

华宝中证 1000 指数证券投资基金 2022 年年度报告

2022 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：2023 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。本报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 03 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，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
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	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	25
§ 8 投资组合报告	54

8.1 期末基金资产组合情况	54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
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	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	79
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	80
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	81
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	81
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	81
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	81
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	81
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	81
8.12 投资组合报告附注	81
§ 9 基金份额持有人信息	82
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	82
9.2 期末上市基金前十名持有人	83
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	83
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	83
§ 10 开放式基金份额变动	83
§ 11 重大事件揭示	84
11.1 基金份额持有人大会决议	84
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	84
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	84
11.4 基金投资策略的改变	84
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	84
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	85
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	85
11.8 其他重大事件	87
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	88
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	88
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	89
§ 13 备查文件目录	89
13.1 备查文件目录	89
13.2 存放地点	89
13.3 查阅方式	89

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝中证 1000 指数证券投资基金	
基金简称	华宝中证 1000 指数	
场内简称	中证 1000 基金	
基金主代码	162413	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 11 月 19 日	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	51,515,053.69 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的 证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2015 年 6 月 8 日	
下属分级基金的基 金简称	华宝中证 1000 指数	华宝中证 1000 指数 C
下属分级基金的交 易代码	162413	016033
报告期末下属分级 基金的份额总额	42,492,020.01 份	9,023,033.68 份

2.2 基金产品说明

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

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金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	基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司、基金管理人	北京市西城区太平桥大街 17 号、中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年	2022 年 7 月 1 日（基金合同生效日）-2022 年 12 月 31 日	2021 年	2020 年 11 月 19 日（基金合同生效日）-2020 年 12 月 31 日	2020 年

	华宝中证 1000 指数	华宝中证 1000 指数 C	华宝中证 1000 指数	华宝中证 1000 指数 C	华宝中证 1000 指数	华宝中证 1000 指数 C
本期已实现收益	-3,830,523.96	-202,572.52	1,340,210.55	-	-806,024.66	-
本期利润	-12,248,348.83	-879,684.19	8,324,188.13	-	-257,707.12	-
加权平均基金份额本期利润	-0.3173	-0.0896	0.2030	-	-0.0063	-
本期加权平均净值利润率	-31.17%	-8.88%	19.13%	-	-0.64%	-
本期基金份额净值增长率	-20.96%	-11.77%	20.70%	-	-0.59%	-
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
期末可供分配利润	-75,097,619.67	-15,960,415.55	-74,658,360.33	-	-65,673,713.72	-
期末可供分配基金份额利润	-1.7673	-1.7689	-1.6612	-	-1.6914	-
期末基金资产净值	40,128,928.33	8,510,133.27	53,699,706.39	-	38,436,006.14	-
期末基金份额净值	0.9444	0.9432	1.1948	-	0.9899	-
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
基金份额累计净值增长率	-5.16%	-11.77%	19.98%	-	-0.59%	-

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润等于本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

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

5. 自 2022 年 07 月 01 日分级基金成立日起，增设华宝中证 1000 指数 C, C 份额的实际起始日 2022 年 07 月 05 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宝中证 1000 指数

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.48%	1.14%	2.46%	1.14%	-0.98%	0.00%
过去六个月	-10.69%	1.20%	-9.67%	1.21%	-1.02%	-0.01%
过去一年	-20.96%	1.49%	-20.49%	1.51%	-0.47%	-0.02%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-5.16%	1.30%	-5.44%	1.32%	0.28%	-0.02%

华宝中证 1000 指数 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.42%	1.14%	2.46%	1.14%	-1.04%	0.00%
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	-11.77%	1.20%	-10.65%	1.22%	-1.12%	-0.02%

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

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

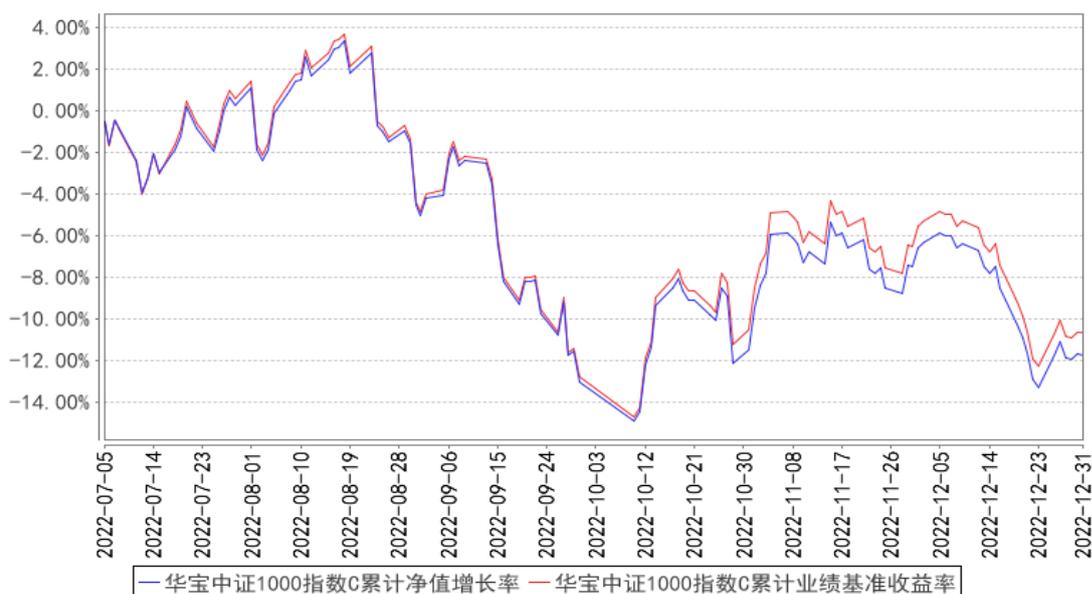
（3）报告期内新增基金 C 份额，基金 C 份额成立于 2022 年 07 月 01 日。

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

华宝中证1000指数累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



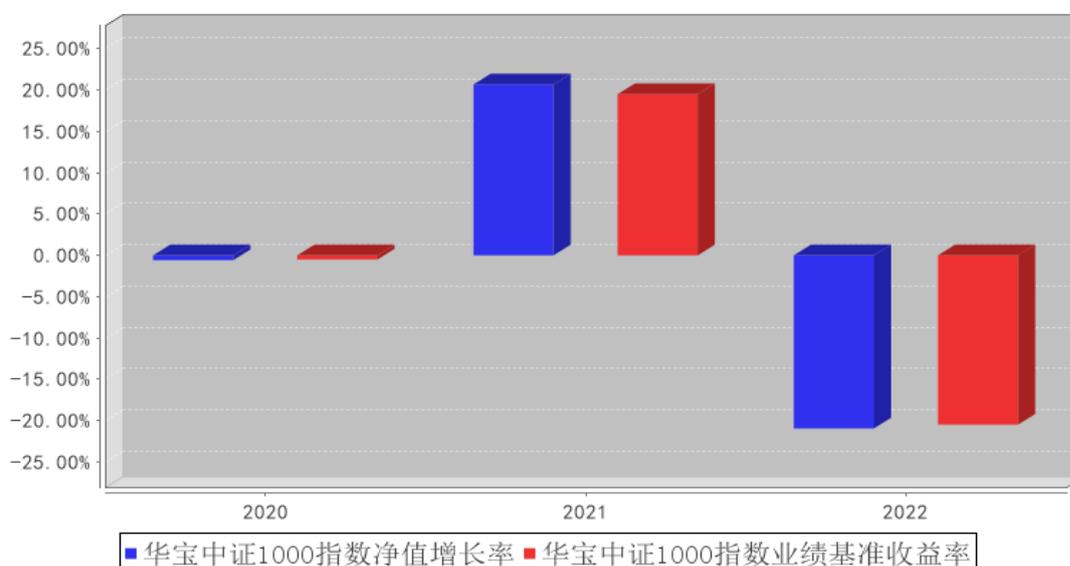
华宝中证1000指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



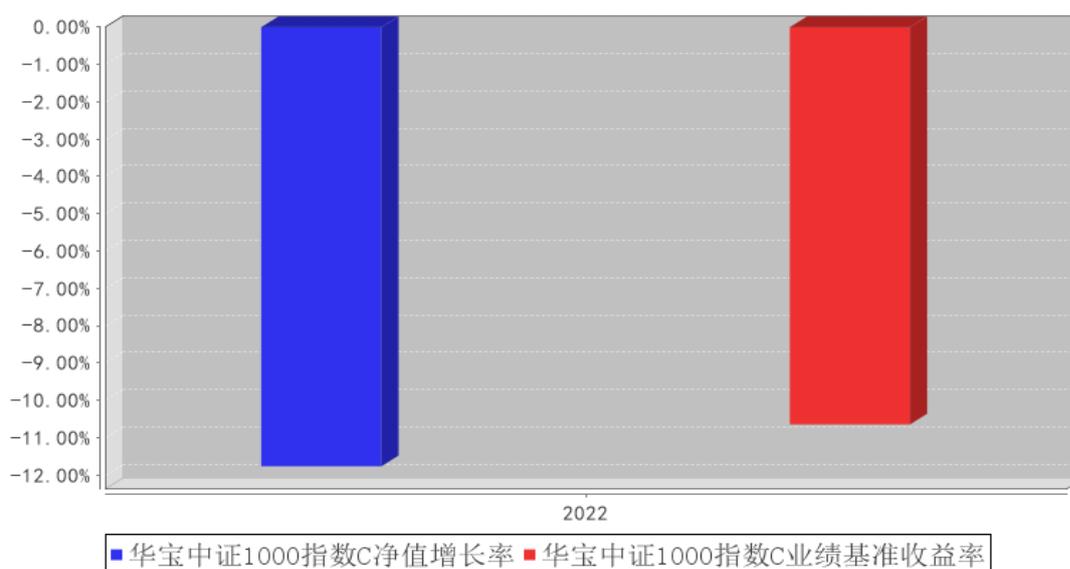
注：按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至 2021 年 05 月 19 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宝中证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



华宝中证1000指数C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金成立未满五年，基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

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

华宝基金管理有限公司（公司原名“华宝兴业基金管理有限公司”）于 2003 年 2 月 12 日经中

国证监会批准设立，2003 年 3 月 7 日在国家工商总局注册登记并正式开业，是国内首批中外合资基金管理公司。成立之初，公司注册资本为人民币 1 亿元人民币，2007 年经中国证监会批准，公司注册资本增加至 1.5 亿元人民币。2017 年公司名称变更为“华宝基金管理有限公司”。目前公司股东为华宝信托有限责任公司、美国华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.）和江苏省铁路集团有限公司，持有股权占比分别为 51%、29%、20%。公司在北京、深圳等地设有分公司，在香港设有子公司——华宝资产管理（香港）有限公司。

截至本报告期末（2022 年 12 月 31 日），本公司正在管理运作的证券投资基金包括：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 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华宝可转债债券型证券投资基金、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、华宝创新优选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、华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金（LOF）、华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金、华宝绿色主题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）、华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金、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、华宝浮动净值型发起式货币市场基金、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）、华宝中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证大数据产业交易型开放式指数证券投资基金等，共 133 只基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
丰晨成	本基金基金经理	2020-11-19	-	14 年	硕士。2009 年 7 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任助理产品经理、数量分析师、投资经理助理、投资经理等职务。2015

				<p>年 11 月起任华宝上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2016 年 8 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2018 年 4 月至 2021 年 1 月任华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2018 年 6 月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2018 年 8 月至 2020 年 11 月任华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金经理，2020 年 11 月起任华宝中证 1000 指数证券投资基金基金经理，2022 年 2 月起任华宝中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2022 年 9 月起任华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，2022 年 12 月起任华宝中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。</p>
--	--	--	--	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝中证 1000 指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

2022 年，世界变局加快演变、外部环境动荡不安，给我国经济带来的影响加深。面对国内经济下行等多重考验，中央加大宏观调控力度，应对超预期因素冲击。全年 A 股市场振荡走低，打破了之前三年的年线三连阳。一季度突然爆发的俄乌战争愈演愈烈，深刻影响了能源及农产品价格、加深了地缘政治的不确定性，全球通货膨胀，新兴市场股票受到一定的压力，A 股市场经历了调整过程。二季度 A 股市场经历了 V 字形先跌后涨的走势，4 月由于部分城市的居民生活、企业生产和交通物流都受到较大影响，上证指数一度跌破 3000 点，随着 4 月底的政治局会议定调一系列宏观稳增长政策措施逐渐推出，5 月份逐步向好的趋势使得投资者风险偏好开始提升，中证 1000 为代表的小市值风格指数逐渐走出一波反弹行情，并在 7 月到 8 月上旬延续了振荡攀升的走势，跑赢大部分宽基指数，“挖小票”蔚然成风，与其他宽基指数三季度振荡下行形成了差异；直到 8 月中下旬受外围美股加息预期超预期，美债利率攀升导致新兴市场流动性回流，A 股市场明显回落，小盘股指数受市场风险偏好下降的影响也出现了明显回调，在三季度末的下挫后，作为小盘股的代表指数于 10 月份率先反弹，振荡向上，但在 11 月受政策调整预期的升温，市场普遍反弹中涨幅不如大盘指数。本报告期内中证 1000 指数表现与中证 500、沪深 300 等大中盘宽基指数接近，略强于创业板指。但从阶段性走势上看，1 月和 3 月上半月的两次明显下挫、4 月悲观情绪叠加市场下跌趋势引发了加速探底过程中跌幅领先其他指数，在 5、6 月市场回暖的反弹中也明显强于多数宽基指数，代表小盘股的中证 1000 指数在报告期内的振幅波动明显大于中证 500、沪深 300 指数，显示出小盘股弹性强，对投资者风险偏好的反映较为敏感。

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

截至本报告期末，本报告期内基金份额 A 类净值增长率为-20.96%，同期业绩比较基准收益率为-20.49%；本报告期内基金份额 C 类净值增长率为-11.77%，同期业绩比较基准收益率为-10.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前我国经济恢复的基础尚不牢固，需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力仍然较大，外部环境动荡不安，给我国经济带来的影响加深。但要看到，我国经济韧性强、潜力大、活力足，各项政策效果持续显现。明年总体看国内经济的复苏势头仍将持续，进程节奏或有起伏，在一系列保就业稳增长的积极产业政策组合拳下，实体经济信用环境的逐渐改善，市场信心将得到恢复，历史上看，小盘风格往往具有高弹性的特征，在经济开始复苏、盈利预期触底、市场流动性预期较为充裕的时候，市场风险偏好提升，小盘股的上涨势头往往都是比大盘股猛的；海外方面，美联储加息周期有望在今年结束，以 A 股为代表的新兴市场资金面有望获得边际上的积极信号。截止报告期末中证 1000 指数的 PE-TTM 估值在 28X 左右，以历史数据看位于 9%分位点左右的位置。

从国内外市场来看，大小盘作为市场的主要风格，存在非常明显的轮动效应。从过去 10 年的历史回顾看，大盘股和中小盘股的相对强弱是以四年左右的时间呈现出周期律的强弱势变化，以 2021 年 2 月为界，抱团投资达到了一个历史极值，大盘风格“抱团股散”重新切换到了小盘风格占优。今年的情况是，在稳增长保就业的背景下，尤其需要对中小企业尤其是制造业的扶持；多层次资本市场的建设、北交所的设立、全面注册制渐行渐近，也是对中小企业融资支持的题中之意。只要经济复苏的方向明确，宏观流动性依然呵护，政策的倾斜叠加流动性的宽松，在这个时点我们对以中证 1000 指数为代表的小市值风格抱有乐观判断。

4.6 管理人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。公司监察稽核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监察稽核部门提出的意见、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。2022 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适用性的情况后及时修订估值方法。基金在投资新品种时，由估值委员会评价现有估值政策和程序的适用性。参与估值的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值各方之间不存在重大利益冲突。

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期亏损，未有应分未分的利润。

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本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

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第 23242 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	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了华宝中证 1000 指数证券投资基金(以下简称“华宝中证 1000 指数基金”)的财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了华宝中证 1000 指数基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。</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。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华宝中证 1000 指数基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>强调事项</p>	<p>-</p>
<p>其他事项</p>	<p>-</p>
<p>其他信息</p>	<p>-</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>华宝中证 1000 指数基金的基金管理人华宝基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华宝中证 1000 指数基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华宝中证 1000 指数基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督华宝中证 1000 指数基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华宝中证</p>

	1000 指数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 指数基金不能持续经营。 (五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	陈熹 林佳璐
会计师事务所的地址	中国上海市
审计报告日期	2023 年 3 月 27 日

§ 7 年度财务报表

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：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	3,792,863.02	3,800,753.80
结算备付金		409,864.16	-
存出保证金		199,246.28	2,607.64
交易性金融资产	7.4.7.2	44,554,892.62	50,537,217.70
其中：股票投资		44,554,892.62	50,537,217.70
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-

其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	135,171.17
应收股利		-	-
应收申购款		36,456.37	32,474.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	391.78
资产总计		48,993,322.45	54,508,616.27
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		78,712.01	585,600.26
应付管理人报酬		21,600.89	22,632.13
应付托管费		4,320.18	4,526.40
应付销售服务费		2,408.96	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	247,218.81	196,151.09
负债合计		354,260.85	808,909.88
净 资 产:			
实收基金	7.4.7.10	123,117,970.14	107,408,959.29
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-74,478,908.54	-53,709,252.90
净资产合计		48,639,061.60	53,699,706.39
负债和净资产总计		48,993,322.45	54,508,616.27

注：1. 报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 51,515,053.69 份，其中华宝中证 1000 指数基金份额总额 42,492,020.01 份，基金份额净值 0.9444 元；华宝中证 1000 指数 C 基金份额总额 9,023,033.68 份，基金份额净值 0.9432 元。

2. 以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年年度报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-12,552,184.26	8,977,101.00
1. 利息收入		15,895.22	10,495.11
其中：存款利息收入	7.4.7.13	15,895.22	10,495.11
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）		-3,526,952.69	1,968,388.60
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-3,870,395.98	1,635,631.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-34.80	-
股利收益	7.4.7.19	343,478.09	332,756.97
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-9,094,936.54	6,983,977.58
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	53,809.75	14,239.71
减：二、营业总支出		575,848.76	652,912.87
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	220,164.35	216,938.71
2. 托管费	7.4.10.2.2	44,032.93	43,387.75
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	14,521.48	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	297,130.00	392,586.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-13,128,033.02	8,324,188.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-13,128,033.02	8,324,188.13
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-13,128,033.02	8,324,188.13

注：以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年年度报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华宝中证 1000 指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期末净资产(基金净值)	107,408,959.29	-	-53,709,252.90	53,699,706.39
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末初净资产(基金净值)	107,408,959.29	-	-53,709,252.90	53,699,706.39

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	15,709,010.85	-	-20,769,655.64	-5,060,644.79
(一)、综合收益总额	-	-	-13,128,033.02	-13,128,033.02
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	15,709,010.85	-	-7,641,622.62	8,067,388.23
其中:1.基金申购款	157,788,167.15	-	-92,172,701.84	65,615,465.31
2.基金赎回款	-142,079,156.30	-	84,531,079.22	-57,548,077.08
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基	123,117,970.14	-	-74,478,908.54	48,639,061.60

金净值)				
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	92,794,990.81	-	-54,358,984.67	38,436,006.14
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本年期初净资产(基金净值)	92,794,990.81	-	-54,358,984.67	38,436,006.14
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	14,613,968.48	-	649,731.77	15,263,700.25
(一)、综合收益总额	-	-	8,324,188.13	8,324,188.13
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	14,613,968.48	-	-7,674,456.36	6,939,512.12
其中:1. 基金申购款	55,177,901.10	-	-30,433,973.51	24,743,927.59
2. 基金赎回	-40,563,932.62	-	22,759,517.15	-17,804,415.47

回款				
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	107,408,959.29	-	-53,709,252.90	53,699,706.39

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：

向辉

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

金合同基金合同》于 2015 年 6 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 330,711,104.54 份基金份额，其中认购资金利息折合 72,245.38 份基金份额。本基金的基金管理人为华宝兴业基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

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

根据本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2022 年 6 月 24 日发布的《华宝基金管理有限公司关于华宝中证 1000 指数证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》以及更新后的《华宝中证 1000 指数证券投资基金基金合同》的有关规定，自 2022 年 7 月 1 日起，本基金增设 C 类基金份额。本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，且不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝中证 1000 指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、存托凭证和其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金采用完全复制法进行指数化投资，股票资产跟踪的标的指数为中证 1000 指数，投资于中证 1000 指数成份股和备选成份股的市值不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5% 的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券。本基金力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%、年跟踪误差不超过 4%，本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×95%+银行同业存款收益率×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2023 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝中证 1000 指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具,分别采用以下两种方式进行计量:

以摊余成本计量:

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的

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

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价

值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的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

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金

估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号——金融资产转移》、《企业会计准则第24号——套期会计》及《企业会计准则第37号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，财政部于2022年颁布了《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》(财会[2022]14号)，中国证监会于2022年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整2022年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021年度的比较财务报表未重列。于2021年12月31日及2022年1月1日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

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

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 3,800,753.80 元、0.00 元、2,607.64 元、391.78 元、135,171.17 元和 32,474.18 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 3,801,144.07 元、0.00 元、2,608.96 元、0.00 元、135,171.17 元和 32,474.18 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 50,537,217.70 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 50,537,217.70 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 0.00 元、585,600.26 元、22,632.13 元、4,526.40 元、28,962.98 元和 51,988.11 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 0.00 元、585,600.26 元、22,632.13 元、4,526.40 元、28,962.98 元和 51,988.11 元。

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

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红

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

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

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

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

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

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

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

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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日

活期存款	3,792,863.02	3,800,753.80
等于：本金	3,792,460.09	3,800,753.80
加：应计利息	402.93	-
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	3,792,863.02	3,800,753.80

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	47,523,504.69	-	44,554,892.62	-2,968,612.07
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	47,523,504.69	-	44,554,892.62	-2,968,612.07
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	44,475,693.23	-	50,537,217.70	6,061,524.47
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	44,475,693.23	-	50,537,217.70	6,061,524.47

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,313,440.00	-	-	-
其中：股指期货投资	1,313,440.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,313,440.00	-	-	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2303	IM2303	1.00	1,248,640.00	-64,800.00
合计				-64,800.00
减：可抵销期货暂收款				-64,800.00
净额				0.00

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无

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未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无

7.4.7.5 债权投资

无

7.4.7.6 其他债权投资

无

7.4.7.7 其他权益工具投资

无

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	391.78
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	391.78

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.68	1,988.11
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	50,218.13	28,962.98
其中：交易所市场	50,218.13	28,962.98
银行间市场	-	-
应付利息	-	-

预提费用	97,000.00	115,200.00
应付指数使用费	100,000.00	50,000.00
合计	247,218.81	196,151.09

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华宝中证 1000 指数

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	44,943,274.25	107,408,959.29
本期申购	34,701,601.07	82,933,641.97
本期赎回（以“-”号填列）	-37,152,855.31	-88,790,635.01
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	42,492,020.01	101,551,966.25

华宝中证 1000 指数 C

项目	本期 2022 年 7 月 1 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	31,319,767.48	74,854,525.18
本期赎回（以“-”号填列）	-22,296,733.80	-53,288,521.29
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	9,023,033.68	21,566,003.89

注：申购含红利再投以及转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

7.4.7.11 其他综合收益

无

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

华宝中证 1000 指数

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-74,658,360.33	20,949,107.43	-53,709,252.90
本期利润	-3,830,523.96	-8,417,824.87	-12,248,348.83
本期基金份额交易产生的变动数	3,391,264.62	1,143,299.19	4,534,563.81
其中：基金申购款	-59,063,318.59	10,048,033.37	-49,015,285.22

基金赎回款	62,454,583.21	-8,904,734.18	53,549,849.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-75,097,619.67	13,674,581.75	-61,423,037.92

华宝中证 1000 指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	-202,572.52	-677,111.67	-879,684.19
本期基金份额交易产生的变动数	-15,757,843.03	3,581,656.60	-12,176,186.43
其中：基金申购款	-54,833,198.49	11,675,781.87	-43,157,416.62
基金赎回款	39,075,355.46	-8,094,125.27	30,981,230.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-15,960,415.55	2,904,544.93	-13,055,870.62

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	12,892.00	10,118.06
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	2,727.52	320.92
其他	275.70	56.13
合计	15,895.22	10,495.11

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	54,652,863.38	23,943,009.99
减：卖出股票成本总额	58,351,085.14	22,307,378.36
减：交易费用	172,174.22	-
买卖股票差价收入	-3,870,395.98	1,635,631.63

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益-证券出借差价收入。

7.4.7.15 债券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.17 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.18 衍生工具收益**7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 收益金额 2021年1月1日至2021年12月31日
股指期货投资收益	-34.80	-

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	343,478.09	332,756.97
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	343,478.09	332,756.97

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	-9,030,136.54	6,983,977.58
股票投资	-9,030,136.54	6,983,977.58
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-

其他	-	-
2. 衍生工具	-64,800.00	-
权证投资	-	-
期货投资	-64,800.00	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-9,094,936.54	6,983,977.58

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
基金赎回费收入	53,809.75	14,239.71
合计	53,809.75	14,239.71

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。

7.4.7.22 信用减值损失

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
审计费用	17,000.00	35,200.00
信息披露费	80,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	130.00	574.38
指数使用费	200,000.00	200,000.00
交易费用	-	76,812.03
合计	297,130.00	392,586.41

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，本基金无需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，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
江苏省铁路集团有限公司 (“江苏铁集”)	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司 (“宝武集团”)	华宝信托的最终控制人
华宝证券股份有限公司 (“华宝证券”)	受宝武集团控制的公司、基金销售机构
华宝投资有限公司 (“华宝投资”)	受宝武集团控制的公司
宝武集团财务有限责任公司 (“宝武财务”)	受宝武集团控制的公司

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据华宝基金股东会第十一次会议决议，并经中国证监会证监许可[2022]888号《关于核准华宝基金管理有限公司变更股权的批复》核准，华平资产管理有限合伙(Warburg Pincus Asset Management, L.P.)将其持有的华宝基金 20%股权转让给江苏省铁路集团有限公司，并于 2022 年 5 月 24 日完成了工商变更登记手续。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	220,164.35	216,938.71
其中：支付销售机构的客户维护费	80,101.80	84,742.15

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
----	-------------------------------------------	------------------------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	44,032.93	43,387.75
----------------	-----------	-----------

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

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝中证 1000 指数	华宝中证 1000 指数 C	合计
华宝基金	-	12,241.67	12,241.67
合计	-	12,241.67	12,241.67
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝中证 1000 指数	华宝中证 1000 指数 C	合计
合计	-	-	-

注：销售服务费每日计提，按月支付。A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.30% 年费率计提。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下： $H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值。

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

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

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本报告期末及上年度末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	3,792,863.02	12,892.00	3,800,753.80	10,118.06

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，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

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
600459	贵研铂业	2022年12月22日	1个月内（含）	配股流通受限	10.91	15.74	761	8,302.51	11,978.14	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

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

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

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪中证 1000 指数。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与跟踪指数相同的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司在经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；合规审计部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为风险管理部和合规审计部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对风险管理部和合规审计部的工作予以直接指导。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是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大型股份制商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

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，除附注中列示的卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息。可赎回基金份额净值（净资产）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 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,792,863.02	-	-	-	3,792,863.02
结算备付金	409,864.16	-	-	-	409,864.16
存出保证金	11,950.28	-	-	187,296.00	199,246.28
交易性金融资产	-	-	-	44,554,892.62	44,554,892.62
应收申购款	10.01	-	-	36,446.36	36,456.37
资产总计	4,214,687.47	-	-	44,778,634.98	48,993,322.45
负债					
应付赎回款	-	-	-	78,712.01	78,712.01
应付管理人报酬	-	-	-	21,600.89	21,600.89
应付托管费	-	-	-	4,320.18	4,320.18
应付销售服务费	-	-	-	2,408.96	2,408.96
其他负债	-	-	-	247,218.81	247,218.81
负债总计	-	-	-	354,260.85	354,260.85
利率敏感度缺口	4,214,687.47	-	-	44,424,374.13	48,639,061.60
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,800,753.80	-	-	-	3,800,753.80
存出保证金	2,607.64	-	-	-	2,607.64
交易性金融资产	-	-	-	50,537,217.70	50,537,217.70
应收申购款	1,153.90	-	-	31,320.28	32,474.18
应收证券清算款	-	-	-	135,171.17	135,171.17
其他资产	-	-	-	391.78	391.78
资产总计	3,804,515.34	-	-	50,704,100.93	54,508,616.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	585,600.26	585,600.26

应付管理人报酬	-	-	-	22,632.13	22,632.13
应付托管费	-	-	-	4,526.40	4,526.40
其他负债	-	-	-	196,151.09	196,151.09
负债总计	-	-	-	808,909.88	808,909.88
利率敏感度缺口	3,804,515.34	-	-	49,895,191.05	53,699,706.39

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

于本报告期末，本基金持有的交易性债券投资占基金净资产的比例较低（含债券投资比例为零），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（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

本基金投资于中证 1000 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。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。通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

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 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	44,554,892.62	91.60	50,537,217.70	94.11
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	44,554,892.62	91.60	50,537,217.70	94.11

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

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（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	1. 业绩比较基准上升 5%	2,396,819.34	2,633,242.18
	2. 业绩比较基准下降 5%	-2,396,819.34	-2,633,242.18

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	44,554,892.62	50,486,370.50

第二层次	-	50,847.20
第三层次	-	-
合计	44,554,892.62	50,537,217.70

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比同期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	

期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	44,554,892.62	90.94
	其中：股票	44,554,892.62	90.94
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	4,202,727.18	8.58
8	其他各项资产	235,702.65	0.48
9	合计	48,993,322.45	100.00

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

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	271,584.80	0.56
B	采矿业	1,278,596.14	2.63
C	制造业	30,750,581.93	63.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,295,989.58	2.66
E	建筑业	862,722.82	1.77
F	批发和零售业	1,259,649.30	2.59
G	交通运输、仓储和邮政业	932,593.67	1.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,905,044.92	8.03
J	金融业	1,026,852.30	2.11
K	房地产业	902,388.10	1.86
L	租赁和商务服务业	327,105.35	0.67
M	科学研究和技术服务业	581,837.24	1.20
N	水利、环境和公共设施管理业	566,688.88	1.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	20,712.00	0.04
Q	卫生和社会工作	173,382.00	0.36
R	文化、体育和娱乐业	360,187.59	0.74
S	综合	38,976.00	0.08
	合计	44,554,892.62	91.60

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部分的股票投资。

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	002176	江特电机	12,400	216,380.00	0.44
2	002405	四维图新	17,300	190,646.00	0.39
3	300438	鹏辉能源	2,350	183,276.50	0.38
4	002240	盛新锂能	4,600	172,454.00	0.35
5	000933	神火股份	11,400	170,544.00	0.35
6	600872	中炬高新	4,600	169,602.00	0.35
7	300395	菲利华	2,950	162,250.00	0.33
8	600559	老白干酒	5,305	146,046.65	0.30
9	002432	九安医疗	2,800	143,108.00	0.29
10	000423	东阿阿胶	3,300	134,310.00	0.28
11	300068	南都电源	6,200	132,060.00	0.27
12	300118	东方日升	5,200	129,064.00	0.27
13	601677	明泰铝业	7,000	126,980.00	0.26
14	601099	太平洋	49,400	126,958.00	0.26
15	002472	双环传动	4,900	124,705.00	0.26
16	002317	众生药业	4,600	124,154.00	0.26
17	600338	西藏珠峰	5,300	121,476.00	0.25
18	002044	美年健康	19,800	121,374.00	0.25
19	000762	西藏矿业	3,000	115,830.00	0.24
20	300054	鼎龙股份	5,440	115,817.60	0.24
21	002312	川发龙蟒	11,000	115,720.00	0.24
22	688050	爱博医疗	500	115,350.00	0.24
23	002335	科华数据	2,300	114,747.00	0.24
24	002463	沪电股份	9,600	114,240.00	0.23
25	000860	顺鑫农业	3,800	113,316.00	0.23
26	688598	金博股份	500	109,740.00	0.23
27	300777	中简科技	2,200	108,130.00	0.22
28	300339	润和软件	5,800	107,706.00	0.22
29	600711	盛屯矿业	18,200	107,198.00	0.22
30	300035	中科电气	5,200	107,016.00	0.22
31	000818	航锦科技	3,900	106,665.00	0.22
32	002262	恩华药业	4,336	106,448.80	0.22
33	688556	高测股份	1,400	105,028.00	0.22

34	002389	航天彩虹	5,100	104,907.00	0.22
35	000690	宝新能源	15,800	102,700.00	0.21
36	600596	新安股份	6,640	100,529.60	0.21
37	688516	奥特维	499	100,299.00	0.21
38	002245	蔚蓝锂芯	6,700	99,696.00	0.20
39	603236	移远通信	986	99,408.52	0.20
40	002487	大金重工	2,400	99,288.00	0.20
41	600771	广誉远	3,500	97,370.00	0.20
42	600583	海油工程	16,000	96,960.00	0.20
43	002402	和而泰	6,650	96,957.00	0.20
44	601975	招商南油	24,600	96,924.00	0.20
45	002036	联创电子	7,823	96,770.51	0.20
46	002518	科士达	1,675	96,480.00	0.20
47	605589	圣泉集团	4,500	96,255.00	0.20
48	000422	湖北宜化	6,500	95,615.00	0.20
49	300034	钢研高纳	2,079	95,301.36	0.20
50	002436	兴森科技	9,800	94,864.00	0.20
51	300725	药石科技	1,176	94,668.00	0.19
52	002484	江海股份	4,216	94,311.92	0.19
53	300393	中来股份	6,327	93,766.14	0.19
54	002865	钧达股份	500	92,550.00	0.19
55	000893	亚钾国际	3,400	92,412.00	0.19
56	002610	爱康科技	32,400	92,340.00	0.19
57	300346	南大光电	3,170	92,088.50	0.19
58	600416	湘电股份	4,800	90,240.00	0.19
59	600478	科力远	9,600	90,048.00	0.19
60	300666	江丰电子	1,300	89,960.00	0.18
61	601222	林洋能源	10,408	89,404.72	0.18
62	300593	新雷能	2,100	89,208.00	0.18
63	300203	聚光科技	2,600	88,140.00	0.18
64	600481	双良节能	6,800	87,992.00	0.18
65	688139	海尔生物	1,377	87,164.10	0.18
66	002541	鸿路钢构	2,950	86,405.50	0.18
67	603027	千禾味业	4,149	86,216.22	0.18
68	603338	浙江鼎力	1,800	86,130.00	0.18
69	300502	新易盛	3,625	86,093.75	0.18
70	300327	中颖电子	2,430	85,949.10	0.18
71	600777	新潮能源	39,400	85,892.00	0.18
72	000875	吉电股份	14,100	85,869.00	0.18
73	600456	宝钛股份	2,100	85,806.00	0.18
74	688066	航天宏图	1,002	85,671.00	0.18
75	605111	新洁能	1,100	85,338.00	0.18
76	600129	太极集团	2,800	84,168.00	0.17

77	300298	三诺生物	2,480	83,650.40	0.17
78	300775	三角防务	2,200	83,600.00	0.17
79	300487	蓝晓科技	1,200	83,508.00	0.17
80	600057	厦门象屿	8,126	83,454.02	0.17
81	002318	久立特材	5,000	83,200.00	0.17
82	600882	妙可蓝多	2,600	82,784.00	0.17
83	002747	埃斯顿	3,800	82,384.00	0.17
84	603179	新泉股份	2,140	82,368.60	0.17
85	603599	广信股份	2,800	82,320.00	0.17
86	300803	指南针	1,800	82,296.00	0.17
87	300633	开立医疗	1,500	82,245.00	0.17
88	002517	恺英网络	12,500	82,000.00	0.17
89	688200	华峰测控	296	81,835.12	0.17
90	603713	密尔克卫	700	81,662.00	0.17
91	002558	巨人网络	10,200	81,192.00	0.17
92	600179	安通控股	24,500	80,605.00	0.17
93	600110	诺德股份	10,100	80,295.00	0.17
94	300343	联创股份	8,200	79,950.00	0.16
95	603678	火炬电子	1,950	79,833.00	0.16
96	002145	中核钛白	12,905	79,494.80	0.16
97	002675	东诚药业	4,800	79,488.00	0.16
98	688023	安恒信息	400	79,200.00	0.16
99	600185	格力地产	7,580	79,059.40	0.16
100	603129	春风动力	700	78,764.00	0.16
101	300294	博雅生物	2,150	78,604.00	0.16
102	300101	振芯科技	3,200	78,400.00	0.16
103	002597	金禾实业	2,400	78,000.00	0.16
104	002456	欧菲光	16,500	77,715.00	0.16
105	688639	华恒生物	500	77,625.00	0.16
106	002617	露笑科技	8,399	77,522.77	0.16
107	002015	协鑫能科	5,900	77,408.00	0.16
108	300332	天壕环境	6,400	76,736.00	0.16
109	300748	金力永磁	2,620	76,661.20	0.16
110	601678	滨化股份	14,900	76,586.00	0.16
111	688707	振华新材	1,700	76,415.00	0.16
112	002254	泰和新材	3,600	76,356.00	0.16
113	002139	拓邦股份	7,325	75,960.25	0.16
114	300432	富临精工	5,250	75,757.50	0.16
115	300083	创世纪	8,900	75,383.00	0.15
116	000034	神州数码	3,400	74,596.00	0.15
117	603308	应流股份	3,500	74,550.00	0.15
118	002851	麦格米特	2,850	73,986.00	0.15
119	002984	森麒麟	2,400	73,896.00	0.15

120	603876	鼎胜新材	1,800	73,872.00	0.15
121	600977	中国电影	5,400	73,440.00	0.15
122	600641	万业企业	4,140	73,402.20	0.15
123	600100	同方股份	17,000	73,270.00	0.15
124	002151	北斗星通	2,600	73,008.00	0.15
125	601001	晋控煤业	6,100	72,956.00	0.15
126	601375	中原证券	20,000	72,800.00	0.15
127	300587	天铁股份	6,257	72,080.64	0.15
128	688700	东威科技	500	71,575.00	0.15
129	000403	派林生物	3,133	71,307.08	0.15
130	300525	博思软件	3,590	71,082.00	0.15
131	002706	良信股份	4,850	71,052.50	0.15
132	300451	创业慧康	8,957	70,849.87	0.15
133	002126	银轮股份	5,700	70,737.00	0.15
134	002324	普利特	4,400	70,400.00	0.14
135	300567	精测电子	1,400	70,280.00	0.14
136	603005	晶方科技	3,776	70,044.80	0.14
137	688778	厦钨新能	900	69,912.00	0.14
138	002063	远光软件	9,190	69,752.10	0.14
139	301035	润丰股份	800	69,680.00	0.14
140	002182	云海金属	3,300	69,630.00	0.14
141	301050	雷电微力	900	69,453.00	0.14
142	002727	一心堂	2,200	69,322.00	0.14
143	300773	拉卡拉	4,100	69,208.00	0.14
144	601908	京运通	10,500	68,985.00	0.14
145	601567	三星医疗	5,100	68,748.00	0.14
146	688019	安集科技	380	68,400.00	0.14
147	300679	电连技术	1,845	68,265.00	0.14
148	300672	国科微	800	68,040.00	0.14
149	603979	金诚信	2,634	67,456.74	0.14
150	300379	东方通	3,300	67,419.00	0.14
151	603306	华懋科技	1,800	67,338.00	0.14
152	600123	兰花科创	5,000	66,700.00	0.14
153	300623	捷捷微电	3,230	66,602.60	0.14
154	000032	深桑达 A	3,300	66,495.00	0.14
155	300065	海兰信	5,025	66,380.25	0.14
156	600330	天通股份	6,280	66,191.20	0.14
157	002085	万丰奥威	11,100	66,045.00	0.14
158	688333	铂力特	460	65,665.00	0.14
159	002761	浙江建投	3,100	65,348.00	0.13
160	600773	西藏城投	3,600	65,340.00	0.13
161	300036	超图软件	3,500	65,275.00	0.13
162	603588	高能环境	6,632	65,258.88	0.13

163	601258	庞大集团	59,300	65,230.00	0.13
164	688711	宏微科技	700	64,960.00	0.13
165	000035	中国天楹	12,800	64,896.00	0.13
166	600277	亿利洁能	15,520	64,873.60	0.13
167	600323	瀚蓝环境	3,500	64,610.00	0.13
168	002832	比音勒芬	2,520	64,537.20	0.13
169	002332	仙琚制药	5,700	64,410.00	0.13
170	300458	全志科技	3,161	64,357.96	0.13
171	688518	联赢激光	2,200	64,262.00	0.13
172	300459	汤姆猫	20,400	64,260.00	0.13
173	300315	掌趣科技	20,000	64,200.00	0.13
174	603505	金石资源	1,620	64,184.40	0.13
175	600996	贵广网络	4,300	64,027.00	0.13
176	603305	旭升集团	1,980	63,835.20	0.13
177	600063	皖维高新	10,900	63,765.00	0.13
178	688559	海目星	1,100	63,624.00	0.13
179	002585	双星新材	4,990	63,622.50	0.13
180	002446	盛路通信	6,620	63,287.20	0.13
181	002258	利尔化学	3,520	63,219.20	0.13
182	000951	中国重汽	4,260	63,218.40	0.13
183	601399	国机重装	20,900	63,118.00	0.13
184	600821	金开新能	8,700	62,988.00	0.13
185	002079	苏州固锔	4,700	62,933.00	0.13
186	600586	金晶科技	7,200	62,712.00	0.13
187	300573	兴齐眼药	500	62,540.00	0.13
188	000915	华特达因	1,370	62,335.00	0.13
189	002807	江阴银行	15,700	62,329.00	0.13
190	002837	英维克	1,870	62,289.70	0.13
191	600685	中船防务	3,000	62,280.00	0.13
192	688276	百克生物	900	62,199.00	0.13
193	688408	中信博	632	62,188.80	0.13
194	600916	中国黄金	4,900	61,936.00	0.13
195	600363	联创光电	2,600	61,906.00	0.13
196	300910	瑞丰新材	500	61,655.00	0.13
197	603128	华贸物流	5,740	61,647.60	0.13
198	600562	国睿科技	3,632	61,562.40	0.13
199	600572	康恩贝	13,000	61,490.00	0.13
200	000657	中钨高新	3,880	61,459.20	0.13
201	688520	神州细胞	1,014	61,448.40	0.13
202	603612	索通发展	2,360	61,407.20	0.13
203	688617	惠泰医疗	200	61,386.00	0.13
204	603063	禾望电气	2,200	61,336.00	0.13
205	688016	心脉医疗	324	61,248.96	0.13

206	600055	万东医疗	3,100	60,574.00	0.12
207	603690	至纯科技	1,600	60,544.00	0.12
208	600452	涪陵电力	4,000	60,400.00	0.12
209	002011	盾安环境	4,600	60,398.00	0.12
210	600483	福能股份	5,700	60,306.00	0.12
211	603279	景津装备	2,040	60,139.20	0.12
212	002091	江苏国泰	7,060	60,010.00	0.12
213	688017	绿的谐波	620	60,003.60	0.12
214	300077	国民技术	4,300	59,985.00	0.12
215	688202	美迪西	280	59,889.20	0.12
216	002291	遥望科技	4,600	59,800.00	0.12
217	600151	航天机电	7,300	59,495.00	0.12
218	600273	嘉化能源	7,100	59,427.00	0.12
219	603565	中谷物流	4,068	59,148.72	0.12
220	600116	三峡水利	6,900	59,133.00	0.12
221	300687	赛意信息	2,000	59,000.00	0.12
222	300827	上能电气	1,000	58,840.00	0.12
223	002544	普天科技	3,500	58,765.00	0.12
224	600877	声光电科	4,300	58,738.00	0.12
225	002004	华邦健康	11,500	58,650.00	0.12
226	002643	万润股份	4,000	58,640.00	0.12
227	300747	锐科激光	2,476	58,557.40	0.12
228	000810	创维数字	4,200	58,548.00	0.12
229	688083	中望软件	300	58,374.00	0.12
230	002216	三全食品	3,150	58,306.50	0.12
231	002839	张家港行	12,600	58,086.00	0.12
232	603529	爱玛科技	1,260	57,796.20	0.12
233	600037	歌华有线	7,100	57,794.00	0.12
234	603348	文灿股份	1,000	57,570.00	0.12
235	002006	精功科技	2,300	57,500.00	0.12
236	002099	海翔药业	8,200	57,482.00	0.12
237	002960	青鸟消防	2,050	57,379.50	0.12
238	002100	天康生物	6,900	57,339.00	0.12
239	600267	海正药业	5,200	57,304.00	0.12
239	600389	江山股份	1,300	57,304.00	0.12
240	601369	陕鼓动力	5,000	57,300.00	0.12
241	300476	胜宏科技	4,420	57,194.80	0.12
242	603008	喜临门	2,000	57,100.00	0.12
243	688388	嘉元科技	1,273	57,094.05	0.12
244	688608	恒玄科技	500	57,000.00	0.12
245	600908	无锡银行	10,800	56,916.00	0.12
246	000049	德赛电池	1,305	56,741.40	0.12
247	601965	中国汽研	2,900	56,202.00	0.12

248	601212	白银有色	21,500	55,900.00	0.11
249	688007	光峰科技	2,238	55,636.68	0.11
250	688680	海优新材	300	55,590.00	0.11
251	688133	泰坦科技	400	55,388.00	0.11
252	300456	赛微电子	3,740	55,277.20	0.11
253	600206	有研新材	4,300	55,212.00	0.11
254	000982	中银绒业	30,900	55,002.00	0.11
255	601860	紫金银行	21,200	54,908.00	0.11
256	300087	荃银高科	3,400	54,740.00	0.11
257	300596	利安隆	1,000	54,570.00	0.11
258	300185	通裕重工	22,600	54,240.00	0.11
259	688131	皓元医药	500	54,190.00	0.11
260	300685	艾德生物	2,048	54,169.60	0.11
261	000902	新洋丰	4,700	54,097.00	0.11
262	300737	科顺股份	4,300	54,094.00	0.11
263	000503	国新健康	5,300	53,848.00	0.11
264	600422	昆药集团	3,800	53,656.00	0.11
265	300166	东方国信	6,700	53,533.00	0.11
266	300772	运达股份	3,600	53,532.00	0.11
267	300627	华测导航	1,920	53,376.00	0.11
268	000917	电广传媒	10,300	53,354.00	0.11
269	688800	瑞可达	500	53,340.00	0.11
270	605123	派克新材	400	53,160.00	0.11
271	600305	恒顺醋业	4,316	53,129.96	0.11
272	002020	京新药业	4,360	53,104.80	0.11
273	300726	宏达电子	1,200	52,968.00	0.11
274	600252	中恒集团	20,100	52,863.00	0.11
275	688033	天宜上佳	2,426	52,814.02	0.11
276	603032	德新科技	600	52,656.00	0.11
277	601208	东材科技	4,600	52,578.00	0.11
278	603826	坤彩科技	1,000	52,410.00	0.11
279	300443	金雷股份	1,300	52,364.00	0.11
280	603197	保隆科技	1,100	52,030.00	0.11
281	600459	贵研铂业	3,296	51,879.04	0.11
282	000090	天健集团	9,500	51,870.00	0.11
283	300398	飞凯材料	3,020	51,853.40	0.11
284	002698	博实股份	3,700	51,837.00	0.11
285	002123	梦网科技	4,600	51,658.00	0.11
286	600966	博汇纸业	5,800	51,562.00	0.11
287	600197	伊力特	2,100	51,534.00	0.11
288	002928	华夏航空	3,725	51,516.75	0.11
289	300855	图南股份	1,100	51,469.00	0.11
290	300133	华策影视	9,600	51,168.00	0.11

291	601126	四方股份	3,500	51,100.00	0.11
292	605376	博迁新材	1,100	51,073.00	0.11
293	601777	力帆科技	13,200	50,952.00	0.10
294	600577	精达股份	12,000	50,880.00	0.10
295	300075	数字政通	2,900	50,837.00	0.10
296	603212	赛伍技术	1,600	50,720.00	0.10
296	603300	华铁应急	8,000	50,720.00	0.10
297	000829	天音控股	5,200	50,648.00	0.10
298	600366	宁波韵升	4,800	50,640.00	0.10
299	300170	汉得信息	6,200	50,468.00	0.10
300	000681	视觉中国	4,100	50,430.00	0.10
301	600850	电科数字	2,510	50,400.80	0.10
302	601137	博威合金	3,400	50,354.00	0.10
303	300674	宇信科技	3,580	50,299.00	0.10
304	688298	东方生物	652	50,275.72	0.10
305	000650	仁和药业	8,100	50,139.00	0.10
306	300233	金城医药	2,200	50,094.00	0.10
307	002171	楚江新材	6,800	49,980.00	0.10
308	600761	安徽合力	3,800	49,970.00	0.10
309	600740	山西焦化	9,236	49,966.76	0.10
310	300457	赢合科技	2,825	49,917.75	0.10
311	300655	晶瑞电材	3,400	49,912.00	0.10
312	688696	极米科技	300	49,860.00	0.10
313	002467	二六三	10,030	49,849.10	0.10
314	301047	义翘神州	500	49,830.00	0.10
315	300767	震安科技	1,064	49,742.00	0.10
316	002726	龙大美食	5,424	49,738.08	0.10
317	600993	马应龙	2,200	49,720.00	0.10
318	603997	继峰股份	3,250	49,660.00	0.10
319	002041	登海种业	2,500	49,550.00	0.10
320	603595	东尼电子	824	49,547.12	0.10
321	600688	上海石化	15,900	49,449.00	0.10
322	600446	金证股份	4,800	49,392.00	0.10
323	300409	道氏技术	3,360	49,358.40	0.10
324	300079	数码视讯	10,300	49,337.00	0.10
325	002567	唐人神	6,950	49,206.00	0.10
326	600610	中毅达	3,100	49,197.00	0.10
327	002174	游族网络	5,300	49,078.00	0.10
328	002163	海南发展	4,300	49,063.00	0.10
329	600491	龙元建设	7,800	49,062.00	0.10
330	300662	科锐国际	1,000	49,000.00	0.10
331	002539	云图控股	4,400	48,928.00	0.10
332	301031	中熔电气	300	48,897.00	0.10

333	600158	中体产业	5,600	48,888.00	0.10
334	603323	苏农银行	10,410	48,822.90	0.10
335	000426	兴业矿业	8,000	48,720.00	0.10
336	002737	葵花药业	2,100	48,678.00	0.10
337	000546	金圆股份	4,000	48,480.00	0.10
337	600869	远东股份	9,600	48,480.00	0.10
338	600328	中盐化工	3,300	48,477.00	0.10
339	002390	信邦制药	10,300	48,410.00	0.10
340	002261	拓维信息	7,300	48,399.00	0.10
341	600888	新疆众和	5,900	48,321.00	0.10
342	003031	中瓷电子	500	48,150.00	0.10
343	300973	立高食品	500	48,090.00	0.10
344	300109	新开源	1,974	47,770.80	0.10
345	301071	力量钻石	400	47,660.00	0.10
346	600986	浙文互联	9,540	47,604.60	0.10
347	000059	华锦股份	7,000	47,600.00	0.10
348	600621	华鑫股份	4,600	47,518.00	0.10
349	000758	中色股份	10,000	47,500.00	0.10
350	000735	罗牛山	6,700	47,369.00	0.10
351	601918	新集能源	11,300	47,347.00	0.10
352	600933	爱柯迪	2,600	47,346.00	0.10
353	300762	上海瀚讯	3,592	47,342.56	0.10
354	000582	北部湾港	6,400	47,296.00	0.10
355	601952	苏垦农发	3,990	47,241.60	0.10
356	688499	利元亨	300	47,214.00	0.10
357	600578	京能电力	14,500	47,125.00	0.10
358	002130	沃尔核材	7,300	47,085.00	0.10
359	688037	芯源微	300	46,950.00	0.10
360	002895	川恒股份	1,800	46,926.00	0.10
361	600557	康缘药业	2,500	46,875.00	0.10
362	300470	中密控股	1,200	46,692.00	0.10
363	600312	平高电气	5,900	46,669.00	0.10
364	000682	东方电子	5,800	46,632.00	0.10
365	688266	泽璟制药	1,118	46,620.60	0.10
366	600246	万通发展	7,400	46,546.00	0.10
367	002906	华阳集团	1,400	46,508.00	0.10
368	600428	中远海特	7,800	46,488.00	0.10
369	300323	华灿光电	7,200	46,440.00	0.10
370	603906	龙蟠科技	2,000	46,300.00	0.10
371	600320	振华重工	14,400	46,224.00	0.10
372	600496	精工钢构	11,700	46,215.00	0.10
373	688321	微芯生物	2,100	46,158.00	0.09
374	600645	中源协和	2,700	45,927.00	0.09

375	002214	大立科技	3,500	45,920.00	0.09
376	688339	亿华通	620	45,880.00	0.09
377	600295	鄂尔多斯	3,020	45,873.80	0.09
378	002537	海联金汇	5,980	45,866.60	0.09
379	688425	铁建重工	11,600	45,820.00	0.09
380	603733	仙鹤股份	1,500	45,705.00	0.09
381	002626	金达威	2,200	45,584.00	0.09
382	600266	城建发展	9,800	45,570.00	0.09
383	002003	伟星股份	4,500	45,540.00	0.09
384	000767	晋控电力	13,400	45,426.00	0.09
385	600811	东方集团	18,600	45,384.00	0.09
386	000627	天茂集团	14,300	45,188.00	0.09
387	603098	森特股份	1,600	45,152.00	0.09
388	300188	美亚柏科	3,500	45,010.00	0.09
389	000685	中山公用	6,400	44,992.00	0.09
390	600587	新华医疗	2,100	44,982.00	0.09
391	300671	富满微	1,100	44,957.00	0.09
392	600248	陕西建工	10,700	44,940.00	0.09
393	600682	南京新百	4,900	44,737.00	0.09
394	300158	振东制药	6,000	44,700.00	0.09
395	600720	祁连山	4,500	44,685.00	0.09
396	600059	古越龙山	4,600	44,666.00	0.09
397	300428	立中集团	1,800	44,550.00	0.09
398	300224	正海磁材	3,550	44,481.50	0.09
399	002612	朗姿股份	1,600	44,416.00	0.09
400	002237	恒邦股份	4,200	44,268.00	0.09
400	600120	浙江东方	12,400	44,268.00	0.09
401	002649	博彦科技	4,300	44,247.00	0.09
402	600210	紫江企业	8,800	44,000.00	0.09
403	000488	晨鸣纸业	8,800	43,824.00	0.09
404	300226	上海钢联	1,580	43,781.80	0.09
405	601200	上海环境	4,900	43,757.00	0.09
406	301155	海力风电	500	43,675.00	0.09
407	000921	海信家电	3,300	43,461.00	0.09
408	300382	斯莱克	2,300	43,424.00	0.09
409	000923	河钢资源	3,300	43,395.00	0.09
410	002847	盐津铺子	400	43,316.00	0.09
411	600797	浙大网新	7,400	43,290.00	0.09
412	601890	亚星锚链	4,900	43,267.00	0.09
413	300348	长亮科技	4,250	43,265.00	0.09
414	002400	省广集团	10,100	43,228.00	0.09
415	300236	上海新阳	1,550	43,074.50	0.09
416	600717	天津港	10,500	43,050.00	0.09

417	600285	羚锐制药	3,300	43,032.00	0.09
418	002061	浙江交科	8,100	42,930.00	0.09
419	002276	万马股份	5,200	42,900.00	0.09
420	002413	雷科防务	9,700	42,874.00	0.09
421	000006	深振业 A	6,800	42,840.00	0.09
422	002038	双鹭药业	5,200	42,744.00	0.09
423	600098	广州发展	7,700	42,735.00	0.09
424	300039	上海凯宝	5,300	42,718.00	0.09
425	300171	东富龙	1,800	42,714.00	0.09
426	600963	岳阳林纸	7,830	42,673.50	0.09
427	002233	塔牌集团	6,000	42,600.00	0.09
428	601519	大智慧	7,400	42,550.00	0.09
429	300151	昌红科技	2,200	42,482.00	0.09
430	002773	康弘药业	2,700	42,363.00	0.09
431	603298	杭叉集团	2,520	42,361.20	0.09
432	605507	国邦医药	1,600	42,352.00	0.09
433	603043	广州酒家	1,640	42,344.80	0.09
434	002349	精华制药	3,500	42,280.00	0.09
435	300229	拓尔思	3,600	42,192.00	0.09
436	300598	诚迈科技	900	42,084.00	0.09
437	300497	富祥药业	3,188	42,081.60	0.09
438	300394	天孚通信	1,660	42,081.00	0.09
439	002556	辉隆股份	4,800	42,000.00	0.09
440	002859	洁美科技	1,480	41,780.40	0.09
441	000528	柳 工	7,100	41,748.00	0.09
442	300638	广和通	2,331	41,724.90	0.09
443	601311	骆驼股份	5,100	41,616.00	0.09
444	600477	杭萧钢构	10,270	41,593.50	0.09
445	600502	安徽建工	8,656	41,548.80	0.09
446	600635	大众公用	14,000	41,440.00	0.09
447	000712	锦龙股份	3,200	41,408.00	0.09
448	688575	亚辉龙	2,100	41,265.00	0.08
449	603123	翠微股份	2,900	41,151.00	0.08
450	603393	新天然气	1,884	41,014.68	0.08
451	002239	奥特佳	16,400	41,000.00	0.08
452	600602	云赛智联	4,700	40,937.00	0.08
453	300369	绿盟科技	4,000	40,840.00	0.08
454	688106	金宏气体	2,172	40,746.72	0.08
455	002550	千红制药	6,500	40,690.00	0.08
456	600675	中华企业	13,200	40,656.00	0.08
457	603363	傲农生物	3,150	40,603.50	0.08
458	300613	富瀚微	808	40,505.04	0.08
459	000851	高鸿股份	8,400	40,404.00	0.08

460	600075	新疆天业	7,380	40,368.60	0.08
461	000969	安泰科技	5,200	40,300.00	0.08
462	300401	花园生物	2,800	40,292.00	0.08
463	002217	合力泰	15,800	40,290.00	0.08
464	600729	重庆百货	1,700	40,205.00	0.08
465	300841	康华生物	475	40,194.50	0.08
466	002498	汉缆股份	9,600	40,128.00	0.08
467	603728	鸣志电器	1,200	39,996.00	0.08
468	002453	华软科技	3,800	39,900.00	0.08
469	000848	承德露露	4,700	39,856.00	0.08
470	600812	华北制药	6,200	39,680.00	0.08
471	300131	英唐智控	8,200	39,606.00	0.08
472	603985	恒润股份	1,600	39,520.00	0.08
473	300180	华峰超纤	10,200	39,372.00	0.08
474	600750	江中药业	2,720	39,304.00	0.08
475	300027	华谊兄弟	14,100	39,198.00	0.08
476	600223	鲁商发展	3,700	39,183.00	0.08
477	300799	左江科技	300	39,108.00	0.08
478	603919	金徽酒	1,460	39,055.00	0.08
479	601028	玉龙股份	3,400	39,032.00	0.08
480	600770	综艺股份	5,600	38,976.00	0.08
481	000688	国城矿业	2,400	38,904.00	0.08
482	000727	冠捷科技	19,700	38,809.00	0.08
483	000555	神州信息	3,600	38,772.00	0.08
484	002222	福晶科技	2,450	38,759.00	0.08
485	002234	民和股份	2,000	38,680.00	0.08
486	603368	柳药集团	2,070	38,646.90	0.08
487	600612	老凤祥	900	38,520.00	0.08
488	300770	新媒股份	1,020	38,413.20	0.08
489	002421	达实智能	11,100	38,406.00	0.08
490	002639	雪人股份	4,500	38,250.00	0.08
491	688798	艾为电子	400	38,212.00	0.08
492	300303	聚飞光电	9,740	38,180.80	0.08
493	600073	上海梅林	4,800	38,160.00	0.08
494	600072	中船科技	3,200	38,080.00	0.08
495	603187	海容冷链	1,200	38,064.00	0.08
496	603301	振德医疗	1,000	38,050.00	0.08
497	000672	上峰水泥	3,560	38,020.80	0.08
498	600552	凯盛科技	4,100	37,884.00	0.08
499	300055	万邦达	4,700	37,882.00	0.08
500	603018	华设集团	4,988	37,809.04	0.08
501	002581	未名医药	2,400	37,800.00	0.08
502	000603	盛达资源	3,000	37,680.00	0.08

503	300639	凯普生物	2,229	37,558.65	0.08
504	300326	凯利泰	5,200	37,440.00	0.08
505	600789	鲁抗医药	5,140	37,316.40	0.08
506	002545	东方铁塔	4,500	37,305.00	0.08
507	601963	重庆银行	5,500	37,290.00	0.08
508	300119	瑞普生物	2,000	37,220.00	0.08
509	000615	奥园美谷	4,500	37,170.00	0.08
509	605090	九丰能源	1,800	37,170.00	0.08
510	000966	长源电力	8,000	37,040.00	0.08
511	000913	钱江摩托	2,000	36,960.00	0.08
512	002043	兔宝宝	3,400	36,924.00	0.08
513	600360	华微电子	5,600	36,904.00	0.08
514	300358	楚天科技	2,500	36,875.00	0.08
515	688278	特宝生物	947	36,866.71	0.08
516	000543	皖能电力	8,200	36,736.00	0.08
517	603936	博敏电子	3,000	36,660.00	0.08
518	600649	城投控股	9,200	36,616.00	0.08
519	000927	中国铁物	13,100	36,549.00	0.08
520	000016	深康佳 A	8,100	36,531.00	0.08
521	002023	海特高新	4,400	36,388.00	0.07
522	000718	苏宁环球	11,000	36,300.00	0.07
523	002201	正威新材	2,812	36,274.80	0.07
524	002440	闰土股份	4,996	36,221.00	0.07
525	688676	金盘科技	1,000	36,180.00	0.07
526	000028	国药一致	1,100	36,179.00	0.07
527	300377	赢时胜	4,400	36,124.00	0.07
528	688198	佰仁医疗	280	36,120.00	0.07
529	002741	光华科技	2,000	36,100.00	0.07
530	300287	飞利信	10,400	36,088.00	0.07
531	000811	冰轮环境	3,250	36,075.00	0.07
532	600995	南网储能	2,500	36,050.00	0.07
533	600125	铁龙物流	6,600	36,036.00	0.07
534	603766	隆鑫通用	7,400	35,964.00	0.07
535	002158	汉钟精机	1,500	35,925.00	0.07
536	600742	一汽富维	4,296	35,914.56	0.07
537	603801	志邦家居	1,336	35,911.68	0.07
538	002589	瑞康医药	8,700	35,844.00	0.07
539	603636	南威软件	2,600	35,724.00	0.07
540	000935	四川双马	1,700	35,700.00	0.07
541	603583	捷昌驱动	1,392	35,579.52	0.07
542	603566	普莱柯	1,300	35,568.00	0.07
543	000539	粤电力 A	6,400	35,520.00	0.07
544	300355	蒙草生态	11,600	35,496.00	0.07

545	600108	亚盛集团	11,300	35,482.00	0.07
546	002428	云南锗业	3,800	35,416.00	0.07
547	600172	黄河旋风	7,300	35,332.00	0.07
548	688166	博瑞医药	1,565	35,322.05	0.07
549	600864	哈投股份	7,500	35,250.00	0.07
550	002967	广电计量	2,100	35,238.00	0.07
551	002206	海利得	5,900	35,223.00	0.07
552	688027	国盾量子	344	35,036.40	0.07
553	688776	国光电气	200	35,016.00	0.07
554	600169	太原重工	14,700	34,986.00	0.07
555	000036	华联控股	8,610	34,870.50	0.07
556	300232	洲明科技	6,348	34,850.52	0.07
557	002218	拓日新能	7,200	34,776.00	0.07
558	002549	凯美特气	2,300	34,753.00	0.07
559	002488	金固股份	5,750	34,730.00	0.07
560	601528	瑞丰银行	5,500	34,705.00	0.07
561	002088	鲁阳节能	1,500	34,680.00	0.07
562	300663	科蓝软件	2,650	34,662.00	0.07
563	605168	三人行	389	34,609.33	0.07
564	688789	宏华数科	200	34,526.00	0.07
565	301219	腾远钴业	500	34,465.00	0.07
566	300653	正海生物	800	34,400.00	0.07
567	600523	贵航股份	1,760	34,390.40	0.07
568	000676	智度股份	6,500	34,385.00	0.07
569	300406	九强生物	2,100	34,377.00	0.07
570	300761	立华股份	1,000	34,250.00	0.07
571	300319	麦捷科技	4,400	34,232.00	0.07
572	002351	漫步者	3,850	34,188.00	0.07
573	300352	北信源	8,375	34,170.00	0.07
574	688508	芯朋微	527	34,154.87	0.07
575	002759	天际股份	2,100	34,083.00	0.07
576	002746	仙坛股份	3,715	34,029.40	0.07
577	688733	壹石通	900	33,903.00	0.07
578	600480	凌云股份	3,980	33,869.80	0.07
579	002190	成飞集成	1,300	33,865.00	0.07
580	002481	双塔食品	5,400	33,804.00	0.07
581	000976	华铁股份	9,200	33,764.00	0.07
582	603896	寿仙谷	850	33,711.00	0.07
583	300366	创意信息	3,500	33,670.00	0.07
583	600420	国药现代	3,700	33,670.00	0.07
584	002293	罗莱生活	3,000	33,660.00	0.07
585	601011	宝泰隆	9,700	33,659.00	0.07
586	002810	山东赫达	1,500	33,630.00	0.07

587	600490	鹏欣资源	11,200	33,600.00	0.07
588	688148	芳源股份	2,300	33,557.00	0.07
589	002697	红旗连锁	5,940	33,442.20	0.07
590	000901	航天科技	4,093	33,398.88	0.07
591	688578	艾力斯	1,697	33,396.96	0.07
592	603995	甬金股份	1,200	33,396.00	0.07
593	002108	沧州明珠	7,242	33,385.62	0.07
594	603396	金辰股份	400	33,296.00	0.07
595	600955	维远股份	1,600	33,232.00	0.07
596	300031	宝通科技	2,400	33,192.00	0.07
597	601619	嘉泽新能	8,800	33,176.00	0.07
598	300208	青岛中程	3,250	33,150.00	0.07
599	688158	优刻得	2,646	33,101.46	0.07
600	300953	震裕科技	400	33,060.00	0.07
601	600284	浦东建设	4,900	33,026.00	0.07
602	000088	盐田港	6,500	32,955.00	0.07
603	300696	爱乐达	1,240	32,897.20	0.07
604	601702	华峰铝业	2,200	32,890.00	0.07
605	300102	乾照光电	5,200	32,864.00	0.07
606	600531	豫光金铅	6,300	32,823.00	0.07
607	300271	华宇软件	4,800	32,784.00	0.07
608	002310	东方园林	15,600	32,760.00	0.07
608	603171	税友股份	900	32,760.00	0.07
609	000989	九芝堂	3,705	32,641.05	0.07
610	300263	隆华科技	4,600	32,568.00	0.07
610	600643	爱建集团	5,900	32,568.00	0.07
611	603105	芯能科技	2,200	32,406.00	0.07
612	601929	吉视传媒	16,700	32,398.00	0.07
613	002194	武汉凡谷	3,500	32,235.00	0.07
614	002646	天佑德酒	2,100	32,130.00	0.07
615	300007	汉威科技	1,900	32,110.00	0.07
616	603489	八方股份	300	32,097.00	0.07
617	600776	东方通信	3,500	32,060.00	0.07
618	603609	禾丰股份	2,700	31,968.00	0.07
619	300267	尔康制药	9,000	31,950.00	0.07
620	600657	信达地产	6,200	31,868.00	0.07
621	002930	宏川智慧	1,658	31,833.60	0.07
622	688686	奥普特	241	31,812.00	0.07
623	000795	英洛华	4,900	31,801.00	0.07
624	002135	东南网架	5,100	31,773.00	0.07
625	300477	合纵科技	6,260	31,675.60	0.07
626	300900	广联航空	1,100	31,603.00	0.06
627	600395	盘江股份	4,700	31,584.00	0.06

628	002106	莱宝高科	4,100	31,488.00	0.06
629	000612	焦作万方	6,000	31,320.00	0.06
630	002645	华宏科技	2,100	31,311.00	0.06
631	600017	日照港	11,100	31,302.00	0.06
632	002777	久远银海	2,086	31,290.00	0.06
633	002979	雷赛智能	1,380	31,201.80	0.06
634	600997	开滦股份	4,600	31,188.00	0.06
635	002987	京北方	1,168	31,057.12	0.06
636	688568	中科星图	500	31,020.00	0.06
637	000498	山东路桥	4,500	30,915.00	0.06
638	600211	西藏药业	860	30,891.20	0.06
639	002635	安洁科技	2,500	30,875.00	0.06
640	000557	西部创业	6,300	30,870.00	0.06
641	688356	键凯科技	197	30,840.35	0.06
642	600971	恒源煤电	4,300	30,788.00	0.06
643	603010	万盛股份	2,600	30,758.00	0.06
644	300738	奥飞数据	3,476	30,623.56	0.06
645	300284	苏交科	5,452	30,531.20	0.06
646	000968	蓝焰控股	3,500	30,415.00	0.06
647	300123	亚光科技	5,140	30,377.40	0.06
648	300821	东岳硅材	2,600	30,368.00	0.06
649	300894	火星人	1,200	30,336.00	0.06
650	600751	海航科技	13,000	30,290.00	0.06
651	000652	泰达股份	7,500	30,225.00	0.06
652	600391	航发科技	1,700	30,209.00	0.06
653	300149	睿智医药	2,900	30,189.00	0.06
653	600775	南京熊猫	2,900	30,189.00	0.06
654	603959	百利科技	2,856	30,187.92	0.06
655	002055	得润电子	3,500	30,170.00	0.06
656	002449	国星光电	3,630	30,165.30	0.06
657	600508	上海能源	2,100	30,093.00	0.06
658	600103	青山纸业	13,370	30,082.50	0.06
659	000065	北方国际	3,642	30,046.50	0.06
660	000560	我爱我家	11,980	29,950.00	0.06
661	002274	华昌化工	4,100	29,889.00	0.06
662	002614	奥佳华	3,200	29,856.00	0.06
663	600662	外服控股	5,000	29,850.00	0.06
664	002292	奥飞娱乐	6,400	29,824.00	0.06
665	600984	建设机械	5,460	29,811.60	0.06
666	603169	兰石重装	4,700	29,798.00	0.06
667	002314	南山控股	7,800	29,796.00	0.06
668	603520	司太立	1,520	29,746.40	0.06
669	001696	宗申动力	5,000	29,700.00	0.06

670	603915	国茂股份	1,420	29,592.80	0.06
671	600331	宏达股份	10,300	29,561.00	0.06
672	600163	中闽能源	5,500	29,535.00	0.06
673	600217	中再资环	6,000	29,520.00	0.06
674	000789	万年青	3,450	29,463.00	0.06
675	603033	三维股份	1,700	29,342.00	0.06
676	300659	中孚信息	1,100	29,337.00	0.06
677	300709	精研科技	1,040	29,317.60	0.06
678	603466	风语筑	2,163	29,265.39	0.06
679	688366	昊海生科	300	29,262.00	0.06
680	600810	神马股份	3,760	29,215.20	0.06
681	601609	金田股份	4,300	29,068.00	0.06
682	002204	大连重工	5,600	29,064.00	0.06
683	300723	一品红	840	29,047.20	0.06
684	002768	国恩股份	1,000	29,020.00	0.06
685	603989	艾华集团	1,130	29,018.40	0.06
686	300755	华致酒行	940	29,017.80	0.06
687	300184	力源信息	6,740	28,982.00	0.06
688	002285	世联行	8,800	28,952.00	0.06
689	002489	浙江永强	7,900	28,914.00	0.06
690	002573	清新环境	5,200	28,912.00	0.06
691	603666	亿嘉和	908	28,865.32	0.06
692	002034	旺能环境	1,600	28,864.00	0.06
693	601882	海天精工	1,100	28,820.00	0.06
694	300222	科大智能	4,520	28,702.00	0.06
695	000801	四川九洲	4,400	28,688.00	0.06
696	300143	盈康生命	2,800	28,476.00	0.06
697	002051	中工国际	3,600	28,332.00	0.06
698	002307	北新路桥	5,500	28,325.00	0.06
699	002733	雄韬股份	1,650	28,297.50	0.06
700	002226	江南化工	5,760	28,224.00	0.06
701	002437	誉衡药业	11,100	28,194.00	0.06
702	603113	金能科技	3,100	28,117.00	0.06
703	600876	洛阳玻璃	1,400	28,056.00	0.06
704	603387	基蛋生物	2,242	28,025.00	0.06
705	000061	农产品	4,900	27,930.00	0.06
706	600308	华泰股份	5,500	27,885.00	0.06
707	603229	奥翔药业	1,168	27,798.40	0.06
708	000567	海德股份	1,995	27,770.40	0.06
709	603881	数据港	1,180	27,765.40	0.06
710	600639	浦东金桥	2,500	27,750.00	0.06
711	002283	天润工业	5,800	27,724.00	0.06
712	002097	山河智能	4,700	27,683.00	0.06

713	001213	中铁特货	6,400	27,648.00	0.06
714	600746	江苏索普	3,400	27,608.00	0.06
715	603938	三孚股份	800	27,600.00	0.06
716	300397	天和防务	2,980	27,594.80	0.06
717	002950	奥美医疗	2,250	27,562.50	0.06
718	002929	润建股份	700	27,482.00	0.06
719	603060	国检集团	2,122	27,373.80	0.06
720	002251	步步高	3,800	27,322.00	0.06
721	688586	江航装备	1,676	27,318.80	0.06
722	600783	鲁信创投	2,200	27,302.00	0.06
723	000600	建投能源	5,200	27,300.00	0.06
724	300657	弘信电子	2,480	27,255.20	0.06
725	600575	淮河能源	11,300	27,233.00	0.06
726	603416	信捷电气	600	27,192.00	0.06
727	000928	中钢国际	4,620	27,165.60	0.06
728	600990	四创电子	910	27,118.00	0.06
729	688018	乐鑫科技	300	27,045.00	0.06
730	601606	长城军工	2,600	27,040.00	0.06
731	603118	共进股份	3,400	27,030.00	0.06
732	002243	力合科创	3,500	27,020.00	0.06
733	600691	阳煤化工	8,600	27,004.00	0.06
734	000828	东莞控股	3,000	26,910.00	0.06
735	688100	威胜信息	1,164	26,876.76	0.06
736	002302	西部建设	3,700	26,825.00	0.06
737	601015	陕西黑猫	5,900	26,786.00	0.06
738	000048	京基智农	1,500	26,775.00	0.06
739	003012	东鹏控股	3,400	26,724.00	0.05
740	300607	拓斯达	1,836	26,713.80	0.05
741	600058	五矿发展	3,100	26,691.00	0.05
742	300177	中海达	4,350	26,665.50	0.05
743	002425	凯撒文化	5,580	26,505.00	0.05
744	000597	东北制药	4,200	26,502.00	0.05
745	002320	海峡股份	4,800	26,400.00	0.05
746	000507	珠海港	4,700	26,367.00	0.05
747	002215	诺普信	5,000	26,350.00	0.05
748	000881	中广核技	3,400	26,282.00	0.05
749	002367	康力电梯	3,500	26,250.00	0.05
750	301015	百洋医药	1,100	26,224.00	0.05
751	600114	东睦股份	3,080	26,180.00	0.05
752	600458	时代新材	2,900	26,158.00	0.05
753	300856	科思股份	500	26,075.00	0.05
754	002516	旷达科技	5,300	25,970.00	0.05
755	000950	重药控股	5,100	25,908.00	0.05

756	300130	新国都	2,140	25,829.80	0.05
757	600835	上海机电	2,300	25,806.00	0.05
758	002815	崇达技术	2,600	25,766.00	0.05
759	002611	东方精工	6,340	25,740.40	0.05
760	300740	水羊股份	1,700	25,704.00	0.05
761	603108	润达医疗	2,540	25,679.40	0.05
762	002461	珠江啤酒	3,200	25,632.00	0.05
762	600929	雪天盐业	3,200	25,632.00	0.05
763	300266	兴源环境	8,000	25,600.00	0.05
764	601886	江河集团	3,300	25,542.00	0.05
765	300702	天宇股份	1,000	25,520.00	0.05
766	301039	中集车辆	3,200	25,504.00	0.05
767	000903	云内动力	10,000	25,500.00	0.05
767	603567	珍宝岛	2,000	25,500.00	0.05
768	688330	宏力达	400	25,472.00	0.05
769	002803	吉宏股份	1,600	25,344.00	0.05
770	688233	神工股份	621	25,336.80	0.05
771	300206	理邦仪器	2,100	25,263.00	0.05
772	600604	市北高新	5,100	25,194.00	0.05
773	603429	集友股份	2,308	25,111.04	0.05
774	300792	壹网壹创	900	25,110.00	0.05
775	603916	苏博特	1,560	25,084.80	0.05
776	000823	超声电子	2,700	25,083.00	0.05
777	002017	东信和平	1,900	24,985.00	0.05
778	600449	宁夏建材	2,100	24,927.00	0.05
779	600696	岩石股份	1,000	24,880.00	0.05
780	600335	国机汽车	3,200	24,832.00	0.05
781	301069	凯盛新材	900	24,822.00	0.05
782	301238	瑞泰新材	1,100	24,739.00	0.05
783	603025	大豪科技	1,300	24,700.00	0.05
784	600550	保变电气	5,300	24,645.00	0.05
785	300735	光弘科技	2,766	24,562.08	0.05
786	002891	中宠股份	1,100	24,541.00	0.05
787	605222	起帆电缆	900	24,516.00	0.05
788	001270	铖昌科技	200	24,400.00	0.05
788	300634	彩讯股份	1,600	24,400.00	0.05
789	601686	友发集团	4,100	24,354.00	0.05
790	600105	永鼎股份	7,140	24,347.40	0.05
791	300768	迪普科技	1,850	24,346.00	0.05
792	688085	三友医疗	877	24,336.75	0.05
793	688526	科前生物	1,083	24,259.20	0.05
794	300205	天喻信息	2,200	24,200.00	0.05
795	300085	银之杰	2,600	24,180.00	0.05

796	002782	可立克	1,400	24,108.00	0.05
797	300191	潜能恒信	1,400	24,010.00	0.05
798	000566	海南海药	5,600	23,912.00	0.05
799	601069	西部黄金	2,000	23,780.00	0.05
800	688315	诺禾致源	900	23,751.00	0.05
801	600007	中国国贸	1,500	23,745.00	0.05
802	000813	德展健康	6,400	23,744.00	0.05
803	601921	浙版传媒	3,200	23,680.00	0.05
804	601588	北辰实业	11,600	23,664.00	0.05
805	301060	兰卫医学	1,200	23,532.00	0.05
806	603601	再升科技	4,440	23,443.20	0.05
807	603328	依顿电子	3,600	23,364.00	0.05
808	300846	首都在线	2,400	23,352.00	0.05
809	002941	新疆交建	1,900	23,332.00	0.05
810	600565	迪马股份	10,800	23,328.00	0.05
811	300423	昇辉科技	2,500	23,325.00	0.05
812	002833	弘亚数控	1,884	23,229.72	0.05
813	603533	掌阅科技	1,600	23,184.00	0.05
814	002534	西子洁能	1,600	23,168.00	0.05
815	601827	三峰环境	3,600	23,148.00	0.05
816	300091	金通灵	6,520	23,146.00	0.05
817	300204	舒泰神	1,700	23,120.00	0.05
818	002267	陕天然气	3,200	23,072.00	0.05
819	600748	上实发展	6,700	23,048.00	0.05
820	002838	道恩股份	1,300	22,984.00	0.05
821	603299	苏盐井神	2,300	22,931.00	0.05
822	300579	数字认证	950	22,923.50	0.05
823	002991	甘源食品	300	22,887.00	0.05
824	601515	东风股份	5,320	22,876.00	0.05
825	688660	电气风电	3,800	22,838.00	0.05
826	300527	中船应急	3,443	22,827.09	0.05
827	000958	电投产融	5,100	22,746.00	0.05
828	003040	楚天龙	1,300	22,672.00	0.05
829	688277	天智航	1,905	22,650.45	0.05
830	000030	富奥股份	5,100	22,440.00	0.05
831	603718	海利生物	2,285	22,438.70	0.05
832	002042	华孚时尚	7,350	22,417.50	0.05
833	600710	苏美达	3,800	22,344.00	0.05
834	301217	铜冠铜箔	1,800	22,302.00	0.05
835	605338	巴比食品	700	22,211.00	0.05
836	600581	八一钢铁	5,600	22,176.00	0.05
837	603208	江山欧派	360	22,104.00	0.05
838	000601	韶能股份	4,700	22,090.00	0.05

839	300114	中航电测	2,150	22,059.00	0.05
840	603920	世运电路	1,530	22,001.40	0.05
841	603730	岱美股份	1,365	21,949.20	0.05
842	600874	创业环保	3,600	21,924.00	0.05
843	300080	易成新能	4,700	21,902.00	0.05
844	603313	梦百合	2,061	21,846.60	0.04
845	300134	大富科技	2,800	21,728.00	0.04
846	301089	拓新药业	300	21,600.00	0.04
847	688389	普门科技	1,211	21,592.13	0.04
848	002344	海宁皮城	4,600	21,574.00	0.04
849	002662	京威股份	6,500	21,385.00	0.04
850	600590	泰豪科技	3,660	21,264.60	0.04
851	300602	飞荣达	1,469	21,138.91	0.04
852	605369	拱东医疗	200	21,122.00	0.04
853	301236	软通动力	600	21,108.00	0.04
854	002605	姚记科技	1,500	21,075.00	0.04
855	300328	宜安科技	3,520	21,049.60	0.04
856	002918	蒙娜丽莎	1,170	21,036.60	0.04
857	002435	长江健康	4,500	21,015.00	0.04
858	601700	风范股份	4,100	20,951.00	0.04
859	001258	立新能源	2,000	20,920.00	0.04
860	688161	威高骨科	400	20,876.00	0.04
861	002695	煌上煌	1,500	20,820.00	0.04
862	300765	新诺威	1,318	20,798.04	0.04
863	605009	豪悦护理	400	20,748.00	0.04
864	003032	传智教育	1,200	20,712.00	0.04
865	000791	甘肃电投	3,920	20,697.60	0.04
866	600400	红豆股份	5,000	20,600.00	0.04
867	300842	帝科股份	400	20,556.00	0.04
868	000710	贝瑞基因	1,800	20,538.00	0.04
868	301080	百普赛斯	200	20,538.00	0.04
869	300183	东软载波	1,700	20,485.00	0.04
870	000910	大亚圣象	2,400	20,448.00	0.04
871	300867	圣元环保	1,200	20,436.00	0.04
872	603337	杰克股份	1,072	20,410.88	0.04
873	002993	奥海科技	600	20,406.00	0.04
874	002677	浙江美大	1,840	20,387.20	0.04
875	300485	赛升药业	1,700	20,366.00	0.04
876	000517	荣安地产	6,900	20,355.00	0.04
877	300276	三丰智能	6,080	20,307.20	0.04
878	600184	光电股份	1,800	20,160.00	0.04
879	000550	江铃汽车	1,500	20,145.00	0.04
880	301216	万凯新材	700	20,076.00	0.04

881	000737	北方铜业	3,900	20,046.00	0.04
882	002978	安宁股份	600	20,016.00	0.04
883	601949	中国出版	4,000	19,960.00	0.04
884	688127	蓝特光学	1,251	19,928.43	0.04
885	603068	博通集成	700	19,922.00	0.04
886	300439	美康生物	1,700	19,890.00	0.04
887	600510	黑牡丹	3,000	19,800.00	0.04
888	002664	信质集团	1,500	19,635.00	0.04
889	601330	绿色动力	2,900	19,633.00	0.04
890	300887	谱尼测试	600	19,566.00	0.04
891	603960	克来机电	1,100	19,503.00	0.04
892	301175	中科环保	3,200	19,424.00	0.04
893	300783	三只松鼠	900	19,323.00	0.04
894	300455	康拓红外	2,600	19,266.00	0.04
895	003021	兆威机电	400	19,228.00	0.04
896	603055	台华新材	1,900	19,190.00	0.04
897	300872	天阳科技	1,480	19,136.40	0.04
898	002378	章源钨业	2,700	19,008.00	0.04
899	688383	新益昌	200	18,976.00	0.04
900	301177	迪阿股份	300	18,894.00	0.04
901	000025	特力 A	1,100	18,865.00	0.04
902	600548	深高速	2,100	18,858.00	0.04
903	002232	启明信息	1,500	18,855.00	0.04
904	300255	常山药业	3,400	18,632.00	0.04
905	603877	太平鸟	1,000	18,390.00	0.04
906	300791	仙乐健康	500	18,385.00	0.04
907	301087	可孚医疗	500	18,240.00	0.04
908	002959	小熊电器	300	18,096.00	0.04
909	605388	均瑶健康	1,200	18,048.00	0.04
910	000019	深粮控股	2,400	18,024.00	0.04
911	000885	城发环境	1,900	17,993.00	0.04
912	300318	博晖创新	3,000	17,550.00	0.04
913	688399	硕世生物	200	17,542.00	0.04
914	000011	深物业 A	1,500	17,385.00	0.04
915	002946	新乳业	1,300	17,199.00	0.04
916	600569	安阳钢铁	8,300	17,181.00	0.04
917	002913	奥士康	700	17,059.00	0.04
918	300219	鸿利智汇	2,550	17,034.00	0.04
919	600841	动力新科	2,800	16,996.00	0.03
920	600370	三房巷	5,600	16,968.00	0.03
921	605007	五洲特纸	900	16,965.00	0.03
922	605136	丽人丽妆	1,200	16,776.00	0.03
923	603297	永新光学	200	16,602.00	0.03

924	000058	深赛格	2,100	16,590.00	0.03
925	003006	百亚股份	1,200	16,572.00	0.03
926	603439	贵州三力	1,200	16,464.00	0.03
927	002990	盛视科技	600	16,458.00	0.03
928	603693	江苏新能	1,270	16,421.10	0.03
929	002636	金安国纪	2,100	16,359.00	0.03
930	300590	移为通信	1,660	16,284.60	0.03
931	600403	大有能源	3,500	16,135.00	0.03
932	000761	本钢板材	5,400	15,930.00	0.03
933	002641	公元股份	3,600	15,840.00	0.03
934	603013	亚普股份	1,100	15,763.00	0.03
935	600618	氯碱化工	1,600	15,728.00	0.03
936	300860	锋尚文化	300	15,609.00	0.03
937	301206	三元生物	400	15,600.00	0.03
938	603610	麒盛科技	1,292	15,568.60	0.03
939	300942	易瑞生物	900	15,426.00	0.03
940	603258	电魂网络	700	15,309.00	0.03
941	003039	顺控发展	900	15,219.00	0.03
942	301268	铭利达	300	15,063.00	0.03
943	300215	电科院	2,700	14,877.00	0.03
944	688268	华特气体	200	14,850.00	0.03
945	605008	长鸿高科	900	14,679.00	0.03
946	605199	葫芦娃	900	14,418.00	0.03
947	002651	利君股份	2,200	14,388.00	0.03
948	300616	尚品宅配	720	14,140.80	0.03
949	301090	华润材料	1,400	14,084.00	0.03
950	002724	海洋王	1,700	13,736.00	0.03
951	300127	银河磁体	900	13,671.00	0.03
952	605339	南侨食品	600	13,650.00	0.03
953	300829	金丹科技	620	13,522.20	0.03
954	600935	华塑股份	3,000	13,500.00	0.03
955	301207	华兰疫苗	300	13,374.00	0.03
956	002961	瑞达期货	1,000	13,330.00	0.03
957	688699	明微电子	290	13,308.10	0.03
958	603071	物产环能	800	12,944.00	0.03
959	688318	财富趋势	140	12,481.00	0.03
960	001308	康冠科技	400	12,416.00	0.03
961	600903	贵州燃气	1,600	12,400.00	0.03
962	300981	中红医疗	640	12,019.20	0.02
963	603053	成都燃气	1,300	11,895.00	0.02
964	603093	南华期货	1,300	11,843.00	0.02
965	003009	中天火箭	300	11,835.00	0.02
966	301200	大族数控	300	11,760.00	0.02

967	605296	神农集团	460	11,513.80	0.02
968	002287	奇正藏药	500	11,425.00	0.02
969	688368	晶丰明源	100	11,170.00	0.02
970	688001	华兴源创	400	10,760.00	0.02
971	300815	玉禾田	700	10,661.00	0.02
972	002911	佛燃能源	880	10,551.20	0.02
973	601068	中铝国际	2,200	10,362.00	0.02
974	688128	中国电研	600	10,248.00	0.02
975	688788	科思科技	280	10,105.20	0.02
976	001323	慕思股份	300	9,936.00	0.02
977	603132	金徽股份	800	9,576.00	0.02
978	002975	博杰股份	300	9,501.00	0.02
979	688739	成大生物	300	9,126.00	0.02
980	603530	神马电力	600	9,006.00	0.02
981	603235	天新药业	300	8,736.00	0.02
982	603103	横店影视	580	8,549.20	0.02
983	603170	宝立食品	300	8,499.00	0.02
984	301078	孩子王	600	7,770.00	0.02
985	601279	英利汽车	1,500	7,530.00	0.02
986	605365	立达信	400	6,432.00	0.01
987	301180	万祥科技	300	4,935.00	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部分的股票投资。

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	002405	四维图新	347,385.00	0.65
2	002176	江特电机	311,429.00	0.58
3	002240	盛新锂能	278,039.00	0.52
4	688063	派能科技	270,720.17	0.50
5	002738	中矿资源	253,346.00	0.47
6	688516	奥特维	235,109.31	0.44
7	300568	星源材质	234,448.00	0.44
8	601099	太平洋	229,317.00	0.43
9	002432	九安医疗	225,584.00	0.42
10	603606	东方电缆	222,182.00	0.41
11	600873	梅花生物	220,718.00	0.41
12	002192	融捷股份	212,785.00	0.40
13	002472	双环传动	203,602.00	0.38
14	688116	天奈科技	199,686.14	0.37

15	601677	明泰铝业	196,337.00	0.37
16	000422	湖北宜化	194,847.00	0.36
17	000933	神火股份	192,240.00	0.36
18	300438	鹏辉能源	188,832.00	0.35
19	600872	中炬高新	187,071.00	0.35
20	000683	远兴能源	185,525.00	0.35

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	300568	星源材质	425,091.64	0.79
2	002738	中矿资源	415,555.60	0.77
3	603606	东方电缆	382,432.00	0.71
4	600873	梅花生物	359,012.00	0.67
5	002192	融捷股份	357,267.00	0.67
6	300012	华测检测	340,232.00	0.63
7	688116	天奈科技	332,515.01	0.62
8	000683	远兴能源	322,613.80	0.60
9	688063	派能科技	318,889.60	0.59
10	002497	雅化集团	318,856.00	0.59
11	603688	石英股份	312,562.00	0.58
12	002240	盛新锂能	300,779.00	0.56
13	600096	云天化	290,614.00	0.54
14	002025	航天电器	278,994.00	0.52
15	002850	科达利	275,353.00	0.51
16	002176	江特电机	270,777.00	0.50
17	300769	德方纳米	269,205.70	0.50
18	300604	长川科技	246,754.40	0.46
19	000591	太阳能	245,881.60	0.46
20	300073	当升科技	240,658.00	0.45

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	61,398,896.60
卖出股票收入（成交）总额	54,652,863.38

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 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

华宝中证 1000 指数截止 2022 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的江西特种电机股份有限公司因 2017 年至 2018 年期间，江特电机间接控股子公司宜春银锂新能源有限责任公司（以下简称宜春银锂）通过与其相关客户开展无实物流转的虚构交易，虚增营业收入、存货和利润；于 2022 年 9 月 15 日收到江西证监局对江西特种电机股份有限公司责令改正，给予警告，并处以六十万元的罚款的处罚决定。

华宝中证 1000 指数截止 2022 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的河南神火煤电股份有限公司因未履行信披义务，重大事项信息披露不及时或违规，于 2022 年 9 月 28 日收到河南证监局对神火股份、李宏伟、李仲远、吴长伟采取出具警示函的行政监管措施，并记入证券期货市场诚信档案的处罚决定。

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

开谴责、处罚的情况。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票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	199,246.28
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	36,456.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	235,702.65

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部分的股票投资。

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

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	3,767	11,280.07	7,259,131.34	17.08	35,232,888.67	82.92

华宝中证 1000 指数 C	203	44,448.44	7,900,903.50	87.56	1,122,130.18	12.44
合计	3,970	12,976.08	15,160,034.84	29.43	36,355,018.85	70.57

9.2 期末上市基金前十名持有人

华宝中证 1000 指数

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	傅文琪	456,537.00	35.64
2	祝东华	100,540.00	7.85
3	杨玉锋	79,623.00	6.22
4	李粤闽	62,895.00	4.91
5	陈秀萍	41,846.00	3.27
6	张绍桓	36,509.00	2.85
7	孙大威	35,466.00	2.77
8	史海涛	28,331.00	2.21
9	杨应该	26,181.00	2.04
10	王跃文	25,681.00	2.00

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	华宝中证 1000 指数	0.00	0.0000
	华宝中证 1000 指数 C	935.45	0.0104
	合计	935.45	0.0018

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝中证 1000 指数	华宝中证 1000 指数 C
基金合同生效日 (2020 年 11 月 19)	41,884,507.09	-

日) 基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	44,943,274.25	-
本报告期基金总申购份额	34,701,601.07	31,319,767.48
减: 本报告期基金总赎回份额	37,152,855.31	22,296,733.80
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	42,492,020.01	9,023,033.68

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内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

2022 年 4 月 18 日, 基金管理人发布高级管理人员变更公告, XIAOYI HELEN HUANG (黄小蕙) 不再担任公司总经理, 公司副总经理向辉代为履行总经理职责。

2022 年 7 月 2 日, 基金管理人发布董事长变更公告, 黄孔威担任公司董事长, 朱永红不再担任公司董事长。

2022 年 10 月 15 日, 基金管理人发布高级管理人员变更公告, 聘任向辉为公司总经理。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内, 无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

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

本报告期内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

本基金自 2022 年 12 月 23 日起更换会计师事务所, 由安永华明会计师事务所(特殊普通合伙) 更换为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。

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 17,000.00 元人民币。

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

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东方证券	2	67,468,810.24	58.17	62,833.28	58.17	-
光大证券	1	48,379,998.09	41.71	45,057.94	41.72	-
招商证券	2	100,314.20	0.09	91.43	0.08	-
国泰君安	2	24,192.00	0.02	22.05	0.02	-
华安证券	1	6,035.92	0.01	5.63	0.01	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	3	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-

红塔证券	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	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
申万宏源 西部	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金国际	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中信证券 华南	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准：资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和

中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需 要，并能为本基金提供全面的信息服 务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的 地域分散化。

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

2、本基金本报告期新增交易单元：山西证券、国融证券、东亚前海证券、粤开证券、华鑫证 券、第一创业证券、长城证券、德邦证券；退租交易单元：中信证券华南。

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

本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝中证 1000 指数证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2022-01-24
2	华宝中证 1000 指数证券投资基金 2021 年年度报告	基金管理人网站	2022-03-31
3	华宝中证 1000 指数证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2022-04-22
4	华宝基金关于旗下部分基金新增中国人寿为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2022-06-15
5	华宝基金关于旗下部分开放式基金参加建设银行定投费率优惠活动的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2022-06-17
6	华宝中证 1000 指数证券投资基金托管协议	基金管理人网站	2022-06-24
7	华宝中证 1000 指数证券投资基金基金合同	基金管理人网站	2022-06-24
8	华宝中证 1000 指数证券投资基金 (C 类份额) 基金产品资料概要 (更新)	基金管理人网站	2022-06-24
9	华宝中证 1000 指数证券投资基金 (A 类份额) 基金产品资料概要 (更新)	基金管理人网站	2022-06-24
10	华宝中证 1000 指数证券投资基金招募说明书 (更新)	基金管理人网站	2022-06-24
11	华宝基金管理有限公司关于华宝中证 1000 指数证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告	基金管理人网站, 证券日报	2022-06-24
12	华宝基金关于华宝中证 1000 指数证券投资基金 A 类新增代销机构的公告	基金管理人网站, 证券日报	2022-07-01

13	华宝基金关于华宝中证 1000 指数证券投资基金 C 类新增代销机构的公告	基金管理人网站, 证券日报	2022-07-01
14	华宝基金关于旗下部分基金新增九州证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2022-07-01
15	华宝中证 1000 指数证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	基金管理人网站	2022-07-21
16	华宝中证 1000 指数证券投资基金 2022 年中期报告	基金管理人网站	2022-08-31
17	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加泰信财富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, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2022-09-29
18	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海中正达广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, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2022-10-12
19	华宝基金关于旗下部分基金新增五矿证券有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2022-10-21
20	华宝中证 1000 指数证券投资基金招募说明书 (更新)	基金管理人网站	2022-10-22
21	华宝中证 1000 指数证券投资基金 (A 类份额) 基金产品资料概要 (更新)	基金管理人网站	2022-10-22
22	华宝中证 1000 指数证券投资基金 (C 类份额) 基金产品资料概要 (更新)	基金管理人网站	2022-10-22
23	华宝中证 1000 指数证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	基金管理人网站	2022-10-26
24	华宝基金关于旗下部分基金新增宁波银行同业易管家平台为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2022-10-31
25	华宝基金关于华宝中证 1000 指数证券投资基金 C 类新增财通证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 证券日报	2022-11-08
26	华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2022-12-24

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

		间区间					
个人	1	20220419~202 20425	0.00	16,746,9 12.29	16,746,91 2.29		0.00 0.00

产品特有风险

报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20% 的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如该投资者集中赎回，可能会增加基金的流动性风险。此外，由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产，可能对持有资产的价格形成冲击，增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于 2022 年 06 月 24 日发布华宝基金管理有限公司关于华宝中证 1000 指数证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告，具体内容详见公司公告，请投资者予以关注。

2022 年 4 月 18 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，XIAOYI HELEN HUANG（黄小蕙）不再担任公司总经理，公司副总经理向辉代为履行总经理职责。

2022 年 7 月 2 日，基金管理人发布董事长变更公告，黄孔威担任公司董事长，朱永红不再担任公司董事长。

2022 年 10 月 15 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，聘任向辉为公司总经理。

§ 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

2023 年 3 月 31 日