利息收入		34,703.76	23,189.04
其中：存款利息收入	7.4.7.11	34,703.48	23,180.39
债券利息收入		0.28	8.65
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）		829,407.29	-4,841,219.94
其中：股票投资收益	7.4.7.12	437,482.96	-5,310,539.05
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-492.72	-
资产支持证券投资	7.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	392,417.05	469,319.11
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	10,083,653.08	16,887,018.79
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）			-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	75,134.05	23,776.81
减：二、费用		919,963.27	965,687.26
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	434,977.65	474,235.11
2. 托管费	7.4.10.2.2	95,695.13	104,331.71
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	70,315.66	56,390.44
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	318,974.83	330,730.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,102,934.91	11,127,077.44
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,102,934.91	11,127,077.44

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝中证 1000 指数分级证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 18 日（基金合同失效日前日）

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 18 日（基金合同失效日前日）		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益(基金净值)	137,101,021.14	-89,960,945.32	47,140,075.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	10,102,934.91	10,102,934.91
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-37,002,572.46	21,470,111.99	-15,532,460.47
其中：1.基金申购款	132,850,897.92	-77,377,869.13	55,473,028.79
2.基金赎回款	-169,853,470.38	98,847,981.12	-71,005,489.26
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	100,098,448.68	-58,387,898.42	41,710,550.26
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	148,771,293.31	-108,584,959.73	40,186,333.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,127,077.44	11,127,077.44
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-11,670,272.17	7,496,936.97	-4,173,335.20
其中：1.基金申购款	44,025,432.14	-29,639,519.75	14,385,912.39
2.基金赎回款	-55,695,704.31	37,136,456.72	-18,559,247.59
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金	-	-	-

净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	137,101,021.14	-89,960,945.32	47,140,075.82

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

黄小薏

向辉

张幸骏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华宝中证 1000 指数分级证券投资基金（原名为华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金，以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]第 664 号《关于准予华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金注册的批复》核准，由华宝基金管理有限公司（原华宝兴业基金管理有限公司，已于 2017 年 10 月 17 日办理完成工商变更登记）依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 330,638,859.16 元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2015）第 673 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 330,711,104.54 份基金份额，其中认购资金利息折合 72,245.38 份基金份额。本基金通过场内、场外两种方式公开发售，按照每份基金份额 1.00 元计算，本基金募集期间含本息共募集 330,711,104.54 份基金份额，其中场外认购的基金份额为 271,827,940.54 份、场内认购的基金份额为 58,883,164.00 份。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

2020 年 10 月 9 日至 2020 年 10 月 18 日，华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，会议审议通过了《关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》，同意华宝中证 1000 指数分级证券投资基金转型为华宝中证 1000 指数证券投资基金，取消分级运作机制，基金名称相应变更为“华宝中证 1000 指数证券投资基金”

并修订《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》。上述基金转型事项已于 2020 年 10 月 19 日经持有人大会表决通过生效，自 2020 年 11 月 19 日起，《华宝中证 1000 指数证券投资基金基金合同》生效，《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》同日失效，华宝中证 1000 指数分级证券投资基金正式变更为华宝中证 1000 指数证券投资基金。

根据《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金的基金份额包括华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之基础份额（以下简称“华宝中证 1000 基础份额”）、华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（以下简称“华宝中证 1000A 份额”）和华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之积极收益类份额（以下简称“华宝中证 1000B 份额”）。本基金通过场外、场内两种方式公开发售华宝中证 1000 基础份额。投资人场外认购所得的华宝中证 1000 基础份额 不进行自动分离或分拆。投资人场内认购所得的华宝中证 1000 基础份额 将按 1：1 的基金份额配比自动分离为华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额。华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的数量保持 1：1 的比例不变。基金合同生效后，华宝中证 1000 基础份额将根据基金合同约定分别开放场外和场内申购、赎回，但是不进行上市交易。在满足上市条件的情况下，华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额将申请上市交易但是不开放申购和赎回等业务。场内华宝中证 1000 基础份额与华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额之间可以按照规定约定的规则进行场内份额的配对转换，包括分拆与合并。分拆指基金份额持有人将其持有的每 2 份场内华宝中证 1000 基础份额按照 1：1 的份额配比转换成 1 份华宝中证 1000A 份额与 1 份华宝中证 1000B 份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每 1 份华宝中证 1000A 份额与 1 份华宝中证 1000B 份额按照 1：1 的基金份额配比转换成 2 份场内华宝中证 1000 基础份额的行为。

基金份额的净值按如下原则计算：华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数，其中基金份额总数为华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额数量的总和。本基金每份华宝中证 1000A 份额与每份华宝中证 1000B 份额构成一对份额组合，该份额组合的基金份额参考净值之和等于 2 份华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值之和。华宝中证 1000A 份额的约定收益率为同期银行人民币一年期定期存款利率（税后）+4.0%，华宝中证 1000A 份额的份额净值每日按该约定收益率逐日计算，计算出华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值后，根据华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值与华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额之间的基金份额参考净值关系，可以计算出华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值。

本基金进行定期份额折算。在本基金存续期内每年 12 月 15 日（若该日为非工作日，则提前至该日之前的最后一个工作日），本基金将进行基金的定期份额折算：定期份额折算后华宝中证

1000A 份额的基金份额参考净值调整为 1.0000 元，基金份额折算基准日折算前华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值超出 1.0000 元的部分将折算为场内华宝中证 1000 基础份额分配给华宝中证 1000A 份额持有人。华宝中证 1000 基础份额持有人持有的每 2 份华宝中证 1000 基础份额将按 1 份华宝中证 1000A 份额获得新增华宝中证 1000 基础份额的分配。持有场外华宝中证 1000 基础份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外华宝中证 1000 基础份额的分配；持有场内华宝中证 1000 基础份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内华宝中证 1000 基础份额的分配。经过上述份额折算后，华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后，华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。华宝中证 1000B 份额不参与定期份额折算，每次定期份额折算不改变华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

除以上的定期份额折算外，当华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时，或当华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元时，本基金将进行不定期份额折算（基金管理人可根据市场情况确定基金份额不定期折算基准日）：份额折算后本基金将确保华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的比例为 1:1，份额折算后华宝中证 1000A 份额的基金份额参考净值、华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值和华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值均调整为 1.0000 元。当华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时，基金份额折算基准日折算前华宝中证 1000 基础份额的基金份额净值及华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值超出 1.0000 元的部分均将折算为华宝中证 1000 基础份额分别分配给华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的持有人。当华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元时，华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的份额数将相应缩减。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包

括中小板、创业板、存托凭证和其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、资产支持证券、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为:本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 90%,投资于中证 1000 指数成份股及其备选成份股的市值不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应保持不低于基金资产净值 5%的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券。

本基金的业绩比较基准为:中证 1000 指数收益率 \times 95%+同期银行活期存款利率(税后) \times 5%。

本财务报表已于 2021 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)和在财务报表附注 7.4.4 所列示依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2020 年 11 月 18 日(基金合同失效日前日)的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 11 月 18 日(基金合同失效日前日)止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 18 日(基金合同失效日前日)止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时计入转融通证券出借业务利息收入；

(6) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(7) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(9) 股指/国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(10) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(11) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(12) 公允价值变动收益/（损失）系基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(13) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，在存续期内，本基金（包

括华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额与华宝中证 1000B 份额) 不进行收益分配。

7.4.4.12 外币交易

-

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

(1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按

证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。

(3) 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业发展费附加的单位外）及地方教育费附加。

(4) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，

自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

(5) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 11 月 18 日（基金合同失效 日前日）	上年度末 2019 年 12 月 31 日

活期存款	2,687,186.00	2,706,235.67
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	2,687,186.00	2,706,235.67

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 11 月 18 日（基金合同失效日前日）		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	40,904,478.11	39,433,707.46	-1,470,770.65
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	40,904,478.11	39,433,707.46	-1,470,770.65
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	55,722,928.11	44,169,009.82	-11,553,918.29
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	4,800.00	4,294.56
	银行间市场	-	-
	合计	4,800.00	4,294.56
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	55,727,728.11	44,173,304.38	-11,554,423.73

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年11月18日（基金合同失效日 前日）	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	4,998.73	588.02
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	16.64	-
应收债券利息	-	8.65
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	16,200.32	0.32
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	6.32	0.66
合计	21,222.01	597.65

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年11月18日（基金合同失效 日前日）	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	15,775.29	13,140.25
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	15,775.29	13,140.25

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年11月18日（基金合 同失效日前日）	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	21.58	254.65
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	101,773.75	70,000.00
应付指数使用费	1,575.32	50,000.00
合计	103,370.65	120,254.65

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年11月18日（基金合同失效日前日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	57,366,238.99	137,101,021.14
本期申购	55,587,147.33	132,850,897.92
本期赎回（以“-”号填列）	-71,068,878.23	-169,853,470.38
2020-11-18 基金拆分/份额折算前	41,884,508.09	100,098,448.68
基金拆分/份额折算调整	-1.00	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	41,884,507.09	100,098,448.68

注：（1）本基金的基金份额包括华宝中证 1000 基础份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额。本期申购含申购的华宝中证 1000 基础份额和配对转入的华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额，本期赎回含赎回的华宝中证 1000 基础份额和配对转出的华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额。

（2）截至 2020 年 11 月 18 日（基金合同失效日前日）止，本基金于深交所上市的基金份额转换为 3,365,702.00 份华宝中证 1000 指数证券投资基金的场内基金份额，托管在场外未上市交易的基金份额转换为 38,518,805.09 份华宝中证 1000 指数证券投资基金的场外基金份额；2019 年 12 月 31 日，华宝中证 1000 分级指数证券投资基金于深交所上市的基金份额为 4,224,481.00 份（其中华宝中证 1000 基础份额为 756,123.00 份，华宝中证 1000A 份额与华宝中证 1000B 份额均为 1,734,179.00 份），托管在场外未上市交易的基金份额为 53,141,757.99 份，均为华宝中证 1000 基础份额。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。根据《华宝基金管理有限公司关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额转换结果的公告》，本基金管理人以 2020 年 11 月 18 日为基金份额转换基准日，将中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记系统登记在册的华宝中证 1000 份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额转换为华宝中证 1000 指数证券投资基金的场内基金份额。在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统登记在册的华宝中证 1000 份额转换为华宝中证 1000 指数证券投资基金的场外基金份额。

（3）本基金在 2020 年 1 月 1 日至 11 月 18 日（基金合同失效日前日）止期间共发生以下 1 次折算：

根据华宝基金管理有限公司于 2020 年 11 月 20 日发布的《华宝基金管理有限公司关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额转换结果的公告》，本基金以 2020 年 11 月 18 日为基金份额转换基准日，进行基金份额转换。转换前，华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额均为 1,534,160.00 份，共计 3,068,320.00 份。根据份额折算公式，A 份额折算比例为 1.055633661，B 份额折算比例为 0.944366339。经转换后，华宝中证 1000 场内份额共计 3,068,319.00 份，转换后较转换前折算调减 1.00 份。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-96,177,604.95	6,216,659.63	-89,960,945.32
本期利润	19,281.83	10,083,653.08	10,102,934.91
本期基金份额交易产生的变动数	26,145,636.11	-4,675,524.12	21,470,111.99
其中：基金申购款	-93,273,883.87	15,896,014.74	-77,377,869.13
基金赎回款	119,419,519.98	-20,571,538.86	98,847,981.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-70,012,687.01	11,624,788.59	-58,387,898.42

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 18 日 (基金合同失效日前日)	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	18,261.44	22,857.22
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	203.84	259.59
其他	16,238.20	63.58
合计	34,703.48	23,180.39

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 18 日 (基金合同失效日前日)	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	437,482.96	-5,310,539.05
股票投资收益——赎回 差价收入	-	-

股票投资收益——申购 差价收入	-	-
股票投资收益——证券 出借差价收入	-	-
合计	437,482.96	-5,310,539.05

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年11月18 日（基金合同失效日前日）	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
卖出股票成交总额	28,822,344.01	20,850,016.20
减：卖出股票成本总 额	28,384,861.05	26,160,555.25
买卖股票差价收入	437,482.96	-5,310,539.05

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年11月18 日（基金合同失效日前日）	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31 日
债券投资收益——买卖 债券（、债转股及债券 到期兑付）差价收入	-492.72	-
债券投资收益——赎回 差价收入	-	-
债券投资收益——申购 差价收入	-	-
合计	-492.72	-

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年11月18 日（基金合同失效日前日）	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
卖出债券（、债转股及 债券到期兑付）成交总额	4,316.21	-
减：卖出债券（、债转股 及债券到期兑付）成本总	4,800.00	-

额		
减：应收利息总额	8.93	-
买卖债券差价收入	-492.72	-

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年11月18日 (基金合同失效日前日)	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	392,417.05	469,319.11
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	392,417.05	469,319.11

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年 11月18日(基金合同失效日前日)	上年度可比期间 2019年1月1日至2019 年12月31日
1. 交易性金融资产	10,083,653.08	16,887,018.79
股票投资	10,083,147.64	16,887,524.23
债券投资	505.44	-505.44
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	10,083,653.08	16,887,018.79

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年11月 18日（基金合同失效日前日）	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
基金赎回费收入	75,134.05	23,776.81
合计	75,134.05	23,776.81

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。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年11月 18日（基金合同失效日前日）	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	70,315.66	56,390.44
银行间市场交易费用	-	-
合计	70,315.66	56,390.44

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年11月 18日（基金合同失效日前日）	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	17,648.72	20,000.00
信息披露费	44,125.03	50,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	625.76	730.00
指数使用费	151,575.32	200,000.00
上市费用	55,000.00	60,000.00
律师费	40,000.00	-
公证费	10,000.00	-
合计	318,974.83	330,730.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

华宝中证 1000 指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会于 2020 年 10 月 19 日表决通过了《关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项

的议案》，同意华宝中证 1000 指数分级证券投资基金取消分级运作机制、由分级基金转为普通指数基金，修改基金的投资、基金资产估值、基金费用与税收、基金的收益与分配等内容，基金名称相应变更为“华宝中证 1000 指数证券投资基金”并修订《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》，华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之华宝中证 1000 份额、华宝中证 1000A 份额及华宝中证 1000B 份额均转换为华宝中证 1000 指数证券投资基金基金份额。基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，基金管理人根据基金份额持有人大会的授权，定于 2020 年 11 月 19 日正式实施基金转型，自基金转型实施日起，《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》失效且《华宝中证 1000 指数证券投资基金基金合同》同时生效，华宝中证 1000 指数分级证券投资基金正式变更为华宝中证 1000 指数证券投资基金。

7.4.9 关联方关系

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 18 日 (基金合同失效日前日)		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
华宝证券	508,614.84	1.23	265,450.91	0.76

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年11月18日（基金合同失效日前日）			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
华宝证券	473.52	1.25	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
华宝证券	247.24	0.76	247.24	1.88

注：（1）上述佣金按参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

（2）该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年11 月18日（基金合同失效日前 日）	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	434,977.65
其中：支付销售机构的客户维护费	168,833.42	189,091.51

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年11月18日（基金合同失效日前日）	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	95,695.13	104,331.71

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.22% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.3 销售服务费

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年11月18日（基金合同失效日前日）	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	2,687,186.00	18,261.44	2,706,235.67	22,857.22

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.8 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末(2020年11月18日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
605068	明新旭腾	2020年11月13日	2020年11月23日	新股流通受限	23.17	23.17	363	8,410.71	8,410.71	-
605177	东亚药业	2020年11月18日	2020年11月25日	新股流通受限	31.13	31.13	407	12,669.91	12,669.91	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只指数型的分级证券投资基金，华宝中证 1000A 份额具有较低风险、收益相对稳定的特征；华宝中证 1000B 份额具有较高风险、较高预期收益的特征。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“以实现与跟踪指数相同”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、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。

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

于本报告期末，本基金无债券投资（于上年度末，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，因此无重大信用风险）。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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，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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

7.4.13.3.2 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)。

本基金所持证券均在证券交易所上市,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。本基金所持证券均在证券交易所上市,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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年11月18日(基 金合同失效日前日)	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,687,186.00	-	-	-	2,687,186.00
结算备付金	20,818.39	-	-	-	20,818.39
存出保证金	3,124.12	-	-	-	3,124.12
交易性金融资产	-	-	-	39,433,707.46	39,433,707.46
应收利息	-	-	-	21,222.01	21,222.01
应收申购款	301.00	-	-	4,411.73	4,712.73
应收证券清算款	-	-	-	1,326,540.05	1,326,540.05
资产总计	2,711,429.51	-	-	40,785,881.25	43,497,310.76
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,641,353.79	1,641,353.79
应付管理人报酬	-	-	-	21,525.22	21,525.22
应付托管费	-	-	-	4,735.55	4,735.55
应付交易费用	-	-	-	15,775.29	15,775.29
其他负债	-	-	-	103,370.65	103,370.65
负债总计	-	-	-	1,786,760.50	1,786,760.50

利率敏感度缺口	2,711,429.51	-	-	38,999,120.75	41,710,550.26
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,706,235.67	-	-	-	2,706,235.67
存出保证金	1,145.30	-	-	-	1,145.30
交易性金融资产	-	-	4,294.56	44,169,009.82	44,173,304.38
应收利息	-	-	-	597.65	597.65
应收申购款	100.00	-	-	11,979.36	12,079.36
应收证券清算款	-	-	-	525,551.83	525,551.83
资产总计	2,707,480.97	-	4,294.56	44,707,138.66	47,418,914.19
负债					
应付赎回款	-	-	-	97,574.29	97,574.29
应付管理人报酬	-	-	-	39,237.02	39,237.02
应付托管费	-	-	-	8,632.16	8,632.16
应付交易费用	-	-	-	13,140.25	13,140.25
其他负债	-	-	-	120,254.65	120,254.65
负债总计	-	-	-	278,838.37	278,838.37
利率敏感度缺口	2,707,480.97	-	4,294.56	44,428,300.29	47,140,075.82

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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）。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 11 月 18 日（基金合同失效日前日）		上年度末 2019 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	39,433,707.46	94.54	44,169,009.82	93.70
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	39,433,707.46	94.54	44,169,009.82	93.70

7.4.13.4.3.2 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		
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（2020 年 11 月 18 日（基金合同失效日前日））	上年度末（2019 年 12 月 31 日）	
分析	1. 业绩比较基准上升 5%	2,043,591.37	2,306,706.51
	2. 业绩比较基准下降 5%	-2,043,591.37	-2,306,706.51

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收证券清算款、应收利息、应收申购款以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 39,412,626.84 元，第二层次的余额为人民币 21,080.62 元，无划分为第三层次的余额（于上年度末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 44,007,129.78 元，第二层次的余额为人民币 166,174.60 元，无划分为第三层次的余额）。

(ii) 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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期及上年度可比期间未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2) 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

(3) 其他事项

截至资产负债表日，本基金基金资产净值存在连续超过二十个工作日低于 5,000 万元的情形。

§ 8 投资组合报告（转型后）

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	36,383,719.57	93.15
	其中：股票	36,383,719.57	93.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	0.00	0.00
	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	2,464,173.25	6.31
8	其他各项资产	211,674.54	0.54
9	合计	39,059,567.36	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	300,157.60	0.78
B	采矿业	765,365.28	1.99
C	制造业	24,864,453.13	64.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	649,509.30	1.69
E	建筑业	645,312.94	1.68
F	批发和零售业	1,062,927.60	2.77
G	交通运输、仓储和邮政业	672,892.80	1.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,030,110.84	10.49
J	金融业	536,339.60	1.40
K	房地产业	839,753.12	2.18
L	租赁和商务服务业	318,388.32	0.83
M	科学研究和技术服务业	392,879.60	1.02
N	水利、环境和公共设施管理业	622,223.34	1.62
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	16,439.60	0.04
Q	卫生和社会工作	192,987.00	0.50

R	文化、体育和娱乐业	366,766.60	0.95
S	综合	107,212.90	0.28
	合计	36,383,719.57	94.66

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

8.2.3 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300677	英科医疗	1,500	252,225.00	0.66
2	000799	酒鬼酒	1,600	250,400.00	0.65
3	300724	捷佳伟创	1,300	189,280.00	0.49
4	300037	新宙邦	1,700	172,380.00	0.45
5	300073	当升科技	2,400	155,640.00	0.40
6	002497	雅化集团	6,800	149,260.00	0.39
7	000733	振华科技	2,500	147,125.00	0.38
8	601636	旗滨集团	11,400	145,920.00	0.38
9	300118	东方日升	5,000	144,150.00	0.38
10	000516	国际医学	11,100	139,527.00	0.36
11	600559	老白干酒	4,305	135,521.40	0.35
12	300751	迈为股份	200	135,402.00	0.35
13	002706	良信股份	4,400	134,816.00	0.35
14	603678	火炬电子	1,850	133,755.00	0.35
15	002389	航天彩虹	4,000	133,000.00	0.35
16	600882	妙可蓝多	2,300	131,330.00	0.34
17	600711	盛屯矿业	14,300	130,988.00	0.34
18	603267	鸿远电子	1,000	128,760.00	0.33
19	603613	国联股份	980	125,518.40	0.33
20	600988	赤峰黄金	7,000	125,370.00	0.33
21	002180	纳思达	4,500	120,285.00	0.31
22	002025	航天电器	1,800	117,324.00	0.31
23	002409	雅克科技	1,900	114,171.00	0.30
24	002402	和而泰	6,450	111,391.50	0.29
25	000591	太阳能	14,860	108,032.20	0.28
26	002151	北斗星通	2,100	106,911.00	0.28
27	002610	爱康科技	31,700	104,293.00	0.27

28	688122	西部超导	1,300	103,363.00	0.27
29	300395	菲利华	1,700	101,711.00	0.26
30	603456	九洲药业	2,800	100,240.00	0.26
31	300251	光线传媒	8,300	100,181.00	0.26
32	002407	多氟多	4,900	98,147.00	0.26
33	300502	新易盛	1,760	97,644.80	0.25
34	300083	创世纪	8,100	95,418.00	0.25
35	002163	海南发展	4,500	94,185.00	0.25
36	300068	南都电源	6,100	92,903.00	0.24
37	300346	南大光电	2,300	92,713.00	0.24
38	300379	东方通	2,000	91,400.00	0.24
39	600305	恒顺醋业	4,116	91,128.24	0.24
40	300185	通裕重工	23,100	89,628.00	0.23
41	002459	晶澳科技	2,200	89,584.00	0.23
42	300054	鼎龙股份	4,640	87,742.40	0.23
43	603129	春风动力	500	87,095.00	0.23
44	002747	埃斯顿	2,900	86,478.00	0.22
45	603236	移远通信	460	85,992.40	0.22
46	600966	博汇纸业	5,700	85,671.00	0.22
47	300747	锐科激光	975	85,663.50	0.22
48	002216	三全食品	3,300	85,635.00	0.22
49	300725	药石科技	620	85,560.00	0.22
50	600621	华鑫股份	3,700	84,249.00	0.22
51	300773	拉卡拉	2,800	83,776.00	0.22
52	603005	晶方科技	1,300	83,668.00	0.22
53	002851	麦格米特	2,450	83,447.00	0.22
54	002727	一心堂	2,500	83,275.00	0.22
55	603027	千禾味业	2,220	82,983.60	0.22
56	300775	三角防务	2,100	82,782.00	0.22
57	002643	万润股份	3,800	82,726.00	0.22
58	688005	容百科技	1,600	82,464.00	0.21
59	600641	万业企业	4,040	81,486.80	0.21
60	300326	凯利泰	5,100	80,835.00	0.21
61	601058	赛轮轮胎	13,340	80,573.60	0.21
62	300476	胜宏科技	3,720	80,240.40	0.21
63	002675	东诚药业	4,000	79,640.00	0.21
64	300451	创业慧康	5,875	79,488.75	0.21
65	002436	兴森科技	8,400	79,464.00	0.21
66	600323	瀚蓝环境	3,200	79,392.00	0.21
67	300457	赢合科技	2,625	78,881.25	0.21
68	002430	杭氧股份	2,700	78,543.00	0.20
69	600456	宝钛股份	1,500	78,135.00	0.20

70	002126	银轮股份	5,600	77,112.00	0.20
71	603127	昭衍新药	740	76,301.40	0.20
72	002240	盛新锂能	3,100	75,764.00	0.20
73	300373	扬杰科技	1,700	75,514.00	0.20
74	002850	科达利	800	75,192.00	0.20
75	002332	仙琚制药	5,600	74,816.00	0.19
76	688006	杭可科技	900	74,727.00	0.19
77	002597	金禾实业	2,300	74,589.00	0.19
78	002481	双塔食品	5,300	73,935.00	0.19
79	300568	星源材质	2,442	73,919.34	0.19
80	000902	新洋丰	4,600	73,600.00	0.19
81	300188	美亚柏科	3,400	73,236.00	0.19
82	600110	诺德股份	7,900	73,075.00	0.19
83	601519	大智慧	7,000	72,660.00	0.19
84	601908	京运通	7,000	72,030.00	0.19
85	002214	大立科技	2,600	71,552.00	0.19
86	000818	航锦科技	3,400	71,366.00	0.19
87	600873	梅花生物	15,300	71,298.00	0.19
88	300298	三诺生物	1,980	70,884.00	0.18
89	300777	中简科技	1,400	70,854.00	0.18
90	688388	嘉元科技	800	70,512.00	0.18
91	002023	海特高新	4,300	70,262.00	0.18
92	300363	博腾股份	1,900	69,388.00	0.18
93	300294	博雅生物	2,050	68,757.00	0.18
94	000034	神州数码	3,200	68,672.00	0.18
95	600732	爱旭股份	4,300	68,671.00	0.18
96	300226	上海钢联	1,043	68,420.80	0.18
97	601375	中原证券	9,700	68,094.00	0.18
98	600267	海正药业	4,100	67,773.00	0.18
99	000667	美好置业	17,400	67,512.00	0.18
100	300348	长亮科技	3,550	67,450.00	0.18
101	603606	东方电缆	2,700	67,365.00	0.18
102	300685	艾德生物	860	67,295.00	0.18
103	000923	河钢资源	2,700	67,203.00	0.17
104	603039	泛微网络	656	66,229.76	0.17
105	603520	司太立	1,000	65,830.00	0.17
106	002541	鸿路钢构	1,800	65,754.00	0.17
107	002123	梦网集团	4,600	65,458.00	0.17
108	600499	科达制造	9,300	65,193.00	0.17
109	002239	奥特佳	13,300	64,904.00	0.17
110	000933	神火股份	8,100	64,638.00	0.17
111	002245	蔚蓝锂芯	4,900	63,602.00	0.17

112	603185	上机数控	450	62,302.50	0.16
113	000403	双林生物	1,633	62,054.00	0.16
114	688116	天奈科技	1,000	62,000.00	0.16
115	600864	哈投股份	7,300	61,977.00	0.16
116	600363	联创光电	2,500	61,575.00	0.16
117	600601	方正科技	15,500	61,535.00	0.16
118	600685	中船防务	2,300	61,134.00	0.16
119	000582	北部湾港	5,800	60,900.00	0.16
120	000049	德赛电池	900	60,840.00	0.16
121	603583	捷昌驱动	780	60,255.00	0.16
122	600252	中恒集团	19,600	60,172.00	0.16
123	000951	中国重汽	1,900	59,774.00	0.16
124	600720	祁连山	4,400	59,752.00	0.16
125	600812	华北制药	5,800	59,682.00	0.16
126	300369	绿盟科技	3,900	59,592.00	0.16
127	688019	安集科技	200	59,560.00	0.15
128	603308	应流股份	2,000	59,400.00	0.15
129	300036	超图软件	3,200	59,008.00	0.15
130	002626	金达威	1,700	58,939.00	0.15
131	000035	中国天楹	14,300	58,773.00	0.15
132	603218	日月股份	1,940	58,685.00	0.15
133	002099	海翔药业	6,900	58,650.00	0.15
134	000735	罗牛山	6,500	58,305.00	0.15
135	300458	全志科技	1,806	58,243.50	0.15
136	300726	宏达电子	800	57,880.00	0.15
137	600211	西藏药业	860	57,860.80	0.15
138	600059	古越龙山	3,400	57,834.00	0.15
139	600490	鹏欣资源	12,500	57,750.00	0.15
140	300674	宇信科技	1,700	57,681.00	0.15
141	300623	捷捷微电	1,320	57,420.00	0.15
142	000831	五矿稀土	4,200	57,246.00	0.15
143	002467	二六三	9,630	57,202.20	0.15
144	603489	八方股份	300	57,090.00	0.15
145	601222	林洋能源	7,208	57,087.36	0.15
146	300034	钢研高纳	1,579	56,765.05	0.15
147	600185	格力地产	8,780	56,718.80	0.15
148	600635	大众公用	13,700	56,718.00	0.15
149	300236	上海新阳	1,150	56,683.50	0.15
150	000672	上峰水泥	2,900	56,579.00	0.15
151	600850	华东电脑	2,100	56,553.00	0.15
152	002262	恩华药业	3,536	56,469.92	0.15
153	600330	天通股份	5,580	56,469.60	0.15

154	002100	天康生物	5,300	56,127.00	0.15
155	600206	有研新材	4,200	56,112.00	0.15
156	603588	高能环境	4,000	56,080.00	0.15
157	002041	登海种业	2,500	55,800.00	0.15
158	300737	科顺股份	2,600	55,796.00	0.15
159	603026	石大胜华	1,100	55,451.00	0.14
160	002413	雷科防务	7,800	55,146.00	0.14
161	002310	东方园林	13,300	55,062.00	0.14
162	300567	精测电子	1,000	54,940.00	0.14
163	601952	苏垦农发	3,890	54,693.40	0.14
164	300132	青松股份	2,900	54,491.00	0.14
165	300666	江丰电子	1,100	54,461.00	0.14
166	002756	永兴材料	1,000	54,220.00	0.14
167	300323	华灿光电	4,400	53,548.00	0.14
168	300143	盈康生命	2,700	53,460.00	0.14
169	002063	远光软件	6,190	53,295.90	0.14
170	002237	恒邦股份	4,100	53,259.00	0.14
171	002531	天顺风能	6,280	52,877.60	0.14
172	600459	贵研铂业	2,050	52,787.50	0.14
173	688188	柏楚电子	200	52,724.00	0.14
174	000555	神州信息	3,400	52,700.00	0.14
175	000566	海南海药	5,700	52,611.00	0.14
176	002617	露笑科技	6,399	52,599.78	0.14
177	300406	九强生物	2,100	52,542.00	0.14
178	600761	安徽合力	3,700	52,540.00	0.14
179	603713	密尔克卫	400	52,396.00	0.14
180	000016	深康佳 A	7,900	52,219.00	0.14
181	002400	省广集团	9,800	52,038.00	0.14
182	002036	联创电子	5,023	51,937.82	0.14
183	000875	吉电股份	12,100	51,667.00	0.13
184	603960	克来机电	1,100	51,645.00	0.13
185	300327	中颖电子	1,580	51,476.40	0.13
186	603128	华贸物流	5,540	51,466.60	0.13
187	603068	博通集成	600	51,168.00	0.13
188	300456	赛微电子	2,140	50,974.80	0.13
189	600197	伊力特	1,800	50,868.00	0.13
190	002324	普利特	3,000	50,820.00	0.13
191	600797	浙大网新	7,300	50,808.00	0.13
192	600984	建设机械	4,100	50,635.00	0.13
193	300770	新媒股份	720	50,616.00	0.13
194	002139	拓邦股份	6,225	50,484.75	0.13
195	600803	新奥股份	3,700	50,283.00	0.13

196	688016	心脉医疗	200	50,240.00	0.13
197	300131	英唐智控	6,000	50,160.00	0.13
198	002318	久立特材	4,600	50,140.00	0.13
199	603301	振德医疗	800	50,024.00	0.13
200	601677	明泰铝业	3,500	49,490.00	0.13
201	300741	华宝股份	900	49,383.00	0.13
202	002585	双星新材	4,890	49,193.40	0.13
203	603298	杭叉集团	2,320	48,743.20	0.13
204	002171	楚江新材	5,700	48,678.00	0.13
205	601666	平煤股份	8,200	48,626.00	0.13
206	000913	钱江摩托	1,900	48,621.00	0.13
207	002091	江苏国泰	6,660	48,151.80	0.13
208	300397	天和防务	2,480	48,136.80	0.13
209	300776	帝尔激光	320	48,064.00	0.13
210	300598	诚迈科技	400	47,952.00	0.12
211	603596	伯特利	1,400	47,908.00	0.12
212	000976	华铁股份	9,000	47,700.00	0.12
213	000851	高鸿股份	6,400	47,616.00	0.12
214	603686	龙马环卫	2,960	47,596.80	0.12
215	000560	我爱我家	11,680	47,420.80	0.12
216	603113	金能科技	2,900	47,415.00	0.12
217	002326	永太科技	4,296	47,341.92	0.12
218	300079	数码科技	10,100	47,167.00	0.12
219	300841	康华生物	100	46,824.00	0.12
220	300702	天宇股份	500	46,750.00	0.12
221	600789	鲁抗医药	4,940	46,287.80	0.12
222	300085	银之杰	2,500	46,225.00	0.12
223	000603	盛达资源	2,900	46,168.00	0.12
224	000921	海信家电	3,200	46,112.00	0.12
225	300438	鹏辉能源	1,750	45,990.00	0.12
226	600057	厦门象屿	7,626	45,908.52	0.12
227	002106	莱宝高科	4,000	45,760.00	0.12
228	688139	海尔生物	700	45,703.00	0.12
229	000710	贝瑞基因	1,200	45,672.00	0.12
230	603599	广信股份	1,900	45,543.00	0.12
231	300352	北信源	8,175	45,534.75	0.12
232	002428	云南锗业	3,700	45,473.00	0.12
233	300101	振芯科技	2,800	45,136.00	0.12
234	601311	骆驼股份	4,800	44,880.00	0.12
235	600360	华微电子	5,400	44,874.00	0.12
236	000155	川能动力	5,400	44,820.00	0.12
237	600562	国睿科技	2,632	44,796.64	0.12

238	002022	科华生物	2,900	44,718.00	0.12
239	300763	锦浪科技	300	44,700.00	0.12
240	002312	三泰控股	7,800	44,694.00	0.12
241	688018	乐鑫科技	300	44,589.00	0.12
242	300078	思创医惠	4,924	44,562.20	0.12
243	000789	万年青	3,350	44,555.00	0.12
244	600496	精工钢构	9,900	44,352.00	0.12
245	002254	泰和新材	2,900	44,341.00	0.12
246	002261	拓维信息	6,200	44,330.00	0.12
247	300123	亚光科技	3,540	44,250.00	0.12
248	603323	苏农银行	8,910	44,193.60	0.11
249	300792	壹网壹创	400	44,164.00	0.11
250	002847	盐津铺子	400	44,088.00	0.11
251	300339	润和软件	4,500	44,055.00	0.11
252	300767	震安科技	600	43,800.00	0.11
253	002698	博实股份	3,600	43,632.00	0.11
254	300748	金力永磁	1,200	43,608.00	0.11
255	002035	华帝股份	4,930	43,531.90	0.11
256	002928	华夏航空	3,425	43,326.25	0.11
257	603018	华设集团	3,940	43,143.00	0.11
258	002097	山河智能	5,400	42,984.00	0.11
259	300393	中来股份	3,305	42,931.95	0.11
260	603919	金徽酒	1,060	42,919.40	0.11
261	300031	宝通科技	2,200	42,724.00	0.11
262	300394	天孚通信	800	42,664.00	0.11
263	000503	国新健康	5,100	42,636.00	0.11
264	603043	广州酒家	1,100	42,603.00	0.11
265	000903	云内动力	9,700	42,583.00	0.11
266	002335	科华数据	1,900	42,446.00	0.11
267	603368	柳药股份	1,970	42,433.80	0.11
268	600072	中船科技	3,100	42,315.00	0.11
269	600596	新安股份	3,900	42,315.00	0.11
270	002182	云海金属	3,200	42,304.00	0.11
271	600993	马应龙	2,100	42,294.00	0.11
272	002581	未名医药	2,300	42,159.00	0.11
273	603881	数据港	700	42,077.00	0.11
274	002291	星期六	2,600	42,016.00	0.11
275	000683	远兴能源	19,440	41,990.40	0.11
276	002803	吉宏股份	1,300	41,912.00	0.11
277	600771	广誉远	2,800	41,804.00	0.11
278	002605	姚记科技	1,700	41,718.00	0.11
279	002614	奥佳华	3,100	41,695.00	0.11

280	601965	中国汽研	2,800	41,468.00	0.11
281	300616	尚品宅配	520	41,423.20	0.11
282	600868	梅雁吉祥	13,400	41,406.00	0.11
283	600391	航发科技	1,600	41,360.00	0.11
284	002695	煌上煌	1,800	41,220.00	0.11
285	600503	华丽家族	11,300	41,132.00	0.11
286	603601	再升科技	3,000	40,950.00	0.11
287	002292	奥飞娱乐	6,700	40,803.00	0.11
288	600612	老凤祥	900	40,797.00	0.11
289	600740	山西焦化	6,920	40,758.80	0.11
290	600108	亚盛集团	11,000	40,700.00	0.11
291	002145	中核钛白	7,300	40,515.00	0.11
292	000088	盐田港	6,400	40,448.00	0.11
293	002276	万马股份	5,100	40,443.00	0.11
294	600246	万通发展	5,800	40,426.00	0.11
295	002967	广电计量	1,100	40,315.00	0.10
296	300525	博思软件	1,400	40,180.00	0.10
297	000901	航天科技	3,993	40,129.65	0.10
298	600986	浙文互联	9,340	40,068.60	0.10
299	600378	昊华科技	1,900	39,919.00	0.10
300	601678	滨化股份	7,600	39,900.00	0.10
301	002020	京新药业	4,000	39,760.00	0.10
302	600337	美克家居	8,700	39,759.00	0.10
303	600662	强生控股	4,500	39,690.00	0.10
304	600604	市北高新	6,000	39,600.00	0.10
305	600095	湘财股份	2,700	39,420.00	0.10
306	300170	汉得信息	5,000	39,300.00	0.10
307	300659	中孚信息	800	39,264.00	0.10
308	002130	沃尔核材	7,100	39,263.00	0.10
309	002833	弘亚数控	900	39,213.00	0.10
310	600125	铁龙物流	6,500	39,130.00	0.10
311	600300	维维股份	8,300	39,093.00	0.10
312	300232	洲明科技	4,148	39,032.68	0.10
313	002421	达实智能	10,900	39,022.00	0.10
314	002498	汉缆股份	9,400	39,010.00	0.10
315	000917	电广传媒	8,000	38,800.00	0.10
316	000697	炼石航空	3,300	38,511.00	0.10
317	002567	唐人神	4,850	38,460.50	0.10
318	300679	电连技术	1,130	38,386.10	0.10
319	300497	富祥药业	2,688	38,357.76	0.10
320	300206	理邦仪器	2,100	38,325.00	0.10
321	300303	聚飞光电	7,240	38,227.20	0.10

322	600742	一汽富维	3,796	38,111.84	0.10
323	002079	苏州固锝	3,700	38,110.00	0.10
324	002697	红旗连锁	5,740	37,941.40	0.10
325	002108	沧州明珠	7,042	37,885.96	0.10
326	001696	宗申动力	4,900	37,779.00	0.10
327	300238	冠昊生物	1,500	37,710.00	0.10
328	002258	利尔化学	1,800	37,620.00	0.10
329	000006	深振业 A	6,700	37,587.00	0.10
330	300639	凯普生物	1,000	37,580.00	0.10
331	000070	特发信息	4,080	37,576.80	0.10
332	000059	华锦股份	6,800	37,536.00	0.10
333	603733	仙鹤股份	1,500	37,500.00	0.10
334	600210	紫江企业	8,600	37,410.00	0.10
335	000796	凯撒旅业	2,800	37,408.00	0.10
336	600129	太极集团	2,800	37,324.00	0.10
337	000652	泰达股份	7,300	37,230.00	0.10
338	601001	晋控煤业	5,900	37,170.00	0.10
339	300638	广和通	620	37,107.00	0.10
340	600395	盘江股份	4,700	36,989.00	0.10
341	601163	三角轮胎	2,300	36,961.00	0.10
342	300607	拓斯达	1,060	36,835.00	0.10
343	300526	中潜股份	580	36,830.00	0.10
344	300149	睿智医药	2,500	36,825.00	0.10
345	300572	安车检测	900	36,792.00	0.10
346	603008	喜临门	1,900	36,708.00	0.10
347	000030	富奥股份	5,000	36,700.00	0.10
348	600531	豫光金铅	6,200	36,642.00	0.10
349	002425	凯撒文化	4,580	36,594.20	0.10
350	300401	花园生物	2,300	36,570.00	0.10
351	600326	西藏天路	5,200	36,504.00	0.09
352	002298	中电兴发	3,900	36,387.00	0.09
353	300208	青岛中程	2,650	36,305.00	0.09
354	603387	基蛋生物	1,060	36,283.80	0.09
355	603429	集友股份	1,220	36,246.20	0.09
356	600764	中国海防	1,000	36,210.00	0.09
357	300233	金城医药	1,900	36,195.00	0.09
358	002726	龙大肉食	2,824	36,147.20	0.09
359	603826	坤彩科技	1,000	36,090.00	0.09
360	002449	国星光电	3,530	36,006.00	0.09
361	000650	仁和药业	5,900	35,990.00	0.09
362	000793	华闻集团	14,100	35,955.00	0.09
363	600756	浪潮软件	2,300	35,857.00	0.09

364	002611	东方精工	7,640	35,831.60	0.09
365	300053	欧比特	3,945	35,662.80	0.09
366	300224	正海磁材	2,850	35,653.50	0.09
367	002950	奥美医疗	1,750	35,542.50	0.09
368	300429	强力新材	2,503	35,467.51	0.09
369	300263	隆华科技	5,200	35,412.00	0.09
370	603690	至纯科技	900	35,388.00	0.09
371	300596	利安隆	900	35,352.00	0.09
372	300222	科大智能	3,420	35,260.20	0.09
373	002859	洁美科技	1,380	34,969.20	0.09
374	002484	江海股份	3,316	34,818.00	0.09
375	002912	中新赛克	600	34,776.00	0.09
376	600063	皖维高新	9,500	34,770.00	0.09
377	002446	盛路通信	5,120	34,764.80	0.09
378	300177	中海达	3,350	34,739.50	0.09
379	002301	齐心集团	2,600	34,684.00	0.09
380	002918	蒙娜丽莎	1,070	34,561.00	0.09
381	600116	三峡水利	4,100	34,522.00	0.09
382	300045	华力创通	3,500	34,475.00	0.09
383	601918	新集能源	11,000	34,430.00	0.09
384	600477	杭萧钢构	9,170	34,387.50	0.09
385	600420	现代制药	3,600	34,236.00	0.09
386	002351	漫步者	2,550	34,221.00	0.09
387	603118	共进股份	3,300	34,188.00	0.09
388	600851	海欣股份	4,200	34,104.00	0.09
389	002043	兔宝宝	3,800	34,086.00	0.09
390	300378	鼎捷软件	1,250	34,062.50	0.09
391	002959	小熊电器	300	34,005.00	0.09
392	600491	龙元建设	6,500	33,995.00	0.09
393	300287	飞利信	8,100	33,939.00	0.09
394	603718	海利生物	2,685	33,857.85	0.09
395	002545	东方铁塔	4,400	33,792.00	0.09
396	600770	综艺股份	5,500	33,770.00	0.09
397	000969	安泰科技	5,100	33,762.00	0.09
398	601369	陕鼓动力	4,700	33,746.00	0.09
399	300613	富瀚微	280	33,745.60	0.09
400	300409	道氏技术	2,260	33,741.80	0.09
401	002222	福晶科技	2,450	33,736.50	0.09
402	300184	力源信息	6,640	33,731.20	0.09
403	600668	尖峰集团	2,400	33,552.00	0.09
404	600751	海航科技	12,700	33,528.00	0.09
405	601011	宝泰隆	7,900	33,496.00	0.09

406	600512	腾达建设	11,300	33,448.00	0.09
407	002367	康力电梯	3,400	33,422.00	0.09
408	002649	博彦科技	3,700	33,337.00	0.09
409	002975	博杰股份	300	33,330.00	0.09
410	002641	永高股份	5,200	33,176.00	0.09
411	300604	长川科技	1,100	33,143.00	0.09
412	300194	福安药业	6,700	33,031.00	0.09
413	688033	天宜上佳	2,300	32,959.00	0.09
414	600587	新华医疗	2,300	32,706.00	0.09
415	000848	承德露露	4,600	32,660.00	0.08
416	300523	辰安科技	1,000	32,630.00	0.08
417	601567	三星医疗	4,900	32,585.00	0.08
418	300355	蒙草生态	9,100	32,578.00	0.08
419	600990	四创电子	700	32,536.00	0.08
420	300219	鸿利智汇	2,950	32,479.50	0.08
421	300662	科锐国际	600	32,460.00	0.08
422	002582	好想你	2,500	32,450.00	0.08
423	300377	赢时胜	3,700	32,449.00	0.08
424	300065	海兰信	2,250	32,377.50	0.08
425	600502	安徽建工	8,556	32,341.68	0.08
426	300398	飞凯材料	1,820	32,323.20	0.08
427	002537	海联金汇	4,380	32,236.80	0.08
428	300682	朗新科技	2,200	32,164.00	0.08
429	002793	罗欣药业	3,100	32,147.00	0.08
430	601137	博威合金	2,800	32,144.00	0.08
431	000910	大亚圣象	2,300	32,108.00	0.08
432	300119	瑞普生物	1,700	32,096.00	0.08
433	002515	金字火腿	5,520	32,071.20	0.08
434	600093	易见股份	4,000	32,040.00	0.08
435	600422	昆药集团	3,700	32,005.00	0.08
436	300552	万集科技	700	32,004.00	0.08
437	600963	岳阳林纸	7,630	31,969.70	0.08
438	000900	现代投资	7,500	31,875.00	0.08
439	002539	云图控股	4,300	31,777.00	0.08
440	300709	精研科技	600	31,686.00	0.08
441	603208	江山欧派	300	31,575.00	0.08
442	603313	梦百合	970	31,447.40	0.08
443	300368	汇金股份	2,300	31,418.00	0.08
444	300738	奥飞数据	900	31,410.00	0.08
445	000676	智度股份	4,700	31,302.00	0.08
446	002251	步步高	3,700	31,265.00	0.08
447	600366	宁波韵升	4,900	31,262.00	0.08

448	300487	蓝晓科技	700	31,150.00	0.08
449	600783	鲁信创投	2,100	31,143.00	0.08
450	002376	新北洋	3,300	31,086.00	0.08
451	300386	飞天诚信	1,500	31,020.00	0.08
452	000823	超声电子	2,700	30,969.00	0.08
453	000550	江铃汽车	1,500	30,960.00	0.08
454	002737	葵花药业	2,100	30,807.00	0.08
455	601929	吉视传媒	15,400	30,800.00	0.08
456	000601	韶能股份	4,600	30,774.00	0.08
457	300267	尔康制药	7,300	30,733.00	0.08
458	603609	禾丰牧业	2,600	30,732.00	0.08
459	601010	文峰股份	10,400	30,680.00	0.08
460	600223	鲁商发展	3,600	30,672.00	0.08
461	300114	中航电测	2,050	30,647.50	0.08
462	300020	银江股份	3,700	30,525.00	0.08
463	601890	亚星锚链	4,700	30,503.00	0.08
464	002930	宏川智慧	1,558	30,396.58	0.08
465	002055	得润电子	2,300	30,383.00	0.08
466	000810	创维数字	3,800	30,362.00	0.08
467	300319	麦捷科技	3,400	30,226.00	0.08
468	000592	平潭发展	10,900	30,193.00	0.08
469	002226	江南化工	4,400	30,184.00	0.08
470	300322	硕贝德	2,300	30,176.00	0.08
471	002283	天润工业	5,600	30,128.00	0.08
472	002488	金固股份	4,950	30,046.50	0.08
473	600308	华泰股份	5,800	30,044.00	0.08
474	300292	吴通控股	7,200	30,024.00	0.08
475	300006	莱美药业	4,038	30,002.34	0.08
476	300299	富春股份	3,940	29,944.00	0.08
477	300624	万兴科技	540	29,910.60	0.08
478	300102	乾照光电	5,000	29,900.00	0.08
479	002489	浙江永强	7,700	29,876.00	0.08
480	300213	佳讯飞鸿	4,200	29,820.00	0.08
481	601827	三峰环境	3,600	29,808.00	0.08
482	000936	华西股份	3,800	29,792.00	0.08
483	600565	迪马股份	10,900	29,757.00	0.08
484	000915	山大华特	1,270	29,705.30	0.08
485	000881	中广核技	2,700	29,700.00	0.08
486	300055	万邦达	4,900	29,645.00	0.08
487	002596	海南瑞泽	5,700	29,640.00	0.08
488	300602	飞荣达	1,469	29,615.04	0.08
489	300663	科蓝软件	1,300	29,601.00	0.08

490	600552	凯盛科技	4,300	29,584.00	0.08
491	300735	光弘科技	2,166	29,565.90	0.08
492	002832	比音勒芬	1,820	29,556.80	0.08
493	600577	精达股份	9,500	29,545.00	0.08
494	603612	索通发展	2,160	29,527.20	0.08
495	600636	国新文化	2,200	29,524.00	0.08
496	600557	康缘药业	2,900	29,493.00	0.08
497	300145	中金环境	9,540	29,383.20	0.08
498	600483	福能股份	3,700	29,341.00	0.08
499	002677	浙江美大	1,840	29,311.20	0.08
500	300256	星星科技	4,750	29,260.00	0.08
501	000828	东莞控股	2,900	29,203.00	0.08
502	600284	浦东建设	4,800	29,184.00	0.08
503	300768	迪普科技	800	29,112.00	0.08
504	000036	华联控股	7,310	29,093.80	0.08
505	300171	东富龙	1,800	29,070.00	0.08
506	000829	天音控股	4,400	29,040.00	0.08
507	600846	同济科技	3,500	28,910.00	0.08
508	002320	海峡股份	3,167	28,851.37	0.08
509	300821	东岳硅材	2,500	28,825.00	0.07
510	603393	新天然气	1,220	28,816.40	0.07
511	000957	中通客车	3,300	28,809.00	0.07
512	603920	世运电路	1,100	28,776.00	0.07
513	002042	华孚时尚	6,450	28,702.50	0.07
514	002798	帝欧家居	1,400	28,700.00	0.07
515	300044	赛为智能	4,380	28,601.40	0.07
516	300573	兴齐眼药	300	28,569.00	0.07
517	002777	久远银海	1,220	28,474.80	0.07
518	600480	凌云股份	3,280	28,470.40	0.07
519	300633	开立医疗	1,100	28,446.00	0.07
520	000751	锌业股份	8,000	28,400.00	0.07
521	002194	武汉凡谷	1,900	28,329.00	0.07
522	002838	道恩股份	1,100	28,314.00	0.07
523	300284	苏交科	4,752	28,274.40	0.07
524	002768	国恩股份	900	28,188.00	0.07
525	600217	中再资环	4,900	28,126.00	0.07
526	000682	东方电子	5,700	28,101.00	0.07
527	002733	雄韬股份	1,350	28,080.00	0.07
528	600933	爱柯迪	1,800	28,080.00	0.07
529	300075	数字政通	2,400	28,056.00	0.07
530	300158	振东制药	5,100	28,050.00	0.07
531	300766	每日互动	1,700	28,033.00	0.07

532	300815	玉禾田	300	27,870.00	0.07
533	600750	江中药业	2,620	27,798.20	0.07
534	002104	恒宝股份	3,976	27,712.72	0.07
535	002135	东南网架	4,400	27,676.00	0.07
536	300047	天源迪科	3,645	27,665.55	0.07
537	600936	广西广电	8,300	27,639.00	0.07
538	603989	艾华集团	1,030	27,604.00	0.07
539	300791	仙乐健康	300	27,588.00	0.07
540	603279	景津环保	1,500	27,570.00	0.07
541	603916	苏博特	1,200	27,564.00	0.07
542	000811	冰轮环境	3,150	27,531.00	0.07
543	600123	兰花科创	4,800	27,504.00	0.07
544	600169	太原重工	12,700	27,432.00	0.07
545	603108	润达医疗	2,440	27,279.20	0.07
546	002532	天山铝业	3,600	27,252.00	0.07
547	002717	岭南股份	7,580	27,212.20	0.07
548	000926	福星股份	5,400	27,162.00	0.07
549	300740	御家汇	1,500	27,150.00	0.07
550	600285	羚锐制药	3,200	27,104.00	0.07
551	002218	拓日新能	5,200	27,040.00	0.07
552	600075	新疆天业	4,780	27,007.00	0.07
553	600831	广电网络	4,000	27,000.00	0.07
554	002647	仁东控股	2,400	27,000.00	0.07
555	002166	莱茵生物	3,200	26,944.00	0.07
556	600200	江苏吴中	5,000	26,900.00	0.07
557	603533	掌阅科技	800	26,880.00	0.07
558	300183	东软载波	1,600	26,864.00	0.07
559	000032	深桑达 A	1,500	26,850.00	0.07
560	002869	金溢科技	800	26,848.00	0.07
561	002550	千红制药	6,300	26,775.00	0.07
562	000801	四川九洲	4,300	26,617.00	0.07
563	000639	西王食品	3,824	26,615.04	0.07
564	603915	国茂股份	1,000	26,580.00	0.07
565	300349	金卡智能	2,100	26,565.00	0.07
566	603337	杰克股份	872	26,526.24	0.07
567	600449	宁夏建材	2,000	26,520.00	0.07
568	600550	保变电气	5,200	26,520.00	0.07
569	300310	宜通世纪	4,988	26,486.28	0.07
570	688030	山石网科	700	26,460.00	0.07
571	300007	汉威科技	1,700	26,452.00	0.07
572	600971	恒源煤电	4,200	26,418.00	0.07
573	002510	天汽模	5,200	26,416.00	0.07

574	600343	航天动力	2,700	26,352.00	0.07
575	000546	金圆股份	3,500	26,320.00	0.07
576	300672	国科微	600	26,274.00	0.07
577	000795	英洛华	4,800	26,256.00	0.07
578	002960	青鸟消防	700	26,187.00	0.07
579	300664	鹏鹞环保	3,500	26,180.00	0.07
580	300198	纳川股份	5,080	26,162.00	0.07
581	000507	珠海港	4,600	26,128.00	0.07
582	002646	青青稞酒	1,300	26,117.00	0.07
583	002303	美盈森	6,500	26,000.00	0.07
584	300762	上海瀚讯	600	25,980.00	0.07
585	002990	盛视科技	300	25,860.00	0.07
586	600602	云赛智联	4,600	25,852.00	0.07
587	600997	开滦股份	4,500	25,830.00	0.07
588	300266	兴源环境	7,700	25,795.00	0.07
589	601588	北辰实业	11,300	25,764.00	0.07
590	600710	苏美达	4,600	25,760.00	0.07
591	600975	新五丰	3,200	25,728.00	0.07
592	300137	先河环保	3,900	25,701.00	0.07
593	300203	聚光科技	2,200	25,674.00	0.07
594	300366	创意信息	2,600	25,662.00	0.07
595	603378	亚士创能	600	25,626.00	0.07
596	002672	东江环保	2,900	25,607.00	0.07
597	600318	新力金融	2,500	25,600.00	0.07
598	300091	金通灵	6,120	25,581.60	0.07
599	300448	浩云科技	2,900	25,578.00	0.07
600	000973	佛塑科技	5,500	25,575.00	0.07
601	603766	隆鑫通用	7,300	25,550.00	0.07
602	603801	志邦家居	740	25,537.40	0.07
603	000931	中关村	3,700	25,493.00	0.07
604	300527	中船应急	2,543	25,480.86	0.07
605	000040	东旭蓝天	7,300	25,477.00	0.07
606	002277	友阿股份	6,900	25,392.00	0.07
607	002651	利君股份	2,200	25,388.00	0.07
608	688066	航天宏图	600	25,350.00	0.07
609	600624	复旦复华	3,230	25,290.90	0.07
610	603979	金诚信	2,034	25,262.28	0.07
611	002479	富春环保	4,400	25,256.00	0.07
612	600105	永鼎股份	6,740	25,207.60	0.07
613	002364	中恒电气	2,800	25,172.00	0.07
614	002609	捷顺科技	2,700	25,137.00	0.07
615	600510	黑牡丹	3,700	25,123.00	0.07

616	002639	雪人股份	3,800	25,118.00	0.07
617	300229	拓尔思	3,000	25,080.00	0.07
618	601366	利群股份	3,600	25,056.00	0.07
619	300441	鲍斯股份	2,760	25,033.20	0.07
620	300190	维尔利	3,300	24,981.00	0.06
621	300038	数知科技	6,660	24,975.00	0.06
622	300761	立华股份	800	24,816.00	0.06
623	002573	清新环境	4,600	24,748.00	0.06
624	600103	青山纸业	13,070	24,702.30	0.06
625	600452	涪陵电力	1,500	24,675.00	0.06
626	300783	三只松鼠	600	24,654.00	0.06
627	002309	中利集团	4,300	24,596.00	0.06
628	002461	珠江啤酒	2,300	24,587.00	0.06
629	600495	晋西车轴	5,980	24,577.80	0.06
630	002031	巨轮智能	12,400	24,552.00	0.06
631	002522	浙江众成	3,800	24,434.00	0.06
632	600773	西藏城投	3,500	24,430.00	0.06
633	002197	证通电子	2,900	24,418.00	0.06
634	000557	西部创业	6,200	24,366.00	0.06
635	600694	大商股份	1,200	24,360.00	0.06
636	000836	富通信息	8,500	24,310.00	0.06
637	601069	西部黄金	1,800	24,282.00	0.06
638	600096	云天化	4,000	24,280.00	0.06
639	000925	众合科技	3,800	24,244.00	0.06
640	600894	广日股份	3,000	24,240.00	0.06
641	300248	新开普	2,723	24,153.01	0.06
642	002668	奥马电器	6,094	24,132.24	0.06
643	688007	光峰科技	1,300	24,115.00	0.06
644	002556	辉隆股份	3,000	24,030.00	0.06
645	600114	东睦股份	3,080	24,024.00	0.06
646	601606	长城军工	2,000	23,960.00	0.06
647	603626	科森科技	2,080	23,940.80	0.06
648	002034	旺能环境	1,500	23,880.00	0.06
649	000688	国城矿业	2,400	23,832.00	0.06
650	600458	时代新材	2,800	23,828.00	0.06
651	300110	华仁药业	5,020	23,744.60	0.06
652	300579	数字认证	600	23,730.00	0.06
653	601126	四方股份	3,400	23,664.00	0.06
654	300130	新国都	2,040	23,643.60	0.06
655	002314	南山控股	5,700	23,598.00	0.06
656	300081	恒信东方	2,600	23,582.00	0.06
657	002161	远望谷	4,200	23,562.00	0.06

658	603688	石英股份	1,000	23,520.00	0.06
659	603111	康尼机电	4,200	23,478.00	0.06
660	002206	海利得	6,000	23,460.00	0.06
661	300455	康拓红外	2,000	23,460.00	0.06
662	300016	北陆药业	2,450	23,422.00	0.06
663	002215	诺普信	3,900	23,322.00	0.06
664	600055	万东医疗	2,300	23,276.00	0.06
665	603636	南威软件	2,500	23,250.00	0.06
666	000958	东方能源	4,900	23,226.00	0.06
667	603012	创力集团	3,600	23,184.00	0.06
668	603060	国检集团	1,180	23,080.80	0.06
669	002117	东港股份	2,650	23,055.00	0.06
670	002822	中装建设	3,600	23,040.00	0.06
671	600736	苏州高新	4,900	23,030.00	0.06
672	600855	航天长峰	1,500	22,905.00	0.06
673	000989	九芝堂	2,905	22,862.35	0.06
674	603887	城地香江	1,300	22,828.00	0.06
675	600261	阳光照明	6,200	22,816.00	0.06
676	603566	普莱柯	1,100	22,803.00	0.06
677	300423	昇辉科技	1,800	22,716.00	0.06
678	300653	正海生物	400	22,652.00	0.06
679	002158	汉钟精机	1,500	22,620.00	0.06
680	603936	博敏电子	1,800	22,608.00	0.06
681	002308	威创股份	4,500	22,590.00	0.06
682	002462	嘉事堂	1,600	22,576.00	0.06
683	600400	红豆股份	7,120	22,499.20	0.06
684	002083	孚日股份	5,100	22,491.00	0.06
685	300388	节能国祯	2,500	22,450.00	0.06
686	002322	理工环科	2,000	22,440.00	0.06
687	300353	东土科技	2,500	22,425.00	0.06
688	002547	春兴精工	4,800	22,416.00	0.06
689	002383	合众思壮	3,200	22,400.00	0.06
690	600523	贵航股份	1,460	22,294.20	0.06
691	300495	美尚生态	3,283	22,258.74	0.06
692	300657	弘信电子	1,400	22,134.00	0.06
693	002204	大连重工	5,500	22,110.00	0.06
694	600331	宏达股份	10,000	22,100.00	0.06
695	300477	合纵科技	3,560	22,072.00	0.06
696	002565	顺灏股份	5,200	22,048.00	0.06
697	002358	森源电气	4,700	22,043.00	0.06
698	601949	中国出版	3,900	22,035.00	0.06
699	603258	电魂网络	700	22,029.00	0.06

700	300755	华致酒行	840	21,991.20	0.06
701	600810	神马股份	2,360	21,924.40	0.06
702	300439	美康生物	1,200	21,924.00	0.06
703	002115	三维通信	3,600	21,924.00	0.06
704	000968	蓝焰控股	2,700	21,897.00	0.06
705	002228	合兴包装	5,200	21,892.00	0.06
706	002512	达华智能	5,700	21,888.00	0.06
707	601020	华钰矿业	2,000	21,740.00	0.06
708	002474	榕基软件	3,500	21,735.00	0.06
709	603959	百利科技	1,756	21,704.16	0.06
710	000882	华联股份	11,600	21,692.00	0.06
711	600133	东湖高新	3,900	21,684.00	0.06
712	000657	中钨高新	2,980	21,605.00	0.06
713	600987	航民股份	3,770	21,602.10	0.06
714	002657	中科金财	1,900	21,546.00	0.06
715	600676	交运股份	4,400	21,516.00	0.06
716	300590	移为通信	700	21,455.00	0.06
717	300039	上海凯宝	4,400	21,428.00	0.06
718	600622	光大嘉宝	6,320	21,361.60	0.06
719	600020	中原高速	6,300	21,357.00	0.06
720	000726	鲁泰A	3,200	21,344.00	0.06
721	300066	三川智慧	4,400	21,340.00	0.06
722	601609	金田铜业	2,100	21,315.00	0.06
723	300209	天泽信息	2,100	21,315.00	0.06
724	600603	广汇物流	4,400	21,252.00	0.06
725	002530	金财互联	2,720	21,216.00	0.06
726	002970	锐明技术	400	21,204.00	0.06
727	300328	宜安科技	2,420	21,175.00	0.06
728	603666	亿嘉和	220	21,095.80	0.05
729	002562	兄弟科技	4,060	20,990.20	0.05
730	000885	城发环境	1,800	20,988.00	0.05
731	600874	创业环保	3,100	20,987.00	0.05
732	600775	南京熊猫	2,800	20,972.00	0.05
733	002664	长鹰信质	1,400	20,902.00	0.05
734	002224	三力士	3,600	20,844.00	0.05
735	600590	泰豪科技	3,660	20,825.40	0.05
736	600592	龙溪股份	2,000	20,760.00	0.05
737	600581	八一钢铁	5,400	20,682.00	0.05
738	300485	赛升药业	1,400	20,664.00	0.05
739	600569	安阳钢铁	8,100	20,655.00	0.05
740	600389	江山股份	1,000	20,590.00	0.05
741	000720	新能泰山	5,500	20,570.00	0.05

742	000802	北京文化	3,500	20,545.00	0.05
743	000935	四川双马	1,600	20,544.00	0.05
744	603730	岱美股份	715	20,413.25	0.05
745	300255	常山药业	3,300	20,394.00	0.05
746	002047	宝鹰股份	5,700	20,349.00	0.05
747	600184	光电股份	1,800	20,322.00	0.05
748	603220	中贝通信	1,400	20,258.00	0.05
749	002061	浙江交科	3,900	20,241.00	0.05
750	603587	地素时尚	1,060	20,214.20	0.05
751	600708	光明地产	7,867	20,060.85	0.05
752	002267	陕天然气	3,100	20,057.00	0.05
753	300311	任子行	3,331	20,052.62	0.05
754	002341	新纶科技	5,700	20,007.00	0.05
755	002741	光华科技	1,600	19,984.00	0.05
756	002234	民和股份	1,300	19,903.00	0.05
757	603803	瑞斯康达	1,800	19,890.00	0.05
758	002519	银河电子	4,810	19,672.90	0.05
759	000928	中钢国际	4,420	19,669.00	0.05
760	300252	金信诺	2,040	19,665.60	0.05
761	002518	科士达	1,675	19,647.75	0.05
762	300302	同有科技	1,740	19,627.20	0.05
763	002542	中化岩土	6,350	19,558.00	0.05
764	002029	七匹狼	3,700	19,425.00	0.05
765	603980	吉华集团	3,000	19,410.00	0.05
766	300215	电科院	2,700	19,386.00	0.05
767	002636	金安国纪	2,100	19,383.00	0.05
768	300096	易联众	2,400	19,320.00	0.05
769	600981	汇鸿集团	6,300	19,278.00	0.05
770	000544	中原环保	2,750	19,277.50	0.05
771	000597	东北制药	3,800	19,266.00	0.05
772	002837	英维克	1,100	19,250.00	0.05
773	603556	海兴电力	1,400	19,250.00	0.05
774	000950	重药控股	3,700	19,240.00	0.05
775	300520	科大国创	900	19,206.00	0.05
776	603348	文灿股份	700	19,180.00	0.05
777	601886	江河集团	3,300	19,173.00	0.05
778	300855	图南股份	400	19,156.00	0.05
779	002168	惠程科技	4,500	19,125.00	0.05
780	002852	道道全	1,050	19,120.50	0.05
781	601700	风范股份	4,000	19,080.00	0.05
782	688020	方邦股份	200	19,042.00	0.05
783	002274	华昌化工	4,000	19,040.00	0.05

784	300571	平治信息	500	19,040.00	0.05
785	600571	信雅达	2,500	18,950.00	0.05
786	002313	日海智能	1,600	18,928.00	0.05
787	600351	亚宝药业	3,800	18,924.00	0.05
788	002761	多喜爱	2,300	18,906.00	0.05
789	603383	顶点软件	600	18,882.00	0.05
790	002906	华阳集团	700	18,872.00	0.05
791	300109	新开源	1,374	18,823.80	0.05
792	300191	潜能恒信	1,100	18,799.00	0.05
793	603305	旭升股份	600	18,774.00	0.05
794	300570	太辰光	1,100	18,766.00	0.05
795	603728	鸣志电器	1,200	18,696.00	0.05
796	000918	嘉凯城	5,100	18,666.00	0.05
797	300205	天喻信息	1,800	18,630.00	0.05
798	002746	仙坛股份	1,610	18,611.60	0.05
799	603359	东珠生态	1,160	18,548.40	0.05
800	300021	大禹节水	3,400	18,530.00	0.05
801	300829	金丹科技	200	18,514.00	0.05
802	603466	风语筑	800	18,464.00	0.05
803	600162	香江控股	9,550	18,431.50	0.05
804	002344	海宁皮城	4,500	18,405.00	0.05
805	300603	立昂技术	1,500	18,315.00	0.05
806	300684	中石科技	800	18,272.00	0.05
807	000011	深物业 A	1,500	18,255.00	0.05
808	002516	旷达科技	5,200	18,200.00	0.05
809	605168	三人行	100	18,135.00	0.05
810	300043	星辉娱乐	5,300	18,126.00	0.05
811	601330	绿色动力	2,100	18,123.00	0.05
812	300785	值得买	199	18,085.12	0.05
813	603367	辰欣药业	1,300	18,083.00	0.05
814	002015	协鑫能科	2,900	18,067.00	0.05
815	002913	奥士康	300	18,063.00	0.05
816	603363	傲农生物	1,450	17,965.50	0.05
817	002307	北新路桥	3,700	17,908.00	0.05
818	002796	世嘉科技	1,100	17,886.00	0.05
819	603660	苏州科达	2,440	17,812.00	0.05
820	300510	金冠股份	3,479	17,777.69	0.05
821	600548	深高速	2,000	17,760.00	0.05
822	300080	易成新能	2,900	17,748.00	0.05
823	002979	雷赛智能	400	17,736.00	0.05
824	000889	中嘉博创	3,340	17,635.20	0.05
825	002343	慈文传媒	2,730	17,581.20	0.05

826	300531	优博讯	1,100	17,578.00	0.05
827	603896	寿仙谷	500	17,565.00	0.05
828	000797	中国武夷	5,541	17,564.97	0.05
829	603869	新智认知	1,800	17,550.00	0.05
830	002017	东信和平	1,900	17,366.00	0.05
831	300428	四通新材	1,200	17,340.00	0.05
832	300548	博创科技	500	17,325.00	0.05
833	000019	深粮控股	2,300	17,250.00	0.04
834	600686	金龙汽车	2,000	17,200.00	0.04
835	002663	普邦股份	8,900	17,177.00	0.04
836	002792	通宇通讯	950	17,147.50	0.04
837	002201	九鼎新材	1,400	17,038.00	0.04
838	000791	甘肃电投	3,820	17,037.20	0.04
839	300276	三丰智能	4,080	17,013.60	0.04
840	300365	恒华科技	1,700	16,983.00	0.04
841	002755	奥赛康	1,300	16,978.00	0.04
842	300788	中信出版	400	16,964.00	0.04
843	300307	慈星股份	3,300	16,962.00	0.04
844	300300	海峡创新	3,275	16,899.00	0.04
845	600229	城市传媒	2,500	16,850.00	0.04
846	600626	申达股份	4,200	16,758.00	0.04
847	603105	芯能科技	1,800	16,632.00	0.04
848	002482	广田集团	5,400	16,632.00	0.04
849	600035	楚天高速	5,700	16,587.00	0.04
850	002840	华统股份	1,580	16,542.60	0.04
851	002947	恒铭达	400	16,516.00	0.04
852	600825	新华传媒	3,700	16,502.00	0.04
853	600239	云南城投	6,800	16,456.00	0.04
854	300771	智莱科技	580	16,448.80	0.04
855	002621	美吉姆	2,920	16,439.60	0.04
856	002991	甘源食品	200	16,390.00	0.04
857	600996	贵广网络	3,000	16,380.00	0.04
858	601789	宁波建工	4,100	16,359.00	0.04
859	600800	天津磁卡	3,500	16,310.00	0.04
860	600054	黄山旅游	1,800	16,164.00	0.04
861	002279	久其软件	3,480	16,147.20	0.04
862	002232	启明信息	1,400	16,114.00	0.04
863	300765	新诺威	860	16,090.60	0.04
864	601858	中国科传	1,700	16,082.00	0.04
865	002095	生意宝	1,100	16,082.00	0.04
866	300288	朗玛信息	1,400	15,890.00	0.04
867	000065	北方国际	2,125	15,852.50	0.04

868	603283	赛腾股份	400	15,848.00	0.04
869	002618	丹邦科技	3,050	15,768.50	0.04
870	601515	东风股份	2,800	15,764.00	0.04
871	601900	南方传媒	1,900	15,732.00	0.04
872	000498	山东路桥	3,300	15,675.00	0.04
873	601116	三江购物	1,500	15,675.00	0.04
874	300673	佩蒂股份	500	15,645.00	0.04
875	600876	洛阳玻璃	800	15,584.00	0.04
876	603299	苏盐井神	2,200	15,576.00	0.04
877	600278	东方创业	1,800	15,570.00	0.04
878	300127	银河磁体	900	15,453.00	0.04
879	300559	佳发教育	1,150	15,410.00	0.04
880	600335	国机汽车	3,100	15,407.00	0.04
881	300204	舒泰神	1,700	15,351.00	0.04
882	600715	文投控股	6,500	15,340.00	0.04
883	000665	湖北广电	3,440	15,273.60	0.04
884	603579	荣泰健康	500	15,085.00	0.04
885	002378	章源钨业	2,600	15,080.00	0.04
886	300140	中环装备	2,100	15,078.00	0.04
887	000561	烽火电子	2,100	15,057.00	0.04
888	601619	嘉泽新能	4,400	14,960.00	0.04
889	002662	京威股份	4,200	14,952.00	0.04
890	600758	辽宁能源	3,700	14,948.00	0.04
891	002137	麦达数字	2,400	14,928.00	0.04
892	002955	鸿合科技	680	14,871.60	0.04
893	002435	长江健康	3,500	14,840.00	0.04
894	603357	设计总院	1,600	14,832.00	0.04
895	300634	彩讯股份	800	14,816.00	0.04
896	603590	康辰药业	400	14,792.00	0.04
897	300504	天邑股份	800	14,744.00	0.04
898	603093	南华期货	800	14,712.00	0.04
899	002685	华东重机	3,600	14,616.00	0.04
900	600295	鄂尔多斯	1,400	14,588.00	0.04
901	600929	雪天盐业	2,600	14,456.00	0.04
902	300506	名家汇	2,390	14,435.60	0.04
903	002880	卫光生物	300	14,409.00	0.04
904	002929	润建股份	600	14,376.00	0.04
905	600136	当代文体	2,100	14,364.00	0.04
906	002181	粤传媒	3,300	14,322.00	0.04
907	002987	京北方	300	14,322.00	0.04
908	002243	通产丽星	1,300	14,261.00	0.04
909	000038	深大通	1,480	14,208.00	0.04

910	002631	德尔未来	1,900	14,174.00	0.04
911	600738	兰州民百	2,200	14,124.00	0.04
912	000058	深赛格	2,100	14,112.00	0.04
913	002619	艾格拉斯	7,780	14,004.00	0.04
914	603180	金牌厨柜	280	13,986.00	0.04
915	601595	上海电影	1,280	13,964.80	0.04
916	603169	兰石重装	3,000	13,950.00	0.04
917	002246	北化股份	1,900	13,927.00	0.04
918	002977	天箭科技	100	13,920.00	0.04
919	300842	帝科股份	200	13,838.00	0.04
920	002933	新兴装备	400	13,816.00	0.04
921	603876	鼎胜新材	900	13,761.00	0.04
922	002978	安宁股份	300	13,755.00	0.04
923	603360	百傲化学	900	13,734.00	0.04
924	300533	冰川网络	550	13,574.00	0.04
925	002980	华盛昌	300	13,530.00	0.04
926	000025	特力A	800	13,520.00	0.04
927	000815	美利云	2,500	13,375.00	0.03
928	002782	可立克	1,000	13,260.00	0.03
929	000620	新华联	5,400	13,230.00	0.03
930	603508	思维列控	540	13,127.40	0.03
931	002982	湘佳股份	200	13,060.00	0.03
932	000517	荣安地产	4,500	13,050.00	0.03
933	600965	福成股份	2,300	13,041.00	0.03
934	300803	指南针	400	13,040.00	0.03
935	002287	奇正藏药	500	12,965.00	0.03
936	000905	厦门港务	1,800	12,906.00	0.03
937	603727	博迈科	800	12,704.00	0.03
938	603421	鼎信通讯	1,360	12,634.40	0.03
939	603595	东尼电子	624	12,517.44	0.03
940	002962	五方光电	700	12,467.00	0.03
941	000567	海德股份	1,400	12,460.00	0.03
942	603777	来伊份	1,000	12,380.00	0.03
943	002393	力生制药	600	12,234.00	0.03
944	603222	济民制药	900	12,168.00	0.03
945	300723	一品红	300	12,054.00	0.03
946	002712	思美传媒	2,460	12,004.80	0.03
947	603081	大丰实业	1,100	11,935.00	0.03
948	603808	歌力思	900	11,880.00	0.03
949	603557	起步股份	1,300	11,830.00	0.03
950	688001	华兴源创	300	11,820.00	0.03
951	300857	协创数据	400	11,812.00	0.03

952	600618	氯碱化工	1,600	11,696.00	0.03
953	603327	福蓉科技	600	11,694.00	0.03
954	603212	赛伍技术	300	11,664.00	0.03
955	002016	世荣兆业	1,700	11,594.00	0.03
956	603693	江苏新能	900	11,592.00	0.03
957	300799	左江科技	200	11,566.00	0.03
958	300793	佳禾智能	600	11,226.00	0.03
959	002989	中天精装	300	11,130.00	0.03
960	603103	横店影视	580	10,933.00	0.03
961	300856	科思股份	200	10,914.00	0.03
962	600956	新天绿能	1,000	10,060.00	0.03
963	603610	麒盛科技	400	9,668.00	0.03
964	002961	瑞达期货	400	9,600.00	0.02
965	000666	经纬纺机	1,100	8,965.00	0.02
966	300846	首都在线	400	8,876.00	0.02
967	603053	成都燃气	700	8,743.00	0.02
968	603839	安正时尚	880	8,676.80	0.02
969	605222	起帆电缆	400	8,596.00	0.02
970	603711	香飘飘	400	8,456.00	0.02
971	300800	力合科技	300	8,268.00	0.02
972	603997	继峰股份	1,050	7,917.00	0.02
973	002895	川恒股份	700	7,721.00	0.02
974	002951	金时科技	600	7,716.00	0.02
975	000711	京蓝科技	2,900	7,656.00	0.02
976	603956	威派格	500	7,590.00	0.02
977	603390	通达电气	700	7,385.00	0.02
978	603619	中曼石油	800	7,280.00	0.02
979	605199	葫芦娃	300	7,236.00	0.02
980	002911	佛燃能源	400	7,224.00	0.02
981	603530	神马电力	300	6,879.00	0.02
982	688098	申联生物	400	6,436.00	0.02
983	603439	贵州三力	300	6,078.00	0.02
984	002973	侨银股份	300	6,000.00	0.02
985	603013	亚普股份	400	5,828.00	0.02
986	300805	电声股份	300	5,655.00	0.01
987	603992	松霖科技	300	5,502.00	0.01
988	603687	大胜达	600	5,466.00	0.01
989	688108	赛诺医疗	400	5,388.00	0.01
990	002907	华森制药	400	5,368.00	0.01
991	603848	好太太	400	5,024.00	0.01
992	603408	建霖家居	300	4,893.00	0.01
993	605118	力鼎光电	300	4,545.00	0.01

994	603551	奥普家居	300	4,473.00	0.01
995	603815	交建股份	400	4,140.00	0.01
996	002969	嘉美包装	700	3,969.00	0.01
997	603676	卫信康	400	3,596.00	0.01
998	300798	锦鸡股份	300	3,261.00	0.01

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	300677	英科医疗	228,495.00	0.59
2	002180	纳思达	141,470.00	0.37
3	300251	光线传媒	107,758.00	0.28
4	002163	海南发展	93,260.00	0.24
5	688122	西部超导	82,915.90	0.22
6	002407	多氟多	82,473.00	0.21
7	603129	春风动力	75,760.00	0.20
8	002541	鸿路钢构	74,442.00	0.19
9	300773	拉卡拉	72,006.00	0.19
10	600732	爱旭股份	69,525.00	0.18
11	300775	三角防务	63,252.00	0.16
12	688005	容百科技	63,236.00	0.16
13	688019	安集科技	60,600.00	0.16
14	300777	中简科技	60,326.00	0.16
15	603613	国联股份	58,800.00	0.15
16	603236	移远通信	58,313.00	0.15
17	000566	海南海药	56,286.00	0.15
18	603267	鸿远电子	55,946.00	0.15
19	688006	杭可科技	54,450.00	0.14
20	000923	河钢资源	50,766.00	0.13

注：买入金额不包括相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	300661	圣邦股份	191,934.40	0.50
2	002568	百润股份	183,491.00	0.48
3	603345	安井食品	168,120.00	0.44
4	300699	光威复材	163,290.00	0.42

5	300676	华大基因	156,656.00	0.41
6	002791	坚朗五金	140,378.00	0.37
7	300463	迈克生物	132,617.00	0.35
8	002065	东华软件	128,103.00	0.33
9	002683	宏大爆破	114,476.00	0.30
10	603737	三棵树	111,286.40	0.29
11	002705	新宝股份	111,162.00	0.29
12	000540	中天金融	104,380.00	0.27
13	300223	北京君正	94,965.60	0.25
14	603638	艾迪精密	87,773.35	0.23
15	600546	山煤国际	59,420.00	0.15
16	300098	高新兴	58,964.59	0.15
17	600517	国网英大	53,632.00	0.14
18	600131	国网信通	51,702.00	0.13
19	600320	振华重工	48,141.00	0.13
20	000429	粤高速 A	46,526.00	0.12

注：卖出金额不包括相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,486,465.61
卖出股票收入（成交）总额	8,384,921.05

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

8.5 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。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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

8.12.2

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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,665.20
2	应收证券清算款	197,770.00
3	应收股利	-
4	应收利息	265.12
5	应收申购款	9,974.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	211,674.54

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

§ 8 投资组合报告（转型前）

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	39,433,707.46	90.66
	其中：股票	39,433,707.46	90.66
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	2,708,004.39	6.23
8	其他各项资产	1,355,598.91	3.12
9	合计	43,497,310.76	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	339,243.70	0.81
B	采矿业	826,828.28	1.98
C	制造业	25,862,888.52	62.01
D	电力、热力、燃气	830,046.20	1.99

	及水生产和供应业		
E	建筑业	709,018.31	1.70
F	批发和零售业	1,180,972.80	2.83
G	交通运输、仓储和邮政业	856,296.64	2.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,524,264.60	10.85
J	金融业	662,253.30	1.59
K	房地产业	1,147,520.45	2.75
L	租赁和商务服务业	407,688.26	0.98
M	科学研究和技术服务业	649,563.92	1.56
N	水利、环境和公共设施管理业	757,358.92	1.82
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	19,230.80	0.05
Q	卫生和社会工作	154,567.24	0.37
R	文化、体育和娱乐业	345,749.90	0.83
S	综合	109,536.60	0.26
	合计	39,383,028.44	94.42

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	50,679.02	0.12
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	50,679.02	0.12

8.2.3 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300661	圣邦股份	680	204,319.60	0.49
2	000799	酒鬼酒	1,700	186,966.00	0.45
3	300037	新宙邦	2,000	155,280.00	0.37
4	601636	旗滨集团	11,500	154,100.00	0.37
5	300676	华大基因	1,200	153,084.00	0.37
6	002568	百润股份	2,000	152,160.00	0.36
7	603345	安井食品	900	152,055.00	0.36
8	300724	捷佳伟创	1,500	143,775.00	0.34
9	300699	光威复材	2,060	143,067.00	0.34
10	002683	宏大爆破	3,300	133,254.00	0.32
11	600988	赤峰黄金	7,000	129,640.00	0.31
12	300463	迈克生物	2,900	127,919.00	0.31
13	002151	北斗星通	2,400	127,224.00	0.31
14	002065	东华软件	14,100	127,041.00	0.30
15	002647	仁东控股	2,000	124,780.00	0.30
16	002791	坚朗五金	1,000	123,810.00	0.30
17	300073	当升科技	2,600	121,160.00	0.29
18	002497	雅化集团	7,800	115,440.00	0.28
19	002705	新宝股份	2,600	115,180.00	0.28
20	000733	振华科技	2,800	113,484.00	0.27
21	603737	三棵树	780	113,388.60	0.27
22	002706	良信股份	4,400	112,420.00	0.27

23	300502	新易盛	1,760	106,796.80	0.26
24	603005	晶方科技	1,500	106,575.00	0.26
25	002409	雅克科技	1,800	106,452.00	0.26
26	002402	和而泰	6,350	105,092.50	0.25
27	600882	妙可蓝多	2,800	104,972.00	0.25
28	603678	火炬电子	2,250	102,892.50	0.25
29	600966	博汇纸业	6,500	101,855.00	0.24
30	002436	兴森科技	9,500	101,650.00	0.24
31	002675	东诚药业	4,500	101,295.00	0.24
32	002389	航天彩虹	4,600	100,602.00	0.24
33	600305	恒顺醋业	4,716	98,375.76	0.24
34	000540	中天金融	31,200	98,280.00	0.24
35	002025	航天电器	2,000	97,980.00	0.23
36	002851	麦格米特	2,750	96,992.50	0.23
37	002430	杭氧股份	3,100	95,945.00	0.23
38	600873	梅花生物	17,300	95,669.00	0.23
39	603027	千禾味业	2,620	94,791.60	0.23
40	600185	格力地产	10,080	94,651.20	0.23
41	300747	锐科激光	1,075	93,095.00	0.22
42	600559	老白干酒	5,105	93,064.15	0.22
43	300457	赢合科技	3,225	92,718.75	0.22
44	601058	赛轮轮胎	14,440	92,704.80	0.22
45	002597	金禾实业	2,700	92,016.00	0.22
46	600323	瀚蓝环境	3,800	91,922.00	0.22
47	002123	梦网集团	5,100	90,780.00	0.22
48	300751	迈为股份	200	90,378.00	0.22
49	300326	凯利泰	5,400	88,560.00	0.21
50	300188	美亚柏科	3,800	87,780.00	0.21
51	002481	双塔食品	5,300	86,655.00	0.21
52	300476	胜宏科技	3,620	85,866.40	0.21
53	002216	三全食品	3,100	85,188.00	0.20
54	300725	药石科技	720	84,816.00	0.20
55	300054	鼎龙股份	5,440	84,755.20	0.20
56	300298	三诺生物	2,280	84,360.00	0.20
57	300373	扬杰科技	1,900	83,353.00	0.20
58	000403	双林生物	2,033	83,271.68	0.20
59	300348	长亮科技	3,950	82,515.50	0.20
60	002643	万润股份	4,300	82,474.00	0.20
61	300236	上海新阳	1,450	82,360.00	0.20
62	000672	上峰水泥	3,400	81,838.00	0.20
63	600984	建设机械	4,600	81,834.00	0.20
64	300223	北京君正	960	81,628.80	0.20

65	002727	一心堂	2,200	81,400.00	0.20
66	600641	万业企业	4,440	81,296.40	0.19
67	600720	祁连山	4,900	81,242.00	0.19
68	002332	仙琚制药	5,700	80,142.00	0.19
69	000951	中国重汽	2,200	79,992.00	0.19
70	000516	国际医学	9,300	79,887.00	0.19
71	603456	九洲药业	2,800	79,576.00	0.19
72	300118	东方日升	4,900	79,478.00	0.19
73	002100	天康生物	6,000	78,660.00	0.19
74	601519	大智慧	7,700	78,540.00	0.19
75	603039	泛微网络	756	78,185.52	0.19
76	300185	通裕重工	20,700	77,832.00	0.19
77	000591	太阳能	16,360	77,710.00	0.19
78	300068	南都电源	4,900	76,881.00	0.18
79	000034	神州数码	3,000	76,710.00	0.18
80	300451	创业慧康	5,475	76,485.75	0.18
81	002747	埃斯顿	3,500	76,475.00	0.18
82	300226	上海钢联	1,243	76,444.50	0.18
83	002023	海特高新	5,100	76,245.00	0.18
84	603638	艾迪精密	1,413	76,033.53	0.18
85	000818	航锦科技	3,800	75,544.00	0.18
86	300379	东方通	2,200	75,416.00	0.18
87	600267	海正药业	4,600	75,256.00	0.18
88	600711	盛屯矿业	11,000	74,910.00	0.18
89	000710	贝瑞基因	1,700	74,698.00	0.18
90	300346	南大光电	2,200	74,646.00	0.18
91	000735	罗牛山	7,600	74,480.00	0.18
92	000902	新洋丰	5,100	74,460.00	0.18
93	600363	联创光电	2,800	74,116.00	0.18
94	300036	超图软件	3,600	74,088.00	0.18
95	000667	美好置业	19,200	72,960.00	0.17
96	600601	方正科技	18,000	72,900.00	0.17
97	300363	博腾股份	2,200	72,182.00	0.17
98	600252	中恒集团	21,900	72,051.00	0.17
99	002126	银轮股份	6,400	71,744.00	0.17
100	002467	二六三	10,730	71,569.10	0.17
101	002262	恩华药业	4,236	71,037.72	0.17
102	600110	诺德股份	9,400	70,876.00	0.17
103	300395	菲利华	1,600	70,848.00	0.17
104	002400	省广集团	11,000	70,840.00	0.17
105	600206	有研新材	4,700	70,829.00	0.17
106	002099	海翔药业	8,100	69,498.00	0.17

107	300737	科顺股份	3,100	69,130.00	0.17
108	600797	浙大网新	8,200	68,716.00	0.16
109	300685	艾德生物	860	68,542.00	0.16
110	000933	神火股份	8,900	68,263.00	0.16
111	600685	中船防务	2,600	68,094.00	0.16
112	300294	博雅生物	1,950	68,055.00	0.16
113	300623	捷捷微电	1,420	67,890.20	0.16
114	002626	金达威	1,900	67,830.00	0.16
115	000555	神州信息	3,800	67,640.00	0.16
116	600812	华北制药	6,500	67,340.00	0.16
117	000582	北部湾港	5,500	66,495.00	0.16
118	002413	雷科防务	8,800	66,440.00	0.16
119	300458	全志科技	1,806	66,280.20	0.16
120	600635	大众公用	15,200	65,664.00	0.16
121	603588	高能环境	4,600	65,596.00	0.16
122	601222	林洋能源	8,808	64,386.48	0.15
123	603596	伯特利	1,600	64,320.00	0.15
124	000831	五矿稀土	4,600	64,216.00	0.15
125	000035	中国天楹	13,900	63,801.00	0.15
126	002214	大立科技	2,900	63,539.00	0.15
127	603606	东方电缆	3,100	63,395.00	0.15
128	603520	司太立	1,000	63,390.00	0.15
129	300674	宇信科技	1,900	63,289.00	0.15
130	603026	石大胜华	1,200	63,216.00	0.15
131	300369	绿盟科技	3,800	62,890.00	0.15
132	603127	昭衍新药	640	62,886.40	0.15
133	600330	天通股份	6,580	62,773.20	0.15
134	000903	云内动力	11,600	62,524.00	0.15
135	002428	云南锗业	4,100	62,484.00	0.15
136	603686	龙马环卫	3,260	61,940.00	0.15
137	300085	银之杰	2,800	61,936.00	0.15
138	002022	科华生物	3,300	61,875.00	0.15
139	000016	深康佳 A	9,300	61,845.00	0.15
140	600496	精工钢构	11,200	61,824.00	0.15
141	300132	青松股份	2,500	61,775.00	0.15
142	300083	创世纪	7,600	61,712.00	0.15
143	300598	诚迈科技	500	61,700.00	0.15
144	000503	国新健康	5,700	61,617.00	0.15
145	002237	恒邦股份	4,300	61,576.00	0.15
146	600803	新奥股份	4,300	61,490.00	0.15
147	600621	华鑫股份	3,300	61,446.00	0.15
148	002310	东方园林	12,800	61,056.00	0.15

149	300143	盈康生命	2,500	60,900.00	0.15
150	000913	钱江摩托	2,200	60,896.00	0.15
151	300079	数码科技	11,100	60,828.00	0.15
152	300567	精测电子	1,200	60,564.00	0.15
153	002610	爱康科技	28,500	60,420.00	0.14
154	000789	万年青	3,750	60,187.50	0.14
155	002239	奥特佳	12,900	59,985.00	0.14
156	600456	宝钛股份	1,600	59,472.00	0.14
157	002035	华帝股份	5,830	59,407.70	0.14
158	000921	海信家电	3,700	59,274.00	0.14
159	300339	润和软件	5,300	59,254.00	0.14
160	002351	漫步者	3,650	59,203.00	0.14
161	300098	高新兴	11,863	59,196.37	0.14
162	002063	远光软件	7,290	58,903.20	0.14
163	600459	贵研铂业	2,350	58,726.50	0.14
164	600761	安徽合力	4,100	58,630.00	0.14
165	300394	天孚通信	1,000	58,550.00	0.14
166	601375	中原证券	10,900	58,424.00	0.14
167	600596	新安股份	4,000	58,240.00	0.14
168	300352	北信源	9,075	58,170.75	0.14
169	603489	八方股份	300	57,747.00	0.14
170	300666	江丰电子	1,100	57,376.00	0.14
171	300323	华灿光电	4,200	57,372.00	0.14
172	603713	密尔克卫	500	57,230.00	0.14
173	002617	露笑科技	7,099	57,146.95	0.14
174	002036	联创电子	4,623	56,354.37	0.14
175	300123	亚光科技	4,040	56,277.20	0.13
176	300327	中颖电子	1,580	56,042.60	0.13
177	600490	鹏欣资源	13,800	55,890.00	0.13
178	300078	思创医惠	5,424	55,758.72	0.13
179	300031	宝通科技	2,700	55,512.00	0.13
180	002254	泰和新材	3,400	55,420.00	0.13
181	002139	拓邦股份	6,525	55,266.75	0.13
182	603881	数据港	800	55,184.00	0.13
183	603308	应流股份	2,300	55,131.00	0.13
184	603599	广信股份	2,200	54,736.00	0.13
185	300568	星源材质	2,342	54,615.44	0.13
186	600864	哈投股份	8,200	54,530.00	0.13
187	002145	中核钛白	8,400	54,432.00	0.13
188	300766	每日互动	1,900	54,359.00	0.13
189	002020	京新药业	4,600	54,326.00	0.13
190	002106	莱宝高科	4,500	54,270.00	0.13

191	603018	华设集团	4,140	54,109.80	0.13
192	002312	三泰控股	8,700	53,766.00	0.13
193	601666	平煤股份	9,300	53,754.00	0.13
194	600517	国网英大	9,000	53,730.00	0.13
195	300232	洲明科技	4,848	53,715.84	0.13
196	000875	吉电股份	13,600	53,584.00	0.13
197	000049	德赛电池	1,000	53,570.00	0.13
198	002240	盛新锂能	3,100	53,444.00	0.13
199	603583	捷昌驱动	780	53,188.20	0.13
200	002585	双星新材	5,390	52,983.70	0.13
201	300456	赛微电子	1,940	52,729.20	0.13
202	600057	厦门象屿	8,226	52,728.66	0.13
203	300741	华宝股份	900	52,632.00	0.13
204	300748	金力永磁	1,300	52,624.00	0.13
205	002091	江苏国泰	7,760	52,612.80	0.13
206	600789	鲁抗医药	5,840	52,326.40	0.13
207	002488	金固股份	5,650	52,262.50	0.13
208	002459	晶澳科技	1,800	52,200.00	0.13
209	601677	明泰铝业	3,600	52,200.00	0.13
210	600546	山煤国际	6,800	52,156.00	0.13
211	603368	柳药股份	2,070	52,060.50	0.12
212	002928	华夏航空	4,025	52,043.25	0.12
213	600986	浙文互联	10,440	51,991.20	0.12
214	603298	杭叉集团	2,720	51,897.60	0.12
215	603267	鸿远电子	600	51,888.00	0.12
216	002042	华孚时尚	7,050	51,817.50	0.12
217	600131	国网信通	2,900	51,765.00	0.12
218	603919	金徽酒	1,160	51,643.20	0.12
219	300170	汉得信息	5,600	51,632.00	0.12
220	000088	盐田港	7,300	51,465.00	0.12
221	300702	天宇股份	600	51,438.00	0.12
222	002324	普利特	3,300	51,348.00	0.12
223	002276	万马股份	5,900	51,035.00	0.12
224	002850	科达利	700	50,981.00	0.12
225	300397	天和防务	2,380	50,765.40	0.12
226	000917	电广传媒	9,500	50,540.00	0.12
227	600993	马应龙	2,500	50,250.00	0.12
228	601965	中国汽研	3,200	50,240.00	0.12
229	603323	苏农银行	10,210	50,131.10	0.12
230	603601	再升科技	3,600	50,112.00	0.12
231	603128	华贸物流	6,540	49,965.60	0.12
232	002531	天顺风能	6,880	49,948.80	0.12

233	600211	西藏药业	760	49,886.40	0.12
234	603043	广州酒家	1,300	49,686.00	0.12
235	002292	奥飞娱乐	6,700	49,513.00	0.12
236	600246	万通发展	6,800	49,504.00	0.12
237	002171	楚江新材	5,300	49,290.00	0.12
238	000683	远兴能源	21,140	49,044.80	0.12
239	300053	欧比特	4,645	48,818.95	0.12
240	600320	振华重工	15,780	48,760.20	0.12
241	002421	达实智能	12,200	48,678.00	0.12
242	000155	川能动力	6,400	48,640.00	0.12
243	000429	粤高速 A	7,100	48,635.00	0.12
244	300238	冠昊生物	1,700	48,603.00	0.12
245	600868	梅雁吉祥	15,500	48,515.00	0.12
246	600105	永鼎股份	7,140	48,480.60	0.12
247	600337	美克家居	9,900	48,411.00	0.12
248	600503	华丽家族	12,700	48,387.00	0.12
249	600742	一汽富维	4,196	48,337.92	0.12
250	000901	航天科技	4,793	48,313.44	0.12
251	300429	强力新材	2,503	48,307.90	0.12
252	002258	利尔化学	2,100	48,237.00	0.12
253	603236	移远通信	260	48,139.00	0.12
254	600612	老凤祥	1,000	48,000.00	0.12
255	002326	永太科技	5,196	47,907.12	0.11
256	002698	博实股份	4,000	47,880.00	0.11
257	002097	山河智能	6,000	47,820.00	0.11
258	002697	红旗连锁	6,740	47,786.60	0.11
259	002301	齐心集团	3,200	47,616.00	0.11
260	000030	富奥股份	5,900	47,613.00	0.11
261	000560	我爱我家	11,180	47,515.00	0.11
262	000976	华铁股份	7,800	47,502.00	0.11
263	002605	姚记科技	1,700	47,481.00	0.11
264	600360	华微电子	6,100	47,397.00	0.11
265	000851	高鸿股份	7,200	47,376.00	0.11
266	300149	睿智医药	2,800	47,264.00	0.11
267	600491	龙元建设	7,600	47,044.00	0.11
268	600326	西藏天路	5,800	47,038.00	0.11
269	603533	掌阅科技	900	46,962.00	0.11
270	600771	广誉远	3,100	46,934.00	0.11
271	600850	华东电脑	2,000	46,900.00	0.11
272	002581	未名医药	2,700	46,845.00	0.11
273	300525	博思软件	1,600	46,800.00	0.11
274	300101	振芯科技	3,100	46,779.00	0.11

275	000059	华锦股份	7,800	46,722.00	0.11
276	603718	海利生物	2,585	46,710.95	0.11
277	002283	天润工业	7,400	46,694.00	0.11
278	300177	中海达	3,750	46,687.50	0.11
279	000796	凯撒旅业	3,400	46,648.00	0.11
280	002446	盛路通信	6,020	46,534.60	0.11
281	300287	飞利信	9,300	46,500.00	0.11
282	600740	山西焦化	7,620	46,405.80	0.11
283	603218	日月股份	1,940	46,288.40	0.11
284	300131	英唐智控	4,600	46,184.00	0.11
285	603118	共进股份	3,900	46,098.00	0.11
286	300102	乾照光电	5,700	46,056.00	0.11
287	000650	仁和药业	6,400	46,016.00	0.11
288	300770	新媒股份	620	45,911.00	0.11
289	000070	特发信息	4,480	45,785.60	0.11
290	603429	集友股份	1,220	45,750.00	0.11
291	002367	康力电梯	4,100	45,510.00	0.11
292	601908	京运通	7,700	45,430.00	0.11
293	002041	登海种业	2,700	45,414.00	0.11
294	002567	唐人神	5,650	45,256.50	0.11
295	300034	钢研高纳	1,779	45,204.39	0.11
296	600210	紫江企业	10,000	45,200.00	0.11
297	600378	昊华科技	2,200	45,144.00	0.11
298	600562	国睿科技	2,732	44,941.40	0.11
299	002484	江海股份	4,016	44,939.04	0.11
300	601163	三角轮胎	2,500	44,725.00	0.11
301	600129	太极集团	3,100	44,671.00	0.11
302	300377	赢时胜	4,100	44,403.00	0.11
303	300679	电连技术	1,130	43,968.30	0.11
304	600072	中船科技	3,700	43,882.00	0.11
305	002918	蒙娜丽莎	1,370	43,648.20	0.10
306	002043	兔宝宝	4,500	43,605.00	0.10
307	002959	小熊电器	400	43,500.00	0.10
308	002245	蔚蓝锂芯	5,500	43,340.00	0.10
309	002498	汉缆股份	10,500	43,260.00	0.10
310	600662	强生控股	5,300	43,195.00	0.10
311	002859	洁美科技	1,680	43,176.00	0.10
312	002298	中电兴发	4,300	43,129.00	0.10
313	600499	科达制造	9,100	43,043.00	0.10
314	000006	深振业 A	7,400	42,994.00	0.10
315	300303	聚飞光电	6,840	42,955.20	0.10
316	002182	云海金属	3,700	42,920.00	0.10

317	300663	科蓝软件	1,700	42,636.00	0.10
318	300263	隆华科技	5,300	42,559.00	0.10
319	002649	博彦科技	4,300	42,527.00	0.10
320	300284	苏交科	5,752	42,449.76	0.10
321	300406	九强生物	2,000	42,400.00	0.10
322	600477	杭萧钢构	10,070	42,394.70	0.10
323	603826	坤彩科技	1,100	42,361.00	0.10
324	001696	宗申动力	5,100	42,228.00	0.10
325	300523	辰安科技	1,100	42,108.00	0.10
326	300572	安车检测	900	42,102.00	0.10
327	600108	亚盛集团	13,100	42,051.00	0.10
328	002425	凯撒文化	4,580	41,998.60	0.10
329	300233	金城医药	1,900	41,990.00	0.10
330	002251	步步高	4,100	41,943.00	0.10
331	002222	福晶科技	2,850	41,923.50	0.10
332	600420	现代制药	4,000	41,840.00	0.10
333	600063	皖维高新	10,000	41,800.00	0.10
334	300292	吴通控股	8,700	41,760.00	0.10
335	002261	拓维信息	6,000	41,760.00	0.10
336	002449	国星光电	3,730	41,738.70	0.10
337	600284	浦东建设	6,500	41,730.00	0.10
338	002335	科华数据	1,800	41,724.00	0.10
339	000603	盛达资源	2,700	41,688.00	0.10
340	601952	苏垦农发	3,490	41,600.80	0.10
341	002318	久立特材	4,000	41,600.00	0.10
342	600300	维维股份	9,900	41,481.00	0.10
343	600604	市北高新	5,700	41,382.00	0.10
344	300664	鹏鹞环保	4,300	41,323.00	0.10
345	002912	中新赛克	700	41,314.00	0.10
346	603008	喜临门	2,200	41,294.00	0.10
347	603920	世运电路	1,300	41,275.00	0.10
348	600587	新华医疗	2,600	41,210.00	0.10
349	600668	尖峰集团	2,700	41,202.00	0.10
350	300194	福安药业	6,900	41,193.00	0.10
351	300267	尔康制药	8,800	41,184.00	0.10
352	600391	航发科技	1,900	41,097.00	0.10
353	300038	数知科技	6,460	41,085.60	0.10
354	603613	国联股份	480	41,040.00	0.10
355	300055	万邦达	5,900	41,005.00	0.10
356	300222	科大智能	3,320	41,002.00	0.10
357	600756	浪潮软件	2,600	41,002.00	0.10
358	300368	汇金股份	2,500	41,000.00	0.10

359	603612	索通发展	2,560	40,960.00	0.10
360	300256	星星科技	5,550	40,848.00	0.10
361	000910	大亚圣象	2,500	40,700.00	0.10
362	002055	得润电子	2,700	40,311.00	0.10
363	601369	陕鼓动力	5,700	40,242.00	0.10
364	002079	苏州固锝	4,000	40,240.00	0.10
365	300378	鼎捷软件	1,350	40,203.00	0.10
366	600059	古越龙山	4,000	40,200.00	0.10
367	300659	中孚信息	900	40,158.00	0.10
368	300401	花园生物	2,800	40,152.00	0.10
369	002130	沃尔核材	7,100	39,973.00	0.10
370	300224	正海磁材	3,450	39,951.00	0.10
371	000829	天音控股	5,200	39,936.00	0.10
372	000652	泰达股份	8,100	39,933.00	0.10
373	300045	华力创通	3,400	39,916.00	0.10
374	002108	沧州明珠	7,842	39,915.78	0.10
375	600512	腾达建设	12,700	39,878.00	0.10
376	600093	易见股份	4,700	39,809.00	0.10
377	000969	安泰科技	5,600	39,760.00	0.10
378	300596	利安隆	1,000	39,730.00	0.10
379	300638	广和通	720	39,614.40	0.09
380	300355	蒙草生态	10,100	39,592.00	0.09
381	603222	济民制药	1,000	39,480.00	0.09
382	000915	山大华特	1,470	39,396.00	0.09
383	300319	麦捷科技	4,200	39,396.00	0.09
384	600422	昆药集团	4,200	39,354.00	0.09
385	300497	富祥药业	2,688	39,217.92	0.09
386	002726	龙大肉食	3,124	39,018.76	0.09
387	300607	拓斯达	1,060	38,944.40	0.09
388	000823	超声电子	3,200	38,848.00	0.09
389	000601	韶能股份	5,300	38,796.00	0.09
390	002539	云图控股	4,700	38,775.00	0.09
391	603113	金能科技	2,700	38,772.00	0.09
392	601010	文峰股份	12,300	38,745.00	0.09
393	600366	宁波韵升	5,800	38,744.00	0.09
394	300398	飞凯材料	2,020	38,743.60	0.09
395	000793	华闻集团	13,400	38,726.00	0.09
396	002194	武汉凡谷	2,300	38,709.00	0.09
397	002489	浙江永强	9,100	38,675.00	0.09
398	601567	三星医疗	5,400	38,664.00	0.09
399	601929	吉视传媒	18,300	38,613.00	0.09
400	300322	硕贝德	2,700	38,529.00	0.09

401	300386	飞天诚信	1,600	38,464.00	0.09
402	002582	好想你	3,000	38,460.00	0.09
403	002611	东方精工	7,840	38,337.60	0.09
404	600531	豫光金铅	6,700	38,257.00	0.09
405	300616	尚品宅配	620	38,247.80	0.09
406	300145	中金环境	10,440	38,210.40	0.09
407	600783	鲁信创投	2,300	38,157.00	0.09
408	000697	炼石航空	4,000	38,120.00	0.09
409	603387	基蛋生物	1,060	38,117.60	0.09
410	300448	浩云科技	3,500	38,080.00	0.09
411	603393	新天然气	1,520	38,045.60	0.09
412	002226	江南化工	5,400	38,016.00	0.09
413	600308	华泰股份	6,800	38,012.00	0.09
414	002545	东方铁塔	4,900	37,926.00	0.09
415	300198	纳川股份	6,780	37,900.20	0.09
416	603108	润达医疗	2,840	37,885.60	0.09
417	002135	东南网架	4,900	37,681.00	0.09
418	002614	奥佳华	2,500	37,575.00	0.09
419	300119	瑞普生物	1,700	37,400.00	0.09
420	603185	上机数控	550	37,378.00	0.09
421	600197	伊力特	1,700	37,366.00	0.09
422	300761	立华股份	1,000	37,340.00	0.09
423	300573	兴齐眼药	300	37,323.00	0.09
424	300487	蓝晓科技	800	37,256.00	0.09
425	002320	海峡股份	3,767	37,255.63	0.09
426	000810	创维数字	4,200	37,254.00	0.09
427	300709	精研科技	600	37,140.00	0.09
428	002717	岭南股份	9,080	37,137.20	0.09
429	002798	帝欧家居	1,600	37,120.00	0.09
430	002672	东江环保	4,000	36,960.00	0.09
431	600075	新疆天业	5,280	36,960.00	0.09
432	300726	宏达电子	900	36,900.00	0.09
433	002376	新北洋	3,900	36,894.00	0.09
434	600116	三峡水利	4,600	36,892.00	0.09
435	600449	宁夏建材	2,300	36,869.00	0.09
436	002832	比音勒芬	2,120	36,824.40	0.09
437	002479	富春环保	5,200	36,816.00	0.09
438	300393	中来股份	3,805	36,756.30	0.09
439	300310	宜通世纪	5,788	36,695.92	0.09
440	603313	梦百合	1,070	36,690.30	0.09
441	600577	精达股份	10,700	36,487.00	0.09
442	601137	博威合金	3,000	36,450.00	0.09

443	002695	煌上煌	1,600	36,416.00	0.09
444	600624	复旦复华	4,030	36,350.60	0.09
445	000550	江铃汽车	1,800	36,342.00	0.09
446	002833	弘亚数控	800	36,320.00	0.09
447	002777	久远银海	1,620	36,288.00	0.09
448	300672	国科微	700	36,239.00	0.09
449	300006	莱美药业	4,638	36,176.40	0.09
450	002104	恒宝股份	4,576	36,013.12	0.09
451	300183	东软载波	2,000	36,000.00	0.09
452	300020	银江股份	3,600	36,000.00	0.09
453	300184	力源信息	5,940	35,996.40	0.09
454	600285	羚锐制药	3,800	35,948.00	0.09
455	300158	振东制药	6,000	35,820.00	0.09
456	300219	鸿利智汇	3,450	35,776.50	0.09
457	002291	星期六	1,800	35,658.00	0.09
458	000592	平潭发展	11,500	35,650.00	0.09
459	600936	广西广电	9,800	35,476.00	0.09
460	601001	晋控煤业	6,700	35,443.00	0.08
461	601011	宝泰隆	9,300	35,433.00	0.08
462	600764	中国海防	1,100	35,398.00	0.08
463	300662	科锐国际	700	35,392.00	0.08
464	300438	鹏辉能源	1,850	35,261.00	0.08
465	300266	兴源环境	9,400	35,250.00	0.08
466	002512	达华智能	6,600	35,244.00	0.08
467	600851	海欣股份	4,900	35,182.00	0.08
468	600750	江中药业	3,120	35,162.40	0.08
469	300735	光弘科技	2,366	35,040.46	0.08
470	002668	奥马电器	7,294	35,011.20	0.08
471	000036	华联控股	8,310	34,902.00	0.08
472	000931	中关村	4,400	34,892.00	0.08
473	000900	现代投资	8,800	34,848.00	0.08
474	002550	千红制药	7,600	34,808.00	0.08
475	603337	杰克股份	1,072	34,711.36	0.08
476	300114	中航电测	2,350	34,709.50	0.08
477	002677	浙江美大	2,040	34,680.00	0.08
478	000926	福星股份	6,500	34,645.00	0.08
479	600480	凌云股份	3,780	34,511.40	0.08
480	002596	海南瑞泽	5,800	34,510.00	0.08
481	002083	孚日股份	6,100	34,343.00	0.08
482	300171	东富龙	2,100	34,314.00	0.08
483	600114	东睦股份	3,680	34,297.60	0.08
484	300075	数字政通	2,800	34,244.00	0.08

485	002067	景兴纸业	9,300	34,224.00	0.08
486	000795	英洛华	5,700	34,200.00	0.08
487	002515	金字火腿	5,720	34,091.20	0.08
488	000546	金圆股份	4,200	34,020.00	0.08
489	000682	东方电子	6,800	33,932.00	0.08
490	600602	云赛智联	5,400	33,858.00	0.08
491	002950	奥美医疗	1,550	33,852.00	0.08
492	600846	同济科技	4,000	33,840.00	0.08
493	300332	天壕环境	6,000	33,840.00	0.08
494	300203	聚光科技	2,600	33,800.00	0.08
495	600269	赣粤高速	9,600	33,792.00	0.08
496	002206	海利得	7,200	33,768.00	0.08
497	000936	华西股份	4,400	33,704.00	0.08
498	600502	安徽建工	8,256	33,684.48	0.08
499	600510	黑牡丹	4,200	33,558.00	0.08
500	300044	赛为智能	4,580	33,525.60	0.08
501	601918	新集能源	12,400	33,480.00	0.08
502	603989	艾华集团	1,230	33,431.40	0.08
503	002277	友阿股份	8,100	33,372.00	0.08
504	002115	三维通信	4,300	33,325.00	0.08
505	002768	国恩股份	1,100	33,319.00	0.08
506	300349	金卡智能	2,200	32,912.00	0.08
507	300047	天源迪科	3,945	32,861.85	0.08
508	600636	国新文化	2,500	32,825.00	0.08
509	002967	广电计量	1,300	32,799.00	0.08
510	603801	志邦家居	840	32,760.00	0.08
511	600963	岳阳林纸	7,530	32,755.50	0.08
512	002930	宏川智慧	1,558	32,749.16	0.08
513	300130	新国都	2,440	32,671.60	0.08
514	600200	江苏吴中	6,000	32,640.00	0.08
515	300016	北陆药业	2,850	32,575.50	0.08
516	300633	开立医疗	1,400	32,564.00	0.08
517	600810	神马股份	2,860	32,489.60	0.08
518	300366	创意信息	2,900	32,480.00	0.08
519	600611	大众交通	8,800	32,384.00	0.08
520	600552	凯盛科技	4,900	32,291.00	0.08
521	300299	富春股份	3,740	32,238.80	0.08
522	002556	辉隆股份	3,600	32,148.00	0.08
523	002073	软控股份	7,600	32,148.00	0.08
524	600831	广电网络	4,500	32,130.00	0.08
525	300091	金通灵	6,720	32,054.40	0.08
526	300613	富瀚微	280	32,029.20	0.08

527	002168	惠程科技	4,800	32,016.00	0.08
528	300208	青岛中程	2,850	32,005.50	0.08
529	300190	维尔利	3,800	31,996.00	0.08
530	002031	巨轮智能	15,000	31,950.00	0.08
531	601890	亚星锚链	5,600	31,920.00	0.08
532	300527	中船应急	2,943	31,902.12	0.08
533	600483	福能股份	4,100	31,857.00	0.08
534	000836	富通信息	10,200	31,824.00	0.08
535	002522	浙江众成	4,400	31,812.00	0.08
536	000989	九芝堂	3,705	31,788.90	0.08
537	000507	珠海港	5,400	31,752.00	0.08
538	002308	威创股份	5,300	31,641.00	0.08
539	002197	证通电子	3,400	31,586.00	0.08
540	000597	东北制药	5,600	31,584.00	0.08
541	600894	广日股份	3,600	31,500.00	0.08
542	603111	康尼机电	5,000	31,450.00	0.08
543	601126	四方股份	3,900	31,434.00	0.08
544	002639	雪人股份	4,600	31,418.00	0.08
545	300552	万集科技	800	31,384.00	0.08
546	300007	汉威科技	1,800	31,374.00	0.08
547	300065	海兰信	2,450	31,286.50	0.08
548	601069	西部黄金	2,200	31,262.00	0.07
549	002537	海联金汇	4,680	31,168.80	0.07
550	600103	青山纸业	15,270	31,150.80	0.07
551	300110	华仁药业	6,020	31,123.40	0.07
552	600055	万东医疗	2,700	31,050.00	0.07
553	600261	阳光照明	7,400	31,006.00	0.07
554	300353	东土科技	2,900	30,914.00	0.07
555	300762	上海瀚讯	700	30,877.00	0.07
556	600217	中再资环	5,700	30,780.00	0.07
557	000957	中通客车	4,000	30,760.00	0.07
558	603626	科森科技	2,180	30,759.80	0.07
559	002573	清新环境	5,500	30,745.00	0.07
560	300815	玉禾田	300	30,630.00	0.07
561	002117	东港股份	3,150	30,618.00	0.07
562	002565	顺灏股份	6,300	30,555.00	0.07
563	603609	禾丰牧业	2,400	30,480.00	0.07
564	002322	理工环科	2,300	30,475.00	0.07
565	002733	雄韬股份	1,650	30,442.50	0.07
566	300657	弘信电子	1,600	30,416.00	0.07
567	300137	先河环保	4,300	30,401.00	0.07
568	002161	远望谷	4,900	30,380.00	0.07

569	002756	永兴材料	1,300	30,355.00	0.07
570	603636	南威软件	3,000	30,150.00	0.07
571	600169	太原重工	15,000	30,150.00	0.07
572	300066	三川智慧	5,300	30,104.00	0.07
573	000973	佛塑科技	6,600	30,030.00	0.07
574	000751	锌业股份	8,600	30,014.00	0.07
575	300590	移为通信	900	29,880.00	0.07
576	601588	北辰实业	11,900	29,869.00	0.07
577	300229	拓尔思	3,000	29,850.00	0.07
578	300248	新开普	2,823	29,641.50	0.07
579	002462	嘉事堂	1,900	29,564.00	0.07
580	002609	捷顺科技	2,600	29,562.00	0.07
581	002034	旺能环境	1,700	29,427.00	0.07
582	600550	保变电气	6,300	29,421.00	0.07
583	002474	榕基软件	4,200	29,274.00	0.07
584	000801	四川九洲	5,100	29,070.00	0.07
585	002303	美盈森	6,500	29,055.00	0.07
586	300213	佳讯飞鸿	3,500	29,050.00	0.07
587	300409	道氏技术	2,060	29,046.00	0.07
588	603979	金诚信	2,334	28,988.28	0.07
589	000040	东旭蓝天	8,900	28,925.00	0.07
590	000688	国城矿业	2,600	28,834.00	0.07
591	002215	诺普信	4,600	28,750.00	0.07
592	000676	智度股份	4,500	28,575.00	0.07
593	600495	晋西车轴	7,080	28,532.40	0.07
594	300388	节能国祯	2,900	28,507.00	0.07
595	002737	葵花药业	1,900	28,405.00	0.07
596	600343	航天动力	3,200	28,384.00	0.07
597	300423	昇辉科技	2,000	28,320.00	0.07
598	002218	拓日新能	6,300	28,287.00	0.07
599	601366	利群股份	4,300	28,165.00	0.07
600	002341	新纶科技	7,000	28,140.00	0.07
601	002970	锐明技术	400	28,120.00	0.07
602	603012	创力集团	3,800	28,044.00	0.07
603	300039	上海凯宝	5,300	28,037.00	0.07
604	300311	任子行	3,731	27,982.50	0.07
605	300740	御家汇	1,700	27,982.00	0.07
606	000811	冰轮环境	3,550	27,974.00	0.07
607	600331	宏达股份	11,100	27,972.00	0.07
608	600133	东湖高新	4,700	27,965.00	0.07
609	300455	康拓红外	2,200	27,962.00	0.07
610	002530	金财互联	3,220	27,949.60	0.07

611	300477	合纵科技	4,160	27,830.40	0.07
612	002664	长鹰信质	1,600	27,760.00	0.07
613	002047	宝鹰股份	6,700	27,738.00	0.07
614	000882	华联股份	13,800	27,738.00	0.07
615	600318	新力金融	2,800	27,636.00	0.07
616	300526	中潜股份	480	27,580.80	0.07
617	600096	云天化	4,800	27,504.00	0.07
618	002358	森源电气	5,500	27,500.00	0.07
619	600736	苏州高新	5,500	27,500.00	0.07
620	600400	红豆股份	8,420	27,449.20	0.07
621	002383	合众思壮	3,500	27,440.00	0.07
622	300328	宜安科技	2,620	27,405.20	0.07
623	300579	数字认证	600	27,372.00	0.07
624	002364	中恒电气	2,800	27,328.00	0.07
625	300495	美尚生态	3,483	27,306.72	0.07
626	002224	三力士	4,300	27,305.00	0.07
627	000639	西王食品	4,424	27,207.60	0.07
628	600676	交运股份	5,200	27,196.00	0.07
629	000968	蓝焰控股	3,300	27,159.00	0.07
630	000802	北京文化	4,000	27,120.00	0.07
631	300237	美晨生态	8,000	27,120.00	0.07
632	300096	易联众	2,900	27,115.00	0.07
633	002869	金溢科技	700	27,104.00	0.06
634	002166	莱茵生物	3,300	27,060.00	0.06
635	600971	恒源煤电	5,100	27,030.00	0.06
636	300252	金信诺	2,440	26,986.40	0.06
637	300215	电科院	3,200	26,976.00	0.06
638	002461	珠江啤酒	2,700	26,973.00	0.06
639	603063	禾望电气	2,000	26,940.00	0.06
640	600990	四创电子	700	26,908.00	0.06
641	603258	电魂网络	800	26,864.00	0.06
642	300755	华致酒行	940	26,846.40	0.06
643	000935	四川双马	1,900	26,771.00	0.06
644	603690	至纯科技	800	26,768.00	0.06
645	603959	百利科技	1,956	26,660.28	0.06
646	600020	中原高速	7,500	26,625.00	0.06
647	002547	春兴精工	5,400	26,622.00	0.06
648	002657	中科金财	2,100	26,607.00	0.06
649	603587	地素时尚	1,160	26,564.00	0.06
650	300255	常山药业	3,800	26,486.00	0.06
651	603060	国检集团	1,380	26,427.00	0.06
652	300176	派生科技	2,690	26,415.80	0.06

653	002061	浙江交科	4,600	26,404.00	0.06
654	600389	江山股份	1,200	26,280.00	0.06
655	000918	嘉凯城	5,800	26,274.00	0.06
656	300205	天喻信息	2,100	26,166.00	0.06
657	600123	兰花科创	4,900	26,117.00	0.06
658	603305	旭升股份	700	26,089.00	0.06
659	002510	天汽模	6,300	26,082.00	0.06
660	002158	汉钟精机	1,700	26,078.00	0.06
661	002822	中装建设	3,500	26,075.00	0.06
662	300792	壹网壹创	200	26,026.00	0.06
663	600987	航民股份	4,570	25,957.60	0.06
664	603666	亿嘉和	320	25,920.00	0.06
665	600622	光大嘉宝	7,020	25,903.80	0.06
666	600997	开滦股份	4,700	25,897.00	0.06
667	300602	飞荣达	1,169	25,869.97	0.06
668	600759	洲际油气	13,400	25,728.00	0.06
669	000557	西部创业	7,300	25,696.00	0.06
670	600855	航天长峰	1,800	25,686.00	0.06
671	002228	合兴包装	5,400	25,650.00	0.06
672	300191	潜能恒信	1,300	25,610.00	0.06
673	000726	鲁泰A	3,700	25,604.00	0.06
674	300276	三丰智能	4,780	25,573.00	0.06
675	000720	新能泰山	6,500	25,480.00	0.06
676	600458	时代新材	3,300	25,476.00	0.06
677	002313	日海智能	1,800	25,380.00	0.06
678	300624	万兴科技	440	25,366.00	0.06
679	600773	西藏城投	4,100	25,338.00	0.06
680	000885	城发环境	2,100	25,305.00	0.06
681	600590	泰豪科技	4,360	25,288.00	0.06
682	300510	金冠股份	4,279	25,246.10	0.06
683	300307	慈星股份	3,300	25,245.00	0.06
684	600981	汇鸿集团	7,600	25,232.00	0.06
685	002519	银河电子	5,610	25,188.90	0.06
686	002838	道恩股份	1,000	25,140.00	0.06
687	002562	兄弟科技	4,260	25,006.20	0.06
688	300300	海峡创新	3,775	24,990.50	0.06
689	002516	旷达科技	6,200	24,986.00	0.06
690	002443	金洲管道	3,500	24,955.00	0.06
691	600825	新华传媒	4,400	24,948.00	0.06
692	601020	华钰矿业	2,000	24,900.00	0.06
693	300776	帝尔激光	220	24,895.20	0.06
694	603887	城地香江	1,200	24,888.00	0.06

695	601949	中国出版	4,500	24,885.00	0.06
696	002167	东方锆业	4,100	24,846.00	0.06
697	603660	苏州科达	2,940	24,843.00	0.06
698	002267	陕天然气	3,700	24,827.00	0.06
699	600681	百川能源	4,720	24,732.80	0.06
700	000996	中国中期	2,650	24,724.50	0.06
701	601330	绿色动力	2,500	24,700.00	0.06
702	603733	仙鹤股份	1,100	24,662.00	0.06
703	600775	南京熊猫	3,400	24,616.00	0.06
704	600571	信雅达	2,900	24,592.00	0.06
705	600351	亚宝药业	4,500	24,480.00	0.06
706	600523	贵航股份	1,560	24,429.60	0.06
707	300081	恒信东方	3,100	24,335.00	0.06
708	603359	东珠生态	1,260	24,255.00	0.06
709	002913	奥士康	400	24,192.00	0.06
710	300043	星辉娱乐	6,200	24,180.00	0.06
711	300604	长川科技	1,000	24,110.00	0.06
712	300302	同有科技	1,840	24,104.00	0.06
713	300773	拉卡拉	700	24,066.00	0.06
714	603730	岱美股份	815	24,042.50	0.06
715	002307	北新路桥	4,500	24,030.00	0.06
716	002029	七匹狼	4,400	23,936.00	0.06
717	002755	奥赛康	1,500	23,925.00	0.06
718	002646	青青稞酒	1,300	23,907.00	0.06
719	000657	中钨高新	3,380	23,896.60	0.06
720	600162	香江控股	11,250	23,850.00	0.06
721	002663	普邦股份	10,600	23,850.00	0.06
722	002234	民和股份	1,400	23,786.00	0.06
723	300441	鲍斯股份	2,560	23,756.80	0.06
724	300684	中石科技	900	23,733.00	0.06
725	300531	优博讯	1,300	23,686.00	0.06
726	600975	新五丰	2,900	23,664.00	0.06
727	002314	南山控股	6,800	23,664.00	0.06
728	000011	深物业 A	1,700	23,664.00	0.06
729	002274	华昌化工	4,700	23,641.00	0.06
730	000950	重药控股	4,200	23,604.00	0.06
731	603728	鸣志电器	1,400	23,548.00	0.06
732	601886	江河集团	3,800	23,522.00	0.06
733	600184	光电股份	2,200	23,496.00	0.06
734	300788	中信出版	500	23,490.00	0.06
735	600708	光明地产	8,667	23,487.57	0.06
736	002518	科士达	1,775	23,376.75	0.06

737	002017	东信和平	2,200	23,342.00	0.06
738	000544	中原环保	3,150	23,310.00	0.06
739	002433	太安堂	5,100	23,307.00	0.06
740	002906	华阳集团	900	23,220.00	0.06
741	603896	寿仙谷	500	23,210.00	0.06
742	000958	东方能源	5,300	23,161.00	0.06
743	000576	甘化科工	2,100	23,058.00	0.06
744	600239	云南城投	7,600	23,028.00	0.06
745	600581	八一钢铁	6,300	22,995.00	0.06
746	002309	中利集团	4,200	22,932.00	0.05
747	603869	新智认知	2,100	22,911.00	0.05
748	002651	利君股份	2,600	22,906.00	0.05
749	000584	哈工智能	3,600	22,896.00	0.05
750	000925	众合科技	3,200	22,784.00	0.05
751	603466	风语筑	900	22,734.00	0.05
752	002960	青鸟消防	600	22,620.00	0.05
753	002662	京威股份	5,100	22,542.00	0.05
754	601116	三江购物	1,800	22,500.00	0.05
755	000498	山东路桥	4,300	22,489.00	0.05
756	600995	文山电力	2,800	22,456.00	0.05
757	002482	广田集团	6,400	22,400.00	0.05
758	300021	大禹节水	4,000	22,360.00	0.05
759	300424	航新科技	1,216	22,325.76	0.05
760	603068	博通集成	300	22,314.00	0.05
761	002060	粤水电	7,000	22,260.00	0.05
762	603367	辰欣药业	1,500	22,185.00	0.05
763	002344	海宁皮城	5,300	22,101.00	0.05
764	300439	美康生物	1,100	22,066.00	0.05
765	002279	久其软件	4,080	22,032.00	0.05
766	000666	经纬纺机	2,600	22,022.00	0.05
767	002235	安妮股份	3,975	22,021.50	0.05
768	000923	河钢资源	1,000	21,980.00	0.05
769	600691	阳煤化工	9,500	21,850.00	0.05
770	002746	仙坛股份	1,810	21,846.70	0.05
771	000615	奥园美谷	4,000	21,800.00	0.05
772	603348	文灿股份	700	21,777.00	0.05
773	002229	鸿博股份	2,850	21,774.00	0.05
774	000019	深粮控股	2,700	21,627.00	0.05
775	600798	宁波海运	6,100	21,594.00	0.05
776	603363	傲农生物	1,650	21,483.00	0.05
777	300571	平治信息	500	21,465.00	0.05
778	601789	宁波建工	4,900	21,413.00	0.05

779	603803	瑞斯康达	1,900	21,375.00	0.05
780	603399	吉翔股份	3,400	21,352.00	0.05
781	600230	沧州大化	1,960	21,344.40	0.05
782	300209	天泽信息	1,700	21,267.00	0.05
783	000520	长航凤凰	5,900	21,181.00	0.05
784	002792	通宇通讯	1,050	21,178.50	0.05
785	300336	新文化	5,150	21,166.50	0.05
786	601700	风范股份	4,700	21,150.00	0.05
787	002343	慈文传媒	3,030	21,149.40	0.05
788	600933	爱柯迪	1,400	21,126.00	0.05
789	300288	朗玛信息	1,600	21,120.00	0.05
790	002538	司尔特	3,400	21,114.00	0.05
791	300765	新诺威	960	21,100.80	0.05
792	300061	旗天科技	3,400	21,080.00	0.05
793	002618	丹邦科技	3,150	21,073.50	0.05
794	002355	兴民智通	3,600	21,060.00	0.05
795	300365	恒华科技	1,800	21,042.00	0.05
796	002345	潮宏基	4,300	21,027.00	0.05
797	600569	安阳钢铁	9,500	20,995.00	0.05
798	002929	润建股份	800	20,960.00	0.05
799	600035	楚天高速	7,000	20,930.00	0.05
800	600626	申达股份	4,900	20,923.00	0.05
801	300785	值得买	199	20,883.06	0.05
802	600548	深高速	2,300	20,838.00	0.05
803	000928	中钢国际	5,020	20,833.00	0.05
804	000532	华金资本	1,700	20,825.00	0.05
805	000881	中广核技	2,300	20,792.00	0.05
806	600076	康欣新材	5,900	20,768.00	0.05
807	002542	中化岩土	5,950	20,706.00	0.05
808	002015	协鑫能科	3,400	20,570.00	0.05
809	002619	艾格拉斯	8,980	20,564.20	0.05
810	002232	启明信息	1,700	20,553.00	0.05
811	002751	易尚展示	900	20,538.00	0.05
812	002137	麦达数字	2,900	20,445.00	0.05
813	002741	光华科技	1,500	20,430.00	0.05
814	300559	佳发教育	1,250	20,375.00	0.05
815	601606	长城军工	1,700	20,332.00	0.05
816	000797	中国武夷	5,841	20,326.68	0.05
817	600229	城市传媒	2,900	20,271.00	0.05
818	300634	彩讯股份	900	20,268.00	0.05
819	601515	东风股份	3,300	20,229.00	0.05
820	300011	鼎汉技术	2,800	20,216.00	0.05

821	300204	舒泰神	2,000	20,120.00	0.05
822	600467	好当家	7,200	20,088.00	0.05
823	601858	中国科传	2,000	20,020.00	0.05
824	601900	南方传媒	2,200	19,976.00	0.05
825	000058	深赛格	2,800	19,908.00	0.05
826	603980	吉华集团	2,800	19,908.00	0.05
827	603458	勘设股份	1,254	19,737.96	0.05
828	600603	广汇物流	4,100	19,721.00	0.05
829	300148	天舟文化	4,700	19,693.00	0.05
830	002636	金安国纪	2,400	19,656.00	0.05
831	002880	卫光生物	400	19,612.00	0.05
832	603357	设计总院	1,900	19,532.00	0.05
833	002204	大连重工	5,400	19,440.00	0.05
834	300109	新开源	1,174	19,371.00	0.05
835	000665	湖北广电	3,840	19,353.60	0.05
836	600533	栖霞建设	5,900	19,234.00	0.05
837	002621	美吉姆	2,620	19,230.80	0.05
838	600897	厦门空港	1,000	19,220.00	0.05
839	603360	百傲化学	1,000	19,210.00	0.05
840	002478	常宝股份	4,000	19,200.00	0.05
841	603383	顶点软件	500	19,170.00	0.05
842	002782	可立克	1,200	19,164.00	0.05
843	300533	冰川网络	650	19,162.00	0.05
844	300570	太辰光	1,000	19,080.00	0.05
845	002947	恒铭达	400	19,020.00	0.05
846	601015	陕西黑猫	5,265	19,006.65	0.05
847	603688	石英股份	1,000	18,910.00	0.05
848	300603	立昂技术	1,300	18,889.00	0.05
849	000038	深大通	1,680	18,816.00	0.05
850	600710	苏美达	3,300	18,777.00	0.05
851	300140	中环装备	2,100	18,711.00	0.04
852	600800	天津磁卡	4,000	18,680.00	0.04
853	600686	金龙汽车	2,300	18,630.00	0.04
854	600929	雪天盐业	3,000	18,600.00	0.04
855	603105	芯能科技	2,000	18,480.00	0.04
856	300777	中简科技	400	18,472.00	0.04
857	002840	华统股份	1,680	18,412.80	0.04
858	300682	朗新科技	1,200	18,300.00	0.04
859	603590	康辰药业	500	18,275.00	0.04
860	603220	中贝通信	1,300	18,239.00	0.04
861	600054	黄山旅游	2,100	18,186.00	0.04
862	000065	北方国际	2,325	18,158.25	0.04

863	601107	四川成渝	5,300	18,126.00	0.04
864	300520	科大国创	700	18,123.00	0.04
865	603595	东尼电子	724	18,121.72	0.04
866	300723	一品红	400	18,076.00	0.04
867	603557	起步股份	1,300	18,070.00	0.04
868	603648	畅联股份	1,800	17,874.00	0.04
869	000620	新华联	5,800	17,864.00	0.04
870	300127	银河磁体	900	17,847.00	0.04
871	000965	天保基建	5,380	17,807.80	0.04
872	002284	亚太股份	3,100	17,794.00	0.04
873	002246	北化股份	2,300	17,779.00	0.04
874	002852	道道全	1,050	17,745.00	0.04
875	002095	生意宝	1,000	17,740.00	0.04
876	600322	天房发展	7,000	17,710.00	0.04
877	603508	思维列控	640	17,696.00	0.04
878	601101	昊华能源	4,400	17,688.00	0.04
879	000821	京山轻机	2,600	17,602.00	0.04
880	002631	德尔未来	2,500	17,600.00	0.04
881	002955	鸿合科技	680	17,530.40	0.04
882	000822	山东海化	4,300	17,415.00	0.04
883	002393	力生制药	700	17,388.00	0.04
884	000889	中嘉博创	3,040	17,358.40	0.04
885	000626	远大控股	1,700	17,255.00	0.04
886	600278	东方创业	1,700	17,187.00	0.04
887	300107	建新股份	2,100	17,157.00	0.04
888	002305	南国置业	7,500	17,100.00	0.04
889	002564	天沃科技	5,000	17,100.00	0.04
890	600136	当代文体	2,200	17,094.00	0.04
891	601595	上海电影	1,380	17,043.00	0.04
892	000561	烽火电子	2,400	16,944.00	0.04
893	002378	章源钨业	3,000	16,920.00	0.04
894	300504	天邑股份	800	16,896.00	0.04
895	300803	指南针	500	16,845.00	0.04
896	000525	红太阳	2,300	16,836.00	0.04
897	600738	兰州民百	2,300	16,836.00	0.04
898	603579	荣泰健康	500	16,830.00	0.04
899	603777	来伊份	1,300	16,809.00	0.04
900	603808	歌力思	1,200	16,704.00	0.04
901	002759	天际股份	1,300	16,627.00	0.04
902	002101	广东鸿图	2,200	16,566.00	0.04
903	002377	国创高新	3,500	16,485.00	0.04
904	300771	智莱科技	480	16,348.80	0.04

905	600295	鄂尔多斯	1,600	16,256.00	0.04
906	002685	华东重机	3,200	16,256.00	0.04
907	600876	洛阳玻璃	1,000	16,240.00	0.04
908	603299	苏盐井神	2,500	16,225.00	0.04
909	603610	麒盛科技	600	16,170.00	0.04
910	603915	国茂股份	700	16,170.00	0.04
911	002435	长江健康	3,900	16,107.00	0.04
912	603618	杭电股份	2,700	16,038.00	0.04
913	300783	三只松鼠	300	16,017.00	0.04
914	600715	文投控股	5,900	15,989.00	0.04
915	000791	甘肃电投	4,120	15,820.80	0.04
916	002451	摩恩电气	2,100	15,729.00	0.04
917	000815	美利云	2,700	15,660.00	0.04
918	002590	万安科技	1,900	15,447.00	0.04
919	603727	博迈科	900	15,363.00	0.04
920	600207	安彩高科	2,600	15,210.00	0.04
921	002141	贤丰控股	5,500	15,125.00	0.04
922	002776	柏堡龙	2,500	15,025.00	0.04
923	000517	荣安地产	5,000	15,000.00	0.04
924	600965	福成股份	2,600	14,924.00	0.04
925	600758	辽宁能源	5,100	14,892.00	0.04
926	000567	海德股份	1,500	14,670.00	0.04
927	603053	成都燃气	1,000	14,650.00	0.04
928	002796	世嘉科技	1,000	14,620.00	0.04
929	603169	兰石重装	3,300	14,619.00	0.04
930	300262	巴安水务	3,100	14,601.00	0.04
931	300428	四通新材	800	14,584.00	0.03
932	000905	厦门港务	1,800	14,436.00	0.03
933	002464	众应互联	3,334	14,402.88	0.03
934	300673	佩蒂股份	400	14,388.00	0.03
935	002243	通产丽星	1,200	14,376.00	0.03
936	603318	派思股份	1,900	14,288.00	0.03
937	603693	江苏新能	1,200	14,244.00	0.03
938	300506	名家汇	2,290	14,129.30	0.03
939	600283	钱江水利	1,300	14,118.00	0.03
940	001896	豫能控股	3,600	14,112.00	0.03
941	603421	鼎信通讯	1,360	13,940.00	0.03
942	002933	新兴装备	400	13,908.00	0.03
943	002962	五方光电	700	13,888.00	0.03
944	002370	亚太药业	3,100	13,826.00	0.03
945	000150	宜华健康	4,904	13,780.24	0.03
946	603876	鼎胜新材	1,000	13,750.00	0.03

947	600618	氯碱化工	1,700	13,719.00	0.03
948	300309	吉艾科技	4,080	13,627.20	0.03
949	603093	南华期货	700	13,482.00	0.03
950	300800	力合科技	400	13,304.00	0.03
951	603997	继峰股份	1,450	13,238.50	0.03
952	002016	世荣兆业	1,900	13,091.00	0.03
953	300799	左江科技	200	13,090.00	0.03
954	603839	安正时尚	1,180	13,015.40	0.03
955	000514	渝开发	3,300	12,969.00	0.03
956	600310	桂东电力	3,200	12,768.00	0.03
957	601619	嘉泽新能	4,000	12,680.00	0.03
958	002712	思美传媒	2,160	12,657.60	0.03
959	300768	迪普科技	300	12,654.00	0.03
960	000711	京蓝科技	4,000	12,600.00	0.03
961	603327	福蓉科技	500	12,590.00	0.03
962	300775	三角防务	400	12,584.00	0.03
963	603390	通达电气	1,000	12,390.00	0.03
964	300793	佳禾智能	600	12,204.00	0.03
965	000056	皇庭国际	3,600	12,132.00	0.03
966	603927	中科软	300	11,991.00	0.03
967	603103	横店影视	680	11,784.40	0.03
968	002961	瑞达期货	400	11,072.00	0.03
969	603956	威派格	600	10,944.00	0.03
970	603711	香飘飘	500	10,650.00	0.03
971	002346	柘中股份	1,000	10,470.00	0.03
972	603180	金牌厨柜	180	10,247.40	0.02
973	603013	亚普股份	600	10,086.00	0.02
974	300805	电声股份	400	9,964.00	0.02
975	002895	川恒股份	800	9,752.00	0.02
976	002973	侨银股份	400	9,740.00	0.02
977	603603	博天环境	1,600	9,648.00	0.02
978	002911	佛燃能源	600	9,498.00	0.02
979	603081	大丰实业	800	9,360.00	0.02
980	603619	中曼石油	900	9,108.00	0.02
981	603530	神马电力	400	8,960.00	0.02
982	603279	景津环保	400	8,716.00	0.02
983	002907	华森制药	500	7,980.00	0.02
984	002485	希努尔	1,600	7,920.00	0.02
985	300798	锦鸡股份	400	7,576.00	0.02
986	603848	好太太	500	7,450.00	0.02
987	002951	金时科技	500	7,040.00	0.02
988	002969	嘉美包装	1,000	7,010.00	0.02

989	603992	松霖科技	400	6,720.00	0.02
990	603551	奥普家居	400	6,468.00	0.02
991	603676	卫信康	600	6,258.00	0.02
992	603687	大胜达	500	5,405.00	0.01
993	603815	交建股份	200	2,502.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	003018	金富科技	1,027	17,294.68	0.04
2	605177	东亚药业	407	12,669.91	0.03
3	605007	五洲特纸	478	12,303.72	0.03
4	605068	明新旭腾	363	8,410.71	0.02

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	002065	东华软件	225,020.00	0.48
2	603005	晶方科技	150,626.80	0.32
3	300661	圣邦股份	128,691.00	0.27
4	300346	南大光电	127,464.00	0.27
5	603520	司太立	127,452.00	0.27
6	300598	诚迈科技	124,636.00	0.26
7	002791	坚朗五金	121,150.00	0.26
8	600882	妙可蓝多	117,966.00	0.25
9	000652	泰达股份	108,150.00	0.23
10	300526	中潜股份	98,084.00	0.21
11	600873	梅花生物	95,693.00	0.20
12	600267	海正药业	89,578.00	0.19
13	002706	良信股份	89,103.00	0.19
14	300573	兴齐眼药	87,093.00	0.18
15	000403	双林生物	86,821.00	0.18
16	300674	宇信科技	82,503.00	0.18
17	002214	大立科技	80,856.00	0.17
18	000503	国新健康	78,050.00	0.17
19	002310	东方园林	76,481.00	0.16
20	300395	菲利华	75,462.00	0.16

注：买入金额不包括相关交易费用。

8.4.2 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	300347	泰格医药	496,293.50	1.05
2	300014	亿纬锂能	330,299.07	0.70
3	002185	华天科技	309,581.40	0.66
4	002405	四维图新	261,578.00	0.55
5	300450	先导智能	260,888.00	0.55
6	300012	华测检测	253,176.00	0.54
7	300558	贝达药业	237,817.00	0.50
8	300357	我武生物	209,821.60	0.45
9	600529	山东药玻	205,753.00	0.44
10	300212	易华录	197,144.00	0.42
11	600918	中泰证券	193,564.04	0.41
12	300782	卓胜微	185,889.00	0.39
13	300271	华宇软件	184,306.60	0.39
14	300661	圣邦股份	184,258.00	0.39
15	300285	国瓷材料	181,149.00	0.38
16	300628	亿联网络	179,994.00	0.38
17	300496	中科创达	172,171.50	0.37
18	002138	顺络电子	163,817.00	0.35
19	300482	万孚生物	161,153.00	0.34
20	601799	星宇股份	152,520.00	0.32

注：卖出金额不包括相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	13,566,411.05
卖出股票收入（成交）总额	28,822,344.01

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

8.5 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。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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

8.12.2

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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,124.12
2	应收证券清算款	1,326,540.05
3	应收股利	-
4	应收利息	21,222.01

5	应收申购款	4,712.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,355,598.91

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	605177	东亚药业	12,669.91	0.03	新股流通受限
2	605068	明新旭腾	8,410.71	0.02	新股流通受限

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

§ 9 基金份额持有人信息（转型后）

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
3,183	12,198.71	1,593,872.00	4.10	37,234,636.58	95.90

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无

9.3 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

无

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无

§ 9 基金份额持有人信息（转型前）

9.1 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 指数分级	3,226	12,983.42	2,127,773.87	5.08	39,756,734.22	94.92
合计	3,226	12,983.42	2,127,773.87	5.08	39,756,734.22	94.92

9.2 期末上市基金前十名持有人

1000A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	新华人寿保险股份有限公司	1,417,560.00	92.40
2	黄晖	33,399.00	2.18
3	曹蜀湘	31,200.00	2.03
4	郭国棠	12,851.00	0.84
5	孙大威	6,663.00	0.43
6	邵文杰	5,911.00	0.39
7	陆成宝	4,533.00	0.30
8	谢岩	2,911.00	0.19
9	张淑贤	2,742.00	0.18
10	曹伟	1,904.00	0.12

1000B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	朱金元	370,190.00	24.13
2	中国国际金融股份有限公司	191,570.00	12.49
3	祝东华	106,463.00	6.94
4	杨玉锋	84,314.00	5.50
5	石彩雯	67,712.00	4.41
6	李粤闽	66,600.00	4.34

7	谢锦星	44,422.00	2.90
8	刘文卿	35,311.00	2.30
9	史海涛	30,000.00	1.96
10	王跃文	27,194.00	1.77

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	1000A	-	-
	1000B	-	-
	华宝中证 1000 指数分级	-	-
	合计	-	0.0000

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

无

9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产情况

无

§ 10 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金合同生效日（2020 年 11 月 19 日）基金份额总额	41,884,507.09
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	345,225.65
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	3,401,224.16
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	38,828,508.58

注：自 2020 年 11 月 19 日起，华宝中证 1000 指数分级证券投资基金正式变更为华宝中证 1000 指数证券投资基金。《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》失效，《华宝中证 1000 指数证券投资基金基金合同》生效。华宝中证 1000 指数证券投资基金基金合同生效后，基金管理人将根据相关规定办理华宝中证 1000 指数证券投资基金基金份额的申购赎回等业务。

§ 10 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	1000A	1000B	华宝中证 1000 指数分级
基金合同生效日（2015 年 6 月 4 日）基金份额总额	29,441,582.00	29,441,582.00	271,827,940.54
本报告期期初基金份额总额	1,734,179.00	1,734,179.00	53,897,880.99
本报告期基金总申购份额	-	-	55,587,147.33
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	71,068,878.23
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-1,734,179.00	-1,734,179.00	3,468,357.00
本报告期期末基金份额总额	-	-	41,884,507.09

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

转型前—华宝中证 1000 指数分级证券投资基金：2020 年 10 月 9 日至 2020 年 10 月 18 日，华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，会议审议通过了《关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》，同意华宝中证 1000 指数分级证券投资基金转型为华宝中证 1000 指数证券投资基金，取消分级运作机制，基金名称相应变更为“华宝中证 1000 指数证券投资基金”并修订《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》。上述基金转型事项已于 2020 年 10 月 19 日经持有人大会表决通过生效，自 2020 年 11 月 19 日起，《华宝中证 1000 指数证券投资基金基金合同》生效，《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》同日失效，华宝中证 1000 指数分级证券投资基金正式变更为华宝中证 1000 指数证券投资基金。

转型后—华宝中证 1000 指数证券投资基金：本报告期内（2020 年 11 月 19 日至 2020 年 12 月 31 日）本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动

2020 年 5 月 20 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，聘任周雷为公司督察长。公司总经理 XIAOYI HELEN HUANG（黄小蕙）自 2020 年 5 月 20 日起不再代任督察长职务。

2020 年 9 月 4 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，聘任李孟恒为公司首席信息官。

2020 年 9 月 23 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，朱永红担任公司董事长，孔祥清不再担任公司董事长。

2020 年 12 月 1 日，基金管理人发布法定代表人变更公告， 法定代表人变更为 XIAOYI HELEN HUANG（黄小意）。

2020 年 12 月 21 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，聘任刘欣为公司常务副总经理。

2、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

转型前-华宝中证 1000 指数分级证券投资基金：本报告期内（2020 年 1 月 1 日至 11 月 19 日）本基金的投资策略未发生变更。

转型后-华宝中证 1000 指数证券投资基金：本报告期内（2020 年 11 月 19 日至 12 月 31 日）本基金的投资策略未发生变更。

11.5 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在本报告期的审计报酬为 20,000.00 元人民币。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：本基金合同生效之日起至本报告期末。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

2、本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后)

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
太平洋证券	2	6,569,886.27	47.68%	5,986.96	47.57%	-
瑞银证券	1	4,044,591.41	29.35%	3,766.79	29.93%	-
东方证券	2	635,370.86	4.61%	591.62	4.70%	-

西部证券	1	503,690.78	3.66%	358.19	2.85%	-
中金国际	1	436,540.76	3.17%	406.67	3.23%	-
东北证券	1	376,758.22	2.73%	350.85	2.79%	-
国信证券	1	352,080.78	2.55%	327.93	2.61%	-
中泰证券	2	306,143.00	2.22%	278.99	2.22%	-
中信证券	2	224,385.77	1.63%	209.01	1.66%	-
中投证券	1	221,083.66	1.60%	205.92	1.64%	-
广发证券	2	109,630.00	0.80%	102.08	0.81%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-

华信证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
申万宏源西 部	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-

中金国际	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

西部						
天风证券						
万联证券						
西南证券						
信达证券						
兴业证券						
银河证券						
招商证券						
中航证券						
中信建投						
中银国际						

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新增交易单元：开源证券。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	2	12,342,188.16	29.93%	11,247.18	29.73%	-
招商证券	2	10,342,371.94	25.08%	9,428.71	24.92%	-
银河证券	1	3,125,785.09	7.58%	2,911.18	7.70%	-

海通证券	1	2,892,204.59	7.01%	2,693.62	7.12%	-
安信证券	1	2,140,678.03	5.19%	1,993.76	5.27%	-
长江证券	1	1,277,516.24	3.10%	1,189.66	3.14%	-
中信建投	1	1,029,291.95	2.50%	937.87	2.48%	-
申万宏源	3	968,783.63	2.35%	902.18	2.38%	-
东方证券	2	913,747.72	2.22%	850.99	2.25%	-
东兴证券	1	900,041.00	2.18%	820.21	2.17%	-
国泰君安	2	685,009.32	1.66%	636.28	1.68%	-
中金国际	1	670,356.00	1.63%	624.42	1.65%	-
东吴证券	1	623,168.86	1.51%	580.36	1.53%	-
兴业证券	2	594,271.80	1.44%	541.64	1.43%	-
广发证券	2	569,794.31	1.38%	530.69	1.40%	-
中投证券	1	517,990.52	1.26%	482.40	1.28%	-
华宝证券	1	508,614.84	1.23%	473.52	1.25%	-
瑞银证券	1	390,820.38	0.95%	363.91	0.96%	-
西部证券	1	300,398.00	0.73%	213.67	0.56%	-
红塔证券	1	234,901.65	0.57%	218.81	0.58%	-
万联证券	1	120,718.40	0.29%	110.02	0.29%	-
天风证券	2	39,220.29	0.10%	36.10	0.10%	-
方正证券	2	20,574.66	0.05%	18.75	0.05%	-
华西证券	1	15,787.05	0.04%	14.39	0.04%	-
中信证券	2	11,569.92	0.03%	10.78	0.03%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-

国金证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源西 部	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

长江证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	4,316.21	100.00%	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-

民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源 西部	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

注：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无变化。

11.8 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝中证 1000 指数证券投资基金招募说明书	基金管理人网站	2020-11-19
2	华宝中证 1000 指数证券投资基金托管协议	基金管理人网站	2020-11-19
3	华宝中证 1000 指数证券投资基金基金合同	基金管理人网站	2020-11-19
4	华宝中证 1000 指数证券投资基金基金产品资料概要	基金管理人网站	2020-11-19
5	华宝基金管理有限公司关于华宝中证 1000 指数证券投资基金基金合同生效公告	基金管理人网站、证券日报	2020-11-19
6	关于华宝中证 1000 指数证券投资基金恢复申购、赎回、定期定额投资及	基金管理人网站、证券日报	2020-11-19

	转托管的公告		
7	华宝基金管理有限公司关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额转换结果的公告	基金管理人网站、证券日报	2020-11-20

11.8 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2020-1-21
2	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	基金管理人网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2020-1-21
3	华宝基金管理有限公司关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金暂停场外申购（含定期定额投资）业务的公告	基金管理人网站、证券日报	2020-3-3
4	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2019 年年度报告	基金管理人网站	2020-3-30
5	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	基金管理人网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2020-3-30
6	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2020-4-21
7	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	基金管理人网站、证券日报	2020-5-6
8	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	基金管理人网站、证券日报	2020-5-7
9	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	基金管理人网站、证券日报	2020-5-8
10	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	基金管理人网站、证券日报	2020-5-9
11	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	基金管理人网站、证券日报	2020-5-12
12	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	基金管理人网站、证券日报	2020-5-13
13	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	基金管理人网站、证券日报	2020-5-15
14	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	基金管理人网站、证券日报	2020-5-16
15	华宝基金管理有限公司关于旗下分级基金暂停场内份额分拆业务的公告	基金管理人网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2020-5-16
16	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	基金管理人网站、证券日报	2020-5-19
17	华宝中证 1000 指数分级证券投资基	基金管理人网站、证券	2020-5-22

	金之 1000B 溢价风险提示公告	日报	
18	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金招募说明书（更新）摘要	基金管理人网站	2020-7-11
19	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金招募说明书（更新）	基金管理人网站	2020-7-11
20	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2020 年第 2 季度报告	基金管理人网站	2020-7-21
21	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加泛华普益基金销售有限公司为代销机构及费率优惠的公告	基金管理人网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2020-8-5
22	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	基金管理人网站、证券日报	2020-8-13
23	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示及停复牌公告	基金管理人网站、证券日报	2020-8-14
24	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示及停复牌公告	基金管理人网站、证券日报	2020-8-17
25	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	基金管理人网站、证券日报	2020-8-20
26	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示及停复牌公告	基金管理人网站、证券日报	2020-8-21
27	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示及停复牌公告	基金管理人网站、证券日报	2020-8-24
28	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	基金管理人网站、证券日报	2020-8-25
29	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	基金管理人网站、证券日报	2020-8-26
30	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示及停复牌公告	基金管理人网站、证券日报	2020-8-27
31	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示及停复牌公告	基金管理人网站、证券日报	2020-8-28
32	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金产品资料概要	基金管理人网站	2020-8-28
33	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2020 年中期报告	基金管理人网站	2020-8-31
34	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	基金管理人网站、证券日报	2020-9-8
35	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝中证 1000 指数分级证券	基金管理人网站、证券日报	2020-9-9

	投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告		
36	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告	基金管理人网站、证券日报	2020-9-9
37	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	基金管理人网站、证券日报	2020-9-10
38	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	基金管理人网站、证券日报	2020-9-10
39	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示及停牌公告	基金管理人网站、证券日报	2020-9-11
40	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的提示性公告	基金管理人网站、证券日报	2020-9-11
41	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	基金管理人网站、证券日报	2020-9-11
42	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示及停牌公告	基金管理人网站、证券日报	2020-9-14
43	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	基金管理人网站、证券日报	2020-9-14
44	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	基金管理人网站、证券日报	2020-9-15
45	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	基金管理人网站、证券日报	2020-9-15
46	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示公告	基金管理人网站、证券日报	2020-9-16
47	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	基金管理人网站、证券日报	2020-9-16
48	华宝基金管理有限公司关于以通讯方	基金管理人网站、证券	2020-9-17

	式召开华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	日报	
49	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	基金管理人网站、证券日报	2020-9-18
50	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	基金管理人网站、证券日报	2020-9-21
51	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	基金管理人网站、证券日报	2020-9-22
52	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	基金管理人网站、证券日报	2020-9-23
53	华宝基金管理有限公司关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金恢复场内申购、场外申购（含定期定额投资和转托管）和场内份额分拆业务的公告	基金管理人网站、证券日报	2020-9-23
54	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	基金管理人网站、证券日报	2020-9-24
55	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	基金管理人网站、证券日报	2020-9-25
56	华宝基金管理有限公司关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金和华宝中证医疗指数分级证券投资基金在直销渠道开展赎回费率优惠活动的公告	基金管理人网站、证券日报	2020-9-25
57	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	基金管理人网站、证券日报	2020-9-28
58	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	基金管理人网站、证券日报	2020-9-29
59	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金	基金管理人网站、证券	2020-9-30

	金之 1000B 溢价风险提示及停复牌公告	日报	
60	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	基金管理人网站、证券日报	2020-9-30
61	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	基金管理人网站、证券日报	2020-10-9
62	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	基金管理人网站、证券日报	2020-10-12
63	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	基金管理人网站、证券日报	2020-10-13
64	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	基金管理人网站、证券日报	2020-10-14
65	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	基金管理人网站、证券日报	2020-10-15
66	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的提示性公告	基金管理人网站、证券日报	2020-10-16
67	华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	基金管理人网站、证券日报	2020-10-19
68	关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000A、1000B 份额自基金份额持有人大会计票日开始停牌的提示性公告	基金管理人网站、证券日报	2020-10-19
69	关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	基金管理人网站、证券日报	2020-10-20
70	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	基金管理人网站	2020-10-28
71	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金	基金管理人网站、证券	2020-11-12

	金之 1000B 溢价风险提示及停复牌公告	日报	
72	华宝基金管理有限公司关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金实施转型的公告	基金管理人网站、证券日报	2020-11-12
73	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示及停复牌公告	基金管理人网站、证券日报	2020-11-13
74	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金托管协议	基金管理人网站	2020-11-13
75	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同	基金管理人网站	2020-11-13
76	华宝基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告	基金管理人网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2020-11-13
77	关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之华宝中证 1000A 份额与华宝中证 1000B 份额终止上市的公告	基金管理人网站、证券日报	2020-11-13
78	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示及停复牌公告	基金管理人网站、证券日报	2020-11-16
79	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金招募说明书（更新）	基金管理人网站	2020-11-16
80	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金产品资料概要	基金管理人网站	2020-11-16
81	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	基金管理人网站、证券日报	2020-11-16
82	关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之华宝中证 1000A 份额与华宝中证 1000B 份额终止上市的提示性公告	基金管理人网站、证券日报	2020-11-16
83	华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之 1000B 溢价风险提示及停复牌公告	基金管理人网站、证券日报	2020-11-17
84	华宝基金管理有限公司关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金之华宝中证 1000A 份额与华宝中证 1000B 份额终止上市的提示性公告	基金管理人网站、证券日报	2020-11-17
85	华宝基金管理有限公司关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资、转托管、场内份额分拆合并业务的公告	基金管理人网站、证券日报	2020-11-17

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

2020 年 9 月 9 日，基金管理人发布了《华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，具体内容详见公司公告，请投资者予以关注。

2020 年 10 月 20 日，基金管理人发布了《关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，具体内容详见公司公告，请投资者予以关注。

2020 年 11 月 12 日，基金管理人发布了《华宝基金管理有限公司关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金实施转型的公告》，具体内容详见公司公告，请投资者予以关注。

基金管理人于 2020 年 11 月 13 日发布《华宝基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告》，公司根据《中华人民共和国证券法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》，对旗下部分基金基金合同有关条款进行修订并相应修订了托管协议，具体修订内容详见公司公告，请投资者予以关注。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 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。

13.3 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

2021 年 3 月 31 日