

# 万家中证 500 指数增强型发起式证券投资 基金 2021 年年度报告

2021 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	13
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>15</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	15
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.....	18
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	19
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	21
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	21
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>22</b>
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
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>23</b>
6.1 审计报告基本信息.....	23
6.2 审计报告的基本内容.....	23
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>25</b>
7.1 资产负债表.....	25
7.2 利润表.....	26
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	28
7.4 报表附注.....	30
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>61</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	61
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	61
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.....	63
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	73
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	85
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.....	85
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.....	85

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 .....	85
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 .....	85
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	86
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	86
8.12 投资组合报告附注 .....	86
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>88</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	88
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	88
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 .....	89
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	89
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>91</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>92</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	92
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 .....	92
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	92
11.4 基金投资策略的改变 .....	92
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	92
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 .....	92
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	92
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>95</b>
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 .....	95
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>96</b>
13.1 备查文件目录 .....	96
13.2 存放地点 .....	96
13.3 查阅方式 .....	96

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	万家中证 500 指数增强发起式	
基金主代码	006729	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 5 月 23 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	54,989,197.26 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 500 指数增强发起式 A	万家中证 500 指数增强发起式 C
下属分级基金的交易代码:	006729	006730
报告期末下属分级基金的份额总额	21,939,024.41 份	33,050,172.85 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，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。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 500 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	郭明
	联系电话	021-38909626	010-66105799
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008880800	95588
传真		021-38909627	010-66105798
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）	北京市西城区复兴门内大街 55 号
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）	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200122	100140
法定代表人		方一天	陈四清

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.wjasset.com">http://www.wjasset.com</a>
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	万家基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）

### § 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	2021 年		2020 年		2019 年 5 月 23 日(基金合同 生效日)-2019 年 12 月 31 日	
	万家中证 500 指数增强发 起式 A	万家中证 500 指数增强发 起式 C	万家中证 500 指数增强发 起式 A	万家中证 500 指数增强发 起式 C	万家中证 500 指数增强发 起式 A	万家中证 500 指数增强发 起式 C
本期 已实 现收 益	6,819,286.7 2	2,878,190.6 5	19,680,747. 17	12,168,044. 09	20,726,929. 94	4,821,704.2 5
本期 利润	6,697,729.3 8	2,030,908.9 8	14,377,707. 09	8,127,770.7 3	26,224,264. 77	9,827,648.3 1
加权 平均 基金 份额 本期 利润	0.3480	0.1759	0.3544	0.3099	0.2078	0.2127
本期 加权 平均 净值 利润 率	20.13%	9.88%	26.08%	23.38%	19.63%	19.53%
本期	22.82%	22.34%	33.71%	33.16%	20.20%	19.57%

基金 份额 净值 增长 率						
3.1. 2 期 末数 据和 指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
期末 可供 分配 利润	19,326,152. 69	28,348,986. 00	10,978,532. 47	3,835,512.6 1	10,532,749. 44	7,210,782.1 6
期末 可供 分配 基金 份额 利润	0.8809	0.8578	0.5314	0.5186	0.1346	0.1289
期末 基金 资产 净值	41,265,177. 10	61,399,158. 85	31,639,354. 55	11,231,623. 01	92,929,350. 27	66,067,174. 90
期末 基金 份额 净值	1.8809	1.8578	1.5314	1.5186	1.1873	1.1815
3.1. 3	2021 年末		2020 年末		2019 年末	

累计 期末 指标						
基金 份额 累计 净值 增长 率	97.40%	94.78%	60.72%	59.21%	20.20%	19.57%

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 500 指数增强发起式 A

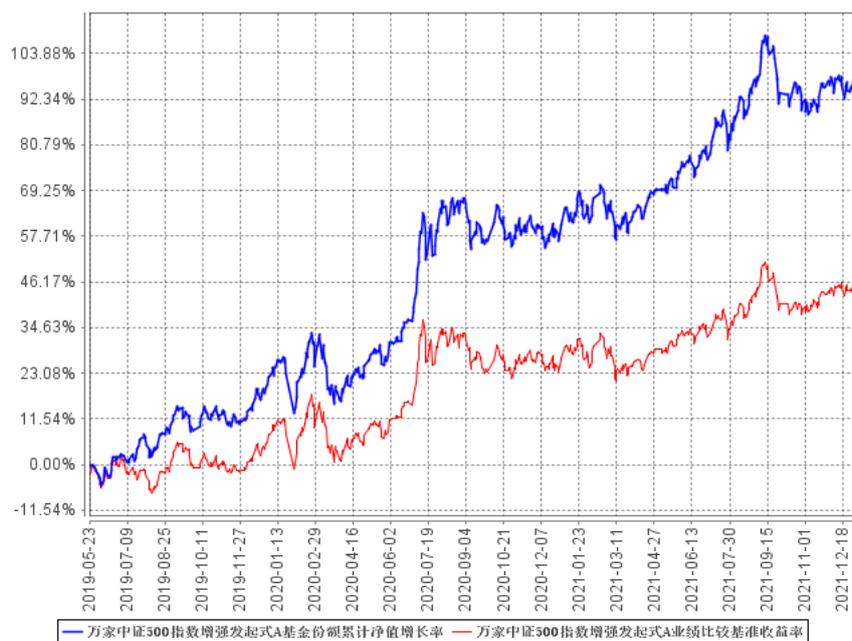
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.76%	0.83%	3.45%	0.72%	-1.69%	0.11%
过去六个月	9.35%	1.01%	7.75%	0.91%	1.60%	0.10%
过去一年	22.82%	0.98%	14.90%	0.92%	7.92%	0.06%
自基金合同生效起至今	97.40%	1.22%	45.68%	1.22%	51.72%	0.00%

万家中证 500 指数增强发起式 C

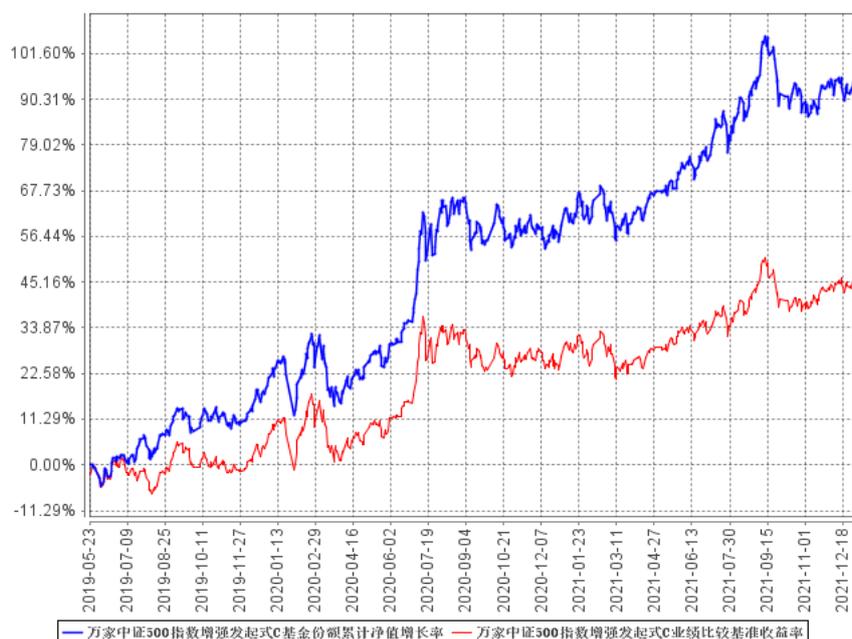
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.66%	0.83%	3.45%	0.72%	-1.79%	0.11%
过去六个月	9.13%	1.01%	7.75%	0.91%	1.38%	0.10%
过去一年	22.34%	0.98%	14.90%	0.92%	7.44%	0.06%
自基金合同生效起至今	94.78%	1.22%	45.68%	1.22%	49.10%	0.00%

### 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500指数增强发起式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



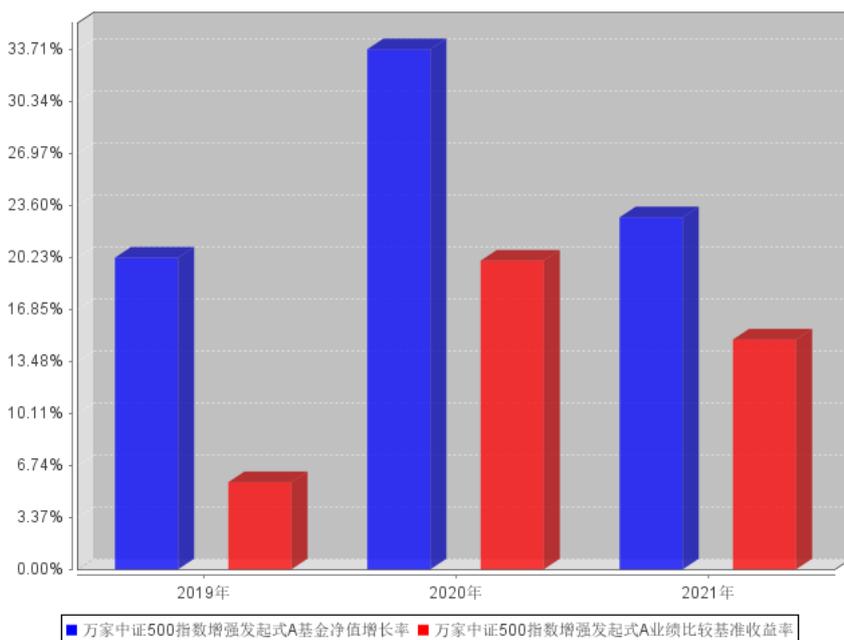
万家中证500指数增强发起式C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



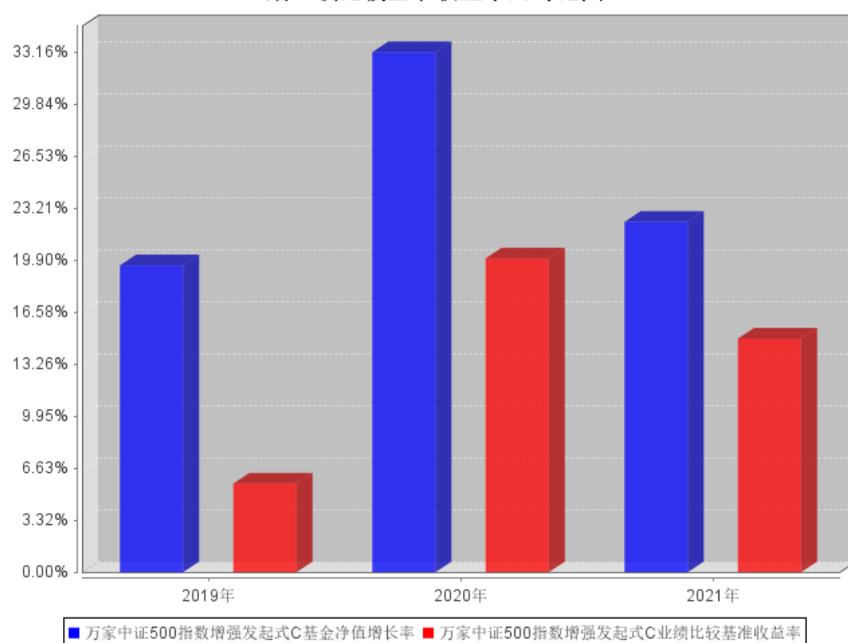
注：本基金合同生效日期为 2019 年 5 月 23 日，本基金建仓期为基金合同生效后 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

### 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500指数增强发起式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500指数增强发起式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 500 指数增强发起式 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
2021	-	-	-	-	
2020	0.5520	979,858.92	160,540.18	1,140,399.10	
2019	0.1390	1,111,270.34	56,753.63	1,168,023.97	
合计	0.6910	2,091,129.26	217,293.81	2,308,423.07	

单位：人民币元

万家中证 500 指数增强发起式 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
2021	-	-	-	-	
2020	0.5380	391,918.93	64,603.92	456,522.85	
2019	0.1340	494,112.04	264,514.73	758,626.77	

合计	0.6720	886,030.97	329,118.65	1,215,149.62	
----	--------	------------	------------	--------------	--

## § 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。目前管理一百只开放式基金,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、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证券投资基金、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证券投资基金、万家鑫动力月月购一年滚动持有混合型证券投资基金、万家养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（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证券投资基金、万家互联互通核心资产量化策略混合型证券投资基金、万家民瑞祥明 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家瑞泽回报一年持有期混合型证券投资基金、万家惠裕回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家悦兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金、万家稳鑫 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、万家全球成长一年持有期混合型证券投资基金（QDII）、万家瑞泰混合型证券投资基金、万家沪港深蓝筹混合型证券投资基金、万家北交所慧选两年定期开放混合型证券投资基金、万家鼎鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家新机遇成长一年持有期混合型发起式证券投资基金。

#### 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	万家量化睿选灵活	2019 年 9 月 6 日	-	14 年	曾任美国巴克莱国际投资管理公司基

	<p>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 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投资基金、万家中证 500 指数增强型基金的基金经理</p>			<p>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 月加入万家基金管理有限公司，担任公司总经理助理。</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)公司投资管理实行分层次决策,投资决策委员会根据公募基金和私募投资组合的规模、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。(2)公司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,公司执行交易系统中的公平交易程序;(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,原则上公司按照价格优先、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，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

万家中证 500 指数增强型证券投资基金采用中证 500 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 500 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。

本基金在保持相对中证 500 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 500 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 500 成分股，保持了跟标的指数的风格基本一致。

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。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家中证 500 指数增强发起式 A 基金份额净值为 1.8809 元，本报告期基金份额净值增长率为 22.82%；截至本报告期末万家中证 500 指数增强发起式 C 基金份额净值为 1.8578 元，本报告期基金份额净值增长率为 22.34%；同期业绩比较基准收益率为 14.90%。基金报告期末 A 份额、C 份额日均跟踪偏离度分别为 0.1940%、0.1936%，年跟踪误差分别为 2.5102%、2.5116%，截止报告期末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

展望 2022 年，从宏观经济角度来看，国内由于地产投资增速可能出现的快速下行风险，带来经济下行压力较大，经济发展面临需求收缩、供给冲击、预期转弱的三重冲击。在此背景下，

中央经济工作会议定调经济“稳字当头”，重提“以经济建设为中心”，同时对过去的政策进行适当纠偏，后续“稳增长”是经济的核心要点。

当前国内货币政策处于宽松窗口，央行连续降准降息、积极释放流动性，政策底已经出现。随着三月份全国两会的开幕，稳增长政策有望加速推进，另外相关行业政策规划也同样值得期待。与此同时，海外通胀推动的利率上行正在影响全球资产定价，美联储 3 月份加息的概率和预期正在加速提升，海外流动性拐点可能反复冲击今年的市场风险偏好，对一些高估值成长型行业形成压制。有鉴于此，“稳增长”是今年上半年最为清晰的投资路线。全年来看，今年 A 股主要的投资主线是市场风格和政策催化，特别是稳增长政策以及之前预期较低的板块带来的投资机会。具体来看：一、低预期下的反转行业：一方面，2022 年最重要的政策方针是稳增长政策，在此预期下，房地产、地产链和基建链、大消费具备政策边际利好的预期。另一方面，虽然疫情不确定性对餐饮旅游、交通运输等为主的行业复苏节奏或仍有扰动，但随着海外疫情管控的放开以及全球疫情防治的进一步科学化，“后疫情”行业有望逐步实现预期修复甚至反转。二、新的主题投资依然在积极涌现，例如受益于十四五“数字经济发展规划”的数字经济、新能源渗透率提升下的汽车智能化、有资产注入预期的国企改革等等。三、长期政策确定性强、行业空间大、国产替代加速的科技板块，以及军工，新能源车等板块虽然短期调整幅度较大，但中长期来看仍然是市场的重要配置方向。

#### 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。估值委员会由负责估值业务的分管领导、合规稽核部负责人、基金运营部负责人、相关估值业务岗位人员、相关风控人员等组成。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》。

### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金未实施利润分配。

### 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——万家基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对万家基金管理有限公司编制和披露的本基金 2021 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 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[2022]第 ZA30185 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 500 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 500 指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“万家中证 500 指数增强发起式”)财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 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 500 指数增强发起式 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 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 500 指数增强发起式,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 500 指数增强发起式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 500 指数增强发起式的持续经营能力,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 500 指数增强发起式的财务报告过程。</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 500 指数增强发起式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 500 指数增强发起式不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与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进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>立信会计师事务所（特殊普通合伙）</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>王斌 徐冬</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>中国 上海</p>
<p>审计报告日期</p>	<p>2022 年 3 月 29 日</p>

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	6,049,943.16	2,810,458.29
结算备付金		526,585.31	156,009.60
存出保证金		14,911.18	14,740.70
交易性金融资产	7.4.7.2	96,912,244.86	40,444,883.36
其中：股票投资		96,912,244.86	40,444,883.36
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		-	1,729,788.54
应收利息	7.4.7.5	897.77	382.86
应收股利		-	-
应收申购款		194,399.53	17,910.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		103,698,981.81	45,174,173.88
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		455,253.32	1,943,394.06
应付管理人报酬		73,253.93	38,380.95
应付托管费		14,650.76	7,676.20
应付销售服务费		15,469.64	4,440.66
应付交易费用	7.4.7.7	345,713.50	118,868.75
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	130,304.71	190,435.70
负债合计		1,034,645.86	2,303,196.32
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	54,989,197.26	28,056,932.48
未分配利润	7.4.7.10	47,675,138.69	14,814,045.08
所有者权益合计		102,664,335.95	42,870,977.56
负债和所有者权益总计		103,698,981.81	45,174,173.88

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，万家中证 500 指数增强发起式 A 基金份额净值 1.8809 元，基金份额总额 21,939,024.41 份；万家中证 500 指数增强发起式 C 基金份额净值 1.8578 元，基金份额总额 33,050,172.85 份。万家中证 500 指数增强发起式份额总额合计为 54,989,197.26 份。

## 7.2 利润表

会计主体：万家中证 500 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		10,838,353.70	24,925,737.42
1.利息收入		17,201.31	37,901.99
其中：存款利息收入	7.4.7.11	17,201.31	37,901.99
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）		11,653,574.62	33,976,772.29
其中：股票投资收益	7.4.7.12	11,276,460.01	33,337,746.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-	-
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	377,114.61	639,026.10
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-968,839.01	-9,343,313.44
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	136,416.78	254,376.58
<b>减：二、费用</b>		2,109,715.34	2,420,259.60
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	537,291.68	913,903.06
2. 托管费	7.4.10.2.2	107,458.28	182,780.62
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	82,189.01	141,852.67

4. 交易费用	7.4.7.19	1,242,283.37	1,041,083.25
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	140,493.00	140,640.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		8,728,638.36	22,505,477.82
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		8,728,638.36	22,505,477.82

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家中证 500 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	28,056,932.48	14,814,045.08	42,870,977.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,728,638.36	8,728,638.36
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）	26,932,264.78	24,132,455.25	51,064,720.03
其中：1. 基金申购款	64,657,387.60	52,743,914.31	117,401,301.91

2. 基金赎回款	-37,725,122.82	-28,611,459.06	-66,336,581.88
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）	54,989,197.26	47,675,138.69	102,664,335.95
项目	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	134,186,486.55	24,810,038.62	158,996,525.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	22,505,477.82	22,505,477.82
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）	-106,129,554.07	-30,904,549.41	-137,034,103.48
其中：1. 基金申购款	57,558,512.21	18,917,379.73	76,475,891.94
2. 基金赎回款	-163,688,066.28	-49,821,929.14	-213,509,995.42
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）	-	-1,596,921.95	-1,596,921.95
五、期末所有者权益（基金净值）	28,056,932.48	14,814,045.08	42,870,977.56

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]1931 号文《关于准予万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》的批准，由万家基金管理有限公司作为基金管理人于 2019 年 5 月 6 日至 2019 年 5 月 17 日向社会公开募集，募集期结束经立信会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具信会师报字[2019]第 ZA30669 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2019 年 5 月 23 日生效，本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 215,969,733.39 元，有效认购资金在募集期间内产生的利息为人民币 31,846.50 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 216,001,579.89 元，折合 216,001,579.89 份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为万家基金管理有限公司，基金托管人为中国工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、存托凭证）、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，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：中证 500 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（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。

### 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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

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公允价值变动计入损益的金融资产，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公允价值变动计入损益的金融资产，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) 本基金的 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 类基金份额分别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

##### (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。

## 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	6,049,943.16	2,810,458.29
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：	6,049,943.16	2,810,458.29

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	96,721,118.42	96,912,244.86	191,126.44
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	96,721,118.42	96,912,244.86	191,126.44
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	39,284,917.91	40,444,883.36	1,159,965.45
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	39,284,917.91	40,444,883.36	1,159,965.45

### 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	654.07	306.06
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	237.00	70.20
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	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	6.70	6.60

合计	897.77	382.86
----	--------	--------

#### 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	345,713.50	118,868.75
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	345,713.50	118,868.75

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	304.71	435.70
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	130,000.00	190,000.00
合计	130,304.71	190,435.70

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

万家中证 500 指数增强发起式 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	20,660,822.08	20,660,822.08
本期申购	14,921,745.98	14,921,745.98
本期赎回（以“-”号填列）	-13,643,543.65	-13,643,543.65
- 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	21,939,024.41	21,939,024.41

金额单位：人民币元

万家中证 500 指数增强发起式 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,396,110.40	7,396,110.40
本期申购	49,735,641.62	49,735,641.62
本期赎回（以“-”号填列）	-24,081,579.17	-24,081,579.17
- 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	33,050,172.85	33,050,172.85

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 500 指数增强发起式 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	12,438,736.55	-1,460,204.08	10,978,532.47
本期利润	6,819,286.72	-121,557.34	6,697,729.38

本期基金份额交易产生的变动数	1,872,910.08	-223,019.24	1,649,890.84
其中：基金申购款	12,945,311.19	-851,663.20	12,093,647.99
基金赎回款	-11,072,401.11	628,643.96	-10,443,757.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,130,933.35	-1,804,780.66	19,326,152.69

单位：人民币元

万家中证 500 指数增强发起式 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,352,621.02	-517,108.41	3,835,512.61
本期利润	2,878,190.65	-847,281.67	2,030,908.98
本期基金份额交易产生的变动数	23,807,695.42	-1,325,131.01	22,482,564.41
其中：基金申购款	43,662,879.23	-3,012,612.91	40,650,266.32
基金赎回款	-19,855,183.81	1,687,481.90	-18,167,701.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,038,507.09	-2,689,521.09	28,348,986.00

## 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
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	12,662.38	33,443.46
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	4,371.23	3,625.72
其他	167.70	832.81
合计	17,201.31	37,901.99

### 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	398,326,122.23	389,224,905.81
减：卖出股票成本总额	387,049,662.22	355,887,159.62
买卖股票差价收入	11,276,460.01	33,337,746.19

### 7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

#### 7.4.7.13.1 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

	月 31 日	31 日
股票投资产生的股利收益	377,114.61	639,026.10
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	377,114.61	639,026.10

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-968,839.01	-9,343,313.44
——股票投资	-968,839.01	-9,343,313.44
——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	-968,839.01	-9,343,313.44

#### 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
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12

	12 月 31 日	月 31 日
基金赎回费收入	136,089.82	250,049.94
转换费收入 006729	235.40	4,319.49
转换费收入 006730	91.56	7.15
合计	136,416.78	254,376.58

#### 7.4.7.19 交易费用

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 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,242,283.37	1,041,083.25
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	1,242,283.37	1,041,083.25

#### 7.4.7.20 其他费用

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 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	20,000.00	20,000.00
信息披露费	80,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
指数费用	40,000.00	40,000.00
银行费用	493.00	640.00
回购手续费	-	-
其他	-	-

合计	140,493.00	140,640.00
----	------------	------------

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日,本基金无需要披露的重大或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》(财会〔2017〕7 号)、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》(财会〔2017〕8 号)、《企业会计准则第 24 号——套期会计》(财会〔2017〕9 号)、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(财会〔2017〕14 号)(以下简称新金融工具相关会计准则)和《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》(财会〔2020〕22 号),自 2022 年 1 月 1 日起,本基金开始执行新金融工具相关会计准则。

## 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
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
中泰证券股份有限公司(“中泰证券”)	基金管理人股东、基金销售机构
新疆国际实业股份有限公司	基金管理人股东
齐河众鑫投资有限公司	基金管理人股东
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、基金销售机构
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: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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
中泰证券	346,621,448.52	41.17%	294,494,861.65	45.95%

#### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
中泰证券	310,679.13	40.39%	110,306.03	31.91%

关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
中泰证券	263,958.61	45.00%	64,200.09	54.01%

## 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
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	537,291.68	913,903.06
其中：支付销售机构的客户维护费	139,017.63	173,189.46

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。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 2 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

### 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
----	----	---------

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	107,458.28	182,780.62

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

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

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，基金托管人复核后于次月首日起 2 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

#### 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家中证 500 指数 增强发起式 A	万家中证 500 指数 增强发起式 C	合计
万家基金管理有限公司	-	242.65	242.65
中泰证券	-	1,725.10	1,725.10
工商银行	-	9,109.80	9,109.80
合计	-	11,077.55	11,077.55
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家中证 500 指数 增强发起式 A	万家中证 500 指数 增强发起式 C	合计
万家基金管理有限公司	-	94,787.37	94,787.37

中泰证券	-	100.53	100.53
工商银行	-	8,930.89	8,930.89
合计	-	103,818.79	103,818.79

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 类基金份额的基金资产净值的 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，由基金管理人向基金托管人发送销售

服务费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间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。

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

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。

### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	万家中证 500 指数增强发起式 A	万家中证 500 指数增强发起式 C
基金合同生效日（2019 年 5 月 23 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,001,000.10	-
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	10,001,000.10	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	45.5854%	-

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	万家中证 500 指数增强发起式 A	万家中证 500 指数增强发起式 C
基金合同生效日（2019 年 5 月 23 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,001,000.10	-
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	10,001,000.10	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	48.4056%	-

#### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.10.6 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12月31日		2020年1月1日至2020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
工商银行	6,049,943.16	12,662.38	2,810,458.29	33,443.46

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

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方所承销的证券。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 7.4.12 期末（2021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
001234	泰慕	2021年	2022	新股流	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-

	士	12 月 31 日	年 1 月 11 日	通受限						
--	---	--------------	---------------	-----	--	--	--	--	--	--

#### 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 2021 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 2021 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。

#### 7.4.12.4 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。

#### 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%。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资。（2020 年 12 月 31 日：同）

### 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 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（2021 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、债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	6,049,943.16	-	-	-	-	-	6,049,943.16
结算备付金	526,585.31	-	-	-	-	-	526,585.31
存出保证金	14,911.18	-	-	-	-	-	14,911.18
交易性金融资产	-	-	-	-	-	96,912,244.86	96,912,244.86
应收利息	-	-	-	-	-	897.77	897.77
应收申购款	-	-	-	-	-	194,399.53	194,399.53
资产总计	6,591,439.65	-	-	-	-	97,107,542.16	103,698,981.81
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	455,253.32	455,253.32
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	73,253.93	73,253.93
应付托管费	-	-	-	-	-	14,650.76	14,650.76
应付销售服务费	-	-	-	-	-	15,469.64	15,469.64
应付交易费用	-	-	-	-	-	345,713.50	345,713.50
其他负债	-	-	-	-	-	130,304.71	130,304.71
负债总计	-	-	-	-	-	1,034,645.86	1,034,645.86
利率敏感度缺口	6,591,439.65	-	-	-	-	-96,072,896.30	102,664,335.95

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	2,810,458.29	-	-	-	-	-	2,810,458.29
结算备付金	156,009.60	-	-	-	-	-	156,009.60
存出保证金	14,740.70	-	-	-	-	-	14,740.70
交易性金融资产	-	-	-	-	-	40,444,883.36	40,444,883.36
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,729,788.54	1,729,788.54
应收利息	-	-	-	-	-	382.86	382.86
应收申购款	-	-	-	-	-	17,910.53	17,910.53
资产总计	2,981,208.59	-	-	-	-	42,192,965.29	45,174,173.88
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,943,394.06	1,943,394.06
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	38,380.95	38,380.95
应付托管费	-	-	-	-	-	7,676.20	7,676.20
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,440.66	4,440.66
应付交易费用	-	-	-	-	-	118,868.75	118,868.75
其他负债	-	-	-	-	-	190,435.70	190,435.70
负债总计	-	-	-	-	-	2,303,196.32	2,303,196.32
利率敏感度缺口	2,981,208.59	-	-	-	-	-39,889,768.97	42,870,977.56

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 2021 年 12 月 31 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。（2020 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 2021 年 12 月 31 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	96,912,244.86	94.40	40,444,883.36	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	96,912,244.86	94.40	40,444,883.36	94.34

注：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。其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上表。

#### 7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1. 股票基准指数下降 100 个基点	-949,482.93	-396,004.56
	2. 股票基准指数上升 100 个基点	949,482.93	396,004.56

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

##### （一）公允价值

##### 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。

##### 2、持续的以公允价值计量的金融工具

##### （1）各层次金融工具公允价值

于 2021 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工具中属于第一层次的余额为 96,906,740.37 元，属于第二层次的余额为 5,504.49 元，无属于第三层次的余额。（2020 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为 40,383,007.52 元，属于第二层次的余额为 61,875.84 元，无属于第三层次的余额。）

##### （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。

##### （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。

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。

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。

(二)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	96,912,244.86	93.46
	其中：股票	96,912,244.86	93.46
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	6,576,528.47	6.34
8	其他各项资产	210,208.48	0.20
9	合计	103,698,981.81	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	1,658,151.00	1.62
B	采矿业	5,138,758.00	5.01
C	制造业	52,362,690.45	51.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,821,914.00	2.75
E	建筑业	1,726,410.00	1.68
F	批发和零售业	849,329.00	0.83
G	交通运输、仓储和邮政业	2,032,344.00	1.98
H	住宿和餐饮业	740,534.00	0.72
I	信息传输、软件和信息技术服务	5,559,659.20	5.42

	业		
J	金融业	4,074,508.70	3.97
K	房地产业	621,453.00	0.61
L	租赁和商务服务业	143,215.00	0.14
M	科学研究和技术服务业	450,177.00	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	152,339.00	0.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	469,980.00	0.46
R	文化、体育和娱乐业	696,384.00	0.68
S	综合	371,961.00	0.36
	合计	79,869,807.35	77.80

### 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	64,277.00	0.06
B	采矿业	151,996.00	0.15
C	制造业	11,155,333.03	10.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,479,126.80	1.44
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	362,762.00	0.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	477,834.00	0.47
J	金融业	1,995,924.68	1.94

K	房地产业	109,970.00	0.11
L	租赁和商务服务业	59,784.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	608,520.00	0.59
N	水利、环境和公共设施管理业	246,600.00	0.24
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	330,310.00	0.32
S	综合	-	-
	合计	17,042,437.51	16.60

### 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	600487	亨通光电	149,300	2,257,416.00	2.20
2	601958	金钼股份	327,300	2,242,005.00	2.18
3	600885	宏发股份	26,600	1,985,424.00	1.93
4	000709	河钢股份	777,800	1,913,388.00	1.86
5	600623	华谊集团	205,200	1,867,320.00	1.82
6	601872	招商轮船	452,800	1,856,480.00	1.81
7	002294	信立泰	66,900	1,827,708.00	1.78
8	000877	天山股份	118,900	1,820,359.00	1.77
9	600372	中航电子	71,900	1,609,841.00	1.57
10	002180	纳思达	33,500	1,599,960.00	1.56

11	603868	飞科电器	33,800	1,467,596.00	1.43
12	000987	越秀金控	156,525	1,361,767.50	1.33
13	600497	驰宏锌锗	265,700	1,325,843.00	1.29
14	000997	新大陆	69,800	1,264,776.00	1.23
15	300630	普利制药	22,300	1,227,392.00	1.20
16	600160	巨化股份	94,100	1,214,831.00	1.18
17	603589	口子窖	16,800	1,190,616.00	1.16
18	000598	兴蓉环境	185,700	1,173,624.00	1.14
19	688521	芯原股份	14,680	1,135,644.80	1.11
20	601615	明阳智能	40,700	1,062,270.00	1.03
21	600970	中材国际	88,200	1,008,126.00	0.98
22	600765	中航重机	19,800	999,702.00	0.97
23	600728	佳都科技	118,200	984,606.00	0.96
24	000039	中集集团	56,600	971,256.00	0.95
25	600733	北汽蓝谷	96,600	967,932.00	0.94
26	002946	新乳业	60,100	957,994.00	0.93
27	300363	博腾股份	10,500	939,225.00	0.91
28	000988	华工科技	33,600	936,096.00	0.91
29	688029	南微医学	4,350	925,114.50	0.90
30	600549	厦门钨业	39,600	896,148.00	0.87
31	002185	华天科技	70,300	893,513.00	0.87
32	600862	中航高科	24,500	876,120.00	0.85
33	601128	常熟银行	130,200	860,622.00	0.84
34	688536	思瑞浦	1,100	844,800.00	0.82
35	002939	长城证券	65,100	843,045.00	0.82
36	601689	拓普集团	15,700	832,100.00	0.81
37	688099	晶晨股份	6,062	789,272.40	0.77
38	002745	木林森	51,751	782,992.63	0.76

39	688005	容百科技	6,666	770,456.28	0.75
40	600642	申能股份	104,300	768,691.00	0.75
41	600546	山煤国际	91,600	752,036.00	0.73
42	000830	鲁西化工	45,400	692,804.00	0.67
43	002124	天邦股份	104,400	672,336.00	0.65
44	605358	立昂微	5,400	648,054.00	0.63
45	601699	潞安环能	57,200	646,932.00	0.63
46	600158	中体产业	41,500	627,480.00	0.61
47	000883	湖北能源	117,300	614,652.00	0.60
48	002384	东山精密	22,500	609,750.00	0.59
49	603456	九洲药业	10,700	601,982.00	0.59
50	601555	东吴证券	65,570	580,950.20	0.57
51	000932	华菱钢铁	106,400	543,704.00	0.53
52	600516	方大炭素	49,900	539,918.00	0.53
53	300223	北京君正	3,900	522,600.00	0.51
54	300037	新宙邦	4,400	497,200.00	0.48
55	600639	浦东金桥	37,900	483,983.00	0.47
56	600875	东方电气	22,500	481,950.00	0.47
57	002396	星网锐捷	20,300	478,471.00	0.47
58	300244	迪安诊断	14,000	469,980.00	0.46
59	600141	兴发集团	12,300	465,924.00	0.45
60	002375	亚厦股份	62,100	465,129.00	0.45
61	600258	首旅酒店	17,800	465,114.00	0.45
62	002409	雅克科技	5,600	454,552.00	0.44
63	603379	三美股份	19,900	453,322.00	0.44
64	603127	昭衍新药	3,900	450,177.00	0.44
65	000729	燕京啤酒	51,500	436,205.00	0.42
66	002867	周大生	24,500	435,610.00	0.42

67	600038	中直股份	5,400	433,620.00	0.42
68	000998	隆平高科	18,000	418,680.00	0.41
69	000960	锡业股份	21,200	414,036.00	0.40
70	002223	鱼跃医疗	10,700	404,460.00	0.39
71	603605	珀莱雅	1,800	374,958.00	0.37
72	600884	杉杉股份	11,405	373,741.85	0.36
73	300763	锦浪科技	1,600	370,480.00	0.36
74	601179	中国西电	66,200	367,410.00	0.36
75	300474	景嘉微	2,400	365,280.00	0.36
76	600782	新钢股份	68,400	361,152.00	0.35
77	600062	华润双鹤	26,600	355,642.00	0.35
78	600299	安迪苏	28,100	346,192.00	0.34
79	600673	东阳光	38,800	344,544.00	0.34
80	000937	冀中能源	60,000	330,600.00	0.32
81	600597	光明乳业	22,400	325,248.00	0.32
82	300751	迈为股份	500	321,150.00	0.31
83	300168	万达信息	24,400	317,688.00	0.31
84	002299	圣农发展	12,000	290,040.00	0.28
85	002797	第一创业	39,100	286,212.00	0.28
86	603707	健友股份	6,810	286,020.00	0.28
87	600259	广晟有色	5,700	280,668.00	0.27
88	002422	科伦药业	14,700	278,271.00	0.27
89	600316	洪都航空	7,100	277,326.00	0.27
90	002458	益生股份	24,500	277,095.00	0.27
91	600754	锦江酒店	4,700	275,420.00	0.27
92	300618	寒锐钴业	3,200	256,576.00	0.25
93	603198	迎驾贡酒	3,640	252,798.00	0.25
94	600392	盛和资源	11,600	227,592.00	0.22

95	002506	协鑫集成	57,600	218,880.00	0.21
96	000970	中科三环	13,400	215,070.00	0.21
97	000060	中金岭南	43,500	213,585.00	0.21
98	600315	上海家化	5,200	210,132.00	0.20
99	002028	思源电气	4,200	206,682.00	0.20
100	002056	横店东磁	10,800	203,796.00	0.20
101	300376	易事特	19,700	197,985.00	0.19
102	002273	水晶光电	11,200	194,768.00	0.19
103	688006	杭可科技	1,808	194,504.64	0.19
104	000739	普洛药业	5,500	192,995.00	0.19
105	603290	斯达半导	500	190,500.00	0.19
106	600776	东方通信	15,600	179,556.00	0.17
107	002203	海亮股份	14,100	175,263.00	0.17
108	300357	我武生物	3,000	171,900.00	0.17
109	600188	兖矿能源	7,300	171,769.00	0.17
110	603444	吉比特	400	168,740.00	0.16
111	600500	中化国际	18,100	154,936.00	0.15
112	002156	通富微电	7,900	153,497.00	0.15
113	601866	中远海发	47,200	153,400.00	0.15
114	601200	上海环境	12,100	152,339.00	0.15
115	600008	首创环保	42,700	145,607.00	0.14
116	002423	中粮资本	17,520	141,912.00	0.14
117	603218	日月股份	4,300	141,685.00	0.14
118	300296	利亚德	13,800	141,450.00	0.14
119	000898	鞍钢股份	37,700	141,375.00	0.14
120	002244	滨江集团	29,500	137,470.00	0.13
121	300024	机器人	12,200	136,274.00	0.13
122	601117	中国化学	11,000	132,000.00	0.13

123	600803	新奥股份	6,500	119,340.00	0.12
124	601869	长飞光纤	3,600	117,864.00	0.11
125	000733	振华科技	900	111,852.00	0.11
126	600066	宇通客车	9,700	106,894.00	0.10
127	600170	上海建工	29,500	106,200.00	0.10
128	600418	江淮汽车	5,800	100,920.00	0.10
129	002010	传化智联	11,500	100,050.00	0.10
130	000400	许继电气	3,800	99,180.00	0.10
131	000959	首钢股份	16,400	93,972.00	0.09
132	002705	新宝股份	3,800	93,860.00	0.09
133	600511	国药股份	2,900	91,437.00	0.09
134	600256	广汇能源	13,600	88,944.00	0.09
135	003022	联泓新科	2,400	87,456.00	0.09
136	600732	爱旭股份	3,600	84,096.00	0.08
137	002385	大北农	7,800	81,822.00	0.08
138	002250	联化科技	4,000	71,880.00	0.07
139	600764	中国海防	1,700	69,122.00	0.07
140	601098	中南传媒	7,200	68,904.00	0.07
141	600282	南钢股份	17,500	64,750.00	0.06
142	603225	新凤鸣	4,303	63,899.55	0.06
143	002985	北摩高科	500	60,230.00	0.06
144	600867	通化东宝	5,100	55,896.00	0.05
145	300285	国瓷材料	1,200	51,084.00	0.05
146	002302	西部建设	5,700	45,771.00	0.04
147	300017	网宿科技	6,800	45,492.00	0.04
148	600529	山东药玻	1,000	43,900.00	0.04
149	600415	小商品城	8,900	43,165.00	0.04
150	000930	中粮科技	3,800	41,306.00	0.04

151	300009	安科生物	3,000	39,270.00	0.04
152	000975	银泰黄金	4,400	38,632.00	0.04
153	688208	道通科技	400	31,760.00	0.03
154	000009	中国宝安	1,900	27,417.00	0.03
155	600787	中储股份	3,600	22,464.00	0.02
156	603893	瑞芯微	140	19,166.00	0.02
157	601717	郑煤机	1,400	16,226.00	0.02
158	300072	三聚环保	1,900	15,067.00	0.01
159	601611	中国核建	1,500	14,955.00	0.01
160	002128	电投能源	900	13,365.00	0.01
161	300166	东方国信	800	8,640.00	0.01
162	300699	光威复材	100	8,448.00	0.01
163	600739	辽宁成大	300	5,856.00	0.01
164	601992	金隅集团	1,900	5,396.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600919	江苏银行	232,300	1,354,309.00	1.32
2	000938	紫光股份	32,100	733,485.00	0.71
3	002129	中环股份	16,700	697,225.00	0.68
4	600360	华微电子	69,300	629,244.00	0.61
5	300404	博济医药	44,000	608,520.00	0.59
6	688578	艾力斯	19,855	599,621.00	0.58
7	603929	亚翔集成	48,300	587,328.00	0.57
8	002330	得利斯	88,400	580,788.00	0.57
9	300575	中旗股份	25,500	572,475.00	0.56

10	300162	雷曼光电	50,400	545,328.00	0.53
11	000498	山东路桥	81,300	502,434.00	0.49
12	688185	康希诺	1,605	480,777.75	0.47
13	600779	水井坊	3,900	467,961.00	0.46
14	300735	光弘科技	29,000	437,030.00	0.43
15	002449	国星光电	40,200	433,356.00	0.42
16	688200	华峰测控	804	411,567.60	0.40
17	600136	当代文体	49,300	330,310.00	0.32
18	688508	芯朋微	2,800	324,408.00	0.32
19	688313	仕佳光子	24,347	313,832.83	0.31
20	002051	中工国际	42,900	306,735.00	0.30
21	601009	南京银行	33,600	301,056.00	0.29
22	300757	罗博特科	4,500	279,000.00	0.27
23	601658	邮储银行	53,100	270,810.00	0.26
24	603099	长白山	22,500	246,600.00	0.24
25	300833	浩洋股份	2,900	234,987.00	0.23
26	002204	大连重工	47,000	204,450.00	0.20
27	002202	金风科技	12,400	204,228.00	0.20
28	002986	宇新股份	5,200	187,096.00	0.18
29	002805	丰元股份	5,800	182,990.00	0.18
30	000768	中航西飞	4,300	156,950.00	0.15
31	601816	京沪高铁	32,200	155,526.00	0.15
32	688520	神州细胞	2,624	153,372.80	0.15
33	688550	瑞联新材	1,500	148,755.00	0.14
34	688596	正帆科技	5,300	137,005.00	0.13
35	603185	上机数控	800	133,584.00	0.13
36	603833	欧派家居	900	132,750.00	0.13
37	000657	中钨高新	7,800	125,424.00	0.12

38	601666	平煤股份	14,800	123,876.00	0.12
39	603888	新华网	5,200	123,552.00	0.12
40	600662	外服控股	16,600	118,856.00	0.12
41	600841	上柴股份	9,900	117,117.00	0.11
42	300505	川金诺	3,300	101,112.00	0.10
43	603508	思维列控	4,200	96,516.00	0.09
44	300239	东宝生物	13,500	95,175.00	0.09
45	688556	高测股份	1,379	93,068.71	0.09
46	300873	海晨股份	1,800	88,380.00	0.09
47	603799	华友钴业	800	88,248.00	0.09
48	300294	博雅生物	2,300	88,205.00	0.09
49	600223	鲁商发展	5,800	76,850.00	0.07
50	600760	中航沈飞	1,100	74,844.00	0.07
51	002407	多氟多	1,600	71,984.00	0.07
52	688598	金博股份	200	71,008.00	0.07
53	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.07
54	600219	南山铝业	14,300	67,353.00	0.07
55	300761	立华股份	1,700	64,277.00	0.06
56	688388	嘉元科技	500	62,775.00	0.06
57	603256	宏和科技	7,100	60,776.00	0.06
58	002707	众信旅游	10,600	59,784.00	0.06
59	601868	中国能建	21,700	59,241.00	0.06
60	300821	东岳硅材	3,100	56,668.00	0.06
61	603351	威尔药业	1,400	54,838.00	0.05
62	688028	沃尔德	1,100	50,732.00	0.05
63	300769	德方纳米	100	49,116.00	0.05
64	600438	通威股份	1,000	44,960.00	0.04
65	688050	爱博医疗	200	42,046.00	0.04

66	000949	新乡化纤	7,400	41,514.00	0.04
67	000913	钱江摩托	2,800	39,732.00	0.04
68	603599	广信股份	1,000	39,000.00	0.04
69	688357	建龙微纳	200	38,388.00	0.04
70	300633	开立医疗	1,200	38,316.00	0.04
71	000836	富通信息	13,300	37,639.00	0.04
72	603610	麒盛科技	1,400	36,204.00	0.04
73	688017	绿的谐波	200	34,912.00	0.03
74	600007	中国国贸	2,300	33,120.00	0.03
75	600110	诺德股份	1,900	30,305.00	0.03
76	601101	昊华能源	3,800	28,120.00	0.03
77	601127	小康股份	400	23,820.00	0.02
78	688558	国盛智科	500	22,600.00	0.02
79	600559	老白干酒	800	22,352.00	0.02
80	000823	超声电子	1,600	21,792.00	0.02
81	603369	今世缘	400	21,760.00	0.02
82	002405	四维图新	1,200	19,104.00	0.02
83	600502	安徽建工	4,500	18,675.00	0.02
84	300820	英杰电气	200	17,980.00	0.02
85	603938	三孚股份	400	14,716.00	0.01
86	603383	顶点软件	300	10,770.00	0.01
87	002597	金禾实业	200	10,270.00	0.01
88	300775	三角防务	200	9,778.00	0.01
89	688122	西部超导	100	9,694.00	0.01
90	001288	运机集团	537	9,563.97	0.01
91	300035	中科电气	300	9,075.00	0.01
92	603008	喜临门	200	7,806.00	0.01
93	605138	盛泰集团	636	7,682.88	0.01

94	300450	先导智能	100	7,437.00	0.01
95	002643	万润股份	300	7,092.00	0.01
96	688779	长远锂科	300	7,032.00	0.01
97	300852	四会富仕	100	5,842.00	0.01
98	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.01
99	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
100	300748	金力永磁	100	4,489.00	0.00
101	300472	新元科技	200	3,212.00	0.00

## 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	600372	中航电子	5,133,116.00	11.97
2	601958	金钼股份	3,479,692.00	8.12
3	600497	驰宏锌锗	3,386,132.00	7.90
4	600885	宏发股份	2,908,368.00	6.78
5	600487	亨通光电	2,855,610.00	6.66
6	300316	晶盛机电	2,840,669.00	6.63
7	600808	马钢股份	2,820,484.00	6.58
8	002294	信立泰	2,771,222.00	6.46
9	300223	北京君正	2,712,948.00	6.33
10	600549	厦门钨业	2,657,314.00	6.20
11	000039	中集集团	2,584,882.00	6.03
12	688029	南微医学	2,570,674.22	6.00
13	601699	潞安环能	2,531,834.00	5.91
14	603868	飞科电器	2,527,902.00	5.90

15	002648	卫星化学	2,504,681.99	5.84
16	000830	鲁西化工	2,481,976.00	5.79
17	600884	杉杉股份	2,379,098.75	5.55
18	000799	酒鬼酒	2,357,880.00	5.50
19	000709	河钢股份	2,327,629.00	5.43
20	000887	中鼎股份	2,313,754.00	5.40
21	002709	天赐材料	2,308,521.00	5.38
22	600141	兴发集团	2,279,251.00	5.32
23	300037	新宙邦	2,207,918.00	5.15
24	600623	华谊集团	2,192,860.00	5.12
25	002180	纳思达	2,192,279.00	5.11
26	600765	中航重机	2,174,471.00	5.07
27	002317	众生药业	2,166,750.00	5.05
28	688099	晶晨股份	2,139,251.66	4.99
29	002185	华天科技	2,058,785.00	4.80
30	600869	远东股份	1,983,554.00	4.63
31	601872	招商轮船	1,981,332.00	4.62
32	002223	鱼跃医疗	1,959,348.00	4.57
33	000930	中粮科技	1,952,036.08	4.55
34	600008	首创环保	1,943,242.00	4.53
35	600862	中航高科	1,914,882.00	4.47
36	002138	顺络电子	1,914,478.00	4.47
37	601615	明阳智能	1,903,980.00	4.44
38	601600	中国铝业	1,897,524.00	4.43
39	603225	新凤鸣	1,889,909.02	4.41
40	600970	中材国际	1,875,233.00	4.37
41	603486	科沃斯	1,870,555.00	4.36
42	300630	普利制药	1,810,793.00	4.22

43	000553	安道麦 A	1,798,758.00	4.20
44	000960	锡业股份	1,784,601.00	4.16
45	603444	吉比特	1,779,005.00	4.15
46	000598	兴蓉环境	1,767,892.00	4.12
47	601128	常熟银行	1,755,349.00	4.09
48	000877	天山股份	1,748,083.00	4.08
49	600779	水井坊	1,745,397.00	4.07
50	000012	南玻 A	1,740,421.00	4.06
51	601233	桐昆股份	1,713,221.00	4.00
52	601689	拓普集团	1,712,954.00	4.00
53	002745	木林森	1,712,426.58	3.99
54	300474	景嘉微	1,695,920.00	3.96
55	002013	中航机电	1,687,896.00	3.94
56	000807	云铝股份	1,677,350.00	3.91
57	601598	中国外运	1,663,354.00	3.88
58	002458	益生股份	1,644,785.00	3.84
59	600782	新钢股份	1,628,930.00	3.80
60	600460	士兰微	1,620,691.00	3.78
61	600160	巨化股份	1,612,009.00	3.76
62	601636	旗滨集团	1,610,327.00	3.76
63	002078	太阳纸业	1,608,220.00	3.75
64	002396	星网锐捷	1,600,982.61	3.73
65	600875	东方电气	1,587,054.00	3.70
66	600639	浦东金桥	1,586,614.00	3.70
67	600919	江苏银行	1,571,219.22	3.66
68	002183	怡亚通	1,564,449.00	3.65
69	600256	广汇能源	1,551,346.00	3.62
70	000937	冀中能源	1,528,114.00	3.56

71	000988	华工科技	1,527,958.00	3.56
72	603589	口子窖	1,527,513.00	3.56
73	600733	北汽蓝谷	1,512,602.00	3.53
74	002203	海亮股份	1,511,579.00	3.53
75	300168	万达信息	1,509,159.00	3.52
76	600967	内蒙一机	1,508,843.00	3.52
77	002266	浙富控股	1,498,761.00	3.50
78	600516	方大炭素	1,492,213.00	3.48
79	000898	鞍钢股份	1,489,275.00	3.47
80	600908	无锡银行	1,471,778.00	3.43
81	002946	新乳业	1,464,993.00	3.42
82	600038	中直股份	1,458,786.00	3.40
83	002129	中环股份	1,431,383.00	3.34
84	603260	合盛硅业	1,427,489.00	3.33
85	002408	齐翔腾达	1,423,406.00	3.32
86	605358	立昂微	1,413,413.00	3.30
87	002128	电投能源	1,412,699.00	3.30
88	300618	寒锐钴业	1,395,760.00	3.26
89	600258	首旅酒店	1,391,602.00	3.25
90	600500	中化国际	1,389,985.00	3.24
91	300009	安科生物	1,388,788.00	3.24
92	000987	越秀金控	1,383,164.50	3.23
93	601928	凤凰传媒	1,364,308.00	3.18
94	601009	南京银行	1,364,145.00	3.18
95	000998	隆平高科	1,361,898.00	3.18
96	601577	长沙银行	1,339,686.00	3.12
97	300207	欣旺达	1,339,067.00	3.12
98	000983	山西焦煤	1,332,428.90	3.11

99	688521	芯原股份	1,328,443.70	3.10
100	002268	卫士通	1,321,664.00	3.08
101	000997	新大陆	1,280,506.00	2.99
102	600089	特变电工	1,279,839.00	2.99
103	000990	诚志股份	1,261,154.00	2.94
104	603156	养元饮品	1,254,565.80	2.93
105	300146	汤臣倍健	1,253,444.00	2.92
106	600809	山西汾酒	1,248,055.00	2.91
107	600315	上海家化	1,244,208.00	2.90
108	300145	中金环境	1,237,433.00	2.89
109	603198	迎驾贡酒	1,233,376.60	2.88
110	002156	通富微电	1,231,806.00	2.87
111	600728	佳都科技	1,207,263.00	2.82
112	600755	厦门国贸	1,204,660.00	2.81
113	601098	中南传媒	1,199,894.00	2.80
114	600435	北方导航	1,198,798.00	2.80
115	603885	吉祥航空	1,151,704.00	2.69
116	688005	容百科技	1,140,267.07	2.66
117	688536	思瑞浦	1,130,812.76	2.64
118	600153	建发股份	1,127,650.00	2.63
119	300024	机器人	1,103,982.00	2.58
120	601333	广深铁路	1,099,616.00	2.56
121	002985	北摩高科	1,089,271.00	2.54
122	600642	申能股份	1,089,119.00	2.54
123	002901	大博医疗	1,081,750.00	2.52
124	002092	中泰化学	1,070,355.00	2.50
125	603256	宏和科技	1,065,388.00	2.49
126	603515	欧普照明	1,061,550.00	2.48

127	000519	中兵红箭	1,058,395.00	2.47
128	002254	泰和新材	1,056,533.00	2.46
129	000970	中科三环	1,050,119.00	2.45
130	600426	华鲁恒升	1,047,738.00	2.44
131	603290	斯达半导	1,046,922.00	2.44
132	000932	华菱钢铁	1,039,942.00	2.43
133	600645	中源协和	1,039,191.00	2.42
134	002124	天邦股份	1,030,170.00	2.40
135	002867	周大生	1,029,292.00	2.40
136	300285	国瓷材料	1,025,594.00	2.39
137	600546	山煤国际	1,019,859.00	2.38
138	002563	森马服饰	1,017,905.00	2.37
139	300769	德方纳米	1,006,804.00	2.35
140	000717	韶钢松山	1,000,380.00	2.33
141	600754	锦江酒店	994,765.00	2.32
142	600348	华阳股份	981,380.00	2.29
143	300363	博腾股份	977,030.00	2.28
144	002635	安洁科技	975,239.00	2.27
145	603929	亚翔集成	956,817.00	2.23
146	000778	新兴铸管	955,799.00	2.23
147	002423	中粮资本	950,349.80	2.22
148	002080	中材科技	943,578.00	2.20
149	000938	紫光股份	938,750.00	2.19
150	601099	太平洋	935,066.12	2.18
151	000739	普洛药业	929,912.00	2.17
152	600030	中信证券	924,761.00	2.16
153	300750	宁德时代	924,266.00	2.16
154	000685	中山公用	923,805.00	2.15

155	603986	兆易创新	910,806.00	2.12
156	300162	雷曼光电	909,011.00	2.12
157	002532	天山铝业	906,133.00	2.11
158	688185	康希诺	905,609.56	2.11
159	601179	中国西电	905,299.00	2.11
160	300296	利亚德	896,384.00	2.09
161	600392	盛和资源	893,242.00	2.08
162	002839	张家港行	891,569.00	2.08
163	002048	宁波华翔	889,815.00	2.08
164	000825	太钢不锈	887,239.00	2.07
165	002191	劲嘉股份	883,462.00	2.06
166	000060	中金岭南	883,133.00	2.06
167	600188	兖矿能源	883,030.00	2.06
168	300633	开立医疗	880,122.00	2.05
169	600760	中航沈飞	878,872.00	2.05
170	600158	中体产业	872,421.00	2.03
171	600325	华发股份	869,030.00	2.03

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	600372	中航电子	3,845,834.00	8.97
2	300316	晶盛机电	3,308,649.00	7.72
3	002709	天赐材料	2,980,569.00	6.95
4	000887	中鼎股份	2,860,276.88	6.67
5	600808	马钢股份	2,677,420.00	6.25

6	002648	卫星化学	2,553,445.80	5.96
7	002138	顺络电子	2,543,146.00	5.93
8	600884	杉杉股份	2,536,264.10	5.92
9	300207	欣旺达	2,532,486.00	5.91
10	600141	兴发集团	2,398,763.00	5.60
11	300223	北京君正	2,347,430.00	5.48
12	000799	酒鬼酒	2,297,252.00	5.36
13	600869	远东股份	2,275,760.00	5.31
14	603486	科沃斯	2,175,019.00	5.07
15	601600	中国铝业	2,169,660.00	5.06
16	600426	华鲁恒升	2,075,455.70	4.84
17	002317	众生药业	2,072,185.00	4.83
18	601598	中国外运	2,055,673.00	4.80
19	000039	中集集团	2,043,238.00	4.77
20	002078	太阳纸业	2,028,205.00	4.73
21	002013	中航机电	2,016,110.00	4.70
22	000930	中粮科技	1,985,302.08	4.63
23	600008	首创环保	1,963,767.30	4.58
24	600497	驰宏锌锗	1,960,526.00	4.57
25	600460	士兰微	1,912,822.00	4.46
26	000807	云铝股份	1,849,014.00	4.31
27	000012	南玻 A	1,815,025.00	4.23
28	603444	吉比特	1,811,120.00	4.22
29	000553	安道麦 A	1,785,629.00	4.17
30	000830	鲁西化工	1,783,410.00	4.16
31	000898	鞍钢股份	1,777,307.00	4.15
32	600549	厦门钨业	1,774,420.00	4.14
33	002223	鱼跃医疗	1,758,796.50	4.10

34	300274	阳光电源	1,739,146.00	4.06
35	300037	新宙邦	1,728,815.00	4.03
36	601689	拓普集团	1,680,975.00	3.92
37	002080	中材科技	1,678,281.16	3.91
38	600435	北方导航	1,664,195.00	3.88
39	601699	潞安环能	1,653,921.00	3.86
40	000990	诚志股份	1,651,360.00	3.85
41	002183	怡亚通	1,642,664.00	3.83
42	000937	冀中能源	1,606,349.00	3.75
43	002408	齐翔腾达	1,582,144.20	3.69
44	600256	广汇能源	1,575,323.00	3.67
45	002266	浙富控股	1,572,738.00	3.67
46	601233	桐昆股份	1,566,137.77	3.65
47	002821	凯莱英	1,564,415.00	3.65
48	688099	晶晨股份	1,541,915.49	3.60
49	603225	新凤鸣	1,529,205.00	3.57
50	300012	华测检测	1,518,862.58	3.54
51	600967	内蒙一机	1,509,678.00	3.52
52	300474	景嘉微	1,508,146.00	3.52
53	688029	南微医学	1,489,510.96	3.47
54	601636	旗滨集团	1,481,068.00	3.45
55	002268	卫士通	1,468,614.00	3.43
56	603260	合盛硅业	1,467,474.00	3.42
57	601098	中南传媒	1,444,812.00	3.37
58	300146	汤臣倍健	1,444,728.00	3.37
59	600765	中航重机	1,429,805.00	3.34
60	002458	益生股份	1,424,776.00	3.32
61	002423	中粮资本	1,406,583.80	3.28

62	002128	电投能源	1,397,903.00	3.26
63	600908	无锡银行	1,395,367.00	3.25
64	600779	水井坊	1,394,309.00	3.25
65	002203	海亮股份	1,385,226.00	3.23
66	600089	特变电工	1,382,238.00	3.22
67	000960	锡业股份	1,358,485.00	3.17
68	600875	东方电气	1,358,482.00	3.17
69	300009	安科生物	1,348,864.80	3.15
70	601577	长沙银行	1,344,191.00	3.14
71	600755	厦门国贸	1,325,201.00	3.09
72	603198	迎驾贡酒	1,318,376.00	3.08
73	002185	华天科技	1,298,854.69	3.03
74	000519	中兵红箭	1,297,836.00	3.03
75	600809	山西汾酒	1,294,005.00	3.02
76	600782	新钢股份	1,291,882.00	3.01
77	000983	山西焦煤	1,287,850.50	3.00
78	002396	星网锐捷	1,279,499.62	2.98
79	600388	龙净环保	1,271,598.35	2.97
80	603885	吉祥航空	1,265,438.00	2.95
81	002156	通富微电	1,241,451.00	2.90
82	601928	凤凰传媒	1,233,977.00	2.88
83	002867	周大生	1,203,273.00	2.81
84	600820	隧道股份	1,201,041.00	2.80
85	300769	德方纳米	1,186,773.00	2.77
86	300168	万达信息	1,178,683.00	2.75
87	603156	养元饮品	1,174,770.32	2.74
88	300145	中金环境	1,169,992.00	2.73
89	603868	飞科电器	1,162,715.00	2.71

90	300618	寒锐钴业	1,138,614.00	2.66
91	600862	中航高科	1,121,796.00	2.62
92	600409	三友化工	1,120,550.00	2.61
93	600153	建发股份	1,112,678.00	2.60
94	600060	海信视像	1,108,127.00	2.58
95	600038	中直股份	1,105,171.00	2.58
96	600639	浦东金桥	1,104,053.00	2.58
97	002092	中泰化学	1,101,435.00	2.57
98	601333	广深铁路	1,098,794.00	2.56
99	600500	中化国际	1,086,205.00	2.53
100	600516	方大炭素	1,081,803.00	2.52
101	300024	机器人	1,076,517.00	2.51
102	601139	深圳燃气	1,067,697.00	2.49
103	600258	首旅酒店	1,067,441.00	2.49
104	603077	和邦生物	1,054,071.00	2.46
105	601009	南京银行	1,047,431.00	2.44
106	601615	明阳智能	1,044,907.00	2.44
107	601958	金钼股份	1,041,914.00	2.43
108	002745	木林森	1,036,263.00	2.42
109	002901	大博医疗	1,035,836.00	2.42
110	000738	航发控制	1,022,444.00	2.38
111	600885	宏发股份	1,018,454.00	2.38
112	002254	泰和新材	1,014,889.00	2.37
113	002635	安洁科技	1,000,347.00	2.33
114	600645	中源协和	999,395.00	2.33
115	600201	生物股份	998,694.00	2.33
116	600845	宝信软件	998,209.00	2.33
117	600030	中信证券	980,628.00	2.29

118	300750	宁德时代	979,019.00	2.28
119	002985	北摩高科	977,375.00	2.28
120	000998	隆平高科	976,809.00	2.28
121	000825	太钢不锈	976,538.00	2.28
122	600348	华阳股份	975,986.00	2.28
123	002281	光迅科技	972,059.00	2.27
124	600315	上海家化	970,797.00	2.26
125	600392	盛和资源	970,700.00	2.26
126	000959	首钢股份	967,763.00	2.26
127	603256	宏和科技	960,122.00	2.24
128	002048	宁波华翔	953,274.00	2.22
129	603515	欧普照明	952,062.50	2.22
130	000970	中科三环	944,666.00	2.20
131	603986	兆易创新	934,594.00	2.18
132	000932	华菱钢铁	930,986.00	2.17
133	603568	伟明环保	929,750.20	2.17
134	002191	劲嘉股份	928,894.00	2.17
135	601801	皖新传媒	928,241.00	2.17
136	600018	上港集团	926,953.00	2.16
137	600970	中材国际	922,121.00	2.15
138	300285	国瓷材料	905,276.00	2.11
139	000717	韶钢松山	905,275.00	2.11
140	002839	张家港行	895,101.00	2.09
141	002180	纳思达	892,190.00	2.08
142	601099	太平洋	891,351.08	2.08
143	603883	老百姓	886,471.00	2.07
144	600563	法拉电子	885,991.00	2.07
145	605358	立昂微	876,179.00	2.04

146	002294	信立泰	873,208.00	2.04
147	603290	斯达半导	868,606.00	2.03
148	601127	小康股份	862,792.00	2.01
149	000778	新兴铸管	861,193.00	2.01
150	603816	顾家家居	859,110.00	2.00

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	444,485,862.73
卖出股票收入(成交)总额	398,326,122.23

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。

### 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

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货持仓。

### 8.10.2 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持仓。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

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	14,911.18
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	897.77
5	应收申购款	194,399.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	210,208.48

#### 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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 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 500 指 数 增 强 发 起 式 A	2,324	9,440.20	10,050,188.52	45.81%	11,888,835.89	54.19%
万 家 中 证 500 指 数 增 强 发 起 式 C	4,874	6,780.91	20,660,312.78	62.51%	12,389,860.07	37.49%
合计	7,032	7,819.85	30,710,501.30	55.85%	24,278,695.96	44.15%

### 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 500 指数 增强发起	114,802.86	0.5233%

	式 A		
	万家中证 500 指数 增强发起 式 C	26,297.79	0.0796%
	合计	141,100.65	0.2566%

### 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 500 指数增 强发起式 A	0
	万家中证 500 指数增 强发起式 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	万家中证 500 指数增 强发起式 A	0
	万家中证 500 指数增 强发起式 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	10,001,000.10	18.19	10,001,000.10	18.19	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	10,001,000.10	18.19	10,001,000.10	18.19	3 年

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家中证 500 指数 增强发起式 A	万家中证 500 指数 增强发起式 C
基金合同生效日（2019 年 5 月 23 日）基金 份额总额	193,620,037.68	22,381,542.21
本报告期期初基金份额总额	20,660,822.08	7,396,110.40
本报告期基金总申购份额	14,921,745.98	49,735,641.62
减:本报告期基金总赎回份额	13,643,543.65	24,081,579.17
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	21,939,024.41	33,050,172.85

## § 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：

2021 年 3 月 16 日，公司聘任陈广益先生担任公司总经理。

2021 年 7 月 20 日，公司聘任戴晓云女士担任公司副总经理。

2021 年 7 月 20 日，李杰先生因个人原因离职，不再担任本公司副总经理职务。

2021 年 7 月 24 日，公司聘任王静女士担任公司副总经理。

2021 年 8 月 28 日，满黎先生因个人原因离职，不再担任本公司副总经理职务。

基金托管人：

2021 年 6 月 30 日，中国工商银行股份有限公司发布公告，任命刘彤女士担任中国工商银行股份有限公司资产托管部总经理，李勇先生不再担任本公司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。

### 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

报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况未发生改变。

### 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 成交总额的比	佣金	占当期佣金 总量的比例	

			例			
上海证券	1	381,119,688.38	45.26%	354,943.63	46.14%	-
中泰证券	1	346,621,448.52	41.17%	310,679.13	40.39%	-
东亚前海证 券	2	100,448,571.45	11.93%	93,548.68	12.16%	-
国元证券	3	13,786,924.53	1.64%	10,081.94	1.31%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
第一创业证 券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财 富证券	1	-	-	-	-	-

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,本基金新增第一创业证券交易单元 2 个,东亚前海证券交易单元 2 个,山西证券交易单元 2 个,大同证券交易单元 1 个,长城证券交易单元 1 个,民生证券交易单元 1 个,德邦证券交易单元 2 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	20210101 - 20211228	10,001,000.10	-	-	10,001,000.10	18.19%
	2	20211229 - 20211231	-	11,345,221.53	-	11,345,221.53	20.63%
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>							

## § 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 500 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、更新招募说明书及其他临时公告。
- 5、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2021 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 500 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](http://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

2022 年 3 月 30 日