

万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资 基金 2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 3 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2020 年 3 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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。

本报告财务资料已经审计,立信会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 5 |
| 2.4 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 其他相关资料..... | 6 |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 7 |
| 3.2 基金净值表现..... | 8 |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况..... | 12 |
| §4 管理人报告 | 14 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 14 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 17 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 17 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明..... | 18 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 19 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况..... | 19 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 20 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 20 |
| 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..... | 21 |
| §5 托管人报告 | 22 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 22 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 22 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 22 |
| §6 审计报告 | 23 |
| 6.1 审计报告基本信息..... | 23 |
| 6.2 审计报告的基本内容..... | 23 |
| §7 年度财务报表 | 26 |
| 7.1 资产负债表..... | 26 |
| 7.2 利润表..... | 27 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 29 |
| 7.4 报表附注..... | 31 |
| §8 投资组合报告 | 60 |
| 8.1 期末基金资产组合情况..... | 60 |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 60 |
| 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..... | 62 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 72 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 115 |
| 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..... | 115 |
| 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..... | 115 |

| | | |
|------------|---|------------|
| 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 | 116 |
| 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 | 116 |
| 8.10 | 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 116 |
| 8.11 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 116 |
| 8.12 | 投资组合报告附注 | 116 |
| §9 | 基金份额持有人信息 | 118 |
| 9.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 118 |
| 9.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 118 |
| 9.3 | 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 | 119 |
| 9.4 | 发起式基金发起资金持有份额情况 | 119 |
| §10 | 开放式基金份额变动 | 120 |
| §11 | 重大事件揭示 | 121 |
| 11.1 | 基金份额持有人大会决议 | 121 |
| 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 | 121 |
| 11.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 121 |
| 11.4 | 基金投资策略的改变 | 121 |
| 11.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 121 |
| 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 | 121 |
| 11.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 121 |
| §12 | 影响投资者决策的其他重要信息 | 123 |
| 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 | 123 |
| §13 | 备查文件目录 | 124 |
| 13.1 | 备查文件目录 | 124 |
| 13.2 | 存放地点 | 124 |
| 13.3 | 查阅方式 | 124 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|--------------------------|------------------|
| 基金名称 | 万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 | |
| 基金简称 | 万家中证 1000 指数增强 | |
| 基金主代码 | 005313 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2018 年 12 月 3 日 | |
| 基金管理人 | 万家基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 22,685,000.42 份 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 万家中证 1000 指数增强 A | 万家中证 1000 指数增强 C |
| 下属分级基金的交易代码: | 005313 | 005314 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 11,199,170.60 份 | 11,485,829.82 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金为指数增强型股票基金，采取量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，在力求有效跟踪标的指数基础上，力争在控制本基金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 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | 本基金为增强型指数产品，在标的指数成份股权重基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数投资收益。 |
| 业绩比较基准 | 中证 1000 指数收益率*95%+一年期人民币定期存款利率（税后）*5% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。 |

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 | 万家基金管理有限公司 | 招商银行股份有限公司 | |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 兰剑 | 张燕 |
| | 联系电话 | 021-38909626 | 0755-83199084 |
| | 电子邮箱 | lanj@wjasset.com | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话 | 4008880800 | 95555 | |
| 传真 | 021-38909627 | 0755-83195201 | |
| 注册地址 | 中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层） | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 | |
| 办公地址 | 中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层） | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 | |
| 邮政编码 | 200122 | 518040 | |
| 法定代表人 | 方一天 | 李建红 | |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《上海证券报》 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.wjasset.com |
| 基金年度报告备置地点 | 中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）基金管理人办公场所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------------|-------------------------|
| 会计师事务所 | 立信会计师事务所（特殊普通合伙） | 上海市南京东路 61 号 4 楼新黄浦金融大厦 |
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2019 年 | | 2018 年 12 月 3 日 (基金合同生效日)-2018 年 12 月 31 日 | |
|---------------|------------------|------------------|--|------------------|
| | 万家中证 1000 指数增强 A | 万家中证 1000 指数增强 C | 万家中证 1000 指数增强 A | 万家中证 1000 指数增强 C |
| 本期已实现收益 | 4,449,479.55 | 22,351,174.93 | -20,333.98 | -1,907.31 |
| 本期利润 | 3,803,682.41 | 24,871,518.86 | -617,930.09 | -37,619.00 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.3496 | 0.5092 | -0.0727 | -0.0632 |
| 本期加权平均净值利润率 | 29.79% | 42.45% | -7.40% | -6.48% |
| 本期基金份额净值增长率 | 40.77% | 40.57% | -6.28% | -6.30% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2019 年末 | | 2018 年末 | |
| 期末可供分配利润 | 645,250.58 | 645,014.53 | -505,079.32 | -37,011.56 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0576 | 0.0562 | -0.0509 | -0.0621 |
| 期末基金资产净值 | 11,844,421.18 | 12,130,844.35 | 9,414,386.58 | 558,648.42 |
| 期末基金份额净值 | 1.0576 | 1.0562 | 0.9491 | 0.9379 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2019 年末 | | 2018 年末 | |
| 基金份额累计净值增长率 | 31.84% | 31.61% | -6.28% | -6.30% |

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)扣除相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

(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) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额, 不是当期发生数)。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家中证 1000 指数增强 A

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 10.26% | 0.95% | 6.10% | 0.96% | 4.16% | -0.01% |
| 过去六个月 | 15.00% | 1.08% | 4.46% | 1.12% | 10.54% | -0.04% |
| 过去一年 | 40.77% | 1.41% | 24.51% | 1.49% | 16.26% | -0.08% |
| 自基金合同生效起至今 | 31.84% | 1.37% | 18.97% | 1.47% | 12.87% | -0.10% |

万家中证 1000 指数增强 C

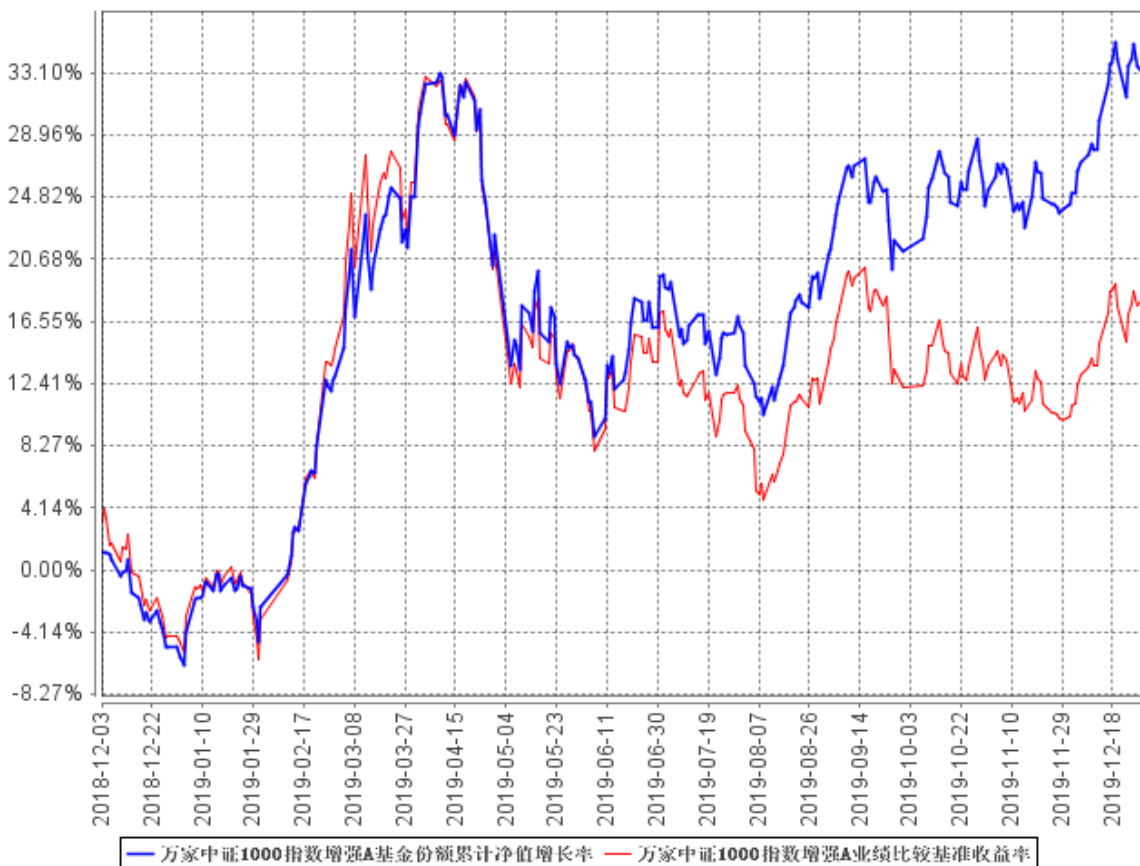
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 10.08% | 0.95% | 6.10% | 0.96% | 3.98% | -0.01% |
| 过去六个月 | 14.72% | 1.08% | 4.46% | 1.12% | 10.26% | -0.04% |
| 过去一年 | 40.57% | 1.41% | 24.51% | 1.49% | 16.06% | -0.08% |
| 自基金合同生效起至今 | 31.61% | 1.37% | 18.97% | 1.47% | 12.64% | -0.10% |

注：基金业绩比较基准增长率=中证 1000 指数收益率*95%+一年期人民币定期存款利率（税后）

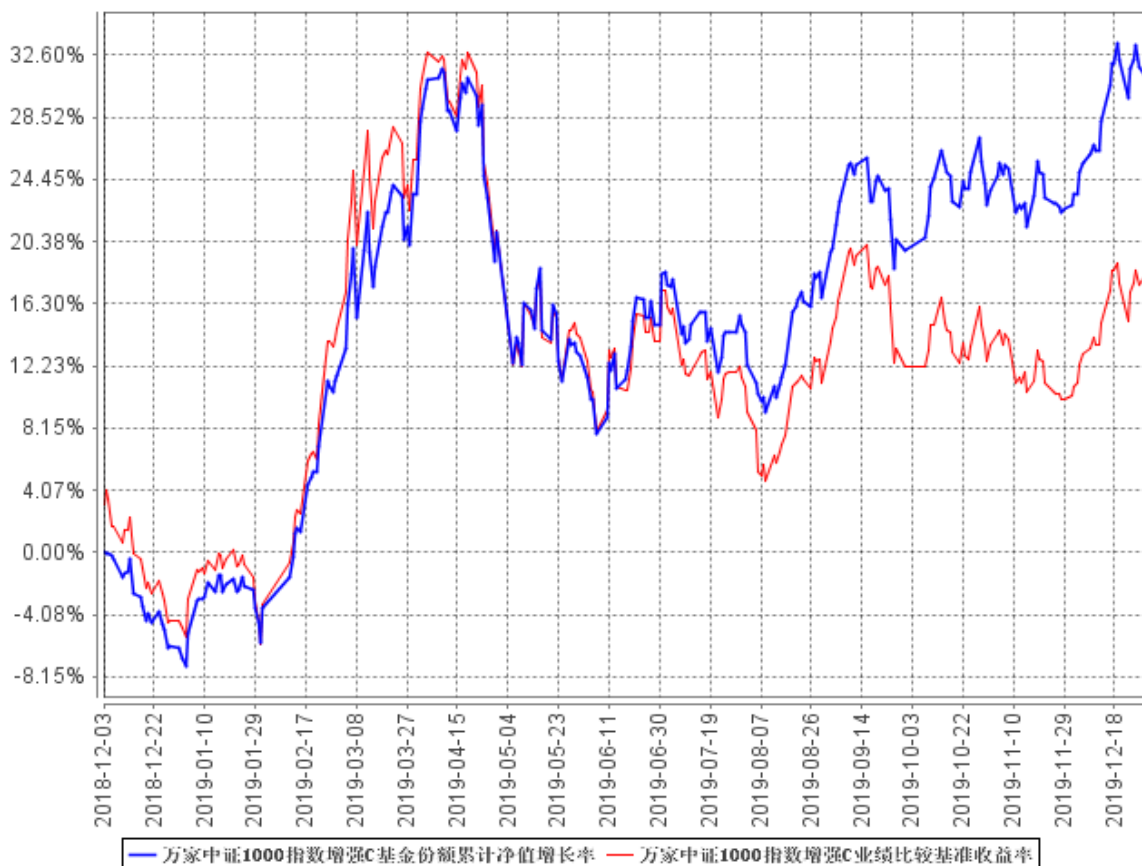
*5%

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

万家中证1000指数增强A基金份额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



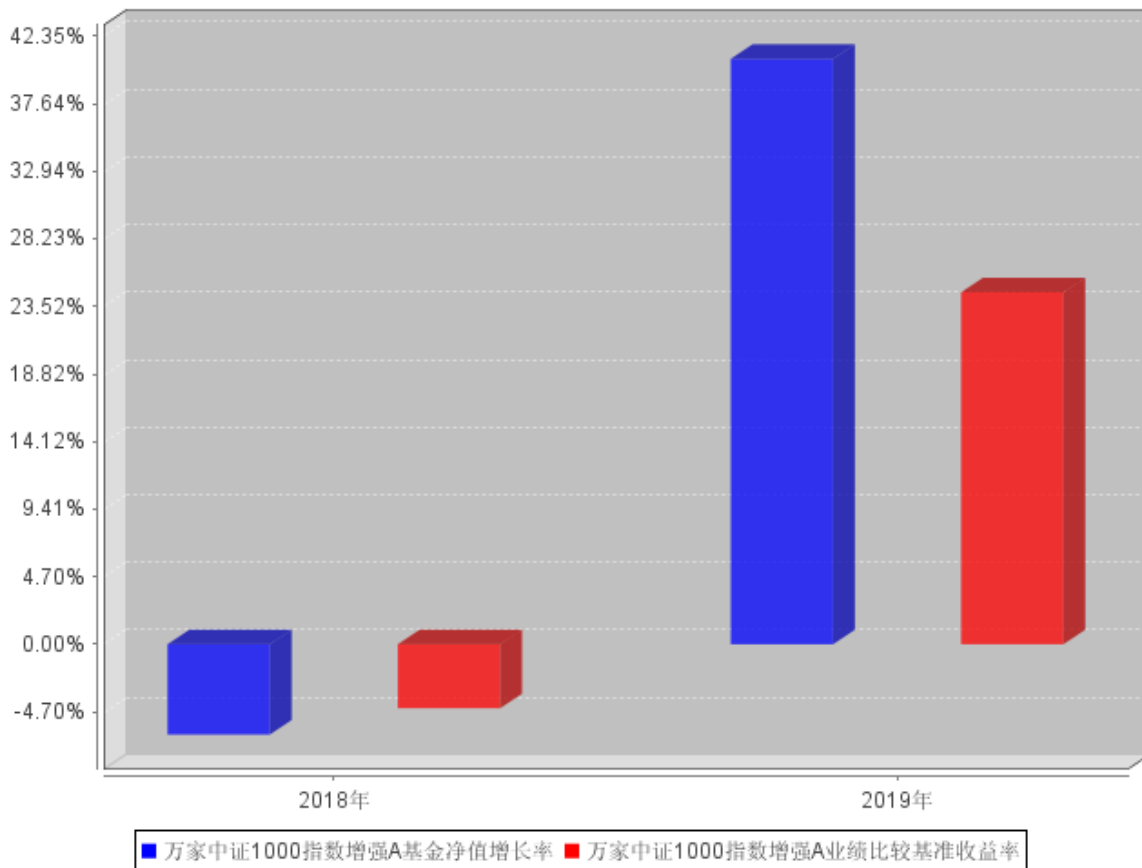
万家中证1000指数增强C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



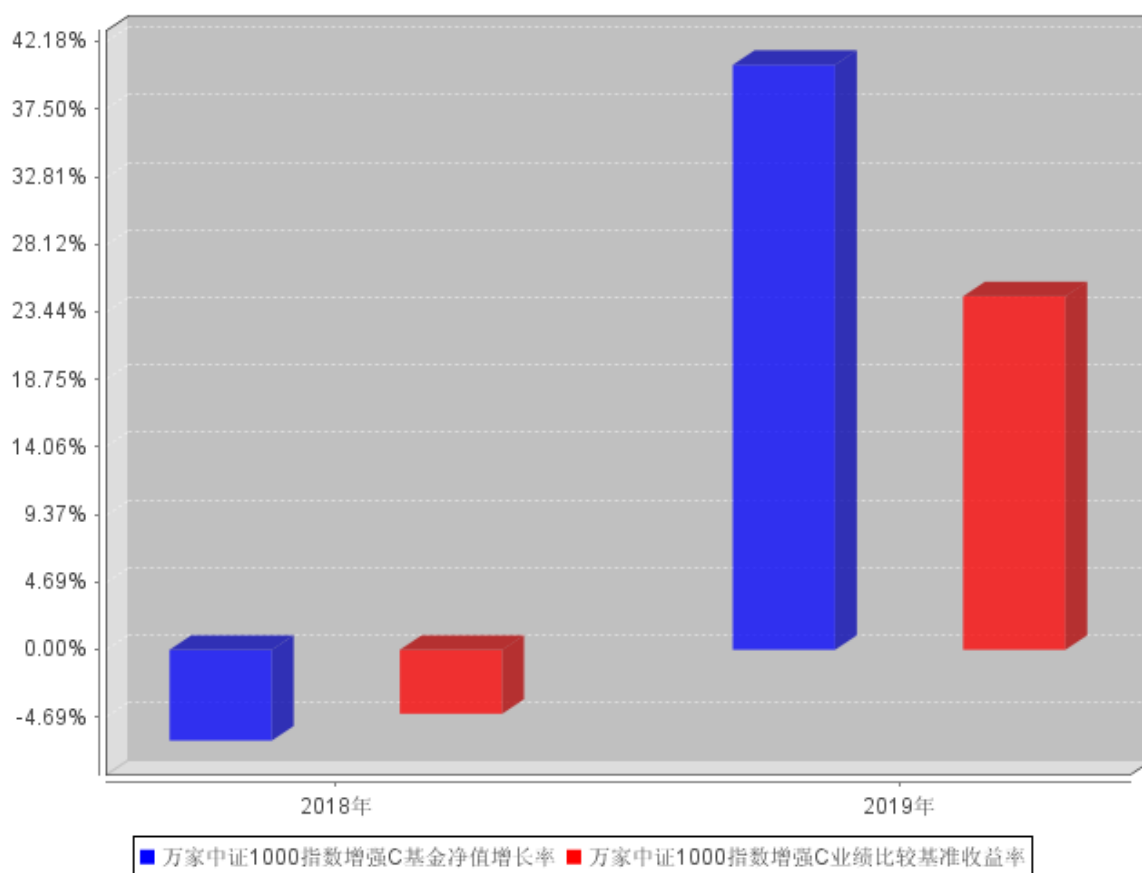
注：本基金合同生效日期为 2018 年 12 月 03 日，基金建仓期为基金合同生效后六个月，基金合同生效后各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

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

万家中证1000指数增强A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对比图



万家中证1000指数增强C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对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 万家中证 1000 指数增强 A | | | | | |
|------------------|-------------|--------------|------------|--------------|----|
| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
| 2019 | 2.6670 | 2,819,285.16 | 126,287.24 | 2,945,572.40 | |
| 2018 | - | - | - | - | |
| 合计 | 2.6670 | 2,819,285.16 | 126,287.24 | 2,945,572.40 | |

单位：人民币元

| 万家中证 1000 指数增强 C | | | | | |
|------------------|-------------|----------|-----------|----------|----|
| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
| | | | | | |

| | | | | | |
|------|--------|------------|---------------|---------------|--|
| 2019 | 2.5130 | 382,394.80 | 30,329,130.54 | 30,711,525.34 | |
| 2018 | - | - | - | - | |
| 合计 | 2.5130 | 382,394.80 | 30,329,130.54 | 30,711,525.34 | |

§ 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

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44 号文批准设立。公司现股东为中泰证券股份有限公司、新疆国际实业股份有限公司和齐河众鑫投资有限公司,住所:中国(上海)自由贸易试验区浦电路 360 号 8 楼(名义楼层 9 层),办公地点:上海市浦东新区浦电路 360 号 9 楼,注册资本 3 亿元人民币。目前管理七十只开放式基金,分别为万家 180 指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选混合型证券投资基金(LOF)、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金(LOF)、万家添利债券型证券投资基金(LOF)、万家新机遇价值驱动灵活配置混合型证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家上证 50 交易型开放式指数证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞和灵活配置混合型证券投资基金、万家颐达灵活配置混合型证券投资基金、万家颐和灵活配置混合型证券投资基金、万家恒瑞 18 个月定期开放债券型证券投资基金、万家 3-5 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家鑫安纯债债券型证券投资基金、万家鑫璟纯债债券型证券投资基金、万家沪深 300 指数增强型证券投资基金、万家家享中短债债券型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家 1-3 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家瑞隆混合型证券投资基金、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家现金增利货币市场基金、万家消费成长股票型证券投资基金、万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家玖盛纯债 9 个月定期开放债券型证券投资基金、万家天添宝货币市场基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、万家家瑞债券型证券投资基金、万家臻选混合型证券投资基金、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家成长优选灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金、万家经济新动能混合型证券投资基金、万家潜力价值灵

活配置混合型证券投资基金、万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家新机遇龙头企业灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型证券投资基金、万家智造优势混合型证券投资基金、万家稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、万家人工智能混合型证券投资基金、万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金（LOF）、万家平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、万家民安增利 12 个月定期开放债券型证券投资基金、万家鑫盛纯债债券型证券投资基金、万家汽车新趋势混合型证券投资基金和万家惠享 39 个月定期开放债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 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 | | |
| 乔亮 | 万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家沪深 300 | 2019 年 8 月 21 日 | - | 13.5 年 | 美国斯坦福大学商学（工商管理）博士研究生。2006 年 8 月至 2009 年 3 月在巴克莱国际投资管理公司（BGI）（后并入贝莱德公司（Black Rock））担任投资部基金经理；2009 年 7 月至 2010 年 8 月在加拿大退休基金国际投资管理公司（CPPIB）担任量化投资部基金经理；2010 年 9 月至 2013 年 3 月在南方基金管理有限公司担任量化投资部 |

| | | | | | |
|----|---|------------|-------------|----|--|
| | 指数增强型证券投资基金、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理 | | | | <p>基金经理；2013 年 3 月至 2015 年 3 月为通联数据股份公司联合创始人，担任投资部首席投资官；2015 年 5 月至 2017 年 7 月在上海寻乾资产管理有限公司（后并入巨杉资产）担任投资部投资总监、公司总经理；2017 年 7 月至 2019 年 6 月在巨杉（上海）资产管理有限公司担任量化投资部投资总监；2019 年 7 月加入万家基金管理有限公司，担任总经理助理、基金经理，2019 年 9 月起兼任量化投资部总监。</p> |
| 陈旭 | 因个人原因离职 | 2018年12月3日 | 2019年10月22日 | 7年 | <p>上海交通大学模式识别与智能系统硕士。2010 年 3 月至 2012 年 9 月在易安信中国卓越研发中心工作，担任高级软件工程师；2013 年 1 月至 2015 年 6 月在</p> |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | <p>国信证券股份有限公司工作，先后担任经济研究所分析师、自营金融工程部投资经理等职，主要从事量化投资研究分析及交易等工作；2015 年 7 月加入万家基金管理有限公司，自 2017 年 11 月起担任基金经理职务，现任量化投资部副总监（主持工作）、基金经理。2019 年 10 月，因个人原因离职。</p> |
|--|--|--|--|--|--|

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律、法规和监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋取最大利益，没有损害基金持有人利益的行为。

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

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《万家基金管理有限公司公平交易管理办法》，涵盖了研究、授权、投资决策和交易执行等投资管理活动的各个环节，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送，确保公平对待不同投资组合。

在投资决策上：(1) 公司对不同类别的投资组合分别设定独立的投资部门，公募基金经理和特

定客户资产管理投资经理不得互相兼任。(2) 公司投资管理实行分层次决策, 投资决策委员会下设的公募基金投资决策小组和专户投资决策小组分别根据公募基金和专户投资组合的规模、风格特征等因素合理确定各投资组合经理的投资权限, 投资组合经理在授权范围内自主决策, 超过投资权限的操作需经过严格的逐级审批程序。(3) 公司接受的外部研究报告、研究员撰写的研究报告等均通过统一的投研管理平台发布, 确保各投资组合经理在获得投资信息、投资建议和实施决策方面享有公平的机会。

在交易执行上:(1) 公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离, 实行集中交易制度;(2) 对于交易公开竞价交易, 所有指令必须通过系统下达, 公司执行交易系统内的公平交易程序;(3) 对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易, 各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量, 公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;(4) 对于银行间交易, 交易部按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。

在行为监控上, 公司定期对不同投资组合的同向交易价差、反向交易, 场外交易对手议价的价格公允性及其他异常交易情况进行监控及分析, 基金经理对异常交易情况进行合理性解释并留存记录, 并定期编制公平交易分析报告, 由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司定期进行同向交易价差分析, 即采集公司旗下管理的所有组合, 连续四个季度期间内, 不同时间窗下(日内、3 日内、5 日内)的同向交易样本, 对两两组合之间的同向交易价差均值进行原假设为 0, 95%的置信水平下的 t 检验, 并对结论进行跟踪分析, 分析结果显示在样本数量大于 30 的前提下, 组合之间在同向交易方面不存在违反公平交易行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内无下列情况: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%。

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

万家中证 1000 指数增强型证券投资基金采用中证 1000 指数增强的投资策略, 运用量化多因子选股模型, 在力求对中证 1000 指数进行有效跟踪的基础上, 通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制, 力争实现超越目标指数的投资收益, 谋求基金资产的长期增值。

万家中证 1000 指数增强型证券投资基金在保持相对中证 1000 指数较小跟踪误差情况下，控制行业权重偏离度、个股集中度，通过量化多因子选股的方式选取一篮子股票组合。在组合的行业和风格上相对于中证 1000 指数保持了均衡的配置，在量化选股方面精选行业内质优个股，持股较为分散。本基金采用量化风险模型来合理控制组合风险，保证较小的跟踪误差，投资目标是获取在既定跟踪误差下的超额收益最大化。本基金股票组合中 80%以上权重为中证 1000 成分股，保持了跟标的指数的风格基本一致。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家中证 1000 指数增强 A 基金份额净值为 1.0576 元，本报告期基金份额净值增长率为 40.77%；截至本报告期末万家中证 1000 指数增强 C 基金份额净值为 1.0562 元，本报告期基金份额净值增长率为 40.57%；同期业绩比较基准收益率为 24.51%。基金报告期末 A 份额、C 份额日均跟踪偏离度分别为 0.2189%、0.2182%，年跟踪误差分别为 4.7822%、4.7815%，符合基金合同中日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%的规定。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年的市场主线是盈利修复叠加风险溢价的回落，股票的超额收益主要来源于盈利超预期。整体市场呈现出了结构性牛市的特征。

展望 2020 年，盈利仍将是市场的主要驱动力，同时政策层面引导的流动性宽松，伴随着无风险利率的持续下行，也有利于风险资产的进一步上行。在基本面方面，市场仍将处于信用扩张周期之中，以平滑经济下行的斜率。从资产配置的角度来看，股债的性价比受盈利周期驱动明显，盈利修正下大概率股票相较于债券更优配置价值。在行业层面，科技类公司有望领涨市场，成为中长期市场的强势力量；二级市场中的核心资产，在高盈利、高持仓、高涨幅的压力下，收益与风险并存，未来市场风格的焦点更倾向于成长风格。

市场未来的主要风险集中在海外政治局势波动、地缘政治风险带来的黑天鹅事件以及疫情对经济影响超预期。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人为防范和化解经营风险，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，主要做了以下工作：

（一）加强风控文化建设

不断梳理和优化制度流程、防范操作风险、加强对员工的合规培训和加深员工对合规风控工作的理解，确保公司各项业务合法合规。

（二）制度流程建设

为加强内控管理，保证公司各项制度流程的有效性、及时性、完备性，本年度对投资、销售、专户业务相关的制度流程及后台部门相关制度进行了修订；

（三）定期和临时稽核工作

报告期内，监察稽核部门按计划完成了各项定期稽核和专项稽核，检查内容覆盖公司各业务部门和业务环节，检查完成后出具监察稽核报告和建议书，并对整改情况进行跟踪。

（四）绩效评估和风险管理工作

报告期内，进一步完善了每日风险监控工作；改进基金业绩评价工作，辅助基金经理投资决策，提供风险评估意见等；针对由于市场流动性紧张的情况，加大了对固定收益产品的风险管理，防范资金交收风险。

（五）员工行为管理与防控内幕交易

报告期内，公司进一步完善防控内幕交易制度和从业人员投资申报等制度，强化员工行为管理工作，防范内幕交易和利益输送。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了估值委员会,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有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。估值委员会由督察长、基金运营部负责人、合规稽核部负责人、权益投资部负责人、固定收益部负责人等组成。估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关从业资格,精通各自领域的理论知识,熟悉政策法规,并具有丰富的实践经验。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不介入基金日常估值业务。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中债金融估值中心有限公司签署了《中债信息产品服务协议》，本基金管理人与中证指数有限公司签署了《中证债券估值数据服务协议》。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同规定：“在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最少为 1 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%”。2019 年 12 月 13 日，本基金进行了利润分配，A 类每 10 份基金份额分红 2.667 元，共计分配利润 2,945,572.40 元；C 类每 10 份基金份额分红 2.513 元，共计分配利润 30,711,525.34 元。

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

本基金为发起式基金，不适用本项说明。

§ 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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 | 信会师报字[2020]第 ZA30173 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 | 万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金全体基金份额持有人 |
| 审计意见 | <p>我们审计了万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“万家中证 1000 指数增强”）财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</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，公允反映了万家中证 1000 指数增强 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础 | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于万家中证 1000 指数增强，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>万家中证 1000 指数增强的基金管理人万家基金管理有限公司管理层（以下简称管理层）负责按照企业会计准则和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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估万家中证 1000 指数增强的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> |

| | |
|------------------------|--|
| | <p>基金管理人治理层负责监督万家中证 1000 指数增强的财务报告过程。</p> |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对万家中证 1000 指数增强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万家中证 1000 指数增强不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与管理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项</p> |

| | | |
|-----------|---------------------------------|-----|
| | 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 | 立信会计师事务所(特殊普通合伙) | |
| 注册会计师的姓名 | 王 斌 | 徐 冬 |
| 会计师事务所的地址 | 中国 上海 | |
| 审计报告日期 | 2020 年 3 月 23 日 | |

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2019 年 12 月 31 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 38,850,913.62 | 1,032,385.23 |
| 结算备付金 | | 809,279.82 | 2,006.13 |
| 存出保证金 | | 50,575.27 | - |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 22,474,923.86 | 8,993,920.00 |
| 其中：股票投资 | | 22,474,923.86 | 8,993,920.00 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 6,321.06 | 228.20 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 62,643.27 | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 62,254,656.90 | 10,028,539.56 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2019 年 12 月 31 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
| 负 债： | | | |

| | | | |
|---------------|----------|---------------|---------------|
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 60,013.24 | - |
| 应付赎回款 | | 37,410,279.81 | - |
| 应付管理人报酬 | | 111,304.94 | 7,409.22 |
| 应付托管费 | | 22,260.98 | 1,483.90 |
| 应付销售服务费 | | 40,227.40 | 197.07 |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 529,080.45 | 8,966.23 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 106,224.55 | 37,448.14 |
| 负债合计 | | 38,279,391.37 | 55,504.56 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 22,685,000.42 | 10,515,125.88 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 1,290,265.11 | -542,090.88 |
| 所有者权益合计 | | 23,975,265.53 | 9,973,035.00 |
| 负债和所有者权益总计 | | 62,254,656.90 | 10,028,539.56 |

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0569 元，基金份额总额 22,685,000.42 份。其中万家中证 1000 指数增强 A 基金份额参考净值 1.0576 元，基金份额总额 11,199,170.60 份；万家中证 1000 指数增强 C 基金份额参考净值 1.0562 元，基金份额总额 11,485,829.82 份。

7.2 利润表

会计主体：万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|-----|----|---------|
|----|-----|----|---------|

| | | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 2018 年 12 月 3 日(基 金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|------------|-------------------------------------|---|
| 一、收入 | | 31,722,229.38 | -629,237.37 |
| 1.利息收入 | | 51,795.30 | 1,560.69 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 51,795.30 | 1,296.61 |
| 债券利息收入 | | - | 264.08 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 29,524,740.83 | 2,503.00 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | 29,220,158.07 | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | - | -697.00 |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.13.3 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.16 | 304,582.76 | 3,200.00 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | 1,874,546.79 | -633,307.80 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.18 | 271,146.46 | 6.74 |
| 减：二、费用 | | 3,047,028.11 | 26,311.72 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 711,065.96 | 7,385.36 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 142,213.21 | 1,477.08 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.10.2.3 | 233,550.02 | 183.99 |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.19 | 1,830,575.82 | 9,820.79 |

| | | | |
|----------------------------|----------|---------------|-------------|
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 税金及附加 | | - | - |
| 7. 其他费用 | 7.4.7.20 | 129,623.10 | 7,444.50 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 28,675,201.27 | -655,549.09 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 28,675,201.27 | -655,549.09 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | | |
|-----------------------------------|--|---------------|-----------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 10,515,125.88 | -542,090.88 | 9,973,035.00 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 28,675,201.27 | 28,675,201.27 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | 12,169,874.54 | 6,814,252.46 | 18,984,127.00 |
| 其中：1. 基金申购款 | 161,062,368.15 | 16,497,703.70 | 177,560,071.85 |
| 2. 基金赎回款 | -148,892,493.61 | -9,683,451.24 | -158,575,944.85 |

| | | | |
|--|--|----------------|----------------|
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | -33,657,097.74 | -33,657,097.74 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 22,685,000.42 | 1,290,265.11 | 23,975,265.53 |
| 项目 | 上年度可比期间 | | |
| | 2018 年 12 月 3 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 620,903.93 | 933.55 | 621,837.48 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -655,549.09 | -655,549.09 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | 9,894,221.95 | 112,524.66 | 10,006,746.61 |
| 其中：1. 基金申购款 | 9,895,133.04 | 112,513.83 | 10,007,646.87 |
| 2. 基金赎回款 | -911.09 | 10.83 | -900.26 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 10,515,125.88 | -542,090.88 | 9,973,035.00 |

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：

方一天

经晓云

陈广益

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

万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）由万家裕债券型证券投资基金转型而来。根据万家裕债券型证券投资基金基金份额持有人大会审议通过的《关于修改万家裕债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》以及相关法律法规的规定，并向中国证券监督管理委员会备案，万家裕债券型证券投资基金于 2018 年 12 月 3 日转型为本基金。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金管理人为万家基金管理有限公司，注册登记机构为中国登记结算有限责任公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股、备选成份股、其他股票（包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中小企业私募债券、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、债券回购、银行存款、同业存单、资产支持证券、金融衍生品（包括权证、股指期货、国债期货、股票期权等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可参与融资业务和转融通证券出借交易。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金在履行适当程序后可将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率*95%+一年期人民币定期存款利率（税后）*5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会、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。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

本基金的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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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、买入返售金融资产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

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

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

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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。

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基金净值比例计算的金额。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基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

- (1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 的年费率逐日计提；
- (2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率逐日计提；
- (3) 基金的 A 类基金份额不收取销售服务费；本基金的 C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 的年费率逐日计提；
- (4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；
- (5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

- 1、若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- 3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- 4、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最少为 1 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%。
- 5、本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；
- 6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 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，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)》，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(可转换债券除外)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(可转换债券除外),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

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1、印花税

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

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

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

2、增值税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。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。

3、企业所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

4、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题

的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019 年 12 月 31 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款 | 38,850,913.62 | 1,032,385.23 |
| 定期存款 | - | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - | - |
| 其他存款 | - | - |
| 合计： | 38,850,913.62 | 1,032,385.23 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019 年 12 月 31 日 | | |
|----|-------------------------|------|--------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| | | | |

| | | | | |
|-------------------|---------------------|---------------|---------------|--------------|
| 股票 | | 21,233,961.87 | 22,474,923.86 | 1,240,961.99 |
| 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 | | 21,233,961.87 | 22,474,923.86 | 1,240,961.99 |
| 项目 | 上年度末 2018年12月31日 | | | |
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 9,627,504.80 | 8,993,920.00 | -633,584.80 |
| 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 | | 9,627,504.80 | 8,993,920.00 | -633,584.80 |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

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各项买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019 年 12 月 31 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息 | 5,895.35 | 227.21 |
| 应收定期存款利息 | - | - |
| 应收其他存款利息 | - | - |
| 应收结算备付金利息 | 400.62 | 0.99 |
| 应收债券利息 | - | - |
| 应收资产支持证券利息 | - | - |
| 应收买入返售证券利息 | - | - |
| 应收申购款利息 | 0.12 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - | - |
| 其他 | 24.97 | - |
| 合计 | 6,321.06 | 228.20 |

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019 年 12 月 31 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 529,080.45 | 8,966.23 |
| 银行间市场应付交易费用 | - | - |
| 合计 | 529,080.45 | 8,966.23 |

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | 上年度末 |
|-------------|------------------|------------------|
| | 2019 年 12 月 31 日 | 2018 年 12 月 31 日 |
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | 0.48 | - |
| 预提费用 | 106,224.07 | 37,448.14 |
| 合计 | 106,224.55 | 37,448.14 |

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 万家中证 1000 指数增强 A | | |
|------------------|----------------------------------|---------------|
| 项目 | 本期 | |
| | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 9,919,465.90 | 9,919,465.90 |
| 本期申购 | 3,977,053.64 | 3,977,053.64 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,697,348.94 | -2,697,348.94 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 11,199,170.60 | 11,199,170.60 |

金额单位：人民币元

| 万家中证 1000 指数增强 C | | |
|------------------|----------------------------------|------------|
| 项目 | 本期 | |
| | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 595,659.98 | 595,659.98 |

| | | |
|---------------|-----------------|-----------------|
| 本期申购 | 157,085,314.51 | 157,085,314.51 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -146,195,144.67 | -146,195,144.67 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 11,485,829.82 | 11,485,829.82 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 万家中证 1000 指数增强 A | | | |
|------------------|---------------|-------------|---------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 107,925.44 | -613,004.76 | -505,079.32 |
| 本期利润 | 4,449,479.55 | -645,797.14 | 3,803,682.41 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 29,731.52 | 262,488.37 | 292,219.89 |
| 其中：基金申购款 | 355,351.23 | 475,612.11 | 830,963.34 |
| 基金赎回款 | -325,619.71 | -213,123.74 | -538,743.45 |
| 本期已分配利润 | -2,945,572.40 | - | -2,945,572.40 |
| 本期末 | 1,641,564.11 | -996,313.53 | 645,250.58 |

单位：人民币元

| 万家中证 1000 指数增强 C | | | |
|------------------|---------------|---------------|---------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | -629.11 | -36,382.45 | -37,011.56 |
| 本期利润 | 22,351,174.93 | 2,520,343.93 | 24,871,518.86 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 10,033,752.01 | -3,511,719.44 | 6,522,032.57 |
| 其中：基金申购款 | 15,945,058.97 | -278,318.61 | 15,666,740.36 |
| 基金赎回款 | -5,911,306.96 | -3,233,400.83 | -9,144,707.79 |

| | | | |
|---------|----------------|---------------|----------------|
| 本期已分配利润 | -30,711,525.34 | - | -30,711,525.34 |
| 本期末 | 1,672,772.49 | -1,027,757.96 | 645,014.53 |

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------|-----------------------|---------------------------------|
| | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年12月3日(基金合同生效日)至2018年12月31日 |
| 活期存款利息收入 | 43,975.82 | 1,094.04 |
| 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 | 7,503.34 | 2.52 |
| 其他 | 316.14 | 200.05 |
| 合计 | 51,795.30 | 1,296.61 |

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|------------|-----------------------|---------------------------------|
| | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年12月3日(基金合同生效日)至2018年12月31日 |
| 卖出股票成交总额 | 600,915,283.50 | - |
| 减：卖出股票成本总额 | 571,695,125.43 | - |
| 买卖股票差价收入 | 29,220,158.07 | - |

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019 年12月31日 | 上年度可比期间 2018年12月3日(基金合 同生效日)至2018年12月31 日 |
|-----------------------------------|---------------------------------|--|
| 债券投资收益——买卖债券（、债 转股及债券到期兑付）差价收入 | - | -697.00 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - | - |
| 合计 | - | -697.00 |

注：本基金本报告期无债券投资收益。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019 年12月31日 | 上年度可比期间 2018年12月3日(基金合 同生效日)至2018年12月31 日 |
|-----------------------------|---------------------------------|--|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑 付）成交总额 | - | 772,087.85 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到 期兑付）成本总额 | - | 753,802.00 |
| 减：应收利息总额 | - | 18,982.85 |
| 买卖债券差价收入 | - | -697.00 |

注：本基金本报告期无债券投资收益。

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2018 年 12 月 3 日(基金合同生效 日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|-------------|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 304,582.76 | 3,200.00 |
| 基金投资产生的股利收益 | - | - |
| 合计 | 304,582.76 | 3,200.00 |

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2018 年 12 月 3 日(基金合同 生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|--------------------------------|---|---|
| 1. 交易性金融资产 | 1,874,546.79 | -633,307.80 |
| ——股票投资 | 1,874,546.79 | -633,584.80 |
| ——债券投资 | - | 277.00 |
| ——资产支持证券投资 | - | - |
| ——贵金属投资 | - | - |
| ——其他 | - | - |
| 2. 衍生工具 | - | - |
| ——权证投资 | - | - |
| 3. 其他 | - | - |
| 减：应税金融商品公允价 值变动产生的预估增 值税 | - | - |
| 合计 | 1,874,546.79 | -633,307.80 |

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

| | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 2018 年 12 月 3 日(基金合同生 效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|---------|-------------------------------------|--|
| 基金赎回费收入 | 271,145.34 | 5.93 |
| 转换费收入 | 1.12 | 0.81 |
| 合计 | 271,146.46 | 6.74 |

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2018 年 12 月 3 日(基金合同生 效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|-----------|---|---|
| 交易所市场交易费用 | 1,830,575.82 | 9,820.79 |
| 银行间市场交易费用 | - | - |
| 交易基金产生的费用 | - | - |
| 其中：申购费 | - | - |
| 赎回费 | - | - |
| 合计 | 1,830,575.82 | 9,820.79 |

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2018 年 12 月 3 日(基金合同 生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|-------|---|---|
| 审计费用 | 45,000.00 | 7,633.57 |
| 信息披露费 | 39,775.93 | -224.07 |
| 指数费用 | 43,152.17 | - |
| 银行费用 | 1,695.00 | 35.00 |
| 合计 | 129,623.10 | 7,444.50 |

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，本基金本报告期末无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|------------------|-----------------|
| 万家基金管理有限公司 | 基金管理人、基金销售机构 |
| 招商银行股份有限公司 | 基金托管人、基金销售机构 |
| 中泰证券股份有限公司 | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 新疆国际实业股份有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 齐河众鑫投资有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 山东省国有资产投资控股有限公司 | 基金管理人的原股东 |
| 万家共赢资产管理有限公司 | 基金管理人的子公司 |
| 万家财富基金销售（天津）有限公司 | 基金管理人的子公司 |
| 上海万家朴智投资管理有限公司 | 基金管理人控制的公司 |

注：1、经中国证券监督管理委员会证监许可[2019]126 号文核准，基金管理人原股东山东省国有资产投资控股有限公司将其持有的基金管理人的 11% 股权转让给齐河众鑫投资有限公司。本次股权变更的工商变更登记手续已办理完毕，基金管理人于 2019 年 2 月 13 日发布了《关于公司股权变更的公告》，公司股东由山东省国有资产投资控股有限公司变更为齐河众鑫投资有限公司。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------------|----------------------------------|--|
| | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 2018 年 12 月 3 日 (基金合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 711,065.96 | 7,385.36 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 12,707.36 | 52.62 |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|------------|----------------------------------|--|
| | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 2018 年 12 月 3 日 (基金合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付 | 142,213.21 | 1,477.08 |

| | | |
|------|--|--|
| 的托管费 | | |
|------|--|--|

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | | |
|----------------|---|----------------------|------------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 万家中证 1000 指数 增强 A | 万家中证 1000 指数 增强 C | 合计 |
| 万家基金管理有限公司 | - | 225,922.76 | 225,922.76 |
| 中泰证券股份有限公司 | - | 363.17 | 363.17 |
| 合计 | - | 226,285.93 | 226,285.93 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2018 年 12 月 3 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 万家中证 1000 指数 增强 A | 万家中证 1000 指数 增强 C | 合计 |
| 中泰证券股份有限公司 | - | 72.74 | 72.74 |
| 合计 | - | 72.74 | 72.74 |

注：本基金 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年费率为 0.40%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据相关协议支付给各销售机构。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | |
|---------------------------------|--|------------------|
| | 万家中证 1000 指数增强 A | 万家中证 1000 指数增强 C |
| 基金合同生效日（2018 年 12 月 3 日）持有的基金份额 | 0.00 | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 9,887,305.69 | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 9,887,305.69 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 43.5852% | - |

| 项目 | 上年度可比期间 2018 年 12 月 3 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 | |
|----|---|------------------|
| | 万家中证 1000 指数增强 A | 万家中证 1000 指数增强 C |
| | | |

| | | |
|---------------------------------|--------------|---|
| 基金合同生效日（2018 年 12 月 3 日）持有的基金份额 | 0.00 | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 0.00 | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | 9,887,305.69 | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 9,887,305.69 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 94.0294% | - |

注：基金管理人申购本基金份额时所适用的费率与本基金公告的费率一致。期间申购/买入总份额含转换入份额；期间因拆分变动份额含红利再投份额；期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 万家中证 1000 指数增强 C | | | | |
|------------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 关联方名称 | 本期末 2019 年 12 月 31 日 | | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 | |
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的 比例 | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的 比例 |
| 万家共赢资产管理 有限公司 | - | - | 249,850.09 | 2.3761% |

注：本基金本报告期内无除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.5 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2018 年 12 月 3 日(基金合同生效日)至 2018 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 |
|------------|---------------|-----------|--------------|----------|
| 招商银行股份有限公司 | 38,850,913.62 | 43,975.82 | 1,032,385.23 | 1,094.04 |

注：本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2019 年 1 月 1 日至 12 月 31 日获得的利息收入为人民币 7,503.34 元(2018 年 12 月 3 日(基金转型日)至 12 月 31 日获得的利息收入为人民币 2.52 元)，2019 年 12 月 31 日结算备付金余额为人民币 809,279.82 元(2018 年末结算备付金余额为人民币 2,006.13 元)。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方所承销的证券。

7.4.10.7 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没有需作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

万家中证1000指数增强A

金额单位：人民币元

| 序号 | 权益 登记日 | 除息日 | | 每 10 份 基金份额分红 数 | 现金形式 发放总额 | 再投资形式 发放总额 | 本期利润分配 合计 | 备注 |
|--------|------------------------|-----|------------------------|-----------------------|--------------|---------------|--------------|----|
| | | 场内 | 场外 | | | | | |
| 1 | 2019 年 12 月 13 日 | - | 2019 年 12 月 13 日 | 2.6670 | 2,819,285.16 | 126,287.24 | 2,945,572.40 | |
| 合 计 | - | - | - | 2.6670 | 2,819,285.16 | 126,287.24 | 2,945,572.40 | |

万家中证 1000 指数增强 C

金额单位：人民币元

| 序号 | 权益 登记日 | 除息日 | | 每 10 份 基金份额分红 数 | 现金形式 发放总额 | 再投资形式 发放总额 | 本期利润分配 合计 | 备注 |
|----|-----------|-----|----|-----------------------|--------------|---------------|--------------|----|
| | | 场内 | 场外 | | | | | |

| | | | | | | | | |
|--------|------------------------|---|------------------------|--------|------------|---------------|---------------|--|
| 1 | 2019 年 12 月 13 日 | - | 2019 年 12 月 13 日 | 2.5130 | 382,394.80 | 30,329,130.54 | 30,711,525.34 | |
| 合 计 | | - | | 2.5130 | 382,394.80 | 30,329,130.54 | 30,711,525.34 | |

7.4.12 期末（2019 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 | 可流 通日 | 流通受 限类型 | 认购 价格 | 期末估 值单价 | 数量 (单位:股) | 期末 成本总额 | 期末估值总 额 | 备注 |
| 688128 | 中国 电研 | 2019 年 10 月 29 日 | 2020 年 5 月 5 日 | 新股流 通受限 | 18.79 | 17.52 | 9,027 | 169,617.33 | 158,153.04 | - |
| 688202 | 美迪 西 | 2019 年 10 月 29 日 | 2020 年 5 月 5 日 | 新股流 通受限 | 41.50 | 50.80 | 2,120 | 87,980.00 | 107,696.00 | - |
| 688258 | 卓易 信息 | 2019 年 11 月 28 日 | 2020 年 6 月 9 日 | 新股流 通受限 | 26.49 | 70.05 | 3,465 | 91,787.85 | 242,723.25 | - |
| 688368 | 晶丰 明源 | 2019 年 9 月 27 日 | 2020 年 4 月 14 日 | 新股流 通受限 | 56.68 | 75.13 | 2,557 | 144,930.76 | 192,107.41 | - |
| 601077 | 渝农 商行 | 2019 年 10 月 16 日 | 2020 年 4 月 29 日 | 新股流 通受限 | 7.36 | 6.26 | 73,889 | 543,823.04 | 462,545.14 | - |
| 002973 | 侨银 环保 | 2019 年 12 月 27 日 | 2020 年 1 月 | 新股未 上市 | 5.74 | 5.74 | 1,146 | 6,578.04 | 6,578.04 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|----------|------------------------|----------------------|------------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| | | 日 | 6 日 | | | | | | | |
| 688181 | 八亿 时空 | 2019 年 12 月 27 日 | 2020 年 7 月 6 日 | 新股流 通受限 | 43.98 | 43.98 | 1,255 | 55,194.90 | 55,194.90 | - |

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 日止, 本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 日止, 本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

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

本基金金融工具的风险主要包括: 信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险, 并设定适当的风险限额及内部控制流程, 通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理融入各业务层面, 建立了三道防线: 以各岗位目标责任制为基础, 形成第一道防线; 通过相关部门、相关岗位之间相互监督制衡, 形成第二道防线; 由监察稽核部门、督察长对各岗位、各部门、各机构、各项业务实施监督反馈, 形成第三道防线。

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, 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建立了信用风险管理流程, 通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险, 本基金均投资于具有良好信用等级的证券, 且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券, 不得超过该证券的 10%。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行, 在

交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度期末均未持有债券。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度期末均未持有债券。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

本基金所持证券全部在证券交易所上市，因此除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

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资产的流动性风险进行管理，基金管理人建立了健全的流动性风险管理的内部控制体系，在申购赎回确认、投资交易、估值和信息披露等运作过程中专业审慎、勤勉尽责地管控基金的流动性风险，维护投资者的合法权益，公平对待投资者。本基金开放期间管理人对组合持仓集中度、短期变现能力、流动性受限资产比例、现金类资产比例等流动性指标进行持续的监测和分析，通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，对交易对手进行必要的尽职调查和准入，加强逆回购的流动性风险和交易对手风险的管理，并健全了逆回购交易质押品管理制度。

本基金所持有的的证券大部分具有良好的流动性，部分证券流通暂时受限的情况参见附注 7.4.12 “期末（2019 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券”，本报告期内本基金未出现因投资品种变现困难或投资集中而无法以合理价格及时变现基金资产以支付赎回款的情况。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

| 本期末 2019年12月31日 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|---------------------|---------------|-------|--------|------|------|----------------|---------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 38,850,913.62 | - | - | - | - | - | 38,850,913.62 |
| 结算备付金 | 809,279.82 | - | - | - | - | - | 809,279.82 |
| 存出保证金 | 50,575.27 | - | - | - | - | - | 50,575.27 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 22,474,923.86 | 22,474,923.86 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 6,321.06 | 6,321.06 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 62,643.27 | 62,643.27 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 39,710,768.71 | - | - | - | - | 22,543,888.19 | 62,254,656.90 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 60,013.24 | 60,013.24 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 37,410,279.81 | 37,410,279.81 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 111,304.94 | 111,304.94 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 22,260.98 | 22,260.98 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 40,227.40 | 40,227.40 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 529,080.45 | 529,080.45 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 106,224.55 | 106,224.55 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 38,279,391.37 | 38,279,391.37 |
| 利率敏感度缺口 | 39,710,768.71 | - | - | - | - | -15,735,503.18 | 23,975,265.53 |
| 上年度末 2018年12月31日 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|---------|--------------|---|---|---|---|--------------|---------------|
| 银行存款 | 1,032,385.23 | - | - | - | - | - | 1,032,385.23 |
| 结算备付金 | 2,006.13 | - | - | - | - | - | 2,006.13 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 8,993,920.00 | 8,993,920.00 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 228.20 | 228.20 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 1,034,391.36 | - | - | - | - | 8,994,148.20 | 10,028,539.56 |
| 负债 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 7,409.22 | 7,409.22 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 1,483.90 | 1,483.90 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 197.07 | 197.07 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 8,966.23 | 8,966.23 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 37,448.14 | 37,448.14 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 55,504.56 | 55,504.56 |
| 利率敏感度缺口 | 1,034,391.36 | - | - | - | - | 8,938,643.64 | 9,973,035.00 |

注：该表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2018 年 12 月 31 日：同），银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2018 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场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。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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 2019 年 12 月 31 日 | 上年度末 2018 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 | 22,474,923.86 | 93.74 | 8,993,920.00 | 90.18 |
| 交易性金融资产-基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-债券投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产-权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 22,474,923.86 | 93.74 | 8,993,920.00 | 90.18 |

注：本基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；权证投资占基金资产净值的 0-3%。每个交易日日终，在扣除股票期权、股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| | | | |
|----|---|-----------------------------|-------------------|
| 假设 | 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； | | |
| | 以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2019年12月31日） | 上年度末（2018年12月31日） |
| | 1. 股票基准指数下降 100 个基点 | -175,669.11 | -93,860.57 |
| | 2. 股票基准指数上升 100 个基点 | 175,669.11 | 93,860.57 |

注：本基金管理人运用资本-资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。表中为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 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。

7.4.14.1.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 21,249,926.08 元，属于第二层次的余额为 1,224,997.78 元，无属于第三层次的余额。（2018 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为 8,993,920.00 元，无属于第二层次和第三层次的余额。）

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次均未发生重大变动。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具本期末及上年度末均未以第三层次公允价值计量。

7.4.14.1.3 非持续的以公允价值计量的金融工具

本基金本期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.1.4 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息以及其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.14.2 除公允价值外，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 | 22,474,923.86 | 36.10 |
| | 其中：股票 | 22,474,923.86 | 36.10 |
| 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 | 39,660,193.44 | 63.71 |
| 8 | 其他各项资产 | 119,539.60 | 0.19 |
| 9 | 合计 | 62,254,656.90 | 100.00 |

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 162,380.85 | 0.68 |
| B | 采矿业 | 222,809.00 | 0.93 |
| C | 制造业 | 12,722,111.20 | 53.06 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 753,879.00 | 3.14 |
| E | 建筑业 | 687,413.60 | 2.87 |
| F | 批发和零售业 | 779,923.00 | 3.25 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 525,927.00 | 2.19 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务 | 1,301,814.00 | 5.43 |

| | | | |
|---|---------------|---------------|-------|
| | 业 | | |
| J | 金融业 | 31,923.00 | 0.13 |
| K | 房地产业 | 581,048.04 | 2.42 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 179,446.00 | 0.75 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 318,633.00 | 1.33 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 249,877.00 | 1.04 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 18,517,184.69 | 77.23 |

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|--------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 2,171,193.29 | 9.06 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 9,450.00 | 0.04 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 497,578.66 | 2.08 |
| J | 金融业 | 462,545.14 | 1.93 |

| | | | |
|---|---------------|--------------|-------|
| K | 房地产业 | 261,221.00 | 1.09 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 265,849.04 | 1.11 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 6,578.04 | 0.03 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 10,244.00 | 0.04 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 273,080.00 | 1.14 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 3,957,739.17 | 16.51 |

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股票投资组合。

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 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|------------|--------------|
| 1 | 002367 | 康力电梯 | 57,700 | 458,715.00 | 1.91 |
| 2 | 603368 | 柳药股份 | 13,600 | 457,504.00 | 1.91 |
| 3 | 600063 | 皖维高新 | 111,700 | 437,864.00 | 1.83 |
| 4 | 300497 | 富祥股份 | 23,100 | 435,897.00 | 1.82 |
| 5 | 603063 | 禾望电气 | 45,900 | 428,706.00 | 1.79 |
| 6 | 600343 | 航天动力 | 44,700 | 409,005.00 | 1.71 |
| 7 | 600855 | 航天长峰 | 32,600 | 400,654.00 | 1.67 |
| 8 | 600846 | 同济科技 | 42,100 | 391,951.00 | 1.63 |
| 9 | 000591 | 太阳能 | 106,300 | 389,058.00 | 1.62 |
| 10 | 601058 | 赛轮轮胎 | 76,100 | 340,167.00 | 1.42 |
| 11 | 000973 | 佛塑科技 | 70,400 | 326,656.00 | 1.36 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 12 | 002792 | 通宇通讯 | 12,200 | 325,984.00 | 1.36 |
| 13 | 002611 | 东方精工 | 69,100 | 293,675.00 | 1.22 |
| 14 | 002928 | 华夏航空 | 23,950 | 291,711.00 | 1.22 |
| 15 | 300171 | 东富龙 | 41,000 | 290,690.00 | 1.21 |
| 16 | 603919 | 金徽酒 | 15,000 | 265,650.00 | 1.11 |
| 17 | 000838 | 财信发展 | 78,300 | 251,343.00 | 1.05 |
| 18 | 601677 | 明泰铝业 | 21,700 | 250,201.00 | 1.04 |
| 19 | 600449 | 宁夏建材 | 22,400 | 249,984.00 | 1.04 |
| 20 | 300523 | 辰安科技 | 5,500 | 246,730.00 | 1.03 |
| 21 | 002182 | 云海金属 | 25,900 | 239,575.00 | 1.00 |
| 22 | 002377 | 国创高新 | 52,000 | 215,280.00 | 0.90 |
| 23 | 600720 | 祁连山 | 16,440 | 206,322.00 | 0.86 |
| 24 | 001896 | 豫能控股 | 57,900 | 206,124.00 | 0.86 |
| 25 | 600552 | 凯盛科技 | 35,000 | 205,800.00 | 0.86 |
| 26 | 300303 | 聚飞光电 | 36,400 | 204,204.00 | 0.85 |
| 27 | 603043 | 广州酒家 | 6,500 | 197,405.00 | 0.82 |
| 28 | 002335 | 科华恒盛 | 11,900 | 193,613.00 | 0.81 |
| 29 | 300130 | 新国都 | 10,200 | 179,826.00 | 0.75 |
| 30 | 603458 | 勘设股份 | 9,400 | 179,446.00 | 0.75 |
| 31 | 000035 | 中国天楹 | 28,900 | 178,313.00 | 0.74 |
| 32 | 300558 | 贝达药业 | 2,700 | 177,390.00 | 0.74 |
| 33 | 002782 | 可立克 | 16,200 | 171,882.00 | 0.72 |
| 34 | 300438 | 鹏辉能源 | 6,300 | 168,840.00 | 0.70 |
| 35 | 600284 | 浦东建设 | 26,116 | 165,836.60 | 0.69 |
| 36 | 601918 | 新集能源 | 50,100 | 162,324.00 | 0.68 |
| 37 | 000802 | 北京文化 | 17,100 | 158,859.00 | 0.66 |
| 38 | 601163 | 三角轮胎 | 9,900 | 151,470.00 | 0.63 |
| 39 | 600261 | 阳光照明 | 30,800 | 146,300.00 | 0.61 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 40 | 000550 | 江铃汽车 | 10,400 | 143,520.00 | 0.60 |
| 41 | 600323 | 瀚蓝环境 | 8,000 | 140,320.00 | 0.59 |
| 42 | 300118 | 东方日升 | 10,100 | 139,885.00 | 0.58 |
| 43 | 300043 | 星辉娱乐 | 26,900 | 137,997.00 | 0.58 |
| 44 | 000957 | 中通客车 | 20,000 | 133,400.00 | 0.56 |
| 45 | 002246 | 北化股份 | 17,100 | 128,592.00 | 0.54 |
| 46 | 603579 | 荣泰健康 | 4,100 | 127,510.00 | 0.53 |
| 47 | 300256 | 星星科技 | 21,000 | 126,840.00 | 0.53 |
| 48 | 300737 | 科顺股份 | 11,200 | 126,784.00 | 0.53 |
| 49 | 603393 | 新天然气 | 4,500 | 125,055.00 | 0.52 |
| 50 | 000576 | 广东甘化 | 16,400 | 124,804.00 | 0.52 |
| 51 | 600012 | 皖通高速 | 20,400 | 119,952.00 | 0.50 |
| 52 | 600382 | 广东明珠 | 17,000 | 118,830.00 | 0.50 |
| 53 | 603008 | 喜临门 | 7,600 | 117,572.00 | 0.49 |
| 54 | 000751 | 锌业股份 | 35,200 | 113,696.00 | 0.47 |
| 55 | 000810 | 创维数字 | 9,400 | 112,706.00 | 0.47 |
| 56 | 603609 | 禾丰牧业 | 9,400 | 111,202.00 | 0.46 |
| 57 | 300114 | 中航电测 | 9,700 | 110,386.00 | 0.46 |
| 58 | 603058 | 永吉股份 | 14,800 | 109,816.00 | 0.46 |
| 59 | 000913 | 钱江摩托 | 9,800 | 107,898.00 | 0.45 |
| 60 | 300209 | 天泽信息 | 7,500 | 107,025.00 | 0.45 |
| 61 | 300066 | 三川智慧 | 21,500 | 99,545.00 | 0.42 |
| 62 | 002851 | 麦格米特 | 4,800 | 99,456.00 | 0.41 |
| 63 | 600612 | 老凤祥 | 2,000 | 95,220.00 | 0.40 |
| 64 | 002895 | 川恒股份 | 7,500 | 92,850.00 | 0.39 |
| 65 | 600180 | 瑞茂通 | 13,300 | 92,834.00 | 0.39 |
| 66 | 603733 | 仙鹤股份 | 6,400 | 91,264.00 | 0.38 |
| 67 | 002100 | 天康生物 | 7,100 | 90,738.00 | 0.38 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|-----------|------|
| 68 | 002156 | 通富微电 | 5,500 | 90,475.00 | 0.38 |
| 69 | 002016 | 世荣兆业 | 10,444 | 90,445.04 | 0.38 |
| 70 | 300496 | 中科创达 | 1,900 | 85,766.00 | 0.36 |
| 71 | 002534 | 杭锅股份 | 10,900 | 84,148.00 | 0.35 |
| 72 | 002318 | 久立特材 | 8,600 | 80,668.00 | 0.34 |
| 73 | 600496 | 精工钢构 | 26,800 | 77,452.00 | 0.32 |
| 74 | 300016 | 北陆药业 | 8,600 | 77,314.00 | 0.32 |
| 75 | 002234 | 民和股份 | 2,400 | 76,344.00 | 0.32 |
| 76 | 300661 | 圣邦股份 | 300 | 75,744.00 | 0.32 |
| 77 | 002912 | 中新赛克 | 600 | 75,600.00 | 0.32 |
| 78 | 000905 | 厦门港务 | 10,000 | 74,700.00 | 0.31 |
| 79 | 300205 | 天喻信息 | 6,600 | 72,336.00 | 0.30 |
| 80 | 300158 | 振东制药 | 13,500 | 65,340.00 | 0.27 |
| 81 | 002913 | 奥士康 | 1,100 | 65,109.00 | 0.27 |
| 82 | 603737 | 三棵树 | 800 | 64,520.00 | 0.27 |
| 83 | 002605 | 姚记科技 | 3,300 | 64,185.00 | 0.27 |
| 84 | 601700 | 风范股份 | 9,700 | 62,662.00 | 0.26 |
| 85 | 002609 | 捷顺科技 | 7,200 | 61,848.00 | 0.26 |
| 86 | 002326 | 永太科技 | 6,200 | 61,380.00 | 0.26 |
| 87 | 002036 | 联创电子 | 3,600 | 61,236.00 | 0.26 |
| 88 | 002279 | 久其软件 | 10,000 | 60,700.00 | 0.25 |
| 89 | 300602 | 飞荣达 | 1,400 | 59,360.00 | 0.25 |
| 90 | 002171 | 楚江新材 | 8,000 | 59,280.00 | 0.25 |
| 91 | 300487 | 蓝晓科技 | 1,600 | 58,400.00 | 0.24 |
| 92 | 002022 | 科华生物 | 5,000 | 58,400.00 | 0.24 |
| 93 | 002746 | 仙坛股份 | 3,705 | 57,686.85 | 0.24 |
| 94 | 603618 | 杭电股份 | 10,400 | 57,200.00 | 0.24 |
| 95 | 601890 | 亚星锚链 | 9,900 | 56,628.00 | 0.24 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 96 | 603218 | 日月股份 | 2,700 | 56,079.00 | 0.23 |
| 97 | 300248 | 新开普 | 6,800 | 55,828.00 | 0.23 |
| 98 | 002091 | 江苏国泰 | 7,900 | 54,273.00 | 0.23 |
| 99 | 300502 | 新易盛 | 1,300 | 52,182.00 | 0.22 |
| 100 | 600229 | 城市传媒 | 7,100 | 50,410.00 | 0.21 |
| 101 | 600477 | 杭萧钢构 | 17,800 | 50,196.00 | 0.21 |
| 102 | 002123 | 梦网集团 | 2,600 | 49,738.00 | 0.21 |
| 103 | 603666 | 亿嘉和 | 700 | 49,560.00 | 0.21 |
| 104 | 603118 | 共进股份 | 4,400 | 49,456.00 | 0.21 |
| 105 | 603606 | 东方电缆 | 4,500 | 49,410.00 | 0.21 |
| 106 | 002664 | 长鹰信质 | 3,000 | 49,020.00 | 0.20 |
| 107 | 300224 | 正海磁材 | 5,000 | 47,700.00 | 0.20 |
| 108 | 002124 | 天邦股份 | 3,800 | 47,690.00 | 0.20 |
| 109 | 002557 | 洽洽食品 | 1,400 | 47,558.00 | 0.20 |
| 110 | 300352 | 北信源 | 6,500 | 47,385.00 | 0.20 |
| 111 | 300726 | 宏达电子 | 1,800 | 47,376.00 | 0.20 |
| 112 | 600422 | 昆药集团 | 4,400 | 47,212.00 | 0.20 |
| 113 | 300034 | 钢研高纳 | 2,900 | 46,313.00 | 0.19 |
| 114 | 002518 | 科士达 | 4,300 | 45,881.00 | 0.19 |
| 115 | 300702 | 天宇股份 | 900 | 45,108.00 | 0.19 |
| 116 | 300624 | 万兴科技 | 700 | 44,170.00 | 0.18 |
| 117 | 000708 | 中信特钢 | 1,900 | 43,567.00 | 0.18 |
| 118 | 002130 | 沃尔核材 | 8,500 | 41,990.00 | 0.18 |
| 119 | 000739 | 普洛药业 | 3,200 | 41,504.00 | 0.17 |
| 120 | 300393 | 中来股份 | 2,800 | 40,572.00 | 0.17 |
| 121 | 600986 | 科达股份 | 8,100 | 40,176.00 | 0.17 |
| 122 | 300630 | 普利制药 | 700 | 39,648.00 | 0.17 |
| 123 | 000885 | 城发环境 | 3,600 | 39,564.00 | 0.17 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 124 | 300366 | 创意信息 | 3,800 | 39,292.00 | 0.16 |
| 125 | 002226 | 江南化工 | 7,100 | 38,908.00 | 0.16 |
| 126 | 600531 | 豫光金铅 | 8,100 | 37,989.00 | 0.16 |
| 127 | 300724 | 捷佳伟创 | 1,000 | 37,890.00 | 0.16 |
| 128 | 600197 | 伊力特 | 2,300 | 36,869.00 | 0.15 |
| 129 | 603596 | 伯特利 | 1,600 | 36,000.00 | 0.15 |
| 130 | 000034 | 神州数码 | 1,800 | 35,730.00 | 0.15 |
| 131 | 002568 | 百润股份 | 1,300 | 34,151.00 | 0.14 |
| 132 | 603801 | 志邦家居 | 1,400 | 32,606.00 | 0.14 |
| 133 | 603920 | 世运电路 | 1,700 | 32,453.00 | 0.14 |
| 134 | 300613 | 富瀚微 | 200 | 32,436.00 | 0.14 |
| 135 | 600211 | 西藏药业 | 1,000 | 31,990.00 | 0.13 |
| 136 | 600987 | 航民股份 | 5,000 | 31,650.00 | 0.13 |
| 137 | 600711 | 盛屯矿业 | 5,900 | 31,211.00 | 0.13 |
| 138 | 002911 | 佛燃股份 | 2,000 | 30,840.00 | 0.13 |
| 139 | 603013 | 亚普股份 | 2,000 | 30,720.00 | 0.13 |
| 140 | 002929 | 润建股份 | 1,100 | 30,470.00 | 0.13 |
| 141 | 600529 | 山东药玻 | 1,100 | 30,404.00 | 0.13 |
| 142 | 002262 | 恩华药业 | 2,600 | 30,238.00 | 0.13 |
| 143 | 300212 | 易华录 | 900 | 30,096.00 | 0.13 |
| 144 | 002918 | 蒙娜丽莎 | 1,500 | 30,030.00 | 0.13 |
| 145 | 603619 | 中曼石油 | 2,100 | 29,274.00 | 0.12 |
| 146 | 002458 | 益生股份 | 1,000 | 28,350.00 | 0.12 |
| 147 | 300036 | 超图软件 | 1,400 | 27,902.00 | 0.12 |
| 148 | 000925 | 众合科技 | 4,100 | 27,470.00 | 0.11 |
| 149 | 300369 | 绿盟科技 | 1,500 | 27,180.00 | 0.11 |
| 150 | 600621 | 华鑫股份 | 1,700 | 26,027.00 | 0.11 |
| 151 | 601636 | 旗滨集团 | 4,700 | 25,803.00 | 0.11 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 152 | 603803 | 瑞斯康达 | 2,000 | 25,800.00 | 0.11 |
| 153 | 600363 | 联创光电 | 1,600 | 24,464.00 | 0.10 |
| 154 | 603587 | 地素时尚 | 900 | 22,842.00 | 0.10 |
| 155 | 300476 | 胜宏科技 | 1,400 | 22,834.00 | 0.10 |
| 156 | 300458 | 全志科技 | 700 | 22,393.00 | 0.09 |
| 157 | 002043 | 兔宝宝 | 3,000 | 22,050.00 | 0.09 |
| 158 | 600797 | 浙大网新 | 2,100 | 21,147.00 | 0.09 |
| 159 | 603363 | 傲农生物 | 1,300 | 20,592.00 | 0.09 |
| 160 | 601949 | 中国出版 | 3,200 | 20,256.00 | 0.08 |
| 161 | 002798 | 帝欧家居 | 800 | 20,040.00 | 0.08 |
| 162 | 002705 | 新宝股份 | 1,200 | 19,788.00 | 0.08 |
| 163 | 600601 | 方正科技 | 5,400 | 19,764.00 | 0.08 |
| 164 | 600206 | 有研新材 | 1,500 | 18,300.00 | 0.08 |
| 165 | 002649 | 博彦科技 | 1,800 | 17,856.00 | 0.07 |
| 166 | 600850 | 华东电脑 | 700 | 17,752.00 | 0.07 |
| 167 | 002429 | 兆驰股份 | 5,000 | 17,400.00 | 0.07 |
| 168 | 603612 | 索通发展 | 1,400 | 17,346.00 | 0.07 |
| 169 | 000667 | 美好置业 | 6,100 | 16,653.00 | 0.07 |
| 170 | 603096 | 新经典 | 300 | 16,590.00 | 0.07 |
| 171 | 600129 | 太极集团 | 1,400 | 15,918.00 | 0.07 |
| 172 | 002351 | 漫步者 | 700 | 15,750.00 | 0.07 |
| 173 | 600571 | 信雅达 | 1,600 | 15,248.00 | 0.06 |
| 174 | 603081 | 大丰实业 | 900 | 14,679.00 | 0.06 |
| 175 | 300595 | 欧普康视 | 300 | 14,199.00 | 0.06 |
| 176 | 600285 | 羚锐制药 | 1,400 | 13,860.00 | 0.06 |
| 177 | 000829 | 天音控股 | 2,200 | 13,794.00 | 0.06 |
| 178 | 300357 | 我武生物 | 300 | 13,245.00 | 0.06 |
| 179 | 300735 | 光弘科技 | 500 | 13,040.00 | 0.05 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 180 | 000049 | 德赛电池 | 300 | 12,222.00 | 0.05 |
| 181 | 603367 | 辰欣药业 | 700 | 11,585.00 | 0.05 |
| 182 | 002726 | 龙大肉食 | 1,600 | 11,200.00 | 0.05 |
| 183 | 600391 | 航发科技 | 600 | 8,286.00 | 0.03 |
| 184 | 603728 | 鸣志电器 | 700 | 7,756.00 | 0.03 |
| 185 | 300229 | 拓尔思 | 600 | 7,740.00 | 0.03 |
| 186 | 300723 | 一品红 | 200 | 7,672.00 | 0.03 |
| 187 | 000560 | 我爱我家 | 1,700 | 7,327.00 | 0.03 |
| 188 | 000910 | 大亚圣象 | 500 | 6,995.00 | 0.03 |
| 189 | 603108 | 润达医疗 | 700 | 6,958.00 | 0.03 |
| 190 | 300725 | 药石科技 | 100 | 6,833.00 | 0.03 |
| 191 | 300096 | 易联众 | 700 | 6,797.00 | 0.03 |
| 192 | 603533 | 掌阅科技 | 400 | 6,776.00 | 0.03 |
| 193 | 601375 | 中原证券 | 1,100 | 5,896.00 | 0.02 |
| 194 | 002850 | 科达利 | 100 | 4,550.00 | 0.02 |
| 195 | 002095 | 生意宝 | 200 | 4,456.00 | 0.02 |
| 196 | 300021 | 大禹节水 | 800 | 4,240.00 | 0.02 |
| 197 | 603686 | 龙马环卫 | 360 | 3,931.20 | 0.02 |
| 198 | 603103 | 横店影视 | 200 | 3,762.00 | 0.02 |
| 199 | 603026 | 石大胜华 | 100 | 3,502.00 | 0.01 |
| 200 | 300255 | 常山药业 | 600 | 3,264.00 | 0.01 |
| 201 | 600207 | 安彩高科 | 600 | 2,802.00 | 0.01 |
| 202 | 300439 | 美康生物 | 200 | 2,718.00 | 0.01 |
| 203 | 002303 | 美盈森 | 400 | 2,124.00 | 0.01 |
| 204 | 002822 | 中装建设 | 200 | 1,978.00 | 0.01 |
| 205 | 002519 | 银河电子 | 500 | 1,960.00 | 0.01 |
| 206 | 300085 | 银之杰 | 100 | 1,548.00 | 0.01 |
| 207 | 000555 | 神州信息 | 100 | 1,481.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 208 | 002461 | 珠江啤酒 | 200 | 1,428.00 | 0.01 |
| 209 | 000917 | 电广传媒 | 100 | 674.00 | 0.00 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|-------|--------|------------|--------------|
| 1 | 601077 | 渝农商行 | 73,889 | 462,545.14 | 1.93 |
| 2 | 688258 | 卓易信息 | 3,465 | 242,723.25 | 1.01 |
| 3 | 002869 | 金溢科技 | 3,300 | 215,589.00 | 0.90 |
| 4 | 002752 | 昇兴股份 | 33,500 | 205,690.00 | 0.86 |
| 5 | 300251 | 光线传媒 | 16,300 | 192,340.00 | 0.80 |
| 6 | 688368 | 晶丰明源 | 2,557 | 192,107.41 | 0.80 |
| 7 | 688128 | 中国电研 | 9,027 | 158,153.04 | 0.66 |
| 8 | 600267 | 海正药业 | 14,700 | 145,677.00 | 0.61 |
| 9 | 600501 | 航天晨光 | 16,200 | 126,522.00 | 0.53 |
| 10 | 603303 | 得邦照明 | 12,200 | 125,782.00 | 0.52 |
| 11 | 688202 | 美迪西 | 2,120 | 107,696.00 | 0.45 |
| 12 | 600731 | 湖南海利 | 14,000 | 101,080.00 | 0.42 |
| 13 | 002105 | 信隆健康 | 16,300 | 96,170.00 | 0.40 |
| 14 | 000573 | 粤宏远 A | 31,100 | 96,099.00 | 0.40 |
| 15 | 300432 | 富临精工 | 6,900 | 85,491.00 | 0.36 |
| 16 | 603999 | 读者传媒 | 11,000 | 80,740.00 | 0.34 |
| 17 | 000736 | 中交地产 | 11,100 | 79,032.00 | 0.33 |
| 18 | 603699 | 纽威股份 | 5,100 | 70,482.00 | 0.29 |
| 19 | 600510 | 黑牡丹 | 9,700 | 64,990.00 | 0.27 |
| 20 | 300162 | 雷曼光电 | 7,100 | 63,900.00 | 0.27 |
| 21 | 300543 | 朗科智能 | 2,700 | 62,613.00 | 0.26 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 22 | 688181 | 八亿时空 | 1,255 | 55,194.90 | 0.23 |
| 23 | 603042 | 华脉科技 | 3,500 | 53,375.00 | 0.22 |
| 24 | 300014 | 亿纬锂能 | 1,000 | 50,160.00 | 0.21 |
| 25 | 603658 | 安图生物 | 500 | 48,190.00 | 0.20 |
| 26 | 603378 | 亚士创能 | 2,000 | 44,640.00 | 0.19 |
| 27 | 002111 | 威海广泰 | 2,500 | 39,100.00 | 0.16 |
| 28 | 300417 | 南华仪器 | 900 | 37,935.00 | 0.16 |
| 29 | 300693 | 盛弘股份 | 2,600 | 37,258.00 | 0.16 |
| 30 | 603277 | 银都股份 | 3,347 | 35,946.78 | 0.15 |
| 31 | 603315 | 福鞍股份 | 2,800 | 34,020.00 | 0.14 |
| 32 | 603890 | 春秋电子 | 3,000 | 31,680.00 | 0.13 |
| 33 | 300552 | 万集科技 | 300 | 25,320.00 | 0.11 |
| 34 | 300625 | 三雄极光 | 1,500 | 24,480.00 | 0.10 |
| 35 | 002876 | 三利谱 | 500 | 24,400.00 | 0.10 |
| 36 | 300719 | 安达维尔 | 1,900 | 22,268.00 | 0.09 |
| 37 | 603197 | 保隆科技 | 700 | 22,071.00 | 0.09 |
| 38 | 600079 | 人福医药 | 1,600 | 21,616.00 | 0.09 |
| 39 | 002972 | 科安达 | 1,075 | 21,532.25 | 0.09 |
| 40 | 300453 | 三鑫医疗 | 2,760 | 20,838.00 | 0.09 |
| 41 | 300433 | 蓝思科技 | 1,400 | 19,348.00 | 0.08 |
| 42 | 600745 | 闻泰科技 | 200 | 18,500.00 | 0.08 |
| 43 | 300491 | 通合科技 | 1,400 | 18,214.00 | 0.08 |
| 44 | 603109 | 神驰机电 | 684 | 18,105.48 | 0.08 |
| 45 | 300494 | 盛天网络 | 1,100 | 17,457.00 | 0.07 |
| 46 | 600132 | 重庆啤酒 | 328 | 17,042.88 | 0.07 |
| 47 | 603365 | 水星家纺 | 1,100 | 16,852.00 | 0.07 |
| 48 | 000042 | 中洲控股 | 1,400 | 15,204.00 | 0.06 |
| 49 | 601718 | 际华集团 | 4,400 | 14,344.00 | 0.06 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 50 | 300465 | 高伟达 | 1,400 | 14,126.00 | 0.06 |
| 51 | 300246 | 宝莱特 | 900 | 13,932.00 | 0.06 |
| 52 | 603679 | 华体科技 | 300 | 12,360.00 | 0.05 |
| 53 | 002660 | 茂硕电源 | 1,400 | 12,278.00 | 0.05 |
| 54 | 603309 | 维力医疗 | 700 | 10,262.00 | 0.04 |
| 55 | 603882 | 金域医学 | 200 | 10,244.00 | 0.04 |
| 56 | 603916 | 苏博特 | 600 | 10,128.00 | 0.04 |
| 57 | 000151 | 中成股份 | 900 | 9,450.00 | 0.04 |
| 58 | 603730 | 岱美股份 | 300 | 9,063.00 | 0.04 |
| 59 | 300129 | 泰胜风能 | 1,700 | 8,262.00 | 0.03 |
| 60 | 002909 | 集泰股份 | 700 | 8,050.00 | 0.03 |
| 61 | 600143 | 金发科技 | 1,100 | 8,008.00 | 0.03 |
| 62 | 603819 | 神力股份 | 500 | 6,955.00 | 0.03 |
| 63 | 000812 | 陕西金叶 | 2,100 | 6,930.00 | 0.03 |
| 64 | 002973 | 侨银环保 | 1,146 | 6,578.04 | 0.03 |
| 65 | 603229 | 奥翔药业 | 300 | 6,078.00 | 0.03 |
| 66 | 600466 | 蓝光发展 | 800 | 5,896.00 | 0.02 |
| 67 | 300231 | 银信科技 | 700 | 5,845.00 | 0.02 |
| 68 | 300690 | 双一科技 | 200 | 5,054.00 | 0.02 |
| 69 | 002860 | 星帅尔 | 200 | 4,626.00 | 0.02 |
| 70 | 002731 | 萃华珠宝 | 400 | 3,100.00 | 0.01 |

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 | 601677 | 明泰铝业 | 4,857,865.00 | 48.71 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|-------|
| 2 | 600846 | 同济科技 | 4,710,021.00 | 47.23 |
| 3 | 002139 | 拓邦股份 | 4,281,569.50 | 42.93 |
| 4 | 600728 | 佳都科技 | 4,228,170.00 | 42.40 |
| 5 | 600995 | 文山电力 | 4,204,596.00 | 42.16 |
| 6 | 600533 | 栖霞建设 | 4,201,597.00 | 42.13 |
| 7 | 000973 | 佛塑科技 | 3,884,151.71 | 38.95 |
| 8 | 603368 | 柳药股份 | 3,804,468.40 | 38.15 |
| 9 | 600063 | 皖维高新 | 3,701,382.00 | 37.11 |
| 10 | 601058 | 赛轮轮胎 | 3,579,903.60 | 35.90 |
| 11 | 603063 | 禾望电气 | 3,479,040.00 | 34.88 |
| 12 | 600261 | 阳光照明 | 3,456,572.00 | 34.66 |
| 13 | 002016 | 世荣兆业 | 3,372,576.48 | 33.82 |
| 14 | 000601 | 韶能股份 | 3,284,719.02 | 32.94 |
| 15 | 600502 | 安徽建工 | 3,205,399.00 | 32.14 |
| 16 | 600720 | 祁连山 | 3,196,698.80 | 32.05 |
| 17 | 600343 | 航天动力 | 3,146,492.00 | 31.55 |
| 18 | 300014 | 亿纬锂能 | 3,019,403.00 | 30.28 |
| 19 | 000672 | 上峰水泥 | 3,008,404.00 | 30.17 |
| 20 | 603118 | 共进股份 | 2,954,791.00 | 29.63 |
| 21 | 300231 | 银信科技 | 2,929,007.00 | 29.37 |
| 22 | 300303 | 聚飞光电 | 2,838,169.00 | 28.46 |
| 23 | 300660 | 江苏雷利 | 2,803,302.60 | 28.11 |
| 24 | 300497 | 富祥股份 | 2,798,120.60 | 28.06 |
| 25 | 603699 | 纽威股份 | 2,727,925.00 | 27.35 |
| 26 | 002907 | 华森制药 | 2,721,382.00 | 27.29 |
| 27 | 603126 | 中材节能 | 2,716,934.00 | 27.24 |
| 28 | 300209 | 天泽信息 | 2,700,437.00 | 27.08 |
| 29 | 002792 | 通宇通讯 | 2,630,025.00 | 26.37 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|-------|
| 30 | 002367 | 康力电梯 | 2,518,428.00 | 25.25 |
| 31 | 002928 | 华夏航空 | 2,453,232.00 | 24.60 |
| 32 | 300114 | 中航电测 | 2,450,598.00 | 24.57 |
| 33 | 000913 | 钱江摩托 | 2,448,718.78 | 24.55 |
| 34 | 002182 | 云海金属 | 2,428,179.00 | 24.35 |
| 35 | 600675 | 中华企业 | 2,417,860.00 | 24.24 |
| 36 | 600552 | 凯盛科技 | 2,398,518.00 | 24.05 |
| 37 | 600855 | 航天长峰 | 2,268,231.00 | 22.74 |
| 38 | 603298 | 杭叉集团 | 2,242,262.29 | 22.48 |
| 39 | 002094 | 青岛金王 | 2,217,894.00 | 22.24 |
| 40 | 600449 | 宁夏建材 | 2,215,817.00 | 22.22 |
| 41 | 002734 | 利民股份 | 2,215,776.00 | 22.22 |
| 42 | 300628 | 亿联网络 | 2,199,358.00 | 22.05 |
| 43 | 300171 | 东富龙 | 2,175,518.00 | 21.81 |
| 44 | 002020 | 京新药业 | 2,138,081.00 | 21.44 |
| 45 | 002746 | 仙坛股份 | 2,119,549.00 | 21.25 |
| 46 | 600136 | 当代明诚 | 2,117,451.00 | 21.23 |
| 47 | 000905 | 厦门港务 | 2,104,043.00 | 21.10 |
| 48 | 601163 | 三角轮胎 | 2,098,934.00 | 21.05 |
| 49 | 600446 | 金证股份 | 2,091,402.00 | 20.97 |
| 50 | 002396 | 星网锐捷 | 2,086,013.00 | 20.92 |
| 51 | 601107 | 四川成渝 | 2,070,880.00 | 20.76 |
| 52 | 001896 | 豫能控股 | 2,053,649.00 | 20.59 |
| 53 | 300130 | 新国都 | 2,033,978.00 | 20.39 |
| 54 | 000810 | 创维数字 | 2,029,987.00 | 20.35 |
| 55 | 300571 | 平治信息 | 2,022,718.00 | 20.28 |
| 56 | 000957 | 中通客车 | 2,011,491.00 | 20.17 |
| 57 | 002458 | 益生股份 | 2,009,658.00 | 20.15 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|-------|
| 58 | 002362 | 汉王科技 | 1,994,344.00 | 20.00 |
| 59 | 000550 | 江铃汽车 | 1,992,586.00 | 19.98 |
| 60 | 300016 | 北陆药业 | 1,938,194.00 | 19.43 |
| 61 | 300438 | 鹏辉能源 | 1,932,866.00 | 19.38 |
| 62 | 300233 | 金城医药 | 1,924,686.59 | 19.30 |
| 63 | 603385 | 惠达卫浴 | 1,900,759.47 | 19.06 |
| 64 | 600668 | 尖峰集团 | 1,897,907.00 | 19.03 |
| 65 | 002318 | 久立特材 | 1,873,741.00 | 18.79 |
| 66 | 600185 | 格力地产 | 1,865,668.00 | 18.71 |
| 67 | 000035 | 中国天楹 | 1,860,953.00 | 18.66 |
| 68 | 600180 | 瑞茂通 | 1,857,409.80 | 18.62 |
| 69 | 300349 | 金卡智能 | 1,851,062.00 | 18.56 |
| 70 | 002379 | 宏创控股 | 1,838,633.00 | 18.44 |
| 71 | 002605 | 姚记科技 | 1,825,616.00 | 18.31 |
| 72 | 000915 | 山大华特 | 1,816,452.00 | 18.21 |
| 73 | 002869 | 金溢科技 | 1,786,120.00 | 17.91 |
| 74 | 300682 | 朗新科技 | 1,773,452.00 | 17.78 |
| 75 | 300298 | 三诺生物 | 1,768,063.28 | 17.73 |
| 76 | 002577 | 雷柏科技 | 1,765,018.00 | 17.70 |
| 77 | 600229 | 城市传媒 | 1,747,863.00 | 17.53 |
| 78 | 601599 | 鹿港文化 | 1,738,397.00 | 17.43 |
| 79 | 601886 | 江河集团 | 1,727,777.00 | 17.32 |
| 80 | 000411 | 英特集团 | 1,725,385.00 | 17.30 |
| 81 | 300523 | 辰安科技 | 1,722,444.10 | 17.27 |
| 82 | 600581 | 八一钢铁 | 1,714,726.00 | 17.19 |
| 83 | 600132 | 重庆啤酒 | 1,705,800.04 | 17.10 |
| 84 | 300417 | 南华仪器 | 1,702,123.00 | 17.07 |
| 85 | 000576 | 广东甘化 | 1,700,332.00 | 17.05 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|-------|
| 86 | 603067 | 振华股份 | 1,700,229.24 | 17.05 |
| 87 | 300568 | 星源材质 | 1,694,572.00 | 16.99 |
| 88 | 600405 | 动力源 | 1,694,087.00 | 16.99 |
| 89 | 300726 | 宏达电子 | 1,693,751.00 | 16.98 |
| 90 | 600310 | 桂东电力 | 1,688,727.00 | 16.93 |
| 91 | 000650 | 仁和药业 | 1,683,243.00 | 16.88 |
| 92 | 300236 | 上海新阳 | 1,680,868.00 | 16.85 |
| 93 | 601126 | 四方股份 | 1,677,286.00 | 16.82 |
| 94 | 300502 | 新易盛 | 1,675,878.00 | 16.80 |
| 95 | 603277 | 银都股份 | 1,675,467.56 | 16.80 |
| 96 | 600985 | 淮北矿业 | 1,669,633.00 | 16.74 |
| 97 | 002351 | 漫步者 | 1,658,090.18 | 16.63 |
| 98 | 002377 | 国创高新 | 1,646,455.00 | 16.51 |
| 99 | 603043 | 广州酒家 | 1,644,900.00 | 16.49 |
| 100 | 002314 | 南山控股 | 1,626,693.00 | 16.31 |
| 101 | 002335 | 科华恒盛 | 1,617,399.88 | 16.22 |
| 102 | 002249 | 大洋电机 | 1,616,737.00 | 16.21 |
| 103 | 300012 | 华测检测 | 1,614,788.00 | 16.19 |
| 104 | 300613 | 富瀚微 | 1,613,647.00 | 16.18 |
| 105 | 002219 | 恒康医疗 | 1,608,596.68 | 16.13 |
| 106 | 000034 | 神州数码 | 1,597,776.00 | 16.02 |
| 107 | 603013 | 亚普股份 | 1,588,544.00 | 15.93 |
| 108 | 300045 | 华力创通 | 1,573,947.00 | 15.78 |
| 109 | 300322 | 硕贝德 | 1,568,425.00 | 15.73 |
| 110 | 002705 | 新宝股份 | 1,566,702.00 | 15.71 |
| 111 | 601918 | 新集能源 | 1,554,505.00 | 15.59 |
| 112 | 600768 | 宁波富邦 | 1,540,288.00 | 15.44 |
| 113 | 600510 | 黑牡丹 | 1,527,546.00 | 15.32 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|-------|
| 114 | 603026 | 石大胜华 | 1,522,597.00 | 15.27 |
| 115 | 600490 | 鹏欣资源 | 1,516,604.00 | 15.21 |
| 116 | 603609 | 禾丰牧业 | 1,509,973.00 | 15.14 |
| 117 | 300487 | 蓝晓科技 | 1,506,553.00 | 15.11 |
| 118 | 002782 | 可立克 | 1,498,608.25 | 15.03 |
| 119 | 600267 | 海正药业 | 1,492,807.80 | 14.97 |
| 120 | 600997 | 开滦股份 | 1,487,815.00 | 14.92 |
| 121 | 002084 | 海鸥住工 | 1,484,398.00 | 14.88 |
| 122 | 600626 | 申达股份 | 1,470,246.00 | 14.74 |
| 123 | 002851 | 麦格米特 | 1,465,976.00 | 14.70 |
| 124 | 000710 | 贝瑞基因 | 1,464,429.00 | 14.68 |
| 125 | 300198 | 纳川股份 | 1,460,292.00 | 14.64 |
| 126 | 300636 | 同和药业 | 1,444,038.00 | 14.48 |
| 127 | 300039 | 上海凯宝 | 1,408,388.23 | 14.12 |
| 128 | 600936 | 广西广电 | 1,404,216.00 | 14.08 |
| 129 | 002234 | 民和股份 | 1,401,318.00 | 14.05 |
| 130 | 601666 | 平煤股份 | 1,396,689.00 | 14.00 |
| 131 | 600873 | 梅花生物 | 1,393,350.00 | 13.97 |
| 132 | 002611 | 东方精工 | 1,393,078.00 | 13.97 |
| 133 | 600381 | 青海春天 | 1,383,775.30 | 13.88 |
| 134 | 002299 | 圣农发展 | 1,383,119.00 | 13.87 |
| 135 | 000802 | 北京文化 | 1,378,407.00 | 13.82 |
| 136 | 600012 | 皖通高速 | 1,376,464.80 | 13.80 |
| 137 | 000999 | 华润三九 | 1,368,734.00 | 13.72 |
| 138 | 603606 | 东方电缆 | 1,350,631.00 | 13.54 |
| 139 | 603458 | 勘设股份 | 1,347,310.18 | 13.51 |
| 140 | 000739 | 普洛药业 | 1,347,060.00 | 13.51 |
| 141 | 600391 | 航发科技 | 1,341,337.00 | 13.45 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|-------|
| 142 | 000019 | 深粮控股 | 1,331,457.20 | 13.35 |
| 143 | 600250 | 南纺股份 | 1,326,774.00 | 13.30 |
| 144 | 002895 | 川恒股份 | 1,317,511.00 | 13.21 |
| 145 | 000662 | 天夏智慧 | 1,303,879.00 | 13.07 |
| 146 | 300219 | 鸿利智汇 | 1,298,844.00 | 13.02 |
| 147 | 002011 | 盾安环境 | 1,297,466.00 | 13.01 |
| 148 | 300251 | 光线传媒 | 1,295,707.00 | 12.99 |
| 149 | 002124 | 天邦股份 | 1,284,996.00 | 12.88 |
| 150 | 002276 | 万马股份 | 1,272,988.00 | 12.76 |
| 151 | 600284 | 浦东建设 | 1,251,616.20 | 12.55 |
| 152 | 600273 | 嘉化能源 | 1,227,182.00 | 12.31 |
| 153 | 600129 | 太极集团 | 1,226,004.00 | 12.29 |
| 154 | 300118 | 东方日升 | 1,225,466.00 | 12.29 |
| 155 | 300020 | 银江股份 | 1,222,929.20 | 12.26 |
| 156 | 600323 | 瀚蓝环境 | 1,196,650.00 | 12.00 |
| 157 | 300533 | 冰川网络 | 1,195,514.00 | 11.99 |
| 158 | 300007 | 汉威科技 | 1,191,864.00 | 11.95 |
| 159 | 300043 | 星辉娱乐 | 1,180,708.00 | 11.84 |
| 160 | 000637 | 茂化实华 | 1,176,069.00 | 11.79 |
| 161 | 002755 | 奥赛康 | 1,173,710.00 | 11.77 |
| 162 | 002568 | 百润股份 | 1,168,091.50 | 11.71 |
| 163 | 300432 | 富临精工 | 1,159,878.00 | 11.63 |
| 164 | 603882 | 金域医学 | 1,158,510.00 | 11.62 |
| 165 | 601566 | 九牧王 | 1,157,227.00 | 11.60 |
| 166 | 300017 | 网宿科技 | 1,154,677.00 | 11.58 |
| 167 | 600715 | 文投控股 | 1,148,615.00 | 11.52 |
| 168 | 603733 | 仙鹤股份 | 1,143,295.00 | 11.46 |
| 169 | 000829 | 天音控股 | 1,142,760.00 | 11.46 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|-------|
| 170 | 000663 | 永安林业 | 1,141,677.00 | 11.45 |
| 171 | 600210 | 紫江企业 | 1,127,502.00 | 11.31 |
| 172 | 002531 | 天顺风能 | 1,120,770.00 | 11.24 |
| 173 | 000987 | 越秀金控 | 1,114,475.00 | 11.17 |
| 174 | 603309 | 维力医疗 | 1,092,828.00 | 10.96 |
| 175 | 000923 | 河钢资源 | 1,083,650.00 | 10.87 |
| 176 | 601360 | 三六零 | 1,082,585.00 | 10.86 |
| 177 | 600731 | 湖南海利 | 1,079,987.00 | 10.83 |
| 178 | 002246 | 北化股份 | 1,070,413.00 | 10.73 |
| 179 | 002664 | 长鹰信质 | 1,063,668.00 | 10.67 |
| 180 | 600382 | 广东明珠 | 1,062,955.80 | 10.66 |
| 181 | 300075 | 数字政通 | 1,054,166.00 | 10.57 |
| 182 | 603843 | 正平股份 | 1,049,119.00 | 10.52 |
| 183 | 603098 | 森特股份 | 1,046,528.60 | 10.49 |
| 184 | 002912 | 中新赛克 | 1,045,380.00 | 10.48 |
| 185 | 300529 | 健帆生物 | 1,043,895.00 | 10.47 |
| 186 | 300269 | 联建光电 | 1,039,395.00 | 10.42 |
| 187 | 600612 | 老凤祥 | 1,028,227.00 | 10.31 |
| 188 | 603959 | 百利科技 | 1,023,859.46 | 10.27 |
| 189 | 600217 | 中再资环 | 1,013,743.00 | 10.16 |
| 190 | 300034 | 钢研高纳 | 1,006,325.00 | 10.09 |
| 191 | 000042 | 中洲控股 | 1,001,055.00 | 10.04 |
| 192 | 000639 | 西王食品 | 994,256.00 | 9.97 |
| 193 | 603008 | 喜临门 | 993,277.00 | 9.96 |
| 194 | 603887 | 城地股份 | 988,365.20 | 9.91 |
| 195 | 002906 | 华阳集团 | 987,693.00 | 9.90 |
| 196 | 600501 | 航天晨光 | 980,508.00 | 9.83 |
| 197 | 300531 | 优博讯 | 976,206.00 | 9.79 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 198 | 600662 | 强生控股 | 970,401.00 | 9.73 |
| 199 | 002045 | 国光电器 | 967,937.00 | 9.71 |
| 200 | 000591 | 太阳能 | 961,319.00 | 9.64 |
| 201 | 300066 | 三川智慧 | 961,201.00 | 9.64 |
| 202 | 300378 | 鼎捷软件 | 959,896.00 | 9.62 |
| 203 | 600641 | 万业企业 | 958,395.00 | 9.61 |
| 204 | 002653 | 海思科 | 953,298.00 | 9.56 |
| 205 | 300393 | 中来股份 | 950,219.72 | 9.53 |
| 206 | 603508 | 思维列控 | 948,258.00 | 9.51 |
| 207 | 300602 | 飞荣达 | 947,313.00 | 9.50 |
| 208 | 603585 | 苏利股份 | 941,686.00 | 9.44 |
| 209 | 002756 | 永兴材料 | 939,423.40 | 9.42 |
| 210 | 600740 | 山西焦化 | 929,753.00 | 9.32 |
| 211 | 000700 | 模塑科技 | 929,574.00 | 9.32 |
| 212 | 603579 | 荣泰健康 | 927,918.00 | 9.30 |
| 213 | 002036 | 联创电子 | 924,444.49 | 9.27 |
| 214 | 002262 | 恩华药业 | 920,924.00 | 9.23 |
| 215 | 603058 | 永吉股份 | 916,731.00 | 9.19 |
| 216 | 603980 | 吉华集团 | 916,490.60 | 9.19 |
| 217 | 600805 | 悦达投资 | 916,213.00 | 9.19 |
| 218 | 002651 | 利君股份 | 910,796.00 | 9.13 |
| 219 | 601588 | 北辰实业 | 907,703.00 | 9.10 |
| 220 | 300158 | 振东制药 | 899,573.00 | 9.02 |
| 221 | 002534 | 杭锅股份 | 897,519.00 | 9.00 |
| 222 | 300366 | 创意信息 | 895,695.00 | 8.98 |
| 223 | 603218 | 日月股份 | 888,308.00 | 8.91 |
| 224 | 603393 | 新天然气 | 876,395.80 | 8.79 |
| 225 | 601900 | 南方传媒 | 875,485.97 | 8.78 |

| | | | | |
|-----|--------|-------|------------|------|
| 226 | 601717 | 郑煤机 | 872,122.00 | 8.74 |
| 227 | 000951 | 中国重汽 | 867,464.00 | 8.70 |
| 228 | 002279 | 久其软件 | 867,426.10 | 8.70 |
| 229 | 600336 | 澳柯玛 | 856,393.00 | 8.59 |
| 230 | 300702 | 天宇股份 | 847,308.00 | 8.50 |
| 231 | 000751 | 锌业股份 | 839,160.00 | 8.41 |
| 232 | 002850 | 科达利 | 831,024.00 | 8.33 |
| 233 | 300624 | 万兴科技 | 829,177.00 | 8.31 |
| 234 | 601369 | 陕鼓动力 | 826,120.57 | 8.28 |
| 235 | 603819 | 神力股份 | 821,404.60 | 8.24 |
| 236 | 002292 | 奥飞娱乐 | 820,908.00 | 8.23 |
| 237 | 000967 | 盈峰环境 | 814,677.00 | 8.17 |
| 238 | 002609 | 捷顺科技 | 809,978.00 | 8.12 |
| 239 | 603666 | 亿嘉和 | 806,967.00 | 8.09 |
| 240 | 300310 | 宜通世纪 | 804,675.16 | 8.07 |
| 241 | 002567 | 唐人神 | 801,103.00 | 8.03 |
| 242 | 300558 | 贝达药业 | 799,533.00 | 8.02 |
| 243 | 000933 | 神火股份 | 782,855.00 | 7.85 |
| 244 | 601116 | 三江购物 | 782,459.00 | 7.85 |
| 245 | 601077 | 渝农商行 | 776,884.80 | 7.79 |
| 246 | 600812 | 华北制药 | 771,490.00 | 7.74 |
| 247 | 000900 | 现代投资 | 771,230.00 | 7.73 |
| 248 | 603596 | 伯特利 | 770,810.00 | 7.73 |
| 249 | 300277 | 海联讯 | 765,441.00 | 7.68 |
| 250 | 300738 | 奥飞数据 | 765,247.00 | 7.67 |
| 251 | 600422 | 昆药集团 | 764,145.00 | 7.66 |
| 252 | 002698 | 博实股份 | 761,538.00 | 7.64 |
| 253 | 000573 | 粤宏远 A | 760,115.00 | 7.62 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 254 | 603208 | 江山欧派 | 756,319.00 | 7.58 |
| 255 | 300205 | 天喻信息 | 755,071.00 | 7.57 |
| 256 | 603658 | 安图生物 | 754,980.00 | 7.57 |
| 257 | 300038 | 数知科技 | 752,100.00 | 7.54 |
| 258 | 600664 | 哈药股份 | 737,564.00 | 7.40 |
| 259 | 002105 | 信隆健康 | 734,345.00 | 7.36 |
| 260 | 002435 | 长江健康 | 734,041.00 | 7.36 |
| 261 | 603638 | 艾迪精密 | 720,393.00 | 7.22 |
| 262 | 002867 | 周大生 | 716,390.00 | 7.18 |
| 263 | 002100 | 天康生物 | 713,282.00 | 7.15 |
| 264 | 600200 | 江苏吴中 | 709,539.00 | 7.11 |
| 265 | 600685 | 中船防务 | 708,515.00 | 7.10 |
| 266 | 002712 | 思美传媒 | 704,338.00 | 7.06 |
| 267 | 600287 | 江苏舜天 | 700,835.00 | 7.03 |
| 268 | 300083 | 劲胜智能 | 696,535.00 | 6.98 |
| 269 | 000560 | 我爱我家 | 694,858.00 | 6.97 |
| 270 | 000718 | 苏宁环球 | 694,578.60 | 6.96 |
| 271 | 300570 | 太辰光 | 692,193.00 | 6.94 |
| 272 | 600470 | 六国化工 | 690,171.00 | 6.92 |
| 273 | 002197 | 证通电子 | 688,763.00 | 6.91 |
| 274 | 600096 | 云天化 | 688,319.00 | 6.90 |
| 275 | 600322 | 天房发展 | 686,401.00 | 6.88 |
| 276 | 002035 | 华帝股份 | 679,319.00 | 6.81 |
| 277 | 300559 | 佳发教育 | 674,306.00 | 6.76 |
| 278 | 688111 | 金山办公 | 672,261.74 | 6.74 |
| 279 | 300411 | 金盾股份 | 671,138.00 | 6.73 |
| 280 | 002759 | 天际股份 | 670,803.00 | 6.73 |
| 281 | 000657 | 中钨高新 | 669,760.64 | 6.72 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 282 | 300248 | 新开普 | 669,407.00 | 6.71 |
| 283 | 603999 | 读者传媒 | 668,569.00 | 6.70 |
| 284 | 603660 | 苏州科达 | 664,450.00 | 6.66 |
| 285 | 002237 | 恒邦股份 | 662,140.00 | 6.64 |
| 286 | 300496 | 中科创达 | 660,520.00 | 6.62 |
| 287 | 002135 | 东南网架 | 658,805.00 | 6.61 |
| 288 | 002833 | 弘亚数控 | 655,878.00 | 6.58 |
| 289 | 603603 | 博天环境 | 653,370.00 | 6.55 |
| 290 | 002657 | 中科金财 | 644,139.00 | 6.46 |
| 291 | 601811 | 新华文轩 | 642,034.00 | 6.44 |
| 292 | 603989 | 艾华集团 | 639,856.00 | 6.42 |
| 293 | 600987 | 航民股份 | 638,308.00 | 6.40 |
| 294 | 600346 | 恒力石化 | 636,521.00 | 6.38 |
| 295 | 600207 | 安彩高科 | 629,004.00 | 6.31 |
| 296 | 300256 | 星星科技 | 628,781.00 | 6.30 |
| 297 | 300634 | 彩讯股份 | 622,548.00 | 6.24 |
| 298 | 300311 | 任子行 | 622,108.00 | 6.24 |
| 299 | 603357 | 设计总院 | 619,575.00 | 6.21 |
| 300 | 002402 | 和而泰 | 619,192.00 | 6.21 |
| 301 | 603356 | 华菱精工 | 618,586.00 | 6.20 |
| 302 | 300242 | 佳云科技 | 617,510.00 | 6.19 |
| 303 | 600211 | 西藏药业 | 616,109.00 | 6.18 |
| 304 | 603199 | 九华旅游 | 615,799.00 | 6.17 |
| 305 | 300737 | 科顺股份 | 614,876.00 | 6.17 |
| 306 | 600162 | 香江控股 | 609,696.00 | 6.11 |
| 307 | 600667 | 太极实业 | 608,339.00 | 6.10 |
| 308 | 002228 | 合兴包装 | 607,272.00 | 6.09 |
| 309 | 600828 | 茂业商业 | 603,140.14 | 6.05 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 310 | 002433 | 太安堂 | 601,487.00 | 6.03 |
| 311 | 300465 | 高伟达 | 598,278.00 | 6.00 |
| 312 | 603737 | 三棵树 | 594,852.00 | 5.96 |
| 313 | 000993 | 闽东电力 | 592,812.00 | 5.94 |
| 314 | 603801 | 志邦家居 | 590,645.00 | 5.92 |
| 315 | 600512 | 腾达建设 | 590,105.00 | 5.92 |
| 316 | 300061 | 旗天科技 | 588,197.00 | 5.90 |
| 317 | 002649 | 博彦科技 | 585,772.00 | 5.87 |
| 318 | 000838 | 财信发展 | 585,245.00 | 5.87 |
| 319 | 000736 | 中交地产 | 585,141.20 | 5.87 |
| 320 | 002022 | 科华生物 | 584,421.00 | 5.86 |
| 321 | 300213 | 佳讯飞鸿 | 577,862.00 | 5.79 |
| 322 | 300460 | 惠伦晶体 | 576,875.00 | 5.78 |
| 323 | 300131 | 英唐智控 | 571,489.00 | 5.73 |
| 324 | 603165 | 荣晟环保 | 568,031.00 | 5.70 |
| 325 | 603811 | 诚意药业 | 567,690.00 | 5.69 |
| 326 | 300661 | 圣邦股份 | 563,662.00 | 5.65 |
| 327 | 600496 | 精工钢构 | 562,317.00 | 5.64 |
| 328 | 300447 | 全信股份 | 561,454.60 | 5.63 |
| 329 | 600251 | 冠农股份 | 556,998.00 | 5.59 |
| 330 | 002521 | 齐峰新材 | 556,892.00 | 5.58 |
| 331 | 603129 | 春风动力 | 555,470.00 | 5.57 |
| 332 | 300223 | 北京君正 | 549,806.00 | 5.51 |
| 333 | 600031 | 三一重工 | 548,168.00 | 5.50 |
| 334 | 000151 | 中成股份 | 546,104.00 | 5.48 |
| 335 | 601336 | 新华保险 | 541,777.00 | 5.43 |
| 336 | 002308 | 威创股份 | 534,719.00 | 5.36 |
| 337 | 002156 | 通富微电 | 534,111.00 | 5.36 |

| | | | | |
|-----|--------|--------|------------|------|
| 338 | 601700 | 风范股份 | 529,970.00 | 5.31 |
| 339 | 601718 | 际华集团 | 529,624.00 | 5.31 |
| 340 | 002329 | 皇氏集团 | 528,083.00 | 5.30 |
| 341 | 002091 | 江苏国泰 | 526,136.00 | 5.28 |
| 342 | 600456 | 宝钛股份 | 525,692.00 | 5.27 |
| 343 | 603587 | 地素时尚 | 521,961.00 | 5.23 |
| 344 | 600677 | *ST 航通 | 515,217.00 | 5.17 |
| 345 | 600984 | 建设机械 | 511,514.00 | 5.13 |
| 346 | 600681 | 百川能源 | 510,922.60 | 5.12 |
| 347 | 002876 | 三利谱 | 510,011.00 | 5.11 |
| 348 | 603299 | 苏盐井神 | 503,597.00 | 5.05 |
| 349 | 600691 | 阳煤化工 | 503,095.00 | 5.04 |
| 350 | 603160 | 汇顶科技 | 502,617.00 | 5.04 |
| 351 | 600587 | 新华医疗 | 500,976.00 | 5.02 |
| 352 | 002024 | 苏宁易购 | 500,698.00 | 5.02 |
| 353 | 300690 | 双一科技 | 498,634.00 | 5.00 |
| 354 | 603528 | 多伦科技 | 496,588.00 | 4.98 |
| 355 | 603693 | 江苏新能 | 495,250.00 | 4.97 |
| 356 | 600090 | 同济堂 | 494,230.00 | 4.96 |
| 357 | 600589 | 广东榕泰 | 492,499.00 | 4.94 |
| 358 | 603920 | 世运电路 | 492,404.00 | 4.94 |
| 359 | 300735 | 光弘科技 | 491,490.00 | 4.93 |
| 360 | 600988 | 赤峰黄金 | 490,708.00 | 4.92 |
| 361 | 000049 | 德赛电池 | 490,051.00 | 4.91 |
| 362 | 600571 | 信雅达 | 487,716.00 | 4.89 |
| 363 | 002539 | 云图控股 | 482,118.00 | 4.83 |
| 364 | 600117 | 西宁特钢 | 480,416.00 | 4.82 |
| 365 | 002913 | 奥士康 | 474,925.00 | 4.76 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 366 | 603678 | 火炬电子 | 469,538.00 | 4.71 |
| 367 | 002933 | 新兴装备 | 466,835.00 | 4.68 |
| 368 | 600727 | 鲁北化工 | 465,438.00 | 4.67 |
| 369 | 002502 | 鼎龙文化 | 461,864.00 | 4.63 |
| 370 | 300401 | 花园生物 | 460,104.00 | 4.61 |
| 371 | 601890 | 亚星锚链 | 458,677.00 | 4.60 |
| 372 | 000851 | 高鸿股份 | 458,300.00 | 4.60 |
| 373 | 603618 | 杭电股份 | 458,121.00 | 4.59 |
| 374 | 002518 | 科士达 | 456,969.00 | 4.58 |
| 375 | 002326 | 永太科技 | 450,824.00 | 4.52 |
| 376 | 300132 | 青松股份 | 450,320.00 | 4.52 |
| 377 | 300162 | 雷曼光电 | 449,276.00 | 4.50 |
| 378 | 000708 | 中信特钢 | 447,519.00 | 4.49 |
| 379 | 002429 | 兆驰股份 | 446,899.00 | 4.48 |
| 380 | 002511 | 中顺洁柔 | 445,779.00 | 4.47 |
| 381 | 300306 | 远方信息 | 445,684.80 | 4.47 |
| 382 | 603798 | 康普顿 | 443,989.00 | 4.45 |
| 383 | 002662 | 京威股份 | 443,679.00 | 4.45 |
| 384 | 002123 | 梦网集团 | 441,746.00 | 4.43 |
| 385 | 300170 | 汉得信息 | 441,733.00 | 4.43 |
| 386 | 600418 | 江淮汽车 | 436,505.00 | 4.38 |
| 387 | 002481 | 双塔食品 | 436,043.00 | 4.37 |
| 388 | 000812 | 陕西金叶 | 435,307.00 | 4.36 |
| 389 | 603696 | 安记食品 | 433,417.00 | 4.35 |
| 390 | 603800 | 道森股份 | 432,203.00 | 4.33 |
| 391 | 300379 | 东方通 | 429,488.00 | 4.31 |
| 392 | 000921 | 海信家电 | 428,703.00 | 4.30 |
| 393 | 600594 | 益佰制药 | 427,032.00 | 4.28 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 394 | 603533 | 掌阅科技 | 426,493.00 | 4.28 |
| 395 | 600057 | 厦门象屿 | 425,042.00 | 4.26 |
| 396 | 300664 | 鹏鹞环保 | 422,674.00 | 4.24 |
| 397 | 600894 | 广日股份 | 421,087.00 | 4.22 |
| 398 | 603360 | 百傲化学 | 420,861.00 | 4.22 |
| 399 | 300543 | 朗科智能 | 419,493.00 | 4.21 |
| 400 | 603988 | 中电电机 | 415,560.00 | 4.17 |
| 401 | 300078 | 思创医惠 | 414,887.00 | 4.16 |
| 402 | 603042 | 华脉科技 | 411,065.00 | 4.12 |
| 403 | 002360 | 同德化工 | 406,002.00 | 4.07 |
| 404 | 603359 | 东珠生态 | 405,818.60 | 4.07 |
| 405 | 603289 | 泰瑞机器 | 405,761.00 | 4.07 |
| 406 | 688036 | 传音控股 | 405,384.95 | 4.06 |
| 407 | 601788 | 光大证券 | 401,911.25 | 4.03 |
| 408 | 600676 | 交运股份 | 401,003.00 | 4.02 |
| 409 | 002322 | 理工环科 | 397,983.00 | 3.99 |
| 410 | 688196 | 卓越新能 | 394,226.19 | 3.95 |
| 411 | 603619 | 中曼石油 | 394,196.00 | 3.95 |
| 412 | 002752 | 昇兴股份 | 389,120.60 | 3.90 |
| 413 | 603081 | 大丰实业 | 388,889.00 | 3.90 |
| 414 | 002171 | 楚江新材 | 388,255.00 | 3.89 |
| 415 | 688363 | 华熙生物 | 386,382.15 | 3.87 |
| 416 | 600206 | 有研新材 | 383,190.00 | 3.84 |
| 417 | 002810 | 山东赫达 | 381,661.00 | 3.83 |
| 418 | 603599 | 广信股份 | 380,127.00 | 3.81 |
| 419 | 300302 | 同有科技 | 379,541.00 | 3.81 |
| 420 | 601636 | 旗滨集团 | 379,157.00 | 3.80 |
| 421 | 000860 | 顺鑫农业 | 378,348.00 | 3.79 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 422 | 600127 | 金健米业 | 377,911.00 | 3.79 |
| 423 | 600986 | 科达股份 | 377,197.00 | 3.78 |
| 424 | 603676 | 卫信康 | 377,126.00 | 3.78 |
| 425 | 603516 | 淳中科技 | 376,447.00 | 3.77 |
| 426 | 300363 | 博腾股份 | 375,042.00 | 3.76 |
| 427 | 603871 | 嘉友国际 | 374,432.00 | 3.75 |
| 428 | 002413 | 雷科防务 | 373,787.00 | 3.75 |
| 429 | 300552 | 万集科技 | 373,070.00 | 3.74 |
| 430 | 300630 | 普利制药 | 373,057.00 | 3.74 |
| 431 | 000668 | 荣丰控股 | 371,813.00 | 3.73 |
| 432 | 300458 | 全志科技 | 371,606.00 | 3.73 |
| 433 | 603038 | 华立股份 | 370,520.40 | 3.72 |
| 434 | 300625 | 三雄极光 | 369,639.00 | 3.71 |
| 435 | 002557 | 洽洽食品 | 365,929.00 | 3.67 |
| 436 | 002666 | 德联集团 | 365,128.00 | 3.66 |
| 437 | 603099 | 长白山 | 362,072.00 | 3.63 |
| 438 | 300494 | 盛天网络 | 361,968.00 | 3.63 |
| 439 | 000622 | 恒立实业 | 361,344.00 | 3.62 |
| 440 | 002203 | 海亮股份 | 359,376.00 | 3.60 |
| 441 | 300352 | 北信源 | 358,549.00 | 3.60 |
| 442 | 600076 | 康欣新材 | 356,498.00 | 3.57 |
| 443 | 000697 | 炼石航空 | 355,647.00 | 3.57 |
| 444 | 600331 | 宏达股份 | 352,104.00 | 3.53 |
| 445 | 300640 | 德艺文创 | 351,836.00 | 3.53 |
| 446 | 603707 | 健友股份 | 351,049.00 | 3.52 |
| 447 | 002852 | 道道全 | 350,725.47 | 3.52 |
| 448 | 600761 | 安徽合力 | 347,869.00 | 3.49 |
| 449 | 300423 | 鲁亿通 | 346,939.00 | 3.48 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 450 | 002130 | 沃尔核材 | 343,263.00 | 3.44 |
| 451 | 002798 | 帝欧家居 | 342,574.00 | 3.44 |
| 452 | 603825 | 华扬联众 | 341,872.00 | 3.43 |
| 453 | 600797 | 浙大网新 | 341,560.00 | 3.42 |
| 454 | 002160 | 常铝股份 | 339,840.00 | 3.41 |
| 455 | 603378 | 亚士创能 | 339,725.00 | 3.41 |
| 456 | 000040 | 东旭蓝天 | 339,205.00 | 3.40 |
| 457 | 600107 | 美尔雅 | 336,842.00 | 3.38 |
| 458 | 601601 | 中国太保 | 336,446.00 | 3.37 |
| 459 | 000715 | 中兴商业 | 335,432.00 | 3.36 |
| 460 | 002512 | 达华智能 | 335,096.00 | 3.36 |
| 461 | 002158 | 汉钟精机 | 332,174.00 | 3.33 |
| 462 | 300149 | 量子生物 | 330,688.00 | 3.32 |
| 463 | 002099 | 海翔药业 | 324,201.00 | 3.25 |
| 464 | 002436 | 兴森科技 | 323,647.00 | 3.25 |
| 465 | 300357 | 我武生物 | 320,784.40 | 3.22 |
| 466 | 600616 | 金枫酒业 | 320,464.60 | 3.21 |
| 467 | 300314 | 戴维医疗 | 320,452.00 | 3.21 |
| 468 | 300107 | 建新股份 | 320,044.00 | 3.21 |
| 469 | 603919 | 金徽酒 | 317,212.00 | 3.18 |
| 470 | 603890 | 春秋电子 | 316,810.00 | 3.18 |
| 471 | 000925 | 众合科技 | 314,640.00 | 3.15 |
| 472 | 300684 | 中石科技 | 313,427.00 | 3.14 |
| 473 | 000885 | 城发环境 | 310,316.00 | 3.11 |
| 474 | 300224 | 正海磁材 | 309,055.00 | 3.10 |
| 475 | 000404 | 长虹华意 | 308,569.00 | 3.09 |
| 476 | 002161 | 远望谷 | 307,365.00 | 3.08 |
| 477 | 002822 | 中装建设 | 307,299.00 | 3.08 |

| | | | | |
|-----|--------|--------|------------|------|
| 478 | 300076 | GQY 视讯 | 305,314.00 | 3.06 |
| 479 | 600557 | 康缘药业 | 304,554.00 | 3.05 |
| 480 | 300592 | 华凯创意 | 304,380.00 | 3.05 |
| 481 | 000656 | 金科股份 | 304,375.00 | 3.05 |
| 482 | 000705 | 浙江震元 | 301,228.00 | 3.02 |
| 483 | 002111 | 威海广泰 | 300,905.00 | 3.02 |
| 484 | 002621 | 美吉姆 | 300,443.00 | 3.01 |
| 485 | 600197 | 伊力特 | 299,937.00 | 3.01 |
| 486 | 688199 | 久日新材 | 299,659.92 | 3.00 |
| 487 | 603555 | 贵人鸟 | 299,382.00 | 3.00 |
| 488 | 002917 | 金奥博 | 296,945.00 | 2.98 |
| 489 | 300618 | 寒锐钴业 | 294,362.00 | 2.95 |
| 490 | 002731 | 萃华珠宝 | 291,569.00 | 2.92 |
| 491 | 600143 | 金发科技 | 290,116.00 | 2.91 |
| 492 | 002199 | 东晶电子 | 289,672.00 | 2.90 |
| 493 | 000555 | 神州信息 | 287,390.00 | 2.88 |
| 494 | 300679 | 电连技术 | 286,872.00 | 2.88 |
| 495 | 600351 | 亚宝药业 | 286,761.00 | 2.88 |
| 496 | 600702 | 舍得酒业 | 286,191.00 | 2.87 |
| 497 | 300030 | 阳普医疗 | 284,599.00 | 2.85 |
| 498 | 603180 | 金牌厨柜 | 283,649.00 | 2.84 |
| 499 | 002226 | 江南化工 | 282,293.00 | 2.83 |
| 500 | 002090 | 金智科技 | 281,860.00 | 2.83 |
| 501 | 000026 | 飞亚达 | 281,483.00 | 2.82 |
| 502 | 002060 | 粤水电 | 281,156.00 | 2.82 |
| 503 | 002331 | 皖通科技 | 277,849.00 | 2.79 |
| 504 | 000333 | 美的集团 | 276,503.00 | 2.77 |
| 505 | 300693 | 盛弘股份 | 275,335.00 | 2.76 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 506 | 002313 | 日海智能 | 274,628.00 | 2.75 |
| 507 | 600580 | 卧龙电驱 | 274,516.00 | 2.75 |
| 508 | 603303 | 得邦照明 | 273,841.40 | 2.75 |
| 509 | 600777 | 新潮能源 | 273,243.00 | 2.74 |
| 510 | 300347 | 泰格医药 | 272,259.00 | 2.73 |
| 511 | 600330 | 天通股份 | 271,593.00 | 2.72 |
| 512 | 002449 | 国星光电 | 270,952.00 | 2.72 |
| 513 | 300050 | 世纪鼎利 | 270,877.00 | 2.72 |
| 514 | 002637 | 赞宇科技 | 270,701.00 | 2.71 |
| 515 | 603363 | 傲农生物 | 270,672.00 | 2.71 |
| 516 | 300221 | 银禧科技 | 269,840.00 | 2.71 |
| 517 | 300446 | 乐凯新材 | 265,971.00 | 2.67 |
| 518 | 300567 | 精测电子 | 265,682.00 | 2.66 |
| 519 | 000425 | 徐工机械 | 263,588.00 | 2.64 |
| 520 | 002530 | 金财互联 | 262,830.00 | 2.64 |
| 521 | 300036 | 超图软件 | 262,588.00 | 2.63 |
| 522 | 300724 | 捷佳伟创 | 261,949.00 | 2.63 |
| 523 | 600521 | 华海药业 | 260,904.00 | 2.62 |
| 524 | 600548 | 深高速 | 259,703.00 | 2.60 |
| 525 | 000157 | 中联重科 | 258,454.00 | 2.59 |
| 526 | 002732 | 燕塘乳业 | 257,915.00 | 2.59 |
| 527 | 300451 | 创业慧康 | 257,433.00 | 2.58 |
| 528 | 300755 | 华致酒行 | 255,635.00 | 2.56 |
| 529 | 600622 | 光大嘉宝 | 255,132.00 | 2.56 |
| 530 | 300455 | 康拓红外 | 254,778.00 | 2.55 |
| 531 | 600570 | 恒生电子 | 254,561.70 | 2.55 |
| 532 | 600191 | 华资实业 | 248,338.00 | 2.49 |
| 533 | 002301 | 齐心集团 | 245,456.00 | 2.46 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 534 | 603598 | 引力传媒 | 244,565.00 | 2.45 |
| 535 | 603315 | 福鞍股份 | 243,510.00 | 2.44 |
| 536 | 300140 | 中环装备 | 241,821.00 | 2.42 |
| 537 | 600900 | 长江电力 | 241,336.00 | 2.42 |
| 538 | 002918 | 蒙娜丽莎 | 239,999.00 | 2.41 |
| 539 | 600020 | 中原高速 | 237,676.00 | 2.38 |
| 540 | 002467 | 二六三 | 235,342.00 | 2.36 |
| 541 | 002133 | 广宇集团 | 234,484.00 | 2.35 |
| 542 | 300212 | 易华录 | 232,106.00 | 2.33 |
| 543 | 002911 | 佛燃股份 | 231,215.00 | 2.32 |
| 544 | 000889 | 中嘉博创 | 230,476.00 | 2.31 |
| 545 | 002882 | 金龙羽 | 228,160.00 | 2.29 |
| 546 | 300348 | 长亮科技 | 227,826.00 | 2.28 |
| 547 | 600213 | 亚星客车 | 227,380.00 | 2.28 |
| 548 | 300397 | 天和防务 | 224,950.00 | 2.26 |
| 549 | 603039 | 泛微网络 | 224,513.00 | 2.25 |
| 550 | 300429 | 强力新材 | 223,707.00 | 2.24 |
| 551 | 000156 | 华数传媒 | 221,604.00 | 2.22 |
| 552 | 300239 | 东宝生物 | 221,589.00 | 2.22 |
| 553 | 300081 | 恒信东方 | 221,103.00 | 2.22 |
| 554 | 603105 | 芯能科技 | 220,561.00 | 2.21 |
| 555 | 300761 | 立华股份 | 219,585.00 | 2.20 |
| 556 | 600711 | 盛屯矿业 | 219,323.00 | 2.20 |
| 557 | 002847 | 盐津铺子 | 218,736.00 | 2.19 |
| 558 | 300476 | 胜宏科技 | 218,582.00 | 2.19 |
| 559 | 600531 | 豫光金铅 | 217,497.00 | 2.18 |
| 560 | 300369 | 绿盟科技 | 217,264.00 | 2.18 |
| 561 | 300234 | 开尔新材 | 216,344.00 | 2.17 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 562 | 600483 | 福能股份 | 215,450.00 | 2.16 |
| 563 | 603345 | 安井食品 | 213,413.00 | 2.14 |
| 564 | 600745 | 闻泰科技 | 213,358.00 | 2.14 |
| 565 | 300680 | 隆盛科技 | 213,039.00 | 2.14 |
| 566 | 603600 | 永艺股份 | 213,035.00 | 2.14 |
| 567 | 603068 | 博通集成 | 211,959.00 | 2.13 |
| 568 | 600611 | 大众交通 | 211,273.00 | 2.12 |
| 569 | 002554 | 惠博普 | 209,779.00 | 2.10 |
| 570 | 600529 | 山东药玻 | 207,680.40 | 2.08 |
| 571 | 002929 | 润建股份 | 207,087.00 | 2.08 |
| 572 | 601515 | 东风股份 | 206,718.00 | 2.07 |
| 573 | 688139 | 海尔生物 | 205,756.97 | 2.06 |
| 574 | 688366 | 昊海生科 | 205,585.92 | 2.06 |
| 575 | 600477 | 杭萧钢构 | 204,236.00 | 2.05 |
| 576 | 688025 | 杰普特 | 204,168.30 | 2.05 |
| 577 | 600300 | 维维股份 | 204,105.00 | 2.05 |
| 578 | 300577 | 开润股份 | 203,710.00 | 2.04 |
| 579 | 600110 | 诺德股份 | 203,468.00 | 2.04 |
| 580 | 002063 | 远光软件 | 202,575.00 | 2.03 |
| 581 | 002214 | 大立科技 | 202,545.00 | 2.03 |
| 582 | 600962 | 国投中鲁 | 202,545.00 | 2.03 |
| 583 | 002261 | 拓维信息 | 202,323.00 | 2.03 |
| 584 | 002893 | 华通热力 | 201,039.00 | 2.02 |
| 585 | 600352 | 浙江龙盛 | 200,613.00 | 2.01 |
| 586 | 603278 | 大业股份 | 200,133.00 | 2.01 |

注：本项买入金额均按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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 | 601677 | 明泰铝业 | 4,839,748.03 | 48.53 |
| 2 | 600846 | 同济科技 | 4,659,270.82 | 46.72 |
| 3 | 002139 | 拓邦股份 | 4,389,470.57 | 44.01 |
| 4 | 600728 | 佳都科技 | 4,340,566.00 | 43.52 |
| 5 | 600995 | 文山电力 | 4,312,766.00 | 43.24 |
| 6 | 600533 | 栖霞建设 | 4,229,415.40 | 42.41 |
| 7 | 000973 | 佛塑科技 | 3,826,648.00 | 38.37 |
| 8 | 600063 | 皖维高新 | 3,784,338.00 | 37.95 |
| 9 | 601058 | 赛轮轮胎 | 3,738,821.00 | 37.49 |
| 10 | 600261 | 阳光照明 | 3,713,261.00 | 37.23 |
| 11 | 000672 | 上峰水泥 | 3,576,888.00 | 35.87 |
| 12 | 300014 | 亿纬锂能 | 3,554,212.00 | 35.64 |
| 13 | 002016 | 世荣兆业 | 3,478,518.00 | 34.88 |
| 14 | 000601 | 韶能股份 | 3,401,875.00 | 34.11 |
| 15 | 603063 | 禾望电气 | 3,353,853.00 | 33.63 |
| 16 | 600720 | 祁连山 | 3,324,030.83 | 33.33 |
| 17 | 300303 | 聚飞光电 | 3,254,752.40 | 32.64 |
| 18 | 603368 | 柳药股份 | 3,126,025.00 | 31.34 |
| 19 | 600502 | 安徽建工 | 3,058,313.66 | 30.67 |
| 20 | 300231 | 银信科技 | 3,032,430.20 | 30.41 |
| 21 | 603699 | 纽威股份 | 2,913,396.25 | 29.21 |
| 22 | 603118 | 共进股份 | 2,860,549.00 | 28.68 |
| 23 | 300209 | 天泽信息 | 2,823,310.00 | 28.31 |
| 24 | 300114 | 中航电测 | 2,798,595.42 | 28.06 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|-------|
| 25 | 300660 | 江苏雷利 | 2,779,398.38 | 27.87 |
| 26 | 600343 | 航天动力 | 2,773,242.92 | 27.81 |
| 27 | 300628 | 亿联网络 | 2,726,045.00 | 27.33 |
| 28 | 002907 | 华森制药 | 2,709,588.00 | 27.17 |
| 29 | 603126 | 中材节能 | 2,694,871.00 | 27.02 |
| 30 | 300497 | 富祥股份 | 2,584,120.60 | 25.91 |
| 31 | 000913 | 钱江摩托 | 2,573,223.16 | 25.80 |
| 32 | 600449 | 宁夏建材 | 2,471,400.35 | 24.78 |
| 33 | 300571 | 平治信息 | 2,446,203.73 | 24.53 |
| 34 | 002094 | 青岛金王 | 2,405,929.40 | 24.12 |
| 35 | 002792 | 通宇通讯 | 2,403,880.00 | 24.10 |
| 36 | 002458 | 益生股份 | 2,399,023.90 | 24.06 |
| 37 | 600552 | 凯盛科技 | 2,360,191.00 | 23.67 |
| 38 | 002928 | 华夏航空 | 2,305,247.00 | 23.11 |
| 39 | 002396 | 星网锐捷 | 2,301,726.00 | 23.08 |
| 40 | 002182 | 云海金属 | 2,298,453.00 | 23.05 |
| 41 | 603298 | 杭叉集团 | 2,283,925.56 | 22.90 |
| 42 | 603385 | 惠达卫浴 | 2,241,832.06 | 22.48 |
| 43 | 600675 | 中华企业 | 2,234,600.40 | 22.41 |
| 44 | 002605 | 姚记科技 | 2,233,300.00 | 22.39 |
| 45 | 300682 | 朗新科技 | 2,196,205.00 | 22.02 |
| 46 | 002351 | 漫步者 | 2,176,330.19 | 21.82 |
| 47 | 000810 | 创维数字 | 2,139,422.00 | 21.45 |
| 48 | 002734 | 利民股份 | 2,108,208.00 | 21.14 |
| 49 | 601163 | 三角轮胎 | 2,098,473.00 | 21.04 |
| 50 | 002746 | 仙坛股份 | 2,097,103.70 | 21.03 |
| 51 | 000905 | 厦门港务 | 2,084,473.00 | 20.90 |
| 52 | 002020 | 京新药业 | 2,072,841.14 | 20.78 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|-------|
| 53 | 600185 | 格力地产 | 2,041,132.92 | 20.47 |
| 54 | 002362 | 汉王科技 | 2,034,806.97 | 20.40 |
| 55 | 600132 | 重庆啤酒 | 2,033,613.69 | 20.39 |
| 56 | 002367 | 康力电梯 | 2,030,454.00 | 20.36 |
| 57 | 002318 | 久立特材 | 2,028,441.00 | 20.34 |
| 58 | 601107 | 四川成渝 | 2,024,521.00 | 20.30 |
| 59 | 688111 | 金山办公 | 2,019,127.70 | 20.25 |
| 60 | 600668 | 尖峰集团 | 2,011,188.00 | 20.17 |
| 61 | 300233 | 金城医药 | 1,994,445.86 | 20.00 |
| 62 | 300322 | 硕贝德 | 1,990,057.00 | 19.95 |
| 63 | 300236 | 上海新阳 | 1,984,457.00 | 19.90 |
| 64 | 300438 | 鹏辉能源 | 1,982,896.00 | 19.88 |
| 65 | 300613 | 富瀚微 | 1,955,433.30 | 19.61 |
| 66 | 001896 | 豫能控股 | 1,921,666.00 | 19.27 |
| 67 | 600136 | 当代明诚 | 1,915,948.00 | 19.21 |
| 68 | 002379 | 宏创控股 | 1,905,967.00 | 19.11 |
| 69 | 300502 | 新易盛 | 1,904,817.00 | 19.10 |
| 70 | 300130 | 新国都 | 1,903,476.00 | 19.09 |
| 71 | 600855 | 航天长峰 | 1,903,195.00 | 19.08 |
| 72 | 002335 | 科华恒盛 | 1,898,082.57 | 19.03 |
| 73 | 000550 | 江铃汽车 | 1,892,794.00 | 18.98 |
| 74 | 600446 | 金证股份 | 1,888,046.00 | 18.93 |
| 75 | 300349 | 金卡智能 | 1,886,362.00 | 18.91 |
| 76 | 300171 | 东富龙 | 1,885,391.92 | 18.90 |
| 77 | 002577 | 雷柏科技 | 1,881,560.00 | 18.87 |
| 78 | 601126 | 四方股份 | 1,878,599.00 | 18.84 |
| 79 | 000957 | 中通客车 | 1,866,970.00 | 18.72 |
| 80 | 300417 | 南华仪器 | 1,854,585.00 | 18.60 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|-------|
| 81 | 300298 | 三诺生物 | 1,839,264.56 | 18.44 |
| 82 | 000650 | 仁和药业 | 1,834,701.36 | 18.40 |
| 83 | 300016 | 北陆药业 | 1,825,145.00 | 18.30 |
| 84 | 000034 | 神州数码 | 1,821,093.00 | 18.26 |
| 85 | 603067 | 振华股份 | 1,802,318.20 | 18.07 |
| 86 | 601599 | 鹿港文化 | 1,777,798.48 | 17.83 |
| 87 | 600180 | 瑞茂通 | 1,769,034.00 | 17.74 |
| 88 | 002314 | 南山控股 | 1,766,329.00 | 17.71 |
| 89 | 601886 | 江河集团 | 1,758,008.00 | 17.63 |
| 90 | 300523 | 辰安科技 | 1,743,449.00 | 17.48 |
| 91 | 002219 | 恒康医疗 | 1,740,716.00 | 17.45 |
| 92 | 600310 | 桂东电力 | 1,723,069.00 | 17.28 |
| 93 | 002705 | 新宝股份 | 1,717,103.00 | 17.22 |
| 94 | 300012 | 华测检测 | 1,707,408.70 | 17.12 |
| 95 | 000915 | 山大华特 | 1,704,768.20 | 17.09 |
| 96 | 000035 | 中国天楹 | 1,672,079.00 | 16.77 |
| 97 | 600229 | 城市传媒 | 1,638,630.75 | 16.43 |
| 98 | 300198 | 纳川股份 | 1,629,959.00 | 16.34 |
| 99 | 603277 | 银都股份 | 1,628,988.00 | 16.33 |
| 100 | 002084 | 海鸥住工 | 1,618,310.00 | 16.23 |
| 101 | 600405 | 动力源 | 1,615,487.80 | 16.20 |
| 102 | 000710 | 贝瑞基因 | 1,615,167.00 | 16.20 |
| 103 | 000411 | 英特集团 | 1,614,722.60 | 16.19 |
| 104 | 300045 | 华力创通 | 1,611,053.00 | 16.15 |
| 105 | 600985 | 淮北矿业 | 1,609,968.00 | 16.14 |
| 106 | 600581 | 八一钢铁 | 1,595,841.56 | 16.00 |
| 107 | 603013 | 亚普股份 | 1,595,089.00 | 15.99 |
| 108 | 603026 | 石大胜华 | 1,589,851.00 | 15.94 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|-------|
| 109 | 002869 | 金溢科技 | 1,565,562.00 | 15.70 |
| 110 | 300726 | 宏达电子 | 1,555,783.00 | 15.60 |
| 111 | 300568 | 星源材质 | 1,533,983.00 | 15.38 |
| 112 | 600626 | 申达股份 | 1,530,718.00 | 15.35 |
| 113 | 300487 | 蓝晓科技 | 1,530,442.00 | 15.35 |
| 114 | 600768 | 宁波富邦 | 1,524,112.00 | 15.28 |
| 115 | 300251 | 光线传媒 | 1,513,915.00 | 15.18 |
| 116 | 002851 | 麦格米特 | 1,490,045.43 | 14.94 |
| 117 | 000662 | 天夏智慧 | 1,489,188.00 | 14.93 |
| 118 | 000576 | 广东甘化 | 1,473,060.00 | 14.77 |
| 119 | 002249 | 大洋电机 | 1,466,449.00 | 14.70 |
| 120 | 600510 | 黑牡丹 | 1,465,301.00 | 14.69 |
| 121 | 002377 | 国创高新 | 1,450,631.00 | 14.55 |
| 122 | 000999 | 华润三九 | 1,448,445.08 | 14.52 |
| 123 | 601918 | 新集能源 | 1,442,990.00 | 14.47 |
| 124 | 300039 | 上海凯宝 | 1,430,109.00 | 14.34 |
| 125 | 000739 | 普洛药业 | 1,424,873.00 | 14.29 |
| 126 | 600381 | 青海春天 | 1,417,524.00 | 14.21 |
| 127 | 002276 | 万马股份 | 1,403,246.00 | 14.07 |
| 128 | 000019 | 深粮控股 | 1,395,694.60 | 13.99 |
| 129 | 300432 | 富临精工 | 1,391,628.00 | 13.95 |
| 130 | 601666 | 平煤股份 | 1,390,001.00 | 13.94 |
| 131 | 300636 | 同和药业 | 1,387,968.00 | 13.92 |
| 132 | 603043 | 广州酒家 | 1,380,574.00 | 13.84 |
| 133 | 603606 | 东方电缆 | 1,375,770.00 | 13.79 |
| 134 | 000802 | 北京文化 | 1,363,932.00 | 13.68 |
| 135 | 002011 | 盾安环境 | 1,358,524.00 | 13.62 |
| 136 | 600490 | 鹏欣资源 | 1,345,720.00 | 13.49 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|-------|
| 137 | 002299 | 圣农发展 | 1,339,253.00 | 13.43 |
| 138 | 002568 | 百润股份 | 1,336,903.00 | 13.41 |
| 139 | 002782 | 可立克 | 1,334,184.00 | 13.38 |
| 140 | 600997 | 开滦股份 | 1,328,086.00 | 13.32 |
| 141 | 600873 | 梅花生物 | 1,326,894.00 | 13.30 |
| 142 | 002755 | 奥赛康 | 1,322,999.24 | 13.27 |
| 143 | 603609 | 禾丰牧业 | 1,322,820.00 | 13.26 |
| 144 | 002124 | 天邦股份 | 1,295,389.00 | 12.99 |
| 145 | 300007 | 汉威科技 | 1,294,291.00 | 12.98 |
| 146 | 600936 | 广西广电 | 1,294,201.00 | 12.98 |
| 147 | 300219 | 鸿利智汇 | 1,281,836.00 | 12.85 |
| 148 | 600812 | 华北制药 | 1,276,613.00 | 12.80 |
| 149 | 600012 | 皖通高速 | 1,276,286.63 | 12.80 |
| 150 | 002045 | 国光电器 | 1,269,422.00 | 12.73 |
| 151 | 002234 | 民和股份 | 1,263,281.00 | 12.67 |
| 152 | 600267 | 海正药业 | 1,244,336.00 | 12.48 |
| 153 | 600273 | 嘉化能源 | 1,234,677.00 | 12.38 |
| 154 | 002895 | 川恒股份 | 1,229,023.00 | 12.32 |
| 155 | 600250 | 南纺股份 | 1,211,811.00 | 12.15 |
| 156 | 300020 | 银江股份 | 1,210,300.60 | 12.14 |
| 157 | 600129 | 太极集团 | 1,206,316.00 | 12.10 |
| 158 | 300602 | 飞荣达 | 1,200,822.00 | 12.04 |
| 159 | 300533 | 冰川网络 | 1,196,488.00 | 12.00 |
| 160 | 600391 | 航发科技 | 1,193,755.00 | 11.97 |
| 161 | 603309 | 维力医疗 | 1,192,689.00 | 11.96 |
| 162 | 300118 | 东方日升 | 1,189,175.00 | 11.92 |
| 163 | 603458 | 勘设股份 | 1,180,002.20 | 11.83 |
| 164 | 600210 | 紫江企业 | 1,177,592.00 | 11.81 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|-------|
| 165 | 300269 | 联建光电 | 1,173,019.00 | 11.76 |
| 166 | 300043 | 星辉娱乐 | 1,162,068.00 | 11.65 |
| 167 | 000663 | 永安林业 | 1,153,856.00 | 11.57 |
| 168 | 603882 | 金城医学 | 1,150,370.00 | 11.53 |
| 169 | 300017 | 网宿科技 | 1,147,052.95 | 11.50 |
| 170 | 600715 | 文投控股 | 1,146,920.00 | 11.50 |
| 171 | 000637 | 茂化实华 | 1,146,389.00 | 11.49 |
| 172 | 000987 | 越秀金控 | 1,138,989.63 | 11.42 |
| 173 | 002611 | 东方精工 | 1,131,498.00 | 11.35 |
| 174 | 000829 | 天音控股 | 1,131,493.00 | 11.35 |
| 175 | 601566 | 九牧王 | 1,130,992.00 | 11.34 |
| 176 | 603733 | 仙鹤股份 | 1,118,527.00 | 11.22 |
| 177 | 600284 | 浦东建设 | 1,108,156.00 | 11.11 |
| 178 | 300531 | 优博讯 | 1,107,927.00 | 11.11 |
| 179 | 601360 | 三六零 | 1,097,042.00 | 11.00 |
| 180 | 600641 | 万业企业 | 1,094,964.73 | 10.98 |
| 181 | 300075 | 数字政通 | 1,090,572.00 | 10.94 |
| 182 | 603887 | 城地股份 | 1,090,429.60 | 10.93 |
| 183 | 002664 | 长鹰信质 | 1,082,217.00 | 10.85 |
| 184 | 300378 | 鼎捷软件 | 1,076,957.00 | 10.80 |
| 185 | 002036 | 联创电子 | 1,073,224.00 | 10.76 |
| 186 | 300529 | 健帆生物 | 1,067,823.00 | 10.71 |
| 187 | 603008 | 喜临门 | 1,066,782.00 | 10.70 |
| 188 | 300034 | 钢研高纳 | 1,049,476.56 | 10.52 |
| 189 | 600382 | 广东明珠 | 1,047,920.00 | 10.51 |
| 190 | 300393 | 中来股份 | 1,047,324.00 | 10.50 |
| 191 | 000042 | 中洲控股 | 1,046,031.00 | 10.49 |
| 192 | 000923 | 河钢资源 | 1,045,361.00 | 10.48 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|-------|
| 193 | 002653 | 海思科 | 1,035,562.00 | 10.38 |
| 194 | 002912 | 中新赛克 | 1,034,032.00 | 10.37 |
| 195 | 002906 | 华阳集团 | 1,012,970.00 | 10.16 |
| 196 | 600323 | 瀚蓝环境 | 1,012,468.00 | 10.15 |
| 197 | 002756 | 永兴材料 | 1,007,986.00 | 10.11 |
| 198 | 603098 | 森特股份 | 1,005,677.20 | 10.08 |
| 199 | 600217 | 中再资环 | 982,348.00 | 9.85 |
| 200 | 300702 | 天宇股份 | 976,563.12 | 9.79 |
| 201 | 600731 | 湖南海利 | 973,425.00 | 9.76 |
| 202 | 002531 | 天顺风能 | 966,091.00 | 9.69 |
| 203 | 002850 | 科达利 | 960,890.00 | 9.63 |
| 204 | 603208 | 江山欧派 | 954,595.00 | 9.57 |
| 205 | 002651 | 利君股份 | 954,322.00 | 9.57 |
| 206 | 000951 | 中国重汽 | 953,480.00 | 9.56 |
| 207 | 002433 | 太安堂 | 953,180.00 | 9.56 |
| 208 | 600662 | 强生控股 | 949,344.00 | 9.52 |
| 209 | 603843 | 正平股份 | 943,806.00 | 9.46 |
| 210 | 600740 | 山西焦化 | 943,447.00 | 9.46 |
| 211 | 000700 | 模塑科技 | 936,348.00 | 9.39 |
| 212 | 603508 | 思维列控 | 932,427.00 | 9.35 |
| 213 | 002262 | 恩华药业 | 929,769.00 | 9.32 |
| 214 | 300066 | 三川智慧 | 927,108.00 | 9.30 |
| 215 | 603980 | 吉华集团 | 922,803.40 | 9.25 |
| 216 | 300624 | 万兴科技 | 919,877.00 | 9.22 |
| 217 | 002246 | 北化股份 | 909,186.00 | 9.12 |
| 218 | 000639 | 西王食品 | 908,163.00 | 9.11 |
| 219 | 600805 | 悦达投资 | 906,485.00 | 9.09 |
| 220 | 603585 | 苏利股份 | 903,685.80 | 9.06 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 221 | 601588 | 北辰实业 | 901,813.00 | 9.04 |
| 222 | 600501 | 航天晨光 | 901,075.54 | 9.04 |
| 223 | 603959 | 百利科技 | 895,645.15 | 8.98 |
| 224 | 300559 | 佳发教育 | 893,630.96 | 8.96 |
| 225 | 600612 | 老凤祥 | 892,892.00 | 8.95 |
| 226 | 002833 | 弘亚数控 | 887,185.00 | 8.90 |
| 227 | 600336 | 澳柯玛 | 885,981.00 | 8.88 |
| 228 | 300738 | 奥飞数据 | 878,074.20 | 8.80 |
| 229 | 002567 | 唐人神 | 867,211.00 | 8.70 |
| 230 | 000933 | 神火股份 | 866,354.00 | 8.69 |
| 231 | 000967 | 盈峰环境 | 864,040.00 | 8.66 |
| 232 | 601900 | 南方传媒 | 852,640.13 | 8.55 |
| 233 | 002534 | 杭锅股份 | 851,617.00 | 8.54 |
| 234 | 300038 | 数知科技 | 850,823.00 | 8.53 |
| 235 | 601717 | 郑煤机 | 848,867.00 | 8.51 |
| 236 | 603579 | 荣泰健康 | 839,010.00 | 8.41 |
| 237 | 300366 | 创意信息 | 837,203.00 | 8.39 |
| 238 | 601369 | 陕鼓动力 | 832,359.98 | 8.35 |
| 239 | 603218 | 日月股份 | 826,080.40 | 8.28 |
| 240 | 600828 | 茂业商业 | 825,570.87 | 8.28 |
| 241 | 603638 | 艾迪精密 | 816,589.47 | 8.19 |
| 242 | 601116 | 三江购物 | 815,813.00 | 8.18 |
| 243 | 603666 | 亿嘉和 | 811,083.26 | 8.13 |
| 244 | 603058 | 永吉股份 | 807,611.00 | 8.10 |
| 245 | 002279 | 久其软件 | 807,568.40 | 8.10 |
| 246 | 300158 | 振东制药 | 805,417.00 | 8.08 |
| 247 | 603596 | 伯特利 | 794,557.00 | 7.97 |
| 248 | 603819 | 神力股份 | 793,261.00 | 7.95 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 249 | 300310 | 宜通世纪 | 786,101.84 | 7.88 |
| 250 | 002435 | 长江健康 | 782,809.50 | 7.85 |
| 251 | 300223 | 北京君正 | 774,733.00 | 7.77 |
| 252 | 002292 | 奥飞娱乐 | 774,634.00 | 7.77 |
| 253 | 603393 | 新天然气 | 773,939.00 | 7.76 |
| 254 | 000591 | 太阳能 | 770,397.00 | 7.72 |
| 255 | 300277 | 海联讯 | 769,253.00 | 7.71 |
| 256 | 002712 | 思美传媒 | 765,940.00 | 7.68 |
| 257 | 300460 | 惠伦晶体 | 764,514.00 | 7.67 |
| 258 | 002035 | 华帝股份 | 759,106.00 | 7.61 |
| 259 | 300083 | 劲胜智能 | 755,575.00 | 7.58 |
| 260 | 300311 | 任子行 | 753,684.00 | 7.56 |
| 261 | 600287 | 江苏舜天 | 748,240.60 | 7.50 |
| 262 | 002698 | 博实股份 | 746,777.00 | 7.49 |
| 263 | 000751 | 锌业股份 | 746,737.00 | 7.49 |
| 264 | 600096 | 云天化 | 724,182.00 | 7.26 |
| 265 | 603658 | 安图生物 | 722,398.00 | 7.24 |
| 266 | 600664 | 哈药股份 | 719,720.00 | 7.22 |
| 267 | 688036 | 传音控股 | 719,057.00 | 7.21 |
| 268 | 000657 | 中钨高新 | 716,703.48 | 7.19 |
| 269 | 000900 | 现代投资 | 716,669.60 | 7.19 |
| 270 | 002609 | 捷顺科技 | 713,539.00 | 7.15 |
| 271 | 300465 | 高伟达 | 703,176.00 | 7.05 |
| 272 | 002197 | 证通电子 | 700,448.00 | 7.02 |
| 273 | 600322 | 天房发展 | 700,125.00 | 7.02 |
| 274 | 600422 | 昆药集团 | 699,678.00 | 7.02 |
| 275 | 300661 | 圣邦股份 | 694,876.00 | 6.97 |
| 276 | 002105 | 信隆健康 | 693,087.00 | 6.95 |

| | | | | |
|-----|--------|-------|------------|------|
| 277 | 600200 | 江苏吴中 | 693,009.00 | 6.95 |
| 278 | 603603 | 博天环境 | 692,271.00 | 6.94 |
| 279 | 000560 | 我爱我家 | 685,653.00 | 6.88 |
| 280 | 601811 | 新华文轩 | 681,148.00 | 6.83 |
| 281 | 300242 | 佳云科技 | 679,785.00 | 6.82 |
| 282 | 002060 | 粤水电 | 675,425.00 | 6.77 |
| 283 | 600162 | 香江控股 | 670,038.00 | 6.72 |
| 284 | 600512 | 腾达建设 | 667,125.00 | 6.69 |
| 285 | 000718 | 苏宁环球 | 666,528.60 | 6.68 |
| 286 | 000573 | 粤宏远 A | 665,441.00 | 6.67 |
| 287 | 688363 | 华熙生物 | 664,819.50 | 6.67 |
| 288 | 002135 | 东南网架 | 663,683.00 | 6.65 |
| 289 | 300205 | 天喻信息 | 663,442.00 | 6.65 |
| 290 | 603199 | 九华旅游 | 662,842.00 | 6.65 |
| 291 | 002867 | 周大生 | 660,707.00 | 6.62 |
| 292 | 300558 | 贝达药业 | 659,017.00 | 6.61 |
| 293 | 600667 | 太极实业 | 658,058.00 | 6.60 |
| 294 | 603811 | 诚意药业 | 657,606.00 | 6.59 |
| 295 | 603989 | 艾华集团 | 656,246.00 | 6.58 |
| 296 | 600470 | 六国化工 | 651,990.00 | 6.54 |
| 297 | 603660 | 苏州科达 | 650,384.00 | 6.52 |
| 298 | 603999 | 读者传媒 | 649,558.00 | 6.51 |
| 299 | 300131 | 英唐智控 | 649,021.00 | 6.51 |
| 300 | 603129 | 春风动力 | 645,544.00 | 6.47 |
| 301 | 600685 | 中船防务 | 644,531.00 | 6.46 |
| 302 | 600031 | 三一重工 | 644,421.00 | 6.46 |
| 303 | 300411 | 金盾股份 | 643,943.00 | 6.46 |
| 304 | 600346 | 恒力石化 | 641,449.00 | 6.43 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 305 | 300496 | 中科创达 | 640,629.00 | 6.42 |
| 306 | 603356 | 华菱精工 | 635,311.00 | 6.37 |
| 307 | 002237 | 恒邦股份 | 634,675.00 | 6.36 |
| 308 | 600987 | 航民股份 | 634,359.00 | 6.36 |
| 309 | 600207 | 安彩高科 | 629,718.00 | 6.31 |
| 310 | 300248 | 新开普 | 627,755.00 | 6.29 |
| 311 | 300634 | 彩讯股份 | 626,416.00 | 6.28 |
| 312 | 002649 | 博彦科技 | 625,346.00 | 6.27 |
| 313 | 603357 | 设计总院 | 625,211.00 | 6.27 |
| 314 | 002657 | 中科金财 | 625,175.00 | 6.27 |
| 315 | 600456 | 宝钛股份 | 622,988.00 | 6.25 |
| 316 | 002156 | 通富微电 | 620,063.00 | 6.22 |
| 317 | 300256 | 星星科技 | 598,109.73 | 6.00 |
| 318 | 002228 | 合兴包装 | 584,588.00 | 5.86 |
| 319 | 300735 | 光弘科技 | 579,972.80 | 5.82 |
| 320 | 603165 | 荣晟环保 | 579,240.00 | 5.81 |
| 321 | 002308 | 威创股份 | 574,489.00 | 5.76 |
| 322 | 300213 | 佳讯飞鸿 | 573,532.00 | 5.75 |
| 323 | 002759 | 天际股份 | 573,442.00 | 5.75 |
| 324 | 603801 | 志邦家居 | 571,323.00 | 5.73 |
| 325 | 000993 | 闽东电力 | 570,046.00 | 5.72 |
| 326 | 600677 | 航天通信 | 569,904.00 | 5.71 |
| 327 | 002100 | 天康生物 | 566,327.00 | 5.68 |
| 328 | 300061 | 康旗股份 | 566,055.00 | 5.68 |
| 329 | 002329 | 皇氏集团 | 566,023.00 | 5.68 |
| 330 | 600251 | 冠农股份 | 565,400.00 | 5.67 |
| 331 | 300570 | 太辰光 | 562,565.00 | 5.64 |
| 332 | 601700 | 风范股份 | 560,864.00 | 5.62 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 333 | 002521 | 齐峰新材 | 558,889.00 | 5.60 |
| 334 | 002022 | 科华生物 | 555,955.00 | 5.57 |
| 335 | 002402 | 和而泰 | 549,000.00 | 5.50 |
| 336 | 300447 | 全信股份 | 548,184.00 | 5.50 |
| 337 | 300690 | 双一科技 | 544,007.00 | 5.45 |
| 338 | 300306 | 远方信息 | 543,095.00 | 5.45 |
| 339 | 603160 | 汇顶科技 | 542,949.00 | 5.44 |
| 340 | 601336 | 新华保险 | 541,202.00 | 5.43 |
| 341 | 000151 | 中成股份 | 538,899.00 | 5.40 |
| 342 | 603920 | 世运电路 | 538,046.00 | 5.40 |
| 343 | 600587 | 新华医疗 | 534,466.00 | 5.36 |
| 344 | 002091 | 江苏国泰 | 533,005.00 | 5.34 |
| 345 | 600984 | 建设机械 | 532,387.00 | 5.34 |
| 346 | 600211 | 西藏药业 | 529,081.00 | 5.31 |
| 347 | 002322 | 理工环科 | 526,332.00 | 5.28 |
| 348 | 000921 | 海信家电 | 522,651.00 | 5.24 |
| 349 | 000736 | 中交地产 | 519,806.00 | 5.21 |
| 350 | 002933 | 新兴装备 | 519,715.00 | 5.21 |
| 351 | 603587 | 地素时尚 | 518,032.00 | 5.19 |
| 352 | 603528 | 多伦科技 | 510,639.00 | 5.12 |
| 353 | 600681 | 百川能源 | 508,789.60 | 5.10 |
| 354 | 600067 | 冠城大通 | 507,302.00 | 5.09 |
| 355 | 300302 | 同有科技 | 506,902.00 | 5.08 |
| 356 | 600496 | 精工钢构 | 505,400.00 | 5.07 |
| 357 | 002539 | 云图控股 | 504,689.00 | 5.06 |
| 358 | 002876 | 三利谱 | 504,293.00 | 5.06 |
| 359 | 002024 | 苏宁易购 | 503,694.00 | 5.05 |
| 360 | 603693 | 江苏新能 | 503,135.00 | 5.04 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 361 | 000708 | 中信特钢 | 500,619.00 | 5.02 |
| 362 | 002788 | 鹭燕医药 | 499,316.34 | 5.01 |
| 363 | 603737 | 三棵树 | 496,793.00 | 4.98 |
| 364 | 300737 | 科顺股份 | 495,347.00 | 4.97 |
| 365 | 600090 | 同济堂 | 491,065.00 | 4.92 |
| 366 | 000851 | 高鸿股份 | 490,743.00 | 4.92 |
| 367 | 600691 | 阳煤化工 | 490,630.00 | 4.92 |
| 368 | 601718 | 际华集团 | 487,636.00 | 4.89 |
| 369 | 300132 | 青松股份 | 483,795.00 | 4.85 |
| 370 | 603798 | 康普顿 | 483,600.00 | 4.85 |
| 371 | 002326 | 永太科技 | 481,024.00 | 4.82 |
| 372 | 600589 | 广东榕泰 | 478,578.00 | 4.80 |
| 373 | 600571 | 信雅达 | 476,941.00 | 4.78 |
| 374 | 000049 | 德赛电池 | 475,352.00 | 4.77 |
| 375 | 002518 | 科士达 | 473,896.00 | 4.75 |
| 376 | 600117 | 西宁特钢 | 473,314.98 | 4.75 |
| 377 | 600988 | 赤峰黄金 | 472,237.00 | 4.74 |
| 378 | 002502 | 鼎龙文化 | 468,322.00 | 4.70 |
| 379 | 603678 | 火炬电子 | 467,734.00 | 4.69 |
| 380 | 300401 | 花园生物 | 462,332.00 | 4.64 |
| 381 | 300162 | 雷曼光电 | 462,318.00 | 4.64 |
| 382 | 600727 | 鲁北化工 | 461,691.00 | 4.63 |
| 383 | 600594 | 益佰制药 | 452,832.00 | 4.54 |
| 384 | 002429 | 兆驰股份 | 452,114.00 | 4.53 |
| 385 | 603533 | 掌阅科技 | 451,440.00 | 4.53 |
| 386 | 300552 | 万集科技 | 449,181.00 | 4.50 |
| 387 | 002810 | 山东赫达 | 446,561.19 | 4.48 |
| 388 | 600894 | 广日股份 | 445,078.00 | 4.46 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 389 | 600057 | 厦门象屿 | 442,518.00 | 4.44 |
| 390 | 603299 | 苏盐井神 | 442,143.00 | 4.43 |
| 391 | 002662 | 京威股份 | 441,896.00 | 4.43 |
| 392 | 300078 | 思创医惠 | 438,871.00 | 4.40 |
| 393 | 000030 | 富奥股份 | 431,575.00 | 4.33 |
| 394 | 300170 | 汉得信息 | 430,895.00 | 4.32 |
| 395 | 688196 | 卓越新能 | 430,487.40 | 4.32 |
| 396 | 603800 | 道森股份 | 430,076.00 | 4.31 |
| 397 | 300363 | 博腾股份 | 425,281.00 | 4.26 |
| 398 | 000812 | 陕西金叶 | 423,330.00 | 4.24 |
| 399 | 002511 | 中顺洁柔 | 421,035.00 | 4.22 |
| 400 | 603696 | 安记食品 | 420,540.64 | 4.22 |
| 401 | 688139 | 海尔生物 | 416,381.87 | 4.18 |
| 402 | 603360 | 百傲化学 | 416,307.00 | 4.17 |
| 403 | 603359 | 东珠生态 | 415,758.00 | 4.17 |
| 404 | 002171 | 楚江新材 | 414,370.00 | 4.15 |
| 405 | 601788 | 光大证券 | 412,602.12 | 4.14 |
| 406 | 002913 | 奥士康 | 412,567.00 | 4.14 |
| 407 | 600418 | 江淮汽车 | 412,467.00 | 4.14 |
| 408 | 002360 | 同德化工 | 411,353.00 | 4.12 |
| 409 | 300379 | 东方通 | 411,025.00 | 4.12 |
| 410 | 601890 | 亚星锚链 | 402,201.00 | 4.03 |
| 411 | 300494 | 盛天网络 | 401,868.00 | 4.03 |
| 412 | 300664 | 鹏鹞环保 | 400,929.00 | 4.02 |
| 413 | 000668 | 荣丰控股 | 397,739.00 | 3.99 |
| 414 | 603289 | 泰瑞机器 | 397,068.80 | 3.98 |
| 415 | 603618 | 杭电股份 | 396,073.00 | 3.97 |
| 416 | 000697 | 炼石航空 | 395,878.00 | 3.97 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 417 | 600676 | 交运股份 | 394,848.00 | 3.96 |
| 418 | 603988 | 中电电机 | 394,648.00 | 3.96 |
| 419 | 002512 | 达华智能 | 393,950.00 | 3.95 |
| 420 | 688030 | 山石网科 | 392,859.46 | 3.94 |
| 421 | 600127 | 金健米业 | 392,774.00 | 3.94 |
| 422 | 300446 | 乐凯新材 | 391,430.00 | 3.92 |
| 423 | 603516 | 淳中科技 | 390,146.20 | 3.91 |
| 424 | 300543 | 朗科智能 | 388,577.00 | 3.90 |
| 425 | 603081 | 大丰实业 | 382,586.00 | 3.84 |
| 426 | 603599 | 广信股份 | 382,521.05 | 3.84 |
| 427 | 603598 | 引力传媒 | 382,014.00 | 3.83 |
| 428 | 002481 | 双塔食品 | 380,267.00 | 3.81 |
| 429 | 603825 | 华扬联众 | 376,500.00 | 3.78 |
| 430 | 000860 | 顺鑫农业 | 375,461.00 | 3.76 |
| 431 | 300458 | 全志科技 | 373,863.00 | 3.75 |
| 432 | 002436 | 兴森科技 | 373,003.00 | 3.74 |
| 433 | 300423 | 鲁亿通 | 372,531.00 | 3.74 |
| 434 | 603707 | 健友股份 | 369,972.00 | 3.71 |
| 435 | 603042 | 华脉科技 | 369,964.00 | 3.71 |
| 436 | 603619 | 中曼石油 | 369,356.00 | 3.70 |
| 437 | 002449 | 国星光电 | 365,236.00 | 3.66 |
| 438 | 600206 | 有研新材 | 363,485.00 | 3.64 |
| 439 | 603099 | 长白山 | 363,235.00 | 3.64 |
| 440 | 002203 | 海亮股份 | 363,080.75 | 3.64 |
| 441 | 300625 | 三雄极光 | 362,789.00 | 3.64 |
| 442 | 002852 | 道道全 | 360,806.18 | 3.62 |
| 443 | 601636 | 旗滨集团 | 360,431.00 | 3.61 |
| 444 | 300618 | 寒锐钴业 | 359,706.00 | 3.61 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 445 | 002158 | 汉钟精机 | 358,918.00 | 3.60 |
| 446 | 600761 | 安徽合力 | 358,553.00 | 3.60 |
| 447 | 603871 | 嘉友国际 | 358,490.00 | 3.59 |
| 448 | 002123 | 梦网集团 | 355,889.00 | 3.57 |
| 449 | 603038 | 华立股份 | 354,904.00 | 3.56 |
| 450 | 000622 | 恒立实业 | 353,665.00 | 3.55 |
| 451 | 300640 | 德艺文创 | 352,977.00 | 3.54 |
| 452 | 300684 | 中石科技 | 352,922.00 | 3.54 |
| 453 | 603378 | 亚士创能 | 352,427.00 | 3.53 |
| 454 | 600076 | 康欣新材 | 351,754.00 | 3.53 |
| 455 | 600331 | 宏达股份 | 348,656.00 | 3.50 |
| 456 | 002798 | 帝欧家居 | 348,557.00 | 3.49 |
| 457 | 600616 | 金枫酒业 | 346,505.00 | 3.47 |
| 458 | 600107 | 美尔雅 | 345,136.00 | 3.46 |
| 459 | 002666 | 德联集团 | 344,800.00 | 3.46 |
| 460 | 601601 | 中国太保 | 344,156.00 | 3.45 |
| 461 | 002161 | 远望谷 | 343,936.00 | 3.45 |
| 462 | 002413 | 雷科防务 | 343,179.00 | 3.44 |
| 463 | 600797 | 浙大网新 | 342,229.34 | 3.43 |
| 464 | 300352 | 北信源 | 342,127.00 | 3.43 |
| 465 | 000838 | 财信发展 | 341,443.00 | 3.42 |
| 466 | 002160 | 常铝股份 | 340,244.00 | 3.41 |
| 467 | 000040 | 东旭蓝天 | 339,142.00 | 3.40 |
| 468 | 603676 | 卫信康 | 337,439.00 | 3.38 |
| 469 | 002130 | 沃尔核材 | 330,718.00 | 3.32 |
| 470 | 600986 | 科达股份 | 328,841.00 | 3.30 |
| 471 | 002557 | 洽洽食品 | 328,202.92 | 3.29 |
| 472 | 300107 | 建新股份 | 325,602.00 | 3.26 |

| | | | | |
|-----|--------|--------|------------|------|
| 473 | 300076 | GQY 视讯 | 323,836.00 | 3.25 |
| 474 | 002099 | 海翔药业 | 323,692.00 | 3.25 |
| 475 | 002637 | 赞宇科技 | 320,736.00 | 3.22 |
| 476 | 688199 | 久日新材 | 320,049.08 | 3.21 |
| 477 | 688366 | 昊海生科 | 317,985.96 | 3.19 |
| 478 | 300630 | 普利制药 | 314,083.50 | 3.15 |
| 479 | 300224 | 正海磁材 | 314,032.00 | 3.15 |
| 480 | 000656 | 金科股份 | 312,902.00 | 3.14 |
| 481 | 600580 | 卧龙电驱 | 312,123.00 | 3.13 |
| 482 | 300592 | 华凯创意 | 311,449.00 | 3.12 |
| 483 | 002822 | 中装建设 | 310,394.00 | 3.11 |
| 484 | 002917 | 金奥博 | 310,321.00 | 3.11 |
| 485 | 300755 | 华致酒行 | 309,361.00 | 3.10 |
| 486 | 300149 | 量子生物 | 306,683.00 | 3.08 |
| 487 | 002530 | 金财互联 | 305,632.00 | 3.06 |
| 488 | 000705 | 浙江震元 | 303,458.00 | 3.04 |
| 489 | 002621 | 美吉姆 | 302,289.00 | 3.03 |
| 490 | 000555 | 神州信息 | 302,260.00 | 3.03 |
| 491 | 000404 | 长虹华意 | 301,511.00 | 3.02 |
| 492 | 601515 | 东风股份 | 300,890.00 | 3.02 |
| 493 | 000715 | 中兴商业 | 300,485.19 | 3.01 |
| 494 | 600557 | 康缘药业 | 300,137.00 | 3.01 |
| 495 | 000333 | 美的集团 | 297,329.00 | 2.98 |
| 496 | 300030 | 阳普医疗 | 297,105.00 | 2.98 |
| 497 | 603890 | 春秋电子 | 296,882.00 | 2.98 |
| 498 | 603180 | 金牌厨柜 | 296,494.00 | 2.97 |
| 499 | 000026 | 飞亚达 A | 294,871.00 | 2.96 |
| 500 | 300314 | 戴维医疗 | 294,766.00 | 2.96 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 501 | 601077 | 渝农商行 | 294,493.80 | 2.95 |
| 502 | 600330 | 天通股份 | 294,243.00 | 2.95 |
| 503 | 002080 | 中材科技 | 293,042.00 | 2.94 |
| 504 | 300357 | 我武生物 | 290,983.00 | 2.92 |
| 505 | 002296 | 辉煌科技 | 290,064.00 | 2.91 |
| 506 | 600570 | 恒生电子 | 289,503.40 | 2.90 |
| 507 | 000925 | 众合科技 | 289,308.00 | 2.90 |
| 508 | 300455 | 康拓红外 | 287,963.00 | 2.89 |
| 509 | 600548 | 深高速 | 285,218.00 | 2.86 |
| 510 | 002313 | 日海智能 | 284,989.00 | 2.86 |
| 511 | 300679 | 电连技术 | 282,330.00 | 2.83 |
| 512 | 300451 | 创业慧康 | 281,726.00 | 2.82 |
| 513 | 300050 | 世纪鼎利 | 281,696.00 | 2.82 |
| 514 | 603555 | 贵人鸟 | 281,628.00 | 2.82 |
| 515 | 600469 | 风神股份 | 281,435.00 | 2.82 |
| 516 | 000157 | 中联重科 | 281,226.00 | 2.82 |
| 517 | 000885 | 城发环境 | 280,597.00 | 2.81 |
| 518 | 002467 | 二六三 | 280,067.20 | 2.81 |
| 519 | 002111 | 威海广泰 | 278,484.00 | 2.79 |
| 520 | 600143 | 金发科技 | 278,008.00 | 2.79 |
| 521 | 688025 | 杰普特 | 275,001.54 | 2.76 |
| 522 | 600702 | 舍得酒业 | 272,785.00 | 2.74 |
| 523 | 600363 | 联创光电 | 272,608.00 | 2.73 |
| 524 | 000425 | 徐工机械 | 271,792.00 | 2.73 |
| 525 | 002731 | 萃华珠宝 | 271,758.00 | 2.72 |
| 526 | 300347 | 泰格医药 | 270,992.00 | 2.72 |
| 527 | 600622 | 光大嘉宝 | 270,446.00 | 2.71 |
| 528 | 600777 | 新潮能源 | 268,152.00 | 2.69 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 529 | 002301 | 齐心集团 | 267,880.00 | 2.69 |
| 530 | 600351 | 亚宝药业 | 267,602.00 | 2.68 |
| 531 | 002847 | 盐津铺子 | 265,531.00 | 2.66 |
| 532 | 300036 | 超图软件 | 262,271.00 | 2.63 |
| 533 | 300397 | 天和防务 | 261,886.00 | 2.63 |
| 534 | 688098 | 申联生物 | 261,363.80 | 2.62 |
| 535 | 600197 | 伊力特 | 261,191.00 | 2.62 |
| 536 | 002918 | 蒙娜丽莎 | 258,492.00 | 2.59 |
| 537 | 600191 | 华资实业 | 258,361.00 | 2.59 |
| 538 | 300221 | 银禧科技 | 258,075.00 | 2.59 |
| 539 | 688101 | 三达膜 | 255,393.39 | 2.56 |
| 540 | 002226 | 江南化工 | 255,358.00 | 2.56 |
| 541 | 603258 | 电魂网络 | 254,208.00 | 2.55 |
| 542 | 002683 | 宏大爆破 | 253,415.00 | 2.54 |
| 543 | 000789 | 万年青 | 252,671.68 | 2.53 |
| 544 | 002331 | 皖通科技 | 249,700.00 | 2.50 |
| 545 | 002214 | 大立科技 | 249,666.00 | 2.50 |
| 546 | 300724 | 捷佳伟创 | 249,617.00 | 2.50 |
| 547 | 300239 | 东宝生物 | 248,019.00 | 2.49 |
| 548 | 002090 | 金智科技 | 247,974.00 | 2.49 |
| 549 | 300140 | 中环装备 | 245,490.00 | 2.46 |
| 550 | 600521 | 华海药业 | 245,387.00 | 2.46 |
| 551 | 600900 | 长江电力 | 244,547.00 | 2.45 |
| 552 | 688039 | 当虹科技 | 244,020.98 | 2.45 |
| 553 | 688166 | 博瑞医药 | 243,686.41 | 2.44 |
| 554 | 002199 | 东晶电子 | 243,682.00 | 2.44 |
| 555 | 002732 | 燕塘乳业 | 241,990.00 | 2.43 |
| 556 | 300693 | 盛弘股份 | 241,151.00 | 2.42 |

| | | | | |
|-----|--------|-------|------------|------|
| 557 | 300429 | 强力新材 | 240,461.00 | 2.41 |
| 558 | 000889 | 中嘉博创 | 240,297.00 | 2.41 |
| 559 | 300567 | 精测电子 | 236,308.00 | 2.37 |
| 560 | 600020 | 中原高速 | 234,086.00 | 2.35 |
| 561 | 002133 | 广宇集团 | 231,840.00 | 2.32 |
| 562 | 002063 | 远光软件 | 230,427.00 | 2.31 |
| 563 | 603363 | 傲农生物 | 228,812.00 | 2.29 |
| 564 | 603105 | 芯能科技 | 227,723.00 | 2.28 |
| 565 | 002882 | 金龙羽 | 227,102.00 | 2.28 |
| 566 | 688068 | 热景生物 | 224,200.80 | 2.25 |
| 567 | 300081 | 恒信东方 | 223,949.00 | 2.25 |
| 568 | 603600 | 永艺股份 | 223,818.00 | 2.24 |
| 569 | 000156 | 华数传媒 | 222,922.00 | 2.24 |
| 570 | 688369 | 致远互联 | 221,530.20 | 2.22 |
| 571 | 603197 | 保隆科技 | 220,639.00 | 2.21 |
| 572 | 688108 | 赛诺医疗 | 220,119.98 | 2.21 |
| 573 | 600213 | 亚星客车 | 219,785.00 | 2.20 |
| 574 | 603315 | 福鞍股份 | 219,248.00 | 2.20 |
| 575 | 600033 | 福建高速 | 217,742.00 | 2.18 |
| 576 | 600745 | 闻泰科技 | 216,721.00 | 2.17 |
| 577 | 300234 | 开尔新材 | 216,380.00 | 2.17 |
| 578 | 600319 | ST 亚星 | 215,344.00 | 2.16 |
| 579 | 603345 | 安井食品 | 214,934.00 | 2.16 |
| 580 | 300476 | 胜宏科技 | 213,502.00 | 2.14 |
| 581 | 300680 | 隆盛科技 | 213,423.00 | 2.14 |
| 582 | 600483 | 福能股份 | 211,517.00 | 2.12 |
| 583 | 002554 | 惠博普 | 210,895.00 | 2.11 |
| 584 | 300348 | 长亮科技 | 210,832.00 | 2.11 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 585 | 601168 | 西部矿业 | 209,671.00 | 2.10 |
| 586 | 603039 | 泛微网络 | 206,630.00 | 2.07 |
| 587 | 002617 | 露笑科技 | 206,269.00 | 2.07 |
| 588 | 600300 | 维维股份 | 205,495.00 | 2.06 |
| 589 | 603041 | 美思德 | 205,358.00 | 2.06 |
| 590 | 002911 | 佛燃股份 | 204,555.00 | 2.05 |
| 591 | 603127 | 昭衍新药 | 204,406.00 | 2.05 |
| 592 | 603068 | 博通集成 | 204,304.00 | 2.05 |
| 593 | 600529 | 山东药玻 | 204,300.00 | 2.05 |
| 594 | 600961 | 株冶集团 | 204,126.00 | 2.05 |
| 595 | 002752 | 昇兴股份 | 203,480.00 | 2.04 |
| 596 | 603519 | 立霸股份 | 202,948.00 | 2.03 |
| 597 | 300369 | 绿盟科技 | 202,848.00 | 2.03 |
| 598 | 600110 | 诺德股份 | 202,666.00 | 2.03 |
| 599 | 600611 | 大众交通 | 202,456.00 | 2.03 |
| 600 | 688299 | 长阳科技 | 201,856.98 | 2.02 |
| 601 | 600585 | 海螺水泥 | 201,699.00 | 2.02 |

注：本项卖出金额均按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

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 | 583,301,582.50 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 600,915,283.50 |

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。

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。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货持仓。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

本报告期内, 本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的, 在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中, 不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

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 | 50,575.27 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 6,321.06 |
| 5 | 应收申购款 | 62,643.27 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 119,539.60 |

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金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

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产 净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|-------------|-------------------|-----------|
| 1 | 601077 | 渝农商行 | 462,545.14 | 1.93 | 网下发行锁定 |
| 2 | 688258 | 卓易信息 | 242,723.25 | 1.01 | 科创板股票流通受限 |

§ 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 |
| 万 家 中 证 1000 指 数 增 强 A | 276 | 40,576.71 | 9,887,305.69 | 88.29% | 1,311,864.91 | 11.71% |
| 万 家 中 证 1000 指 数 增 强 C | 505 | 22,744.22 | 9,754,318.60 | 84.92% | 1,731,511.22 | 15.08% |
| 合计 | 748 | 30,327.54 | 19,641,624.29 | 86.58% | 3,043,376.13 | 13.42% |

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额 比例 |
|----------------------|-------------------------|-----------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员 持有本基金 | 万家中证 1000 指数 增强 A | 179.00 | 0.0016% |
| | 万家中证 1000 指数 | 10,979.02 | 0.0956% |

| | | | |
|--|------|-----------|---------|
| | 增强 C | | |
| | 合计 | 11,158.02 | 0.0492% |

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 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 | 万家中证 1000 指数 增强 A | 0~10 |
| | 万家中证 1000 指数 增强 C | 0~10 |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开 放式基金 | 万家中证 1000 指数 增强 A | 0 |
| | 万家中证 1000 指数 增强 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占 基金总份额 比例（%） | 发起份额总数 | 发起份额占 基金总份额 比例（%） | 发起份额承 诺持有期限 |
|-----------------|--------------|-------------------------|--------------|-------------------------|----------------|
| 基金管理人固有资 金 | 9,887,305.69 | 43.59 | 9,887,305.69 | 43.59 | 3 年 |
| 基金管理人高级管 理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 9,887,305.69 | 43.59 | 9,887,305.69 | 43.59 | 3 年 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 万家中证 1000 指数增强 A | 万家中证 1000 指数增强 C |
|--------------------------------|------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2018 年 12 月 3 日）基金份额总额 | 25,339.33 | 595,564.60 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 9,919,465.90 | 595,659.98 |
| 本报告期基金总申购份额 | 3,977,053.64 | 157,085,314.51 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 2,697,348.94 | 146,195,144.67 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 11,199,170.60 | 11,485,829.82 |

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内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

基金管理人：

2019 年 8 月 21 日，公司增聘乔亮为万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，与陈旭共同管理该基金。

2019 年 10 月 22 日，陈旭因个人原因离职，公司免去其万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。

2019 年 6 月 13 日，公司聘任陈广益先生担任公司首席信息官。

2019 年 7 月 20 日，公司聘任满黎先生担任公司副总经理。

基金托管人：

自 2019 年 12 月 18 日起，姜然女士不再担任招商银行股份有限公司总行资产托管部总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期期为基金进行审计的会计师事务所未发生改变。

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

报告期内，本基金管理人、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 | 佣金 | 占当期佣金 | |
| | | | | | | |

| | | | 成交总额的比 例 | | 总量的比例 | |
|-------|---|----------------|-------------|------------|--------|---|
| 太平洋证券 | 2 | 928,606,932.90 | 78.88% | 864,814.81 | 78.88% | - |
| 西南证券 | 1 | 134,946,136.73 | 11.46% | 125,677.45 | 11.46% | - |
| 申万宏源 | 1 | 84,902,871.37 | 7.21% | 79,074.40 | 7.21% | - |
| 中信证券 | 2 | 28,753,063.44 | 2.44% | 26,779.66 | 2.44% | - |

注：1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范, 内控制度健全, 在业内有良好的声誉;
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设施满足基金进行证券交易的需要;
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平, 包括但不限于: 有较好的研究能力和行业分析能力, 能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务; 能根据公司所管理基金的特定要求, 提供专门研究报告, 具有开发量化投资组合模型的能力; 能积极为公司投资业务的开展, 投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构;
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

3、基金专用交易席位的变更情况：

本报告期内，本基金新增太平洋证券交易单元 2 个、西南证券交易单元 1 个、申万宏源交易单元 1 个。

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通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

§ 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%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 20190101 - 20190805 , 20191230 - 20191231 | 9,887,305.69 | 0.00 | 0.00 | 9,887,305.69 | 43.59% |
| | 2 | 20190806 - 20191218 | 0.00 | 67,206,394.14 | 67,206,394.14 | 0.00 | 0.00% |
| | 3 | 20190806 - 20191231 | 0.00 | 41,443,943.04 | 36,704,556.00 | 4,739,387.04 | 20.89% |
| | 4 | 20190806 - 20191231 | 0.00 | 41,443,943.04 | 36,434,852.00 | 5,009,091.04 | 22.08% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。</p> <p>未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；本基金基金合同生效满三年后继续存续时，若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。持有基金份额占比较高的投资者 在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> | | | | | | | |

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》。
- 3、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 4、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金净值、更新招募说明书及其他临时公告。
- 5、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2019 年年度报告原文。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。
- 7、《万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》

13.2 存放地点

基金管理人的办公场所，并登载于基金管理人网站：〈www.wjasset.com〉

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司

2020 年 3 月 25 日