

万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资 基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 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：2021 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会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。本中期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 2021 年 8 月 27 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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	47
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	80
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	80
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	80
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	81
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	81
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	81
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	81
7.12 投资组合报告附注.....	81
§8 基金份额持有人信息.....	83
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	83
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	83
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	83
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	84
§9 开放式基金份额变动.....	85
§10 重大事件揭示.....	86
10.1 基金份额持有人大会决议.....	86
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	86
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	86
10.4 基金投资策略的改变.....	86
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	86
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	86
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	86
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	88
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	88

§12 备查文件目录	89
12.1 备查文件目录.....	89
12.2 存放地点.....	89
12.3 查阅方式.....	89

§ 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	108,941,501.63 份	
基金合同存续期	不定期	
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	50,248,469.33 份	58,693,032.30 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的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。具体策略包括：1、股票投资策略；2、债券投资策略；3、中小企业私募债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、可转换债券投资策略；6、证券公司短期公司债券投资策略；7、衍生产品投资策略：（1）权证投资策略；（2）股指期货投资策略；（3）国债期货投资策略；（4）股票期权投资策略；（5）其他金融衍生产品；8、融资及转融通证券出借业务投资策略；9、其他。
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
	联系电话	021-38909626
	电子邮箱	lanj@wjasset.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	深圳市深南大道 7088 号招商银

	区浦电路 360 号 8 层(名义楼层 9 层)	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	缪建民

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.wjasset.com
基金中期报告备置地点	中国(上海)自由贸易实验区浦电路 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
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	万家中证 1000 指数增强 A	万家中证 1000 指数增强 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	6,195,546.81	5,465,401.46
本期利润	8,574,437.72	7,417,191.34
加权平均基金份额本期利润	0.1201	0.1077
本期加权平均净值利润率	11.78%	10.58%
本期基金份额净值增长率	11.21%	11.01%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	7,556,968.53	8,903,123.25
期末可供分配基金份额利润	0.1504	0.1517
期末基金资产净值	57,805,437.86	67,596,155.55
期末基金份额净值	1.1504	1.1517
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	95.86%	94.33%

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
过去一个月	5.43%	1.00%	3.76%	0.97%	1.67%	0.03%
过去三个月	15.18%	0.84%	11.93%	0.84%	3.25%	0.00%
过去六个月	11.21%	1.08%	6.32%	1.10%	4.89%	-0.02%
过去一年	25.08%	1.34%	11.66%	1.32%	13.42%	0.02%
自基金合同生效起至今	95.86%	1.44%	50.06%	1.48%	45.80%	-0.04%

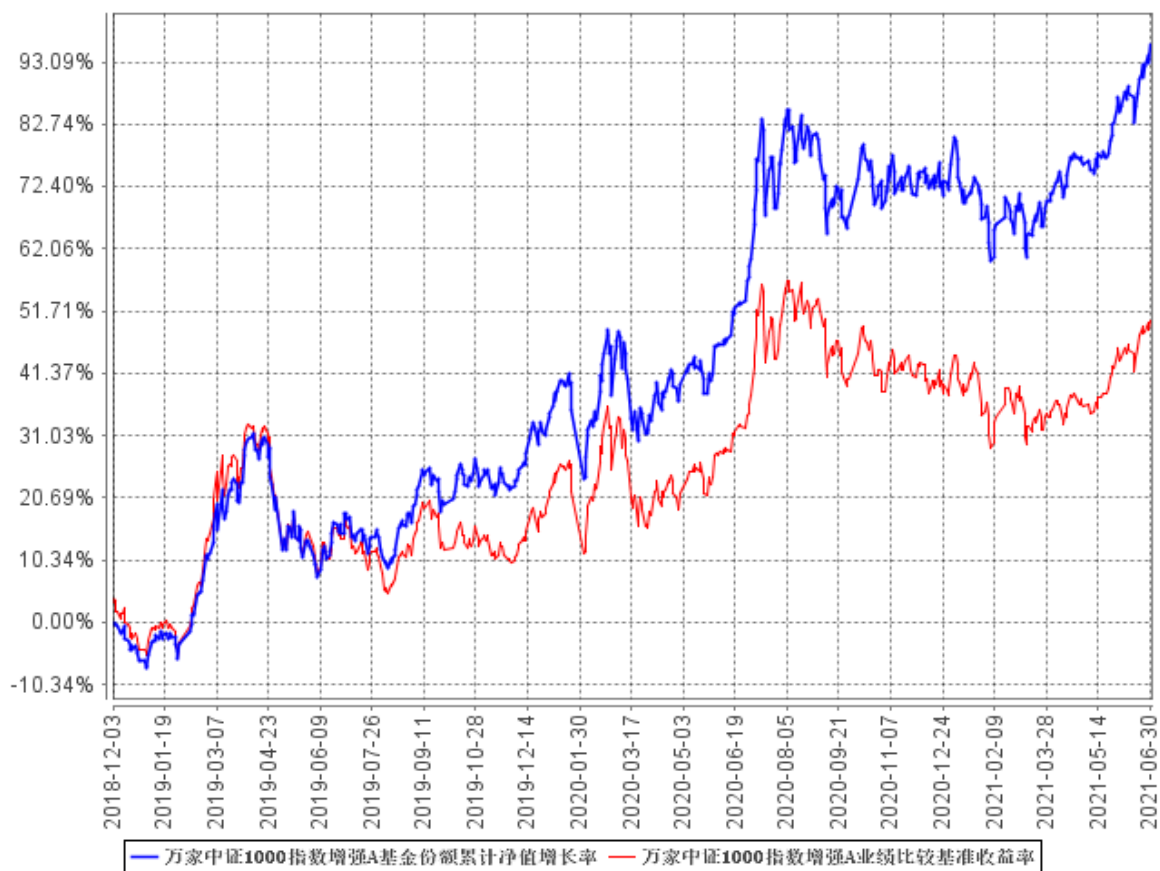
万家中证 1000 指数增强 C

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
过去一个月	5.39%	1.00%	3.76%	0.97%	1.63%	0.03%
过去三个月	15.07%	0.85%	11.93%	0.84%	3.14%	0.01%
过去六个月	11.01%	1.08%	6.32%	1.10%	4.69%	-0.02%
过去一年	24.56%	1.34%	11.66%	1.32%	12.90%	0.02%
自基金合同生效起至今	94.33%	1.44%	50.06%	1.48%	44.27%	-0.04%

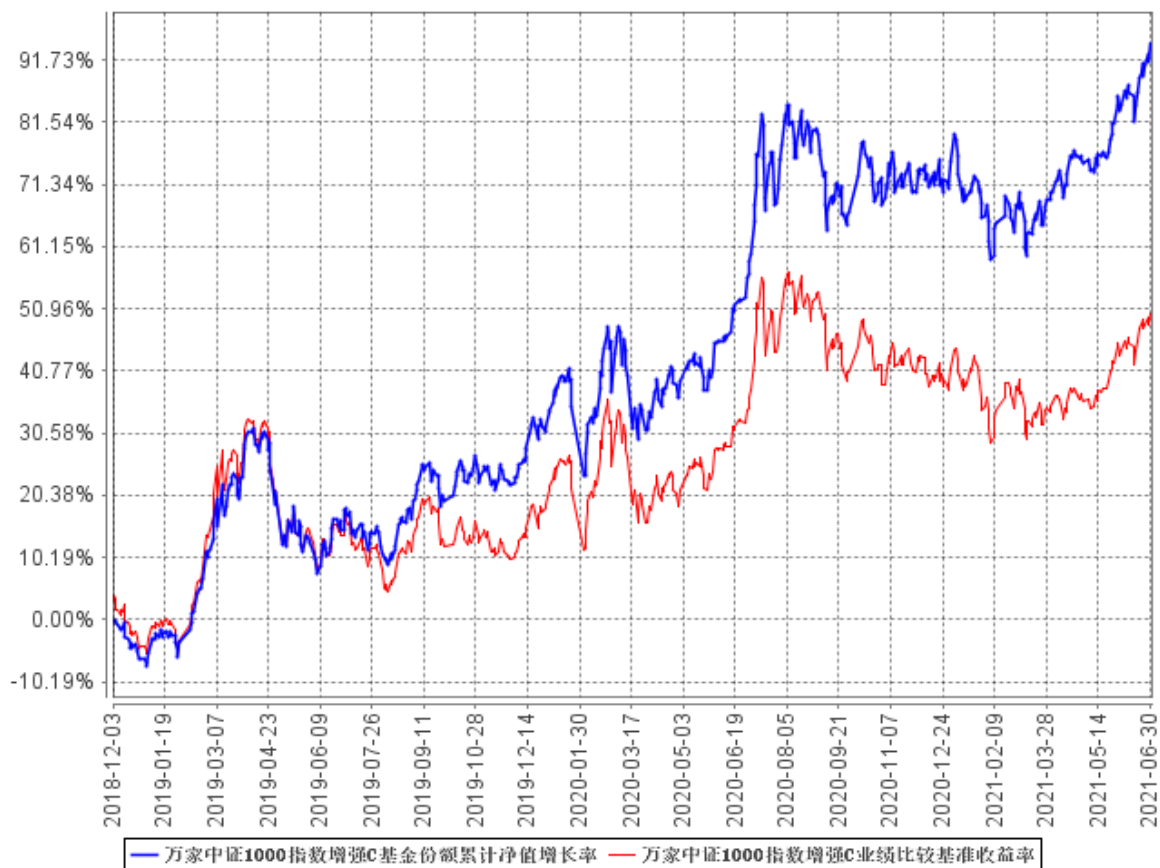
注：基金业绩比较基准增长率=中证 1000 指数收益率*95%+一年期人民币定期存款利率（税后）*5%。

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。

§ 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。目前管理九十一只开放式基金,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、万家智造优势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)、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金(FOF)、万家平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金(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、万家鑫盛纯债债券型证券投资基金、万家民安增利 12 个月定期开放债券型证券投资基金、万家汽车新趋势混合型证券投资基金、万家惠享 39 个月定期开放债券型证券投资基金、万家科技创新混合型证券投资基金、万家自主创新混合型证券投资基金、万家民丰回报一年持有期混合型基金中基金(FOF)、万家可转债债券型证券投资基金、万家民瑞祥和 6 个月持有期债券型证券投资基金、万家价值优势一年持有期混合型基金中基金(FOF)、万家养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金(FOF)、万家鑫动力月月购一年滚动持有混合型基金中基金(FOF)、万家科创板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家创业板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家周期优势企业混合型证券投资基金、万家健康产业混合型证券投资基金、万家互联互通中国优势量化策略混合型证券投资基金、万家战略发展产业混合型证券投资基金、万家创业板指数增强型证券投资基金、万家陆家嘴金融城金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家内需增长一年持有期混合型基金中基金(FOF)、万家互联互通核心资产量化策略混合型证券投资基金、万家民瑞祥明 6 个月持有期混合型基金中基金(FOF)、万家瑞泽回报一年持有期混合型基金中基金(FOF)、万家惠裕回报 6 个月持有期混合型基金中基金(FOF)。

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	万家量化睿选灵活配置混合型基金、万家中证 1000 指数增强型发起式基金、万家沪深 300	2019 年 8 月 21 日	-	14 年	曾任美国巴克莱国际投资管理公司基金经理，加拿大退休基金国际投资管理公司基金经理，南方基金管理有限公司量化投资部基金经理，通联数据股份有限公司联合创始人、首席投资官，上海寻乾资产管理有限公司投资总监、总经理，巨杉（上海）资产管理有限公司量化投资部投资总监。2019 年 7 月加入

	指数增强型基金、万家互联互通核心资产量化策略混合型证券投资基金、万家创业板指数增强型证券投资基金、万家中证 500 指数增强型基金的基金经理			万家基金管理有限公司，担任公司总经理助理。
--	--	--	--	-----------------------

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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》、《公开募集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 公平交易制度的执行情况

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《公平交易管理办法》和《异常交易监控及报告管理办法》等规章制度，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,确保公平对待不同投资组合,防范导致不公平交易以及利益输送的异常交易发生。

公司制订了明确的投资授权制度,并建立了统一的投资管理平台,确保不同投资组合获得公平的投资决策机会。实行集中交易制度,对于交易所公开竞价交易,执行交易系统内的公平交易程序;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,原则上按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;对于银行间交易,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。为保证公平交易原则的实现,通过制度规范、流程审批、系统风控参数设置等进行事前控制,通过对投资交易系统的实时监控进行事中控制,通过对异常交易的监控和分析实现事后控制。

4.3.2 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,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,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%的交易共有 1 次,为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易,有关基金经理按规定履行了审批程序。

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

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。

万家中证 1000 指数增强基金采用量化多因子选股策略,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。在行业和风格配置相对于业绩基准指数相对均衡,无重仓行业或具体风格,在量化选股方面精选行业内质优个股组合,持股较为分散。采用量化风险模型合理控制组合风险,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 1.1504 元，本报告期基金份额净值增长率为 11.21%；截至本报告期末万家中证 1000 指数增强 C 基金份额净值为 1.1517 元，本报告期基金份额净值增长率为 11.01%；同期业绩比较基准收益率为 6.32%。基金报告期末 A 份额、C 份额日均跟踪偏离度分别为 0.2266%、0.2268%，年跟踪误差分别为 3.0838%、3.0884%，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

回顾 2021 年上半年，在一季度中，春节前后 A 股市场经历了快速的上涨与调整。在年初的市场上，A 股在核心资产的带动下一路高歌猛进，叠加大量新发基金进场导致市场过去两年热门赛道上的股票估值进一步扩张。春节后在美债收益率快速上升以及通胀预期等各种因素催化下，核心资产迎来大幅度回调。在此过程中，一些前期不太受市场关注的低估值顺周期板块表现较好。二季度，美债收益率在经历了一季度的飙升之后逐渐企稳，经济复苏进入实质阶段。中国市场仍得到海外资金的青睐，上半年北向资金累计净流入超两千亿元。市场在修复了一季度的大起大落后表现平稳，期间各类题材主题不断轮动，市场成交活跃。市场风格在经历了一季度严重的分化与波动后，在二季度中整体表现更加均衡，并且随着市场逐步的企稳以及一些高景气板块共识的达成，成长风格稳步占优。

展望 2021 年下半年，我们认为市场将整体呈现震荡格局，但会存在结构性机会，后续来看，无论是核心资产还是中小市值个股，核心抓手都是业绩增速。流动性方面，全球新冠疫苗大规模接种持续推进，中国接种率快速上升，全球疫情逐渐好转。美联储论调虽偏鹰，目前仍未实施收紧政策，海外流动性保持整体宽松。中国经济复苏走向中后期阶段，生产端有所回落，需求端增速下行，出口仍保持较高增速。信贷额度以及地产调控可能继续趋紧，PPI 高位震荡，核心 CPI 处于低位。在经济持续复苏背景下，货币政策虽难系统性放松，但伴随央行本次降准等操作，市场流动性总量仍将保持基本稳定。同时，股市资金面也整体向好，二季度以来股市成交量持续回升，融资融券余额、新基金发行份额也反映出市场活跃度提升。上半年北向资金累计净流入超过 2200 亿元，已超过去年全年的水平。预计下半年仍将保持平稳净流入的节奏，全年净流入规模有望超过 2019 年的水平。从企业盈利上来看，行业业绩增速同比也全面上行。在盈利驱动仍为行情主线的当前时点，我们认为有业绩支撑，景气度持续较高，并且符合政策倾斜方向，时代发展趋势的细分行业会有结构性的机会。

后续投资运作继续坚持以量化多因子选股为策略基础，积极参与科创、创业板打新等事件性

机会，追求长期稳健的超额收益。

4.6 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。估值委员会由总经理、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》、《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》。

4.7 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%”。2021 年 01 月 13 日，本基金进行了利润分配，A 类每 10 份基金份额分红 3.30 元，共计分配利润 3,684,662.14 元；C 类每 10 份基金份额分红 3.20 元，共计分配利润 708,133.99 元。符合基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，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。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	7,883,105.65	1,092,654.49
结算备付金		885,283.29	48,374.56
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	118,203,794.04	17,155,937.38
其中：股票投资		118,203,794.04	17,155,937.38
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	864.30	144.83
应收股利		-	-
应收申购款		2,667,299.10	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		129,640,346.38	18,297,111.26
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		4,050,938.07	29,180.87
应付管理人报酬		97,547.14	15,642.35
应付托管费		19,509.42	3,128.47
应付销售服务费		20,391.61	1,028.83
应付交易费用	6.4.7.7	-	21,592.30
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	50,366.73	41,232.88
负债合计		4,238,752.97	111,805.70
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	108,941,501.63	13,257,277.16
未分配利润	6.4.7.10	16,460,091.78	4,928,028.40
所有者权益合计		125,401,593.41	18,185,305.56
负债和所有者权益总计		129,640,346.38	18,297,111.26

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，万家中证 1000 指数增强 A 基金份额净值 1.1504 元，基金份额总额 50,248,469.33 份；万家中证 1000 指数增强 C 基金份额净值 1.1517 元，基金份额总额 58,693,032.30 份。万家中证 1000 指数增强份额总额合计为 108,941,501.63 份。

6.2 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		18,175,769.00	4,786,409.91
1.利息收入		21,214.10	7,771.41
其中：存款利息收入	6.4.7.11	21,214.10	7,771.41
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		13,208,098.82	3,306,625.27
其中：股票投资收益	6.4.7.12	12,441,500.70	3,150,866.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	766,598.12	155,759.16
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	4,330,680.79	1,429,411.87
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	615,775.29	42,601.36
减：二、费用		2,184,139.94	354,670.10
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	711,386.32	134,019.02
2. 托管费	6.4.10.2.2	142,277.24	26,803.84
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	140,109.85	27,756.81
4. 交易费用	6.4.7.19	1,151,415.32	128,877.74
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	6.4.7.20	38,951.21	37,212.69
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		15,991,629.06	4,431,739.81
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		15,991,629.06	4,431,739.81

6.3 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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）	13,257,277.16	4,928,028.40	18,185,305.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	15,991,629.06	15,991,629.06
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）	95,684,224.47	-66,769.55	95,617,454.92
其中：1.基金申购款	312,211,607.46	5,566,223.73	317,777,831.19
2.基金赎回款	-216,527,382.99	-5,632,993.28	-222,160,376.27
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的	-	-4,392,796.13	-4,392,796.13

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）	108,941,501.63	16,460,091.78	125,401,593.41
	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
项目	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）	22,685,000.42	1,290,265.11	23,975,265.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,431,739.81	4,431,739.81
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）	-3,547,708.95	-851,493.29	-4,399,202.24
其中：1.基金申购款	19,500,079.97	2,074,413.17	21,574,493.14
2.基金赎回款	-23,047,788.92	-2,925,906.46	-25,973,695.38
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）	19,137,291.47	4,870,511.63	24,007,803.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 方一天 _____ 陈广益 _____ 尹超
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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”）由万家裕裕债券型证券投资基金转型而来。根据万家裕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%。

6.4.2 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（2020 年修订）》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》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。

6.4.3 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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本中期报告所采取的会计政策、会计估计与上年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

(一) 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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》的规定，基金通过深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(二) 增值税

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

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

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

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

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

(三) 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。

(四) 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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》的规定，对基金通过深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	7,883,105.65
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：	7,883,105.65

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	112,993,358.19	118,203,794.04	5,210,435.85
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	112,993,358.19	118,203,794.04	5,210,435.85

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	751.38
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	2.32
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	110.60
合计	864.30

注：其他本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金所产生的应收利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,294.34
应付证券出借违约金	-
其他	196.00
预提费用	44,876.39
合计	50,366.73

6.4.7.9 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,120,961.79	11,120,961.79
本期申购	122,425,852.97	122,425,852.97
本期赎回(以“-”号填列)	-83,298,345.43	-83,298,345.43
- 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	50,248,469.33	50,248,469.33

金额单位：人民币元

万家中证 1000 指数增强 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,136,315.37	2,136,315.37
本期申购	189,785,754.49	189,785,754.49
本期赎回(以“-”号填列)	-133,229,037.56	-133,229,037.56

- 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	58,693,032.30	58,693,032.30

注:申购含红利再投、转换入份额,赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	5,320,052.93	-1,173,385.80	4,146,667.13
本期利润	6,195,546.81	2,378,890.91	8,574,437.72
本期基金份额交易产生的变动数	5,410,127.64	-6,889,601.82	-1,479,474.18
其中:基金申购款	20,676,528.16	-19,395,740.96	1,280,787.20
基金赎回款	-15,266,400.52	12,506,139.14	-2,760,261.38
本期已分配利润	-3,684,662.14	-	-3,684,662.14
本期末	13,241,065.24	-5,684,096.71	7,556,968.53

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	1,007,435.85	-226,074.58	781,361.27
本期利润	5,465,401.46	1,951,789.88	7,417,191.34
本期基金份额交易产生的变动数	9,771,860.49	-8,359,155.86	1,412,704.63
其中:基金申购款	33,445,195.06	-29,159,758.53	4,285,436.53
基金赎回款	-23,673,334.57	20,800,602.67	-2,872,731.90
本期已分配利润	-708,133.99	-	-708,133.99
本期末	15,536,563.81	-6,633,440.56	8,903,123.25

6.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	17,139.31
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	5.59
其他	4,069.20
合计	21,214.10

注：本期其他包含存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	453,886,319.79
减：卖出股票成本总额	441,444,819.09
买卖股票差价收入	12,441,500.70

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期末无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

股票投资产生的股利收益	766,598.12
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	766,598.12

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	4,330,680.79
——股票投资	4,330,680.79
——债券投资	-
——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	4,330,680.79

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	613,759.50
转换费收入	2,015.79
合计	615,775.29

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,151,415.32
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	1,151,415.32

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	-
证券出借违约金	-
指数费用	20,000.00
银行费用	4,074.82
合计	38,951.21

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日,本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内,与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
中泰证券股份有限公司	-	-	10,292,517.70	12.36%

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本报告期及上年度可比期间, 本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间, 本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中泰证券股份有 限公司	9,585.07	12.36%	9,585.07	30.12%

注：本基金本报告期内未产生关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	711,386.32	134,019.02
其中：支付销售机构的客户维护费	317,418.97	17,814.54

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 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、休息日，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	142,277.24	26,803.84

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 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 5 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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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	-	7,518.88	7,518.88
招商银行股份有限公司	-	135.60	135.60
中泰证券股份有限公司	-	62.07	62.07
合计	-	7,716.55	7,716.55
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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	-	15,210.80	15,210.80
招商银行股份有限公司	-	101.68	101.68
中泰证券股份有限公司	-	107.07	107.07
合计	-	15,419.55	15,419.55

注：销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及 C 类基金份额持有人服务等各项费用。本基金份额分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A 类不收取销售服务费，C 类销售服务费年费率为 0.40%。C 类基金份额的销售服务费计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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	-	-
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	9.0758%	-

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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	-	-
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	51.6651%	-

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	7,883,105.65	17,139.31	1,407,496.73	6,401.12

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管，活期存款按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.11 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	2021年1月13日	-	2021年1月13日	3.3000	3,568,145.64	116,516.50	3,684,662.14	
合计	-	-	-	3.3000	3,568,145.64	116,516.50	3,684,662.14	

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	2021 年 1 月 13 日	-	2021 年 1 月 13 日	3.2000	567,997.74	140,136.25	708,133.99	
合计	-	-	-	3.2000	567,997.74	140,136.25	708,133.99	

6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	10.64	10.64	2,652	28,217.28	28,217.28	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	9.46	9.46	2,054	19,430.84	19,430.84	-
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股流通受限	10.64	10.64	295	3,138.80	3,138.80	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股流通受限	9.46	9.46	229	2,166.34	2,166.34	-
688611	杭州柯林	2021 年 4 月 1 日	2021 年 10 月 12 日	新股流通受限	33.44	42.34	1,372	45,879.68	58,090.48	-
300957	贝泰妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股流通受限	47.33	251.96	132	6,247.56	33,258.72	-
300979	华利	2021 年	2021	新股流	33.22	87.50	218	7,241.96	19,075.00	-

	集团	4月15日	年10月26日	通受限						
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股流通受限	28.28	115.71	162	4,581.36	18,745.02	-
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月22日	新股流通受限	28.77	99.85	182	5,236.14	18,172.70	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
301013	利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	新股流通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股流通受限	7.64	38.83	308	2,353.12	11,959.64	-
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	新股流通受限	48.59	90.39	129	6,268.11	11,660.31	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股流通受限	9.19	40.38	250	2,297.50	10,095.00	-
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股流通受限	6.87	12.07	784	5,386.08	9,462.88	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021年3月3日	2021年9月13日	新股流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-

300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	新股流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股流通受限	18.71	57.62	150	2,806.50	8,643.00	-
300950	德固特	2021年2月24日	2021年9月3日	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新股流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股流通受限	4.94	13.05	552	2,726.88	7,203.60	-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
301004	嘉益股份	2021年6月18日	2021年12月27日	新股流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股流通受限	13.75	32.98	201	2,763.75	6,628.98	-

300975	商络电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	新股流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	新股流通受限	14.79	30.57	195	2,884.05	5,961.15	-
300967	晓鸣股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新股流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股流通受限	14.20	33.84	162	2,300.40	5,482.08	-
300972	万辰生物	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 19 日	新股流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300960	通业科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	新股流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300985	致远新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	新股流通受限	24.90	24.81	180	4,482.00	4,465.80	-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-

			日							
300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688368	晶丰明源	2021 年 6 月 21 日	临时停牌	335.26	2021 年 7 月 5 日	402.31	800	275,754.30	268,208.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 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证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，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。

6.4.13.3 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。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金期末持有的流通受限证券外，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资产的公允价值。

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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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 6.4.12“期末（2021 年 6 月 30 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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1	1-5 年	5 年以	不计息	合计
-----	--------	--------	--------	-------	------	-----	----

2021 年 6 月 30 日			年		上		
资产							
银行存款	7,883,105.65	-	-	-	-	-	7,883,105.65
结算备付金	885,283.29	-	-	-	-	-	885,283.29
交易性金融资产		-	-	-	-	-118,203,794.04	118,203,794.04
应收利息		-	-	-	-	864.30	864.30
应收申购款	1,100.00	-	-	-	-	2,666,199.10	2,667,299.10
资产总计	8,769,488.94	-	-	-	-	-120,870,857.44	129,640,346.38
负债							
应付赎回款		-	-	-	-	4,050,938.07	4,050,938.07
应付管理人报酬		-	-	-	-	97,547.14	97,547.14
应付托管费		-	-	-	-	19,509.42	19,509.42
应付销售服务费		-	-	-	-	20,391.61	20,391.61
其他负债		-	-	-	-	50,366.73	50,366.73
负债总计		-	-	-	-	4,238,752.97	4,238,752.97
利率敏感度缺口	8,769,488.94	-	-	-	-	-116,632,104.47	125,401,593.41
上年度末 2020 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	1,092,654.49	-	-	-	-	-	1,092,654.49
结算备付金	48,374.56	-	-	-	-	-	48,374.56
交易性金融资产		-	-	-	-	-17,155,937.38	17,155,937.38
应收利息		-	-	-	-	144.83	144.83
资产总计	1,141,029.05	-	-	-	-	-17,156,082.21	18,297,111.26
负债							
应付赎回款		-	-	-	-	29,180.87	29,180.87
应付管理人报酬		-	-	-	-	15,642.35	15,642.35
应付托管费		-	-	-	-	3,128.47	3,128.47
应付销售服务费		-	-	-	-	1,028.83	1,028.83
应付交易费用		-	-	-	-	21,592.30	21,592.30
其他负债		-	-	-	-	41,232.88	41,232.88
负债总计		-	-	-	-	111,805.70	111,805.70
利率敏感度	1,141,029.05	-	-	-	-	-17,044,276.51	18,185,305.56

缺口							
----	--	--	--	--	--	--	--

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2020 年 12 月 31 日：同），银行存款、结算备付金以及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（2020 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	118,203,794.04	94.26	17,155,937.38	94.34
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	118,203,794.04	94.26	17,155,937.38	94.34

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。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	若股票基准指数发生变动而其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	股票基准指数下降 100 个基点	-1,257,544.96	-171,454.22
股票基准指数上升 100 个基点	1,257,544.96	171,454.22	

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。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	118,203,794.04	91.18
	其中：股票	118,203,794.04	91.18
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	8,768,388.94	6.76
8	其他各项资产	2,668,163.40	2.06
9	合计	129,640,346.38	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	540,665.00	0.43
B	采矿业	2,627,662.00	2.10
C	制造业	74,012,394.15	59.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	535,999.00	0.43
E	建筑业	2,659,418.00	2.12
F	批发和零售业	2,160,739.00	1.72
G	交通运输、仓储和邮政业	1,352,991.90	1.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,710,989.77	4.55
J	金融业	1,251,912.00	1.00
K	房地产业	553,286.00	0.44
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	1,832,402.00	1.46
N	水利、环境和公共设施管理业	339,837.00	0.27
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	429,808.50	0.34
R	文化、体育和娱乐业	2,500,186.00	1.99
S	综合	-	-
	合计	96,508,290.32	76.96

7.2.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	12,287.28	0.01
B	采矿业	396,934.00	0.32
C	制造业	13,922,671.34	11.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,330.00	0.01
E	建筑业	764,984.37	0.61
F	批发和零售业	437,643.41	0.35
G	交通运输、仓储和邮政业	1,500,605.00	1.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,204,253.64	0.96
J	金融业	34,721.10	0.03
K	房地产业	105,535.00	0.08
L	租赁和商务服务业	245,817.00	0.20
M	科学研究和技术服务业	87,916.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	56,536.58	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	565,258.00	0.45
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,348,011.00	1.87
S	综合	-	-
	合计	21,695,503.72	17.30

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002920	德赛西威	14,100	1,552,128.00	1.24
2	603267	鸿远电子	11,000	1,407,120.00	1.12
3	688388	嘉元科技	14,994	1,363,854.24	1.09
4	688116	天奈科技	11,367	1,341,306.00	1.07
5	002850	科达利	15,200	1,328,480.00	1.06
6	600688	上海石化	347,900	1,308,104.00	1.04
7	300073	当升科技	22,900	1,286,751.00	1.03
8	300145	中金环境	405,400	1,232,416.00	0.98
9	300476	胜宏科技	56,300	1,230,155.00	0.98
10	002402	和而泰	51,300	1,229,661.00	0.98
11	300633	开立医疗	38,800	1,225,304.00	0.98
12	300685	艾德生物	11,600	1,207,328.00	0.96
13	603337	杰克股份	43,800	1,170,774.00	0.93
14	002913	奥士康	15,000	1,169,250.00	0.93
15	688202	美迪西	2,200	1,143,780.00	0.91
16	603103	横店影视	77,600	1,142,272.00	0.91
17	300724	捷佳伟创	9,500	1,102,095.00	0.88
18	600184	光电股份	98,662	1,072,455.94	0.86
19	601678	滨化股份	134,711	1,065,564.01	0.85
20	603026	石大胜华	6,200	1,004,710.00	0.80
21	300294	博雅生物	27,000	976,050.00	0.78
22	600512	腾达建设	315,500	959,120.00	0.76
23	601519	大智慧	110,100	956,769.00	0.76
24	300377	赢时胜	81,200	904,568.00	0.72
25	600308	华泰股份	161,100	889,272.00	0.71
26	600711	盛屯矿业	122,000	869,860.00	0.69
27	600110	诺德股份	70,000	852,600.00	0.68
28	300055	万邦达	91,700	841,806.00	0.67
29	002025	航天电器	16,700	837,839.00	0.67
30	600966	博汇纸业	63,200	824,760.00	0.66
31	002636	金安国纪	50,700	822,354.00	0.66
32	300366	创意信息	92,145	821,933.40	0.66
33	688016	心脉医疗	1,800	818,298.00	0.65

34	300747	锐科激光	7,000	798,420.00	0.64
35	300054	鼎龙股份	43,400	792,050.00	0.63
36	600882	妙可蓝多	11,300	788,740.00	0.63
37	300755	华致酒行	19,300	787,633.00	0.63
38	300319	麦捷科技	64,500	777,225.00	0.62
39	300458	全志科技	8,800	771,408.00	0.62
40	002254	泰和新材	37,800	766,206.00	0.61
41	002042	华孚时尚	158,400	765,072.00	0.61
42	002293	罗莱生活	57,130	764,970.70	0.61
43	600575	淮河能源	343,700	745,829.00	0.59
44	300477	合纵科技	108,100	744,809.00	0.59
45	300252	金信诺	90,780	725,332.20	0.58
46	600502	安徽建工	183,800	713,144.00	0.57
47	002568	百润股份	7,380	699,550.20	0.56
48	002430	杭氧股份	20,200	698,718.00	0.56
49	603997	继峰股份	84,300	692,946.00	0.55
50	300101	振芯科技	38,400	687,744.00	0.55
51	600618	氯碱化工	74,900	685,335.00	0.55
52	300679	电连技术	23,200	668,624.00	0.53
53	603728	鸣志电器	37,900	666,661.00	0.53
54	000818	航锦科技	22,900	663,871.00	0.53
55	688005	容百科技	5,400	654,480.00	0.52
56	603678	火炬电子	9,686	653,805.00	0.52
57	600338	西藏珠峰	45,800	648,986.00	0.52
58	002852	道道全	44,700	648,597.00	0.52
59	002022	科华生物	35,400	634,014.00	0.51
60	000683	远兴能源	131,000	611,770.00	0.49
61	603305	旭升股份	17,755	598,876.15	0.48
62	600123	兰花科创	76,900	595,206.00	0.47
63	300406	九强生物	29,700	585,981.00	0.47
64	603551	奥普家居	48,000	570,240.00	0.45
65	002550	千红制药	136,400	559,240.00	0.45
66	600612	老凤祥	10,500	556,185.00	0.44
67	002840	华统股份	60,460	544,744.60	0.43
68	600715	文投控股	178,000	539,340.00	0.43
69	603466	风语筑	32,880	537,588.00	0.43
70	300496	中科创达	3,400	534,004.00	0.43
71	300307	慈星股份	64,900	530,882.00	0.42
72	300783	三只松鼠	11,200	530,432.00	0.42

73	002597	金禾实业	15,200	527,440.00	0.42
74	300653	正海生物	6,600	516,780.00	0.41
75	600096	云天化	36,200	508,248.00	0.41
76	600480	凌云股份	54,540	499,586.40	0.40
77	300725	药石科技	3,100	492,621.00	0.39
78	603613	国联股份	4,871	486,953.87	0.39
79	603345	安井食品	1,900	482,638.00	0.38
80	000733	振华科技	7,900	482,453.00	0.38
81	300012	华测检测	14,800	471,824.00	0.38
82	002313	日海智能	39,800	466,058.00	0.37
83	002727	一心堂	14,000	463,540.00	0.37
84	603877	太平鸟	8,600	459,068.00	0.37
85	600602	云赛智联	76,500	453,645.00	0.36
86	600378	昊华科技	20,500	451,615.00	0.36
87	300363	博腾股份	5,300	445,836.00	0.36
88	000933	神火股份	46,800	442,260.00	0.35
89	601311	骆驼股份	37,800	437,346.00	0.35
90	000951	中国重汽	16,100	435,666.00	0.35
91	000516	国际医学	22,850	429,808.50	0.34
92	300726	宏达电子	5,900	415,891.00	0.33
93	300751	迈为股份	900	409,230.00	0.33
94	002541	鸿路钢构	7,000	408,450.00	0.33
95	002245	蔚蓝锂芯	20,400	401,880.00	0.32
96	603612	索通发展	21,300	382,761.00	0.31
97	603508	思维列控	19,400	380,434.00	0.30
98	603599	广信股份	12,200	366,976.00	0.29
99	000875	吉电股份	57,600	330,624.00	0.26
100	002407	多氟多	9,300	330,522.00	0.26
101	002497	雅化集团	14,500	330,310.00	0.26
102	688023	安恒信息	1,300	327,600.00	0.26
103	002614	奥佳华	14,400	325,872.00	0.26
104	603456	九洲药业	6,700	325,486.00	0.26
105	300775	三角防务	8,200	313,240.00	0.25
106	688158	优刻得	7,878	309,211.50	0.25
107	300130	新国都	26,000	297,440.00	0.24
108	300208	青岛中程	28,900	293,624.00	0.23
109	300910	瑞丰新材	2,800	292,740.00	0.23
110	300102	乾照光电	31,500	292,635.00	0.23
111	300894	火星号	4,300	292,400.00	0.23

112	600323	瀚蓝环境	13,400	291,986.00	0.23
113	300034	钢研高纳	9,000	289,890.00	0.23
114	601588	北辰实业	119,800	280,332.00	0.22
115	002206	海利得	45,100	280,071.00	0.22
116	688122	西部超导	4,200	272,454.00	0.22
117	600587	新华医疗	12,000	271,800.00	0.22
118	688368	晶丰明源	800	268,208.00	0.21
119	600596	新安股份	15,051	266,703.72	0.21
120	300638	广和通	5,500	256,850.00	0.20
121	002706	良信股份	11,200	252,448.00	0.20
122	000918	嘉凯城	56,200	245,594.00	0.20
123	600103	青山纸业	98,300	243,784.00	0.19
124	002274	华昌化工	24,200	243,694.00	0.19
125	300068	南都电源	22,800	241,680.00	0.19
126	300298	三诺生物	7,600	238,032.00	0.19
127	688177	百奥泰	8,982	235,687.68	0.19
128	300441	鲍斯股份	22,700	235,626.00	0.19
129	603129	春风动力	1,800	223,344.00	0.18
130	300083	创世纪	20,100	220,095.00	0.18
131	603180	金牌厨柜	4,560	217,466.40	0.17
132	300763	锦浪科技	1,190	214,914.00	0.17
133	600933	爱柯迪	16,300	212,552.00	0.17
134	002262	恩华药业	13,600	208,760.00	0.17
135	002240	盛新锂能	7,100	202,705.00	0.16
136	601898	中煤能源	27,900	199,485.00	0.16
137	300438	鹏辉能源	8,700	199,230.00	0.16
138	002960	青鸟消防	7,575	198,162.00	0.16
139	300233	金城医药	6,900	196,650.00	0.16
140	300748	金力永磁	6,200	196,106.00	0.16
141	600797	浙大网新	29,200	195,056.00	0.16
142	600756	浪潮软件	14,400	193,824.00	0.15
143	688007	光峰科技	4,600	192,648.00	0.15
144	300788	中信出版	5,200	191,204.00	0.15
145	688200	华峰测控	400	189,332.00	0.15
146	300568	星源材质	4,479	185,296.23	0.15
147	002036	联创电子	14,000	184,100.00	0.15
148	603956	威派格	10,000	183,000.00	0.15
149	002041	登海种业	12,100	182,831.00	0.15
150	000923	河钢资源	9,500	181,165.00	0.14

151	600499	科达制造	12,500	180,000.00	0.14
152	300740	水羊股份	8,600	179,568.00	0.14
153	603218	日月股份	6,400	173,312.00	0.14
154	300567	精测电子	2,800	171,920.00	0.14
155	600452	涪陵电力	11,900	171,003.00	0.14
156	002847	盐津铺子	1,700	169,524.00	0.14
157	603348	文灿股份	4,700	164,500.00	0.13
158	603236	移远通信	940	160,373.40	0.13
159	000550	江铃汽车	6,800	159,324.00	0.13
160	300761	立华股份	4,800	159,024.00	0.13
161	603429	集友股份	4,800	156,000.00	0.12
162	688366	昊海生科	741	155,091.30	0.12
163	600676	交运股份	36,200	148,782.00	0.12
164	002756	永兴材料	2,500	148,475.00	0.12
165	600876	洛阳玻璃	7,700	146,993.00	0.12
166	002777	久远银海	8,300	146,827.00	0.12
167	000851	高鸿股份	21,500	142,975.00	0.11
168	002234	民和股份	9,500	142,785.00	0.11
169	601058	赛轮轮胎	14,000	139,860.00	0.11
170	300766	每日互动	9,300	139,407.00	0.11
171	300861	美畅股份	1,600	134,896.00	0.11
172	000969	安泰科技	15,600	134,160.00	0.11
173	688037	芯源微	900	134,100.00	0.11
174	002283	天润工业	24,100	133,514.00	0.11
175	600458	时代新材	15,800	131,614.00	0.10
176	300872	天阳科技	3,600	130,680.00	0.10
177	300803	指南针	3,300	127,380.00	0.10
178	300078	思创医惠	17,100	126,540.00	0.10
179	601918	新集能源	25,300	123,717.00	0.10
180	000666	经纬纺机	15,000	119,550.00	0.10
181	002967	广电计量	2,700	118,260.00	0.09
182	002907	华森制药	8,800	118,184.00	0.09
183	603363	傲农生物	11,300	116,390.00	0.09
184	601369	陕鼓动力	14,200	115,446.00	0.09
185	688086	紫晶存储	4,323	109,198.98	0.09
186	300639	凯普生物	3,096	102,198.96	0.08
187	002651	利君股份	8,200	99,138.00	0.08
188	002139	拓邦股份	5,500	98,945.00	0.08
189	002409	雅克科技	1,200	97,200.00	0.08

190	300439	美康生物	5,000	96,500.00	0.08
191	002833	弘亚数控	2,480	96,100.00	0.08
192	603489	八方股份	400	94,552.00	0.08
193	688019	安集科技	300	93,300.00	0.07
194	603108	润达医疗	8,300	93,209.00	0.07
195	688389	普门科技	3,008	92,225.28	0.07
196	000498	山东路桥	16,400	91,840.00	0.07
197	601595	上海电影	7,700	89,782.00	0.07
198	603688	石英股份	3,800	89,300.00	0.07
199	300378	鼎捷软件	4,151	89,121.97	0.07
200	688188	柏楚电子	203	88,508.00	0.07
201	688298	东方生物	400	87,040.00	0.07
202	300379	东方通	3,000	85,470.00	0.07
203	300590	移为通信	4,400	84,216.00	0.07
204	002145	中核钛白	6,000	77,700.00	0.06
205	603690	至纯科技	1,900	76,779.00	0.06
206	300799	左江科技	1,400	76,720.00	0.06
207	002733	雄韬股份	4,600	76,176.00	0.06
208	603113	金能科技	4,200	75,852.00	0.06
209	688166	博瑞医药	1,700	71,077.00	0.06
210	600694	大商股份	3,400	70,584.00	0.06
211	300663	科蓝软件	1,800	69,138.00	0.06
212	300623	捷捷微电	1,800	68,094.00	0.05
213	300395	菲利华	1,400	67,508.00	0.05
214	300373	扬杰科技	1,100	66,594.00	0.05
215	000710	贝瑞基因	2,200	66,088.00	0.05
216	688139	海尔生物	619	65,056.90	0.05
217	000025	特力A	4,200	62,496.00	0.05
218	300485	赛升药业	4,885	62,332.60	0.05
219	300613	富瀚微	399	62,196.12	0.05
220	600389	江山股份	1,800	61,902.00	0.05
221	603566	普莱柯	2,600	59,280.00	0.05
222	603220	中贝通信	4,800	58,944.00	0.05
223	688006	杭可科技	693	58,905.00	0.05
224	002747	埃斯顿	1,500	58,575.00	0.05
225	000921	海信家电	4,000	57,480.00	0.05
226	300110	华仁药业	12,900	56,889.00	0.05
227	603128	华贸物流	4,010	56,500.90	0.05
228	300087	荃银高科	2,500	56,025.00	0.04

229	600984	建设机械	5,200	55,692.00	0.04
230	300841	康华生物	200	53,760.00	0.04
231	603959	百利科技	5,200	53,508.00	0.04
232	000848	承德露露	4,300	51,342.00	0.04
233	300118	东方日升	2,600	50,440.00	0.04
234	300520	科大国创	2,300	49,565.00	0.04
235	603520	司太立	800	49,320.00	0.04
236	601375	中原证券	9,900	48,213.00	0.04
237	601827	三峰环境	4,900	46,403.00	0.04
238	600552	凯盛科技	6,500	44,980.00	0.04
239	603416	信捷电气	700	44,429.00	0.04
240	603169	兰石重装	10,000	44,200.00	0.04
241	002135	东南网架	5,700	43,605.00	0.03
242	002123	梦网科技	2,400	43,344.00	0.03
243	300170	汉得信息	5,800	43,326.00	0.03
244	000676	智度股份	7,013	42,568.91	0.03
245	002646	青青稞酒	1,900	41,306.00	0.03
246	300798	锦鸡股份	4,400	39,424.00	0.03
247	002906	华阳集团	1,200	37,896.00	0.03
248	300456	赛微电子	1,200	36,180.00	0.03
249	300409	道氏技术	1,500	35,670.00	0.03
250	002151	北斗星通	800	34,456.00	0.03
251	603693	江苏新能	2,600	34,372.00	0.03
252	688399	硕世生物	200	33,720.00	0.03
253	688222	成都先导	1,100	32,450.00	0.03
254	688108	赛诺医疗	2,829	30,949.26	0.02
255	603229	奥翔药业	900	30,051.00	0.02
256	002055	得润电子	2,200	28,556.00	0.02
257	300448	浩云科技	3,400	27,880.00	0.02
258	600641	万业企业	1,500	27,360.00	0.02
259	300777	中简科技	600	27,108.00	0.02
260	603976	正川股份	700	26,614.00	0.02
261	603989	艾华集团	800	26,072.00	0.02
262	002425	凯撒文化	3,100	25,947.00	0.02
263	002106	莱宝高科	2,300	25,875.00	0.02
264	688066	航天宏图	600	24,714.00	0.02
265	603068	博通集成	300	24,690.00	0.02
266	300238	冠昊生物	1,200	24,348.00	0.02
267	603005	晶方科技	400	23,692.00	0.02

268	688266	泽璟制药	300	21,213.00	0.02
269	002611	东方精工	4,500	20,835.00	0.02
270	002108	沧州明珠	3,400	18,734.00	0.01
271	605111	新洁能	100	18,027.00	0.01
272	300346	南大光电	400	15,472.00	0.01
273	688268	华特气体	200	15,036.00	0.01
274	300390	天华超净	300	14,409.00	0.01
275	000913	钱江摩托	800	14,296.00	0.01
276	603008	喜临门	400	13,204.00	0.01
277	000810	创维数字	1,500	12,765.00	0.01
278	002043	兔宝宝	1,200	11,832.00	0.01
279	300224	正海磁材	1,000	10,870.00	0.01
280	601666	平煤股份	1,300	9,243.00	0.01
281	300287	飞利信	1,500	8,265.00	0.01
282	300119	瑞普生物	200	6,764.00	0.01
283	000019	深粮控股	900	6,552.00	0.01
284	603801	志邦家居	200	6,392.00	0.01
285	002979	雷赛智能	200	5,734.00	0.00
286	000795	英洛华	1,100	5,489.00	0.00
287	300682	朗新科技	200	3,364.00	0.00
288	603777	来伊份	200	3,318.00	0.00
289	300204	舒泰神	200	2,588.00	0.00
290	603588	高能环境	100	1,448.00	0.00
291	002631	德尔未来	100	626.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	603186	华正新材	29,800	1,086,508.00	0.87
2	600977	中国电影	78,000	977,340.00	0.78
3	002739	万达电影	54,500	860,555.00	0.69
4	300769	德方纳米	3,700	764,753.00	0.61
5	300506	名家汇	127,300	739,613.00	0.59
6	600884	杉杉股份	31,600	736,912.00	0.59
7	601882	海天精工	46,200	718,410.00	0.57
8	300465	高伟达	54,900	666,486.00	0.53
9	002011	盾安环境	111,500	654,505.00	0.52

10	300434	金石亚药	63,200	578,912.00	0.46
11	600035	楚天高速	191,300	573,900.00	0.46
12	600661	昂立教育	46,600	565,258.00	0.45
13	603773	沃格光电	21,400	564,318.00	0.45
14	002231	奥维通信	99,900	535,464.00	0.43
15	600548	深高速	53,400	465,648.00	0.37
16	601598	中国外运	85,100	429,755.00	0.34
17	002905	金逸影视	52,000	427,960.00	0.34
18	600497	驰宏锌锗	91,000	392,210.00	0.31
19	300691	联合光电	23,600	373,588.00	0.30
20	600778	友好集团	86,901	348,473.01	0.28
21	688288	鸿泉物联	7,102	337,984.18	0.27
22	603738	泰晶科技	9,538	329,251.76	0.26
23	601689	拓普集团	7,500	280,725.00	0.22
24	603228	景旺电子	10,300	269,860.00	0.22
25	002183	怡亚通	42,900	245,817.00	0.20
26	000680	山推股份	61,600	240,856.00	0.19
27	002078	太阳纸业	17,200	229,620.00	0.18
28	688099	晶晨股份	2,000	224,400.00	0.18
29	603225	新凤鸣	11,000	223,300.00	0.18
30	600111	北方稀土	10,600	219,420.00	0.17
31	688180	君实生物	2,700	219,267.00	0.17
32	000012	南玻A	21,300	218,112.00	0.17
33	600678	四川金顶	39,500	216,065.00	0.17
34	300223	北京君正	2,100	211,932.00	0.17
35	603077	和邦生物	99,400	206,752.00	0.16
36	000799	酒鬼酒	800	204,480.00	0.16
37	300721	怡达股份	5,500	202,345.00	0.16
38	002141	贤丰控股	42,300	174,699.00	0.14
39	603933	睿能科技	10,400	166,608.00	0.13
40	600201	生物股份	9,300	162,285.00	0.13
41	300617	安靠智电	3,100	151,249.00	0.12
42	000100	TCL 科技	19,300	147,645.00	0.12
43	688561	奇安信	1,519	140,218.89	0.11
44	000717	韶钢松山	30,400	139,536.00	0.11
45	300181	佐力药业	15,900	128,313.00	0.10
46	603818	曲美家居	14,400	127,872.00	0.10
47	601600	中国铝业	24,100	127,730.00	0.10
48	300705	九典制药	3,000	114,150.00	0.09

49	688233	神工股份	2,100	113,400.00	0.09
50	002008	大族激光	2,800	113,092.00	0.09
51	000738	航发控制	5,400	112,482.00	0.09
52	600664	哈药股份	37,500	108,375.00	0.09
53	603703	盛洋科技	8,500	107,950.00	0.09
54	000045	深纺织 A	11,400	102,258.00	0.08
55	688300	联瑞新材	1,600	99,200.00	0.08
56	002196	方正电机	11,100	94,905.00	0.08
57	688533	上声电子	3,493	91,865.90	0.07
58	600613	神奇制药	17,100	91,656.00	0.07
59	600809	山西汾酒	200	89,600.00	0.07
60	603638	艾迪精密	2,020	86,597.40	0.07
61	688026	洁特生物	1,000	86,100.00	0.07
62	600645	中源协和	3,600	82,620.00	0.07
63	300251	光线传媒	7,600	82,156.00	0.07
64	002881	美格智能	2,900	80,040.00	0.06
65	000573	粤宏远 A	23,800	73,780.00	0.06
66	603297	永新光学	1,100	72,380.00	0.06
67	002288	超华科技	9,900	71,874.00	0.06
68	300463	迈克生物	1,700	71,553.00	0.06
69	002876	三利谱	1,100	71,170.00	0.06
70	600180	瑞茂通	12,000	70,800.00	0.06
71	600172	黄河旋风	10,200	68,850.00	0.05
72	000949	新乡化纤	8,000	67,760.00	0.05
73	688258	卓易信息	1,297	67,210.54	0.05
74	000768	中航西飞	2,500	65,700.00	0.05
75	688611	杭州柯林	1,372	58,090.48	0.05
76	300358	楚天科技	3,000	56,130.00	0.04
77	000510	新金路	11,700	55,575.00	0.04
78	002946	新乳业	3,100	46,965.00	0.04
79	601339	百隆东方	7,800	42,042.00	0.03
80	600862	中航高科	1,300	40,014.00	0.03
81	601633	长城汽车	900	39,231.00	0.03
82	688068	热景生物	200	37,800.00	0.03
83	300636	同和药业	2,300	36,616.00	0.03
84	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.03
85	300957	贝泰妮	132	33,258.72	0.03
86	300168	万达信息	2,200	32,120.00	0.03
87	600684	珠江股份	8,700	31,755.00	0.03

88	301020	密封科技	2,947	31,356.08	0.03
89	000905	厦门港务	4,700	31,302.00	0.02
90	002153	石基信息	1,300	30,563.00	0.02
91	600475	华光环能	2,900	29,580.00	0.02
92	600282	南钢股份	8,200	29,192.00	0.02
93	300196	长海股份	1,600	27,456.00	0.02
94	300677	英科医疗	200	24,960.00	0.02
95	600176	中国巨石	1,586	24,598.86	0.02
96	000822	山东海化	2,900	22,620.00	0.02
97	301021	英诺激光	2,283	21,597.18	0.02
98	300979	华利集团	218	19,075.00	0.02
99	300973	立高食品	162	18,745.02	0.01
100	300953	震裕科技	182	18,172.70	0.01
101	603658	安图生物	200	15,154.00	0.01
102	603567	珍宝岛	900	14,661.00	0.01
103	603256	宏和科技	1,600	14,624.00	0.01
104	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
105	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
106	301013	利和兴	471	12,768.81	0.01
107	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
108	301015	百洋医药	308	11,959.64	0.01
109	300981	中红医疗	129	11,660.31	0.01
110	000898	鞍钢股份	2,600	11,570.00	0.01
111	300242	佳云科技	2,300	11,569.00	0.01
112	600536	中国软件	200	11,386.00	0.01
113	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
114	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.01
115	300614	百川畅银	250	10,095.00	0.01
116	300421	力星股份	600	9,894.00	0.01
117	300968	格林精密	784	9,462.88	0.01
118	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.01
119	603168	莎普爱思	1,000	9,350.00	0.01
120	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.01
121	300966	共同药业	286	9,020.44	0.01
122	002603	以岭药业	300	8,748.00	0.01
123	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.01
124	301002	崧盛股份	150	8,643.00	0.01
125	300950	德固特	219	8,569.47	0.01
126	300958	建工修复	300	8,166.00	0.01

127	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.01
128	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.01
129	603318	水发燃气	1,200	7,668.00	0.01
130	300997	欢乐家	552	7,203.60	0.01
131	002728	特一药业	500	7,035.00	0.01
132	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.01
133	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.01
134	300991	创益通	254	6,733.54	0.01
135	301016	雷尔伟	201	6,628.98	0.01
136	000488	晨鸣纸业	800	6,512.00	0.01
137	300975	商络电子	492	6,410.76	0.01
138	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.01
139	300986	志特新材	195	5,961.15	0.00
140	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
141	301011	华立科技	162	5,482.08	0.00
142	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
143	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
144	300825	阿尔特	200	5,296.00	0.00
145	601699	潞安环能	400	4,724.00	0.00
146	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
147	300985	致远新能	180	4,465.80	0.00
148	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
149	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
150	300577	开润股份	200	4,286.00	0.00
151	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
152	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
153	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
154	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
155	601636	旗滨集团	154	2,858.24	0.00
156	600782	新钢股份	400	2,232.00	0.00
157	300733	西菱动力	100	2,192.00	0.00
158	002645	华宏科技	100	1,598.00	0.00
159	002458	益生股份	100	997.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300677	英科医疗	6,936,754.00	38.14
2	300037	新宙邦	5,516,935.00	30.34
3	300724	捷佳伟创	5,374,064.00	29.55
4	603456	九洲药业	5,191,407.00	28.55
5	603267	鸿远电子	5,053,330.24	27.79
6	300661	圣邦股份	5,020,526.00	27.61
7	002025	航天电器	4,572,200.00	25.14
8	603345	安井食品	4,108,760.30	22.59
9	002568	百润股份	4,095,506.40	22.52
10	300502	新易盛	3,913,446.00	21.52
11	600458	时代新材	3,815,737.00	20.98
12	603337	杰克股份	3,764,494.00	20.70
13	000799	酒鬼酒	3,735,355.00	20.54
14	000951	中国重汽	3,610,119.00	19.85
15	300073	当升科技	3,545,591.62	19.50
16	002706	良信股份	3,468,699.00	19.07
17	603678	火炬电子	3,426,978.02	18.84
18	000516	国际医学	3,384,023.50	18.61
19	600569	安阳钢铁	3,292,871.00	18.11
20	002482	广田集团	2,994,097.00	16.46
21	300751	迈为股份	2,944,805.00	16.19
22	002421	达实智能	2,910,853.00	16.01
23	002402	和而泰	2,895,949.00	15.92
24	002727	一心堂	2,874,093.56	15.80
25	000733	振华科技	2,800,144.00	15.40
26	002312	川发龙鳞	2,773,188.00	15.25
27	300679	电连技术	2,749,436.35	15.12
28	600708	光明地产	2,746,408.00	15.10
29	603129	春风动力	2,745,063.00	15.09
30	300188	美亚柏科	2,650,671.62	14.58
31	300567	精测电子	2,621,127.00	14.41
32	002332	仙琚制药	2,560,572.00	14.08
33	603466	风语筑	2,473,431.65	13.60
34	603043	广州酒家	2,439,814.95	13.42

35	002022	科华生物	2,386,163.00	13.12
36	603313	梦百合	2,354,171.00	12.95
37	601678	滨化股份	2,345,551.61	12.90
38	002497	雅化集团	2,328,937.00	12.81
39	002850	科达利	2,328,833.00	12.81
40	300395	菲利华	2,266,348.00	12.46
41	002705	新宝股份	2,256,218.31	12.41
42	600742	一汽富维	2,247,563.46	12.36
43	300763	锦浪科技	2,201,518.00	12.11
44	603626	科森科技	2,199,919.00	12.10
45	000950	重药控股	2,177,384.00	11.97
46	002335	科华数据	2,170,171.00	11.93
47	600096	云天化	2,161,949.00	11.89
48	002541	鸿路钢构	2,158,973.00	11.87
49	603348	文灿股份	2,113,405.00	11.62
50	002726	龙大肉食	2,094,729.00	11.52
51	300054	鼎龙股份	2,092,098.00	11.50
52	000923	河钢资源	2,058,093.00	11.32
53	603660	苏州科达	2,055,321.00	11.30
54	601126	四方股份	2,054,397.74	11.30
55	601231	环旭电子	2,043,162.00	11.24
56	000550	江铃汽车	2,035,318.00	11.19
57	002614	奥佳华	2,028,708.00	11.16
58	002139	拓邦股份	2,028,159.00	11.15
59	002462	嘉事堂	2,026,550.07	11.14
60	601636	旗滨集团	2,024,598.18	11.13
61	300476	胜宏科技	2,005,539.00	11.03
62	300747	锐科激光	1,994,191.00	10.97
63	300373	扬杰科技	1,992,721.00	10.96
64	300377	赢时胜	1,962,313.00	10.79
65	300639	凯普生物	1,953,377.00	10.74
66	002946	新乳业	1,948,088.00	10.71
67	600184	光电股份	1,937,084.72	10.65
68	300699	光威复材	1,911,849.88	10.51
69	601900	南方传媒	1,892,476.69	10.41
70	300723	一品红	1,890,621.40	10.40

71	002216	三全食品	1,890,527.00	10.40
72	600490	鹏欣资源	1,840,967.00	10.12
73	002043	兔宝宝	1,811,954.00	9.96
74	300101	振芯科技	1,792,785.00	9.86
75	002245	蔚蓝锂芯	1,774,946.00	9.76
76	300378	鼎捷软件	1,768,332.18	9.72
77	600692	亚通股份	1,755,256.00	9.65
78	603613	国联股份	1,749,779.00	9.62
79	002911	佛燃能源	1,724,423.17	9.48
80	600622	光大嘉宝	1,717,043.00	9.44
81	300485	赛升药业	1,698,184.15	9.34
82	600612	老凤祥	1,695,955.80	9.33
83	002777	久远银海	1,682,260.00	9.25
84	002276	万马股份	1,666,606.00	9.16
85	600512	腾达建设	1,665,602.00	9.16
86	002537	海联金汇	1,643,714.00	9.04
87	600966	博汇纸业	1,629,621.00	8.96
88	603801	志邦家居	1,613,110.36	8.87
89	603298	杭叉集团	1,612,721.00	8.87
90	300737	科顺股份	1,567,106.00	8.62
91	300366	创意信息	1,564,305.40	8.60
92	300394	天孚通信	1,554,150.00	8.55
93	603026	石大胜华	1,523,041.00	8.38
94	002920	德赛西威	1,521,671.32	8.37
95	600063	皖维高新	1,506,519.00	8.28
96	002840	华统股份	1,504,369.80	8.27
97	300319	麦捷科技	1,489,658.00	8.19
98	300170	汉得信息	1,486,198.00	8.17
99	002636	金安国纪	1,474,783.00	8.11
100	002430	杭氧股份	1,474,097.00	8.11
101	300145	中金环境	1,473,868.00	8.10
102	300685	艾德生物	1,427,057.00	7.85
103	600162	香江控股	1,415,612.00	7.78
104	603359	东珠生态	1,410,567.00	7.76
105	300091	金通灵	1,401,249.26	7.71
106	300097	智云股份	1,393,415.00	7.66

107	002314	南山控股	1,387,537.00	7.63
108	300102	乾照光电	1,385,974.00	7.62
109	603603	博天环境	1,385,941.00	7.62
110	300002	神州泰岳	1,382,319.00	7.60
111	300458	全志科技	1,377,733.00	7.58
112	600581	八一钢铁	1,376,898.00	7.57
113	603598	引力传媒	1,373,123.00	7.55
114	600548	深高速	1,373,099.00	7.55
115	000863	三湘印象	1,359,678.00	7.48
116	688388	嘉元科技	1,357,802.28	7.47
117	603186	华正新材	1,346,454.64	7.40
118	603103	横店影视	1,343,723.00	7.39
119	002378	章源钨业	1,342,388.00	7.38
120	600688	上海石化	1,336,226.00	7.35
121	002037	保利联合	1,332,675.00	7.33
122	300525	博思软件	1,326,116.00	7.29
123	603602	纵横通信	1,317,732.42	7.25
124	600480	凌云股份	1,316,617.96	7.24
125	603897	长城科技	1,310,208.46	7.20
126	000034	神州数码	1,306,615.00	7.19
127	002254	泰和新材	1,296,033.00	7.13
128	600977	中国电影	1,287,436.00	7.08
129	603686	龙马环卫	1,274,494.00	7.01
130	300311	任子行	1,263,035.00	6.95
131	002585	双星新材	1,262,763.00	6.94
132	300633	开立医疗	1,261,828.00	6.94
133	600012	皖通高速	1,246,913.00	6.86
134	600884	杉杉股份	1,231,139.00	6.77
135	601789	宁波建工	1,220,369.00	6.71
136	601882	海天精工	1,204,486.00	6.62
137	300208	青岛中程	1,200,242.00	6.60
138	688116	天奈科技	1,197,661.17	6.59
139	603208	江山欧派	1,195,441.00	6.57
140	002206	海利得	1,191,759.00	6.55
141	603612	索通发展	1,190,083.00	6.54
142	300653	正海生物	1,185,916.00	6.52

143	600761	安徽合力	1,183,016.00	6.51
144	300322	硕贝德	1,180,961.00	6.49
145	300288	朗玛信息	1,173,738.00	6.45
146	600308	华泰股份	1,173,085.00	6.45
147	688202	美迪西	1,169,206.21	6.43
148	603956	威派格	1,167,788.00	6.42
149	002913	奥士康	1,165,869.00	6.41
150	600711	盛屯矿业	1,165,031.00	6.41
151	300379	东方通	1,163,404.00	6.40
152	002550	千红制药	1,156,289.00	6.36
153	002293	罗莱生活	1,148,690.10	6.32
154	600507	方大特钢	1,142,397.00	6.28
155	300748	金力永磁	1,126,394.00	6.19
156	002285	世联行	1,123,073.00	6.18
157	600850	电科数字	1,114,431.00	6.13
158	600499	科达制造	1,110,602.00	6.11
159	002097	山河智能	1,099,450.00	6.05
160	300007	汉威科技	1,094,648.00	6.02
161	000910	大亚圣象	1,070,120.00	5.88
162	300506	名家汇	1,061,076.30	5.83
163	002026	山东威达	1,059,019.28	5.82
164	300674	宇信科技	1,030,952.00	5.67
165	300477	合纵科技	1,020,457.00	5.61
166	300627	华测导航	1,017,818.00	5.60
167	300732	设研院	1,016,333.80	5.59
168	300579	数字认证	992,943.00	5.46
169	002382	蓝帆医疗	991,146.00	5.45
170	002713	东易日盛	985,327.20	5.42
171	002832	比音勒芬	984,932.00	5.42
172	603606	东方电缆	983,417.00	5.41
173	600169	太原重工	980,950.00	5.39
174	300294	博雅生物	979,658.00	5.39
175	300119	瑞普生物	973,535.81	5.35
176	600596	新安股份	972,574.03	5.35
177	300353	东土科技	968,896.00	5.33
178	603997	继峰股份	968,735.00	5.33

179	300083	创世纪	963,352.00	5.30
180	002739	万达电影	948,255.00	5.21
181	002870	香山股份	939,692.00	5.17
182	603236	移远通信	939,274.00	5.17
183	601519	大智慧	936,275.00	5.15
184	603180	金牌厨柜	922,988.90	5.08
185	300726	宏达电子	920,284.00	5.06
186	300385	雪浪环境	913,876.00	5.03
187	000049	德赛电池	912,263.00	5.02
188	600775	南京熊猫	905,931.00	4.98
189	603421	鼎信通讯	905,566.97	4.98
190	603018	华设集团	904,233.00	4.97
191	603728	鸣志电器	899,936.00	4.95
192	000900	现代投资	891,345.00	4.90
193	600710	苏美达	889,412.00	4.89
194	300725	药石科技	884,581.00	4.86
195	601886	江河集团	877,483.00	4.83
196	600230	沧州大化	872,835.00	4.80
197	002905	金逸影视	867,571.00	4.77
198	300409	道氏技术	863,320.00	4.75
199	300755	华致酒行	859,899.00	4.73
200	300650	太龙照明	854,682.00	4.70
201	002539	云图控股	854,563.00	4.70
202	002042	华孚时尚	849,175.00	4.67
203	002061	浙江交科	849,035.00	4.67
204	300428	立中集团	842,310.50	4.63
205	600882	妙可蓝多	839,492.00	4.62
206	300222	科大智能	838,836.00	4.61
207	300439	美康生物	835,971.00	4.60
208	000498	山东路桥	833,369.00	4.58
209	603081	大丰实业	832,082.00	4.58
210	300055	万邦达	831,621.00	4.57
211	002847	盐津铺子	829,862.00	4.56
212	300670	大烨智能	829,167.00	4.56
213	300181	佐力药业	824,090.00	4.53
214	601163	三角轮胎	823,036.58	4.53

215	300623	捷捷微电	818,900.00	4.50
216	600531	豫光金铅	814,048.00	4.48
217	603301	振德医疗	813,664.00	4.47
218	603733	仙鹤股份	803,724.00	4.42
219	002055	得润电子	803,435.00	4.42
220	600057	厦门象屿	802,656.00	4.41
221	600075	新疆天业	801,907.00	4.41
222	300687	赛意信息	801,649.00	4.41
223	002930	宏川智慧	800,759.98	4.40
224	600110	诺德股份	797,538.00	4.39
225	000921	海信家电	796,973.00	4.38
226	603730	岱美股份	795,136.00	4.37
227	000666	经纬纺机	794,599.00	4.37
228	000783	长江证券	785,603.00	4.32
229	688005	容百科技	784,930.08	4.32
230	300252	金信诺	779,860.80	4.29
231	600575	淮河能源	774,102.00	4.26
232	601311	骆驼股份	765,970.00	4.21
233	300388	节能国祯	765,878.00	4.21
234	002522	浙江众成	764,823.00	4.21
235	002368	太极股份	760,982.00	4.18
236	000902	新洋丰	760,540.00	4.18
237	000059	华锦股份	758,476.00	4.17
238	300465	高伟达	754,203.00	4.15
239	600129	太极集团	749,808.00	4.12
240	688016	心脉医疗	745,960.74	4.10
241	002416	爱施德	745,886.00	4.10
242	603218	日月股份	735,910.00	4.05
243	002284	亚太股份	728,533.00	4.01
244	000723	美锦能源	727,302.00	4.00
245	600502	安徽建工	725,248.00	3.99
246	002852	道道全	703,191.00	3.87
247	002641	永高股份	702,400.00	3.86
248	600618	氯碱化工	701,290.00	3.86
249	600133	东湖高新	698,818.00	3.84
250	300562	乐心医疗	697,814.00	3.84

251	601375	中原证券	689,336.00	3.79
252	600035	楚天高速	686,847.00	3.78
253	002231	奥维通信	678,112.00	3.73
254	601908	京运通	677,860.00	3.73
255	002277	友阿股份	676,864.00	3.72
256	603738	泰晶科技	673,816.08	3.71
257	600105	永鼎股份	672,891.00	3.70
258	000818	航锦科技	671,887.00	3.69
259	000801	四川九洲	670,853.00	3.69
260	300434	金石亚药	670,608.00	3.69
261	600602	云赛智联	667,963.00	3.67
262	300307	慈星股份	666,780.00	3.67
263	600180	瑞茂通	665,490.00	3.66
264	600988	赤峰黄金	660,094.00	3.63
265	000683	远兴能源	655,520.00	3.60
266	300131	英唐智控	652,468.00	3.59
267	600338	西藏珠峰	651,924.00	3.58
268	601598	中国外运	651,612.00	3.58
269	300673	佩蒂股份	651,602.00	3.58
270	002036	联创电子	651,448.00	3.58
271	601015	陕西黑猫	650,571.00	3.58
272	603600	永艺股份	645,649.00	3.55
273	300177	中海达	644,913.00	3.55
274	600715	文投控股	641,114.00	3.53
275	002407	多氟多	640,655.00	3.52
276	002108	沧州明珠	634,619.40	3.49
277	300769	德方纳米	632,528.00	3.48
278	603877	太平鸟	629,093.00	3.46
279	600103	青山纸业	626,950.00	3.45
280	000615	奥园美谷	625,451.00	3.44
281	002940	昂利康	623,927.00	3.43
282	002056	横店东磁	622,725.00	3.42
283	600123	兰花科创	620,068.00	3.41
284	300339	润和软件	619,340.00	3.41
285	002544	杰赛科技	615,693.00	3.39
286	603305	旭升股份	613,210.90	3.37

287	300783	三只松鼠	611,511.00	3.36
288	300406	九强生物	605,263.00	3.33
289	601881	中国银河	602,569.00	3.31
290	300441	鲍斯股份	601,325.00	3.31
291	600661	昂立教育	599,243.00	3.30
292	603477	巨星农牧	598,516.00	3.29
293	000560	我爱我家	596,038.00	3.28
294	300548	博创科技	591,125.00	3.25
295	600067	冠城大通	590,958.00	3.25
296	002737	葵花药业	574,510.00	3.16
297	603773	沃格光电	570,519.00	3.14
298	300365	恒华科技	570,134.00	3.14
299	600185	格力地产	569,857.00	3.13
300	002528	英飞拓	569,433.00	3.13
301	002011	盾安环境	568,912.00	3.13
302	603551	奥普家居	564,747.00	3.11
303	300757	罗博特科	559,354.80	3.08
304	002318	久立特材	558,042.00	3.07
305	603013	亚普股份	554,994.00	3.05
306	002615	哈尔斯	549,399.50	3.02
307	000692	惠天热电	546,828.00	3.01
308	002649	博彦科技	544,004.00	2.99
309	000933	神火股份	543,341.00	2.99
310	300415	伊之密	535,999.00	2.95
311	688561	奇安信	534,770.69	2.94
312	000989	九芝堂	529,736.37	2.91
313	603238	诺邦股份	528,951.00	2.91
314	600223	鲁商发展	528,713.00	2.91
315	600323	瀚蓝环境	523,911.00	2.88
316	603128	华贸物流	521,180.00	2.87
317	300499	高澜股份	520,900.00	2.86
318	002274	华昌化工	519,033.00	2.85
319	002597	金禾实业	513,240.00	2.82
320	300788	中信出版	512,825.00	2.82
321	002313	日海智能	511,701.00	2.81
322	002960	青鸟消防	510,784.00	2.81

323	600478	科力远	508,926.00	2.80
324	603787	新日股份	508,737.67	2.80
325	300721	怡达股份	507,028.00	2.79
326	002603	以岭药业	504,101.00	2.77
327	300117	嘉寓股份	503,243.00	2.77
328	300168	万达信息	502,811.00	2.76
329	300020	银江股份	502,449.00	2.76
330	300531	优博讯	496,112.00	2.73
331	600197	伊力特	493,958.00	2.72
332	300012	华测检测	493,827.00	2.72
333	300496	中科创达	493,654.00	2.71
334	600497	驰宏锌锗	489,736.00	2.69
335	002441	众业达	482,248.00	2.65
336	000606	ST 顺利	480,711.00	2.64
337	000887	中鼎股份	480,652.00	2.64
338	000544	中原环保	480,086.00	2.64
339	002903	宇环数控	477,262.00	2.62
340	603283	赛腾股份	472,142.00	2.60
341	300363	博腾股份	470,269.00	2.59
342	002637	赞宇科技	469,680.00	2.58
343	002034	旺能环境	466,239.00	2.56
344	603912	佳力图	465,985.00	2.56
345	600741	华域汽车	465,041.00	2.56
346	002258	利尔化学	464,326.00	2.55
347	002367	康力电梯	460,271.00	2.53
348	300217	东方电热	459,459.00	2.53
349	600378	昊华科技	458,821.00	2.52
350	002743	富煌钢构	456,363.00	2.51
351	300456	赛微电子	440,239.00	2.42
352	300318	博晖创新	440,186.00	2.42
353	603329	上海雅仕	437,449.00	2.41
354	600756	浪潮软件	431,747.00	2.37
355	603533	掌阅科技	430,453.00	2.37
356	002287	奇正藏药	427,277.00	2.35
357	600420	国药现代	426,232.00	2.34
358	000898	鞍钢股份	423,439.00	2.33

359	300078	思创医惠	422,574.00	2.32
360	300803	指南针	418,682.00	2.30
361	002068	黑猫股份	417,424.00	2.30
362	300219	鸿利智汇	413,515.00	2.27
363	300266	兴源环境	411,453.00	2.26
364	002881	美格智能	407,784.00	2.24
365	000019	深粮控股	407,302.00	2.24
366	300348	长亮科技	407,230.00	2.24
367	603113	金能科技	405,056.00	2.23
368	603508	思维列控	402,536.40	2.21
369	000026	飞亚达	401,558.00	2.21
370	002609	捷顺科技	399,567.00	2.20
371	688122	西部超导	396,586.58	2.18
372	300727	润禾材料	396,363.00	2.18
373	300110	华仁药业	393,853.00	2.17
374	300655	晶瑞股份	391,143.00	2.15
375	603258	电魂网络	390,445.00	2.15
376	300207	欣旺达	386,972.00	2.13
377	002906	华阳集团	385,967.00	2.12
378	300691	联合光电	384,828.00	2.12
379	601689	拓普集团	381,224.00	2.10
380	000920	南方汇通	377,344.00	2.07
381	300280	紫天科技	377,021.00	2.07
382	603713	密尔克卫	372,317.00	2.05
383	300495	*ST 美尚	369,278.00	2.03
384	002396	星网锐捷	369,012.00	2.03
385	603599	广信股份	365,582.00	2.01
386	688023	安恒信息	365,066.50	2.01
387	000030	富奥股份	364,875.00	2.01
388	601222	林洋能源	364,658.00	2.01
389	600831	广电网络	364,386.00	2.00
390	600797	浙大网新	363,882.00	2.00

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300037	新宙邦	5,407,539.00	29.74
2	603456	九洲药业	5,370,082.00	29.53
3	300677	英科医疗	5,206,136.12	28.63
4	603345	安井食品	5,068,878.00	27.87
5	300661	圣邦股份	4,872,882.51	26.80
6	600569	安阳钢铁	4,344,982.64	23.89
7	002568	百润股份	3,906,957.00	21.48
8	600458	时代新材	3,793,448.00	20.86
9	300724	捷佳伟创	3,771,529.00	20.74
10	300502	新易盛	3,580,306.00	19.69
11	002025	航天电器	3,557,073.00	19.56
12	000516	国际医学	3,479,602.00	19.13
13	603267	鸿远电子	3,377,488.33	18.57
14	002312	川发龙蟒	3,339,952.00	18.37
15	000951	中国重汽	3,263,604.00	17.95
16	000799	酒鬼酒	3,250,219.00	17.87
17	002421	达实智能	3,235,043.00	17.79
18	002706	良信股份	3,145,403.00	17.30
19	002482	广田集团	3,129,246.00	17.21
20	002332	仙琚制药	3,028,935.00	16.66
21	600708	光明地产	2,962,742.60	16.29
22	603337	杰克股份	2,937,959.00	16.16
23	002727	一心堂	2,839,471.66	15.61
24	300679	电连技术	2,725,346.26	14.99
25	002139	拓邦股份	2,598,192.00	14.29
26	601126	四方股份	2,568,322.20	14.12
27	600742	一汽富维	2,549,106.22	14.02
28	300188	美亚柏科	2,548,165.02	14.01
29	603678	火炬电子	2,457,503.44	13.51
30	601636	旗滨集团	2,429,403.00	13.36
31	000733	振华科技	2,415,089.00	13.28
32	300567	精测电子	2,402,937.53	13.21
33	002378	章源钨业	2,400,135.00	13.20

34	300373	扬杰科技	2,399,031.20	13.19
35	000950	重药控股	2,388,595.00	13.13
36	603129	春风动力	2,371,668.00	13.04
37	002705	新宝股份	2,340,599.00	12.87
38	603043	广州酒家	2,330,716.85	12.82
39	603466	风语筑	2,275,298.75	12.51
40	603348	文灿股份	2,257,215.00	12.41
41	300073	当升科技	2,208,650.00	12.15
42	300751	迈为股份	2,189,850.00	12.04
43	300395	菲利华	2,176,178.00	11.97
44	002462	嘉事堂	2,144,395.36	11.79
45	300639	凯普生物	2,144,254.00	11.79
46	002216	三全食品	2,133,582.00	11.73
47	603801	志邦家居	2,129,360.40	11.71
48	002614	奥佳华	2,113,654.00	11.62
49	002726	龙大肉食	2,063,861.00	11.35
50	300737	科顺股份	2,062,664.00	11.34
51	300723	一品红	2,039,544.71	11.22
52	002335	科华数据	2,038,776.59	11.21
53	603626	科森科技	2,024,663.00	11.13
54	002946	新乳业	2,016,860.00	11.09
55	300699	光威复材	2,011,478.00	11.06
56	002245	蔚蓝锂芯	1,988,114.00	10.93
57	600096	云天化	1,985,230.00	10.92
58	002022	科华生物	1,980,072.00	10.89
59	002043	兔宝宝	1,954,639.39	10.75
60	601900	南方传媒	1,948,550.80	10.71
61	601678	滨化股份	1,937,068.59	10.65
62	002497	雅化集团	1,935,011.00	10.64
63	000923	河钢资源	1,910,584.00	10.51
64	002911	佛燃能源	1,900,829.65	10.45
65	000550	江铃汽车	1,900,090.00	10.45
66	603660	苏州科达	1,895,779.00	10.42
67	603313	梦百合	1,880,799.00	10.34
68	600622	光大嘉宝	1,853,569.00	10.19
69	601231	环旭电子	1,851,416.33	10.18
70	600490	鹏欣资源	1,801,069.00	9.90
71	002585	双星新材	1,770,493.00	9.74

72	002537	海联金汇	1,753,136.28	9.64
73	300763	锦浪科技	1,725,044.00	9.49
74	002402	和而泰	1,708,403.00	9.39
75	300485	赛升药业	1,678,912.00	9.23
76	002541	鸿路钢构	1,677,940.00	9.23
77	603298	杭叉集团	1,641,376.00	9.03
78	002276	万马股份	1,633,728.00	8.98
79	600581	八一钢铁	1,620,246.00	8.91
80	603603	博天环境	1,602,636.00	8.81
81	603359	东珠生态	1,571,971.00	8.64
82	300394	天孚通信	1,569,227.80	8.63
83	002777	久远银海	1,566,043.00	8.61
84	603026	石大胜华	1,551,919.00	8.53
85	600692	亚通股份	1,548,481.00	8.52
86	600012	皖通高速	1,523,182.00	8.38
87	002314	南山控股	1,514,992.00	8.33
88	300102	乾照光电	1,490,154.00	8.19
89	002037	保利联合	1,488,055.00	8.18
90	300378	鼎捷软件	1,475,754.00	8.12
91	603686	龙马环卫	1,440,024.80	7.92
92	300002	神州泰岳	1,432,598.00	7.88
93	600162	香江控股	1,428,427.00	7.85
94	300458	全志科技	1,420,892.00	7.81
95	603598	引力传媒	1,417,253.00	7.79
96	600063	皖维高新	1,413,928.00	7.78
97	300091	金通灵	1,401,051.00	7.70
98	603897	长城科技	1,397,997.87	7.69
99	600612	老凤祥	1,390,947.18	7.65
100	300170	汉得信息	1,382,112.00	7.60
101	300097	智云股份	1,378,934.00	7.58
102	300054	鼎龙股份	1,365,250.00	7.51
103	002285	世联行	1,356,263.00	7.46
104	000863	三湘印象	1,352,509.00	7.44
105	600507	方大特钢	1,350,333.00	7.43
106	000910	大亚圣象	1,318,920.00	7.25
107	300119	瑞普生物	1,318,768.24	7.25
108	300311	任子行	1,301,569.00	7.16
109	002026	山东威达	1,299,633.14	7.15

110	600499	科达制造	1,288,635.00	7.09
111	000034	神州数码	1,283,701.00	7.06
112	300525	博思软件	1,274,281.00	7.01
113	601789	宁波建工	1,271,819.00	6.99
114	300627	华测导航	1,267,607.00	6.97
115	603602	纵横通信	1,245,650.48	6.85
116	002832	比音勒芬	1,241,957.00	6.83
117	600850	电科数字	1,238,430.00	6.81
118	601015	陕西黑猫	1,237,066.00	6.80
119	603613	国联股份	1,230,791.00	6.77
120	300319	麦捷科技	1,215,881.00	6.69
121	603612	索通发展	1,211,973.00	6.66
122	300322	硕贝德	1,196,156.00	6.58
123	300007	汉威科技	1,195,709.00	6.58
124	603208	江山欧派	1,176,321.00	6.47
125	300288	朗玛信息	1,174,019.00	6.46
126	300377	赢时胜	1,164,117.00	6.40
127	300747	锐科激光	1,145,694.00	6.30
128	002097	山河智能	1,127,683.50	6.20
129	002850	科达利	1,126,099.50	6.19
130	603956	威派格	1,104,465.00	6.07
131	300379	东方通	1,099,623.00	6.05
132	600761	安徽合力	1,096,671.00	6.03
133	300579	数字认证	1,093,175.00	6.01
134	300748	金力永磁	1,084,876.20	5.97
135	300101	振芯科技	1,063,310.00	5.85
136	603018	华设集团	1,045,556.00	5.75
137	300732	设研院	1,035,063.71	5.69
138	600775	南京熊猫	1,018,145.00	5.60
139	600075	新疆天业	1,016,144.00	5.59
140	002713	东易日盛	1,015,863.48	5.59
141	002206	海利得	1,003,524.50	5.52
142	300674	宇信科技	985,655.80	5.42
143	300208	青岛中程	985,350.00	5.42
144	603081	大丰实业	983,738.00	5.41
145	300409	道氏技术	968,579.00	5.33
146	600129	太极集团	951,320.00	5.23
147	600480	凌云股份	946,165.80	5.20

148	002870	香山股份	945,893.00	5.20
149	300353	东土科技	937,399.00	5.15
150	300650	太龙照明	935,052.00	5.14
151	002430	杭氧股份	934,164.00	5.14
152	600596	新安股份	932,102.00	5.13
153	600531	豫光金铅	928,772.00	5.11
154	603606	东方电缆	919,506.92	5.06
155	600710	苏美达	912,374.00	5.02
156	300623	捷捷微电	907,067.00	4.99
157	300222	科大智能	904,232.00	4.97
158	002636	金安国纪	897,011.00	4.93
159	600169	太原重工	896,850.00	4.93
160	000900	现代投资	895,983.00	4.93
161	002382	蓝帆医疗	888,851.00	4.89
162	000059	华锦股份	880,698.00	4.84
163	601886	江河集团	880,028.90	4.84
164	000049	德赛电池	876,096.20	4.82
165	300476	胜宏科技	872,226.00	4.80
166	300385	雪浪环境	867,829.20	4.77
167	300687	赛意信息	860,463.00	4.73
168	603421	鼎信通讯	859,565.00	4.73
169	601163	三角轮胎	847,877.00	4.66
170	300670	大烨智能	837,941.00	4.61
171	300428	立中集团	837,194.38	4.60
172	603733	仙鹤股份	833,014.00	4.58
173	300366	创意信息	831,277.00	4.57
174	002061	浙江交科	826,862.00	4.55
175	600966	博汇纸业	824,896.00	4.54
176	002840	华统股份	824,329.00	4.53
177	000723	美锦能源	816,010.00	4.49
178	603180	金牌厨柜	812,268.89	4.47
179	000498	山东路桥	811,312.00	4.46
180	600230	沧州大化	797,313.40	4.38
181	002539	云图控股	795,864.00	4.38
182	600133	东湖高新	792,724.00	4.36
183	000921	海信家电	783,590.25	4.31
184	603730	岱美股份	781,257.00	4.30
185	002522	浙江众成	779,870.00	4.29

186	002284	亚太股份	771,047.00	4.24
187	000615	奥园美谷	769,625.00	4.23
188	000783	长江证券	769,283.00	4.23
189	300083	创世纪	759,621.00	4.18
190	002930	宏川智慧	758,828.80	4.17
191	600057	厦门象屿	756,983.48	4.16
192	300388	节能国祯	754,995.00	4.15
193	002055	得润电子	754,305.00	4.15
194	600548	深高速	752,372.00	4.14
195	600105	永鼎股份	749,375.00	4.12
196	603301	振德医疗	748,831.00	4.12
197	300181	佐力药业	746,457.54	4.10
198	600184	光电股份	744,413.00	4.09
199	002416	爱施德	742,980.00	4.09
200	002641	永高股份	741,960.68	4.08
201	000801	四川九洲	739,757.00	4.07
202	600512	腾达建设	738,772.00	4.06
203	002847	盐津铺子	731,282.00	4.02
204	600884	杉杉股份	724,041.50	3.98
205	300653	正海生物	714,581.00	3.93
206	300339	润和软件	712,460.00	3.92
207	601375	中原证券	704,678.00	3.87
208	603128	华贸物流	700,418.00	3.85
209	300131	英唐智控	698,040.00	3.84
210	300726	宏达电子	694,644.00	3.82
211	002108	沧州明珠	693,551.00	3.81
212	002368	太极股份	690,733.74	3.80
213	000666	经纬纺机	683,341.00	3.76
214	002277	友阿股份	680,644.00	3.74
215	000560	我爱我家	676,126.00	3.72
216	600185	格力地产	666,408.00	3.66
217	300177	中海达	666,252.66	3.66
218	300439	美康生物	665,857.00	3.66
219	000902	新洋丰	660,765.00	3.63
220	002254	泰和新材	658,289.00	3.62
221	600988	赤峰黄金	656,774.47	3.61
222	300562	乐心医疗	651,456.00	3.58
223	603600	永艺股份	629,374.00	3.46

224	603477	巨星农牧	628,522.00	3.46
225	601908	京运通	626,383.00	3.44
226	600067	冠城大通	625,500.00	3.44
227	002940	昂利康	622,322.00	3.42
228	300673	佩蒂股份	620,568.00	3.41
229	600180	瑞茂通	608,138.00	3.34
230	002737	葵花药业	605,344.00	3.33
231	002649	博彦科技	597,257.00	3.28
232	601881	中国银河	595,747.00	3.28
233	002544	杰赛科技	593,318.00	3.26
234	000989	九芝堂	591,663.00	3.25
235	603236	移远通信	590,713.20	3.25
236	002550	千红制药	583,972.00	3.21
237	002034	旺能环境	579,785.00	3.19
238	603013	亚普股份	579,629.00	3.19
239	300506	名家汇	576,956.00	3.17
240	002056	横店东磁	574,642.00	3.16
241	300365	恒华科技	570,150.00	3.14
242	300415	伊之密	566,172.00	3.11
243	002318	久立特材	565,894.00	3.11
244	300757	罗博特科	564,533.98	3.10
245	002615	哈尔斯	554,955.00	3.05
246	002637	赞宇科技	553,967.00	3.05
247	300655	晶瑞股份	550,084.76	3.02
248	000692	惠天热电	545,330.00	3.00
249	300020	银江股份	541,978.00	2.98
250	300548	博创科技	541,003.00	2.97
251	000544	中原环保	539,685.00	2.97
252	002603	以岭药业	538,256.00	2.96
253	603218	日月股份	531,395.00	2.92
254	601882	海天精工	530,955.00	2.92
255	603738	泰晶科技	525,888.00	2.89
256	600478	科力远	524,120.00	2.88
257	002528	英飞拓	523,175.58	2.88
258	002258	利尔化学	521,063.00	2.87
259	600197	伊力特	519,661.00	2.86
260	300531	优博讯	516,647.00	2.84
261	600741	华域汽车	509,010.00	2.80

262	002881	美格智能	508,376.00	2.80
263	300499	高澜股份	508,198.00	2.79
264	000606	ST 顺利	502,506.00	2.76
265	000887	中鼎股份	498,049.00	2.74
266	300168	万达信息	496,908.00	2.73
267	603238	诺邦股份	490,355.00	2.70
268	002036	联创电子	488,891.00	2.69
269	002743	富煌钢构	486,040.00	2.67
270	603329	上海雅仕	485,333.00	2.67
271	002441	众业达	484,683.00	2.67
272	600223	鲁商发展	483,710.00	2.66
273	002903	宇环数控	480,882.00	2.64
274	603258	电魂网络	470,453.00	2.59
275	300219	鸿利智汇	467,818.41	2.57
276	603787	新日股份	467,355.09	2.57
277	300266	兴源环境	462,322.00	2.54
278	002472	双环传动	462,088.31	2.54
279	603533	掌阅科技	461,926.00	2.54
280	603912	佳力图	458,288.00	2.52
281	000026	飞亚达	451,027.00	2.48
282	002609	捷顺科技	449,268.00	2.47
283	300217	东方电热	446,349.00	2.45
284	002367	康力电梯	446,189.00	2.45
285	000019	深粮控股	446,182.80	2.45
286	002287	奇正藏药	445,219.21	2.45
287	300117	嘉寓股份	443,591.00	2.44
288	300477	合纵科技	439,499.00	2.42
289	002068	黑猫股份	438,436.00	2.41
290	300456	赛微电子	428,738.00	2.36
291	603283	赛腾股份	428,150.00	2.35
292	600420	国药现代	426,852.00	2.35
293	300280	紫天科技	424,409.00	2.33
294	300348	长亮科技	421,481.00	2.32
295	002407	多氟多	413,141.00	2.27
296	600707	彩虹股份	411,802.00	2.26
297	000920	南方汇通	410,449.00	2.26
298	002293	罗莱生活	410,008.00	2.25
299	002905	金逸影视	408,254.00	2.24

300	300725	药石科技	406,814.00	2.24
301	603595	东尼电子	403,328.00	2.22
302	300318	博晖创新	401,244.06	2.21
303	300767	震安科技	400,233.00	2.20
304	300495	*ST 美尚	399,791.00	2.20
305	300441	鲍斯股份	397,494.00	2.19
306	601311	骆驼股份	396,150.00	2.18
307	600103	青山纸业	395,432.00	2.17
308	688561	奇安信	394,670.48	2.17
309	300727	润禾材料	392,954.00	2.16
310	603725	天安新材	379,962.00	2.09
311	600831	广电网络	379,823.00	2.09
312	000898	鞍钢股份	375,001.00	2.06
313	300171	东富龙	371,132.00	2.04
314	300207	欣旺达	371,118.00	2.04
315	002643	万润股份	370,947.00	2.04

注：“卖出金额”按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	538,161,994.96
卖出股票收入（成交）总额	453,886,319.79

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

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	864.30
5	应收申购款	2,667,299.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,668,163.40

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
万家中证 1000 指数增强 A	1,443	34,822.22	9,887,305.69	19.68%	40,361,163.64	80.32%
万家中证 1000 指数增强 C	2,062	28,464.13	16,470,118.24	28.06%	42,222,914.06	71.94%
合计	3,444	31,632.26	26,357,423.93	24.19%	82,584,077.70	75.81%

注：本基金存在同时持有 A 级和 C 级的客户。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	万家中证 1000 指数增强 A	88,830.14	0.1768%
	万家中证 1000 指数增强 C	4,678.11	0.0080%
	合计	93,508.25	0.0858%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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
	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

8.4 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	9.08	9,887,305.69	9.08	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	9.08	9,887,305.69	9.08	3 年

§ 9 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	11,120,961.79	2,136,315.37
本报告期基金总申购份额	122,425,852.97	189,785,754.49
减：本报告期基金总赎回份额	83,298,345.43	133,229,037.56
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	50,248,469.33	58,693,032.30

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：
公司高级管理人员：
2021 年 3 月 16 日，公司聘任陈广益先生担任公司总经理。
基金托管人：
本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
浙商证券	2	988,998,981.68	100.00%	604,576.68	100.00%	-

注：1、本基金采用券商结算模式，本基金选择浙商证券股份有限公司作为证券经纪商，本基金与证券经纪商浙商证券股份有限公司不存在关联方关系。

2、本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准如下：

- 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，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用券商结算模式进行证券交易和结算的需要；
 - 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；
 - 4) 资金划付、交收、调整、差异处理及时，且基金交易、结算、对账等数据的提供能满足券商结算模式下 T+0 估值的时效性要求。
- 3、基金证券经纪商的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定证券经营机构，然后基金管理人、基金托管人和证券经纪商签订证券经纪服务协议。
- 4、交易佣金包含已由证券经纪商扣收的一级交易费用（包括经手费、证管费、风险金），但不包括印花税、上海市场过户费、港股通交易相关费用等税费。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20210101 - 20210117	9,887,305.69	-	-	9,887,305.69	9.08%
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；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。</p>							

§ 12 备查文件目录

12.1 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媒介上公开披露的基金净值、季度报告、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 2021 年中期报告原文。
- 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》

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人网站：www.wjasset.com

12.3 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

2021 年 8 月 30 日