

万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资 基金 2022 年中期报告

2022 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：2022 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 2022 年 8 月 29 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 2022 年 1 月 1 日起至 2022 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	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	50
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	62
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	62

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	62
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	62
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	62
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12 投资组合报告附注	62
§ 8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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情况	64
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	64
§ 9 开放式基金份额变动	64
§ 10 重大事件揭示	65
10.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4 基金投资策略的改变	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
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	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
10.8 其他重大事件	66
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
§ 12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

§ 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	789,984,331.52 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	407,059,783.12 份	382,924,548.40 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
		张燕
		0755-83199084
		yan_zhang@cmbchina.com

客户服务电话	4008880800	95555
传真	021-38909627	0755-83195201
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200122	518040
法定代表人	方一天	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
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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日)	
	万家中证 1000 指数增强 A	万家中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	-28,966,796.18	-33,115,962.48
本期利润	-3,394,779.72	-19,469,041.71
加权平均基金份额本期利润	-0.0108	-0.0606
本期加权平均净值利润率	-0.90%	-5.07%
本期基金份额净值增长率	-4.09%	-4.28%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	117,851,300.27	109,436,309.64
期末可供分配利润		

期末可供分配基金份额利润	0.2895	0.2858
期末基金资产净值	524,911,083.39	492,360,858.04
期末基金份额净值	1.2895	1.2858
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	119.55%	116.95%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润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	12.62%	1.47%	9.60%	1.24%	3.02%	0.23%
过去三个月	5.87%	1.98%	3.21%	1.95%	2.66%	0.03%
过去六个月	-4.09%	1.81%	-11.95%	1.78%	7.86%	0.03%
过去一年	12.09%	1.54%	-0.96%	1.51%	13.05%	0.03%
过去三年	91.50%	1.44%	30.49%	1.44%	61.01%	0.00%
自基金合同生效起至今	119.55%	1.47%	48.61%	1.49%	70.94%	-0.02%

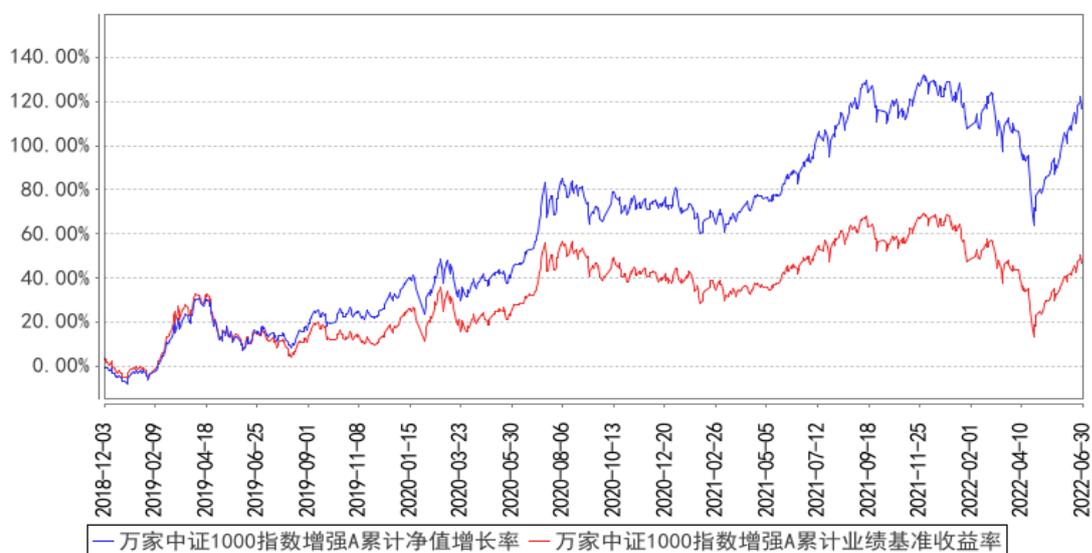
万家中证 1000 指数增强 C

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	12.58%	1.47%	9.60%	1.24%	2.98%	0.23%
过去三个月	5.77%	1.98%	3.21%	1.95%	2.56%	0.03%
过去六个月	-4.28%	1.81%	-11.95%	1.78%	7.67%	0.03%
过去一年	11.64%	1.54%	-0.96%	1.51%	12.60%	0.03%
过去三年	89.11%	1.44%	30.49%	1.44%	58.62%	0.00%
自基金合同生效起至今	116.95%	1.47%	48.61%	1.49%	68.34%	-0.02%

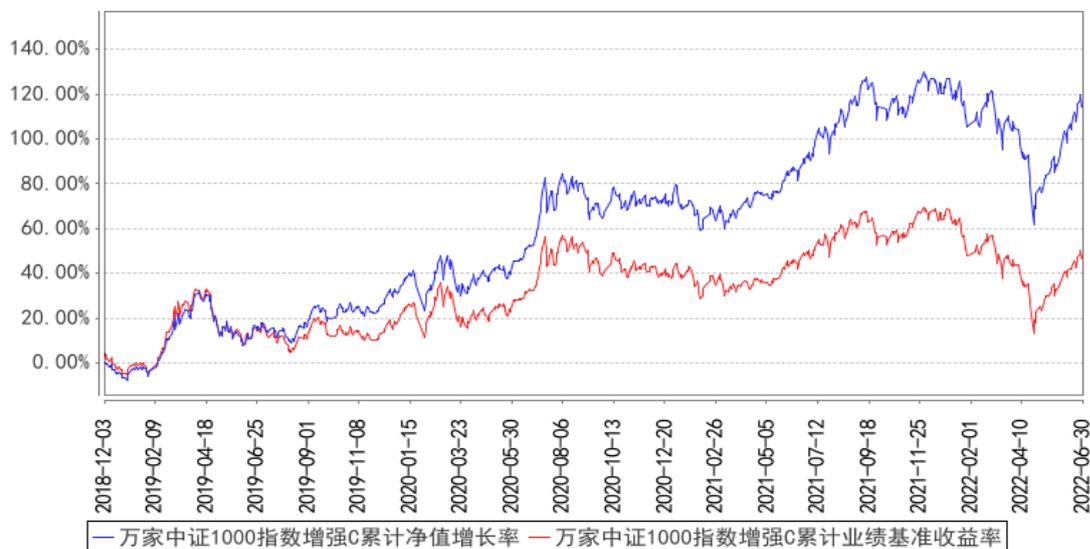
注：基金业绩比较基准增长率=中证 1000 指数收益率*95%+一年期人民币定期存款利率（税后）*5%。

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 3 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、山东省新动能基金管理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。目前管理一百零九只开放式基金,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、万家科创主题灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、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证券投资基金、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、万家港股通精选混合型证券投资基金、万家景气驱动混合型证券投资基金、万家安恒纯债 3 个月持有期债券型发起式证券投资基金、万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫橙纯债债券型证券投资基金、万家聚优稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、万家新能源主题混合型发起式证券投资基金、万家中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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 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	2019 年 8 月 21 日	-	15.5 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。

	指数增强型基金的基金经理				
--	--------------	--	--	--	--

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。

4.2 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 2 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。本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 的基金份额净值为 1.2895 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.09%，同期业绩比较基准收益率为-11.95%，截至本报告期末万家中证 1000 指数增强 C 的基金份额净值为 1.2858 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.28%，同期业绩比较基准收益率为-11.95%。基金报告期末 A 份额、C 份额日均跟踪偏离度分别为 0.2179%、0.2175%，年跟踪误差分别为 4.3364%、4.3287%，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 2022 上半年，整体上，A 股市场表现受到多重因素的扰动，外围市场有地缘政治冲突、通胀高企、部分海外央行开启加息周期的影响，国内受到疫情反复影响，投资者信心不足，投资者避险情绪升温，制约包括 A 股在内的全球风险资产表现。具体而言，在一季度中，A 股整体呈现震荡下跌态势，行业风格从热门赛道切换到传统价值蓝筹；在二季度中，A 股市场二次探底，随后在稳增长政策大力加码下，市场开启反弹，整体呈现 V 型反弹态势。尤其是 5 月以来在海外市场大幅下跌的环境下走出独立反弹行情，反应出 A 股市场和中国经济的强劲韧性。

展望 2022 下半年，A 股已从情绪驱动回归基本面驱动的常态并将进入政策的关键发力期。稳增长政策正逐步进入执行落地阶段，下半年中国经济将进一步修复。货币政策方面，资金面持续宽松充裕。流动性方面，上半年流动性宽松起因财政投放，下半年流动性依然不可忽视财政的作用。通胀方面，今年上半年海外（尤其美国）通胀上行幅度历史罕见，下半年 PPI 通胀有望稳步下行，但下行空间受到供求关系制约。CPI 上行空间和节奏主要由猪价确定，全球“滞胀”向我国的传导构成最大的不确定性。需求端，内需贡献有望在 2022 下半年回升，其中投资先行，消费次之。生产端，二、三产业增长在 2022 年下半年均将有所回升。但总体而言，原材料成本高昂、外需增长减速等因素可能在一定程度上抑制制造业增加值和盈利反弹的“高度”，以及总体制造业产能扩张的力度。

配置层面，下半年 A 股主要的投资主线是市场风格和政策催化，特别是稳增长政策及预期较低的板块带来的投资机会，不同行业和投资主题的高低轮动将会是未来的主旋律。具体来看，一高景气优势成长板块，如新能源车、风光电、军工、计算机。二是疫后修复，消费聚焦出清、反转逻辑，如白酒、生猪、酒店、汽车零部件、大众消费品。三是稳增长板块，如基建、房地产。

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》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金在报告期内未实施利润分配。

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

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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合规守信、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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	22,416,110.27	17,729,574.45
结算备付金		62,532,913.88	25,899,350.66
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	956,838,024.22	641,995,114.15
其中：股票投资		956,838,024.22	641,995,114.15
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-

应收申购款		9,857,578.90	4,297,967.09
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	4,503.15
资产总计		1,051,644,627.27	689,926,509.50
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		32,976,402.85	5,022,354.83
应付管理人报酬		757,780.02	587,407.88
应付托管费		151,556.00	117,481.56
应付销售服务费		150,552.71	130,286.67
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	336,394.26	217,134.74
负债合计		34,372,685.84	6,074,665.68
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	789,984,331.52	508,887,576.10
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	227,287,609.91	174,964,267.72
净资产合计		1,017,271,941.43	683,851,843.82
负债和净资产总计		1,051,644,627.27	689,926,509.50

注：1、报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额总额 789,984,331.52 份，其中万家中证 1000 指数增强 A 基金份额净值 1.2895 元，基金份额总额 407,059,783.12 份；万家中证 1000 指数增强 C 基金份额净值 1.2858 元，基金份额总额 382,924,548.40 份。

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

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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-17,464,478.02	18,175,769.00
1. 利息收入		81,774.34	21,214.10
其中：存款利息收入	6.4.7.10	81,774.34	21,214.10
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）		-58,533,169.17	13,208,098.82
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-62,279,898.21	12,441,500.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
收益		-	-
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	3,746,729.04	766,598.12
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	39,218,937.23	4,330,680.79
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	1,767,979.58	615,775.29
减：二、营业总支出		5,399,343.41	2,184,139.94
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,745,581.50	711,386.32
2. 托管费	6.4.10.2.2	749,116.32	142,277.24
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	758,049.06	140,109.85
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.20	146,596.53	1,190,366.53

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-22,863,821.43	15,991,629.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-22,863,821.43	15,991,629.06
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-22,863,821.43	15,991,629.06

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

6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	508,887,576.10	-	174,964,267.72	683,851,843.82
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	508,887,576.10	-	174,964,267.72	683,851,843.82
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	281,096,755.42	-	52,323,342.19	333,420,097.61
(一)、综合收	-	-	-22,863,821.43	-22,863,821.43

益总额				
(二)、 本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	281,096,755.42	-	75,187,163.62	356,283,919.04
其中:1.基金申购款	906,274,007.58	-	196,370,097.45	1,102,644,105.03
2.基金赎回款	-625,177,252.16	-	-121,182,933.83	-746,360,185.99
(三)、 本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、 其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	789,984,331.52	-	227,287,609.91	1,017,271,941.43
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基	13,257,277.16	-	4,928,028.40	18,185,305.56

金净值)				
加:会计 政策变 更	-	-	-	-
前 期差 错 更 正	-	-	-	-
其 他	-	-	-	-
二、本 期初 净 资 产(基 金净 值)	13,257,277.16	-	4,928,028.40	18,185,305.56
三、本 期增 减变 动额 (减 少以 “-” 号填 列)	95,684,224.47	-	11,532,063.38	107,216,287.85
(一)、 综合 收 益 总 额	-	-	15,991,629.06	15,991,629.06
(二)、 本 期 基 金 份 额 交 易 产 生 的 基 金 净 值 变 动 数 (净 值 减 少 以 “-” 号 填 列)	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
(三)、 本 期 向 基 金 份 额 持 有 人 分 配 利 润 产 生 的 基	-	-	-4,392,796.13	-4,392,796.13

金净值变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	108,941,501.63	-	16,460,091.78	125,401,593.41

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：

<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

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股、备选成份股、其他股票（包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中小企业私募债券、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、债券回购、银行存款、同业存单、资产支持证券、金融衍生品（包括权证、股指期货、国债期货、股票期权等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可参与融资业务和转融通证券出借交易。如法律法规或监管机构以后允许基金投资

其他品种，本基金在履行适当程序后可将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率*95%+一年期人民币定期存款利率（税后）*5%。

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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本中期报告所采用的在金融工具相关会计准则上与上年度报告不一致，其他会计政策、会计估计与上年度报告一致。

会计政策变更：

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，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新准则与现行准则的差异追溯调整报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。本基金需考虑自身业务模式以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金在编制 2022 年中期财务报表时已采用上述准则，对本基金财务报表的影响具体请参见附注 6.4.5.1 会计政策变更的说明。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

1、 金融资产的分类

自 2022 年 1 月 1 日起适用

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、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金目前暂无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

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以摊余成本计量的金融资产，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

2022 年 1 月 1 日前适用

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

自 2022 年 1 月 1 日起适用

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

2022 年 1 月 1 日前适用

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金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卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

自 2022 年 1 月 1 日起适用

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。其他金融资产和以摊余成本计量的金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。在考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息的基础上，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失，应当分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，按照未来 12 个月内（若预期存续期少于 12 个月，则为预期存续期内）的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。本基金确定金融工具在估值日只具有较低的信用风险的，可以假设该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加（即处于第一阶段）。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取金融资产现金流量的合同权利终止；（2）金融资产已转移，且已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；（3）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，但是未保留对金融资产的控制。

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。

2022 年 1 月 1 日前适用

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；

对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

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

6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

自 2022 年 1 月 1 日起适用

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。资产支持证券在持有期间收到的款项,根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分,将本金部分冲减资产支持证券投资成本,并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

其他金融资产在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

2022 年 1 月 1 日前适用

(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。

6.4.4.4 费用的确认和计量

自 2022 年 1 月 1 日起适用

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

2022 年 1 月 1 日前适用

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率逐日计提；

(3) 基金的 A 类基金份额不收取销售服务费；本基金的 C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 的年费率逐日计提；

(4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响

基金份额净值小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

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,根据衔接规定,对可比期间信息不予调整,首日执行新准则与现行准则的差异追溯调整报告期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式,确定了三个主要的计量类别:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。本基金需考虑自身业务模式以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”,适用于以摊余成本计量的金融资产和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

2022 年 1 月 1 日各项金融资产和金融负债按照修订前后金融工具确认计量准则的规定进行分类和计量结果对比如下:

金融资产/负债类别	修订前的金融工具确认计量准则		修订后的金融工具确认计量准则	
	计量类别	账面价值	计量类别	账面价值
金融资产				
银行存款	摊余成本(应收款项)	17,729,574.45	摊余成本	17,730,730.13
结算备付金	摊余成本(应收款项)	25,899,350.66	摊余成本	25,902,697.58
交易性金融资产	以公允价值计量且其变动计入当期损益	641,995,114.15	以公允价值计量且其变动计入当期损益	641,995,114.15
应收利息	摊余成本(应收款项)	4,503.15	—	—
应收申购款	摊余成本(应收款项)	4,297,967.09	摊余成本	4,297,967.64
金融负债				
应付赎回款	摊余成本	5,022,354.83	摊余成本	5,022,354.83
应付管理人报酬	摊余成本	587,407.88	摊余成本	587,407.88
应付托管费	摊余成本	117,481.56	摊余成本	117,481.56
应付销售服务费	摊余成本	130,286.67	摊余成本	130,286.67

其他负债	摊余成本	217,134.74	摊余成本	217,134.74
------	------	------------	------	------------

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

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；

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收增值税。

(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；

目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内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；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税。

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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	22,416,110.27
等于：本金	22,413,747.94
加：应计利息	2,362.33
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
合计	22,416,110.27

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	916,664,077.95	-	956,838,024.22	40,173,946.27
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	916,664,077.95	-	956,838,024.22	40,173,946.27

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 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,237.73
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	201,822.86

应付指数使用费	83,641.17
其他	44,692.50
合计	336,394.26

6.4.7.7 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	230,974,168.43	230,974,168.43
本期申购	336,648,476.14	336,648,476.14
本期赎回（以“-”号填列）	-160,562,861.45	-160,562,861.45
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	407,059,783.12	407,059,783.12

万家中证 1000 指数增强 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	277,913,407.67	277,913,407.67
本期申购	569,625,531.44	569,625,531.44
本期赎回（以“-”号填列）	-464,614,390.71	-464,614,390.71
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	382,924,548.40	382,924,548.40

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.9 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
本期期初	102,433,125.81	-22,870,945.03	79,562,180.78
本期利润	-28,966,796.18	25,572,016.46	-3,394,779.72
本期基金份额交易产生的变动数	62,071,288.55	-20,387,389.34	41,683,899.21
其中：基金申购款	118,337,845.10	-40,778,864.30	77,558,980.80

基金赎回款	-56,266,556.55	20,391,474.96	-35,875,081.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	135,537,618.18	-17,686,317.91	117,851,300.27

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
本期期初	122,892,126.51	-27,490,039.57	95,402,086.94
本期利润	-33,115,962.48	13,646,920.77	-19,469,041.71
本期基金份额交易产生的变动数	36,359,318.54	-2,856,054.13	33,503,264.41
其中：基金申购款	197,732,710.58	-78,921,593.93	118,811,116.65
基金赎回款	-161,373,392.04	76,065,539.80	-85,307,852.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	126,135,482.57	-16,699,172.93	109,436,309.64

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	33,529.67
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	48,164.14
其他	80.53
合计	81,774.34

注：结算备付金利息收入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。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-62,279,898.21
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-62,279,898.21

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
----	----------------------------

卖出股票成交总额	3,530,797,013.07
减：卖出股票成本总额	3,584,351,894.86
减：交易费用	8,725,016.42
买卖股票差价收入	-62,279,898.21

6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,746,729.04
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	3,746,729.04

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	39,218,937.23
股票投资	39,218,937.23
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	39,218,937.23

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,764,353.98
基金转换费收入	3,625.60
合计	1,767,979.58

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	4,844.39
指数使用费	59,929.28
合计	146,596.53

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,中国证监会核准新疆国际实业股份有限公司将其持有的万家基金 40%股权转让给山东省新动能基金管理有限公司。股权变更后,万家基金股东变更为中泰证券股份有限公司(49%),山东省新动能基金管理有限公司(40%),齐河众鑫投资有限公司(11%)。

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

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

本基金本报告期及上年度可比期间未产生关联方佣金。

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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,745,581.50	711,386.32
其中:支付销售机构的客户维护费	1,422,244.07	317,418.97

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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	749,116.32	142,277.24

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	-	47,283.32	47,283.32
招商银行股份有限公司	-	26,486.04	26,486.04
中泰证券股份有限公司	-	1,617.31	1,617.31
合计	-	75,386.67	75,386.67
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 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

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 类基金份额前一日的基金资产净值

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 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	2.4290%	-
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	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	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减:报告期内赎回/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%	-

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	22,416,110.27	33,529.67	7,883,105.65	17,139.31

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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间没有需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

报告期内,本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末(2022 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	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

300834	星辉环材	2022 年 1 月 6 日	6 个月	新股流通受限	55.57	30.03	360	20,005.20	10,810.80	-
301103	何氏眼科	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股流通受限	42.50	32.02	507	16,575.00	16,234.14	-
301112	信邦智能	2022 年 6 月 20 日	6 个月	新股流通受限	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-
301116	益客食品	2022 年 1 月 10 日	6 个月	新股流通受限	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301117	佳缘科技	2022 年 1 月 7 日	6 个月	新股流通受限	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	-
301122	采纳股份	2022 年 1 月 19 日	6 个月	新股流通受限	50.31	70.37	301	15,143.31	21,181.37	-
301123	奕东电子	2022 年 1 月 14 日	6 个月	新股流通受限	37.23	25.39	568	21,146.64	14,421.52	-
301125	腾亚精工	2022 年 5 月 27 日	6 个月	新股流通受限	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-
301130	西点药业	2022 年 2 月 16 日	6 个月	新股流通受限	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301135	瑞德智能	2022 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-
301137	哈焊华通	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股流通受限	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
301151	冠龙节能	2022 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	30.82	21.46	703	21,666.46	15,086.38	-
301153	中科江南	2022 年 5 月 10 日	6 个月	新股流通受限	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-
301158	德石股份	2022 年 1 月 7 日	6 个月	新股流通受限	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301175	中科环保	2022 年 6 月 30 日	1 个月内(含)	新股未上市	3.82	3.82	57,324	218,977.68	218,977.68	-

		日									
301175	中科环保	2022年6月30日	6个月	新股流通受限	3.82	3.82	6,370	24,333.40	24,333.40		-
301181	标榜股份	2022年2月11日	6个月	新股流通受限	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63		-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新股流通受限	64.08	37.52	247	15,827.76	9,267.44		-
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	6个月	新股流通受限	56.88	56.42	318	18,087.84	17,941.56		-
301215	中汽股份	2022年2月28日	6个月	新股流通受限	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77		-
301216	万凯新材	2022年3月21日	6个月	新股流通受限	35.68	29.84	747	26,652.96	22,290.48		-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	新股流通受限	173.98	87.82	202	19,485.76	17,739.64		-
301220	亚香股份	2022年6月15日	6个月	新股流通受限	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75		-
301222	浙江恒威	2022年3月2日	6个月	新股流通受限	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72		-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	1个月内(含)	新股未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36		-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	6个月	新股流通受限	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16		-
301235	华康医疗	2022年1月21日	6个月	新股流通受限	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74		-
301238	瑞泰新材	2022年6月10日	6个月	新股流通受限	19.18	32.07	2,441	46,818.38	78,282.87		-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	1个月内(含)	新股未上市	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80		-
301239	普瑞	2022年	6个月	新股流	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75		-

	眼科	6月22日		通受限							
301256	华融化学	2022年3月14日	6个月	新股流通受限	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48		-
301263	泰恩康	2022年3月22日	6个月	新股流通受限	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16		-
301266	宇邦新材	2022年5月30日	6个月	新股流通受限	26.86	47.07	517	13,886.62	24,335.19		-
301268	铭利达	2022年3月29日	6个月	新股流通受限	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67		-
301286	侨源股份	2022年6月6日	6个月	新股流通受限	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36		-
301298	东利机械	2022年5月27日	6个月	新股流通受限	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22		-
301302	华如科技	2022年6月16日	6个月	新股流通受限	52.03	56.42	423	22,008.69	23,865.66		-
688220	翱捷科技	2022年1月6日	6个月	新股流通受限	164.54	68.59	3,331	548,082.74	228,473.29		-
688234	天岳先进	2022年1月5日	6个月	新股流通受限	82.79	65.19	3,283	271,799.57	214,018.77		-
688282	理工导航	2022年3月10日	6个月	新股流通受限	65.21	45.37	3,185	207,693.85	144,503.45		-
688400	凌云光	2022年6月27日	1个月内(含)	新股未上市	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23		-

6.4.12.2 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。

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 2022 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 2022 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（2022 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 2022 年 6 月 30 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	22,416,110.27	-	-	-	-	-	22,416,110.27
结算备付金	62,532,913.88	-	-	-	-	-	62,532,913.88

交易性金融资产	-	-	-	-	-	-956,838,024.22	956,838,024.22
应收申购款	24,123.10	-	-	-	-	9,833,455.80	9,857,578.90
资产总计	84,973,147.25	-	-	-	-	-966,671,480.02	1,051,644,627.27
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	32,976,402.85	32,976,402.85
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	757,780.02	757,780.02
应付托管费	-	-	-	-	-	151,556.00	151,556.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	150,552.71	150,552.71
其他负债	-	-	-	-	-	336,394.26	336,394.26
负债总计	-	-	-	-	-	34,372,685.84	34,372,685.84
利率敏感度缺口	84,973,147.25	-	-	-	-	-932,298,794.18	1,017,271,941.43
上年度末 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	17,729,574.45	-	-	-	-	-	17,729,574.45
结算备付金	25,899,350.66	-	-	-	-	-	25,899,350.66
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-641,995,114.15	641,995,114.15
其他资产	-	-	-	-	-	4,503.15	4,503.15
应收申购款	3,149.00	-	-	-	-	4,294,818.09	4,297,967.09
资产总计	43,632,074.11	-	-	-	-	-646,294,435.39	689,926,509.50
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,022,354.83	5,022,354.83
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	587,407.88	587,407.88
应付托管费	-	-	-	-	-	117,481.56	117,481.56
应付销售服务费	-	-	-	-	-	130,286.67	130,286.67
其他负债	-	-	-	-	-	217,134.74	217,134.74
负债总计	-	-	-	-	-	6,074,665.68	6,074,665.68
利率敏感度缺口	43,632,074.11	-	-	-	-	-640,219,769.71	683,851,843.82

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 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2021 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（2021 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 2022年6月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	956,838,024.22	94.06	641,995,114.15	93.88
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	956,838,024.22	94.06	641,995,114.15	93.88

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	1. 若股票基准指数发生变动而其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）	
分析	1. 股票基准指数下降 100个基点	-9,914,725.46	-6,811,216.66
	2. 股票基准指数上升	9,914,725.46	6,811,216.66

	100 个基点		
--	---------	--	--

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 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	954,917,844.38	640,187,977.61
第二层次	789,657.38	1,807,136.54
第三层次	1,130,522.46	-
合计	956,838,024.22	641,995,114.15

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、新发未上市、涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本期末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	956,838,024.22	90.98
	其中：股票	956,838,024.22	90.98
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	84,949,024.15	8.08
8	其他各项资产	9,857,578.90	0.94
9	合计	1,051,644,627.27	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	9,907,769.31	0.97
B	采矿业	29,838,304.38	2.93
C	制造业	575,306,093.34	56.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,294,796.00	2.49
E	建筑业	23,398,147.52	2.30
F	批发和零售业	16,193,604.26	1.59
G	交通运输、仓储和邮政业	3,812,728.00	0.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	57,086,377.00	5.61

J	金融业	13,155,570.00	1.29
K	房地产业	17,244,268.00	1.70
L	租赁和商务服务业	6,374,217.14	0.63
M	科学研究和技术服务业	865,368.00	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	2,474,332.00	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	7,610,175.00	0.75
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	788,561,749.95	77.52

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	331,650.00	0.03
B	采矿业	1,532,250.00	0.15
C	制造业	113,743,060.59	11.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	171,738.00	0.02
E	建筑业	7,036,584.00	0.69
F	批发和零售业	3,369,944.16	0.33
G	交通运输、仓储和邮政业	18,411,405.00	1.81
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,249,997.98	1.70
J	金融业	38,710.56	0.00
K	房地产业	4,776,286.20	0.47
L	租赁和商务服务业	20,739.45	0.00
M	科学研究和技术服务业	46,162.51	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	262,065.13	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,285,680.69	0.13

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	168,276,274.27	16.54

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002413	雷科防务	2,172,245	12,055,959.75	1.19
2	600578	京能电力	3,709,100	11,609,483.00	1.14
3	002405	四维图新	744,000	11,212,080.00	1.10
4	600073	上海梅林	1,394,800	11,116,556.00	1.09
5	300429	强力新材	1,139,900	10,817,651.00	1.06
6	601686	友发集团	1,368,700	10,456,868.00	1.03
7	603306	华懋科技	291,500	9,881,850.00	0.97
8	600929	雪天盐业	1,059,700	9,834,016.00	0.97
9	300568	星源材质	336,009	9,757,701.36	0.96
10	600604	市北高新	1,658,500	9,685,640.00	0.95
11	300900	广联航空	361,900	9,662,730.00	0.95
12	688339	亿华通	97,690	9,610,742.20	0.94
13	000090	天健集团	1,391,800	9,589,502.00	0.94
14	300393	中来股份	545,882	9,279,994.00	0.91
15	300373	扬杰科技	128,900	9,184,125.00	0.90
16	300068	南都电源	597,300	9,162,582.00	0.90
17	000989	九芝堂	996,400	9,067,240.00	0.89
18	002298	中电兴发	1,361,500	8,931,440.00	0.88
19	300118	东方日升	301,600	8,845,928.00	0.87
20	002597	金禾实业	203,928	8,836,200.24	0.87
21	300735	光弘科技	840,929	8,787,708.05	0.86
22	688019	安集科技	41,200	8,772,304.00	0.86
23	688516	奥特维	32,485	8,671,870.75	0.85
24	000034	神州数码	563,583	8,577,733.26	0.84
25	603236	移远通信	63,680	8,511,468.80	0.84
26	300856	科思股份	192,300	8,341,974.00	0.82
27	002258	利尔化学	350,580	8,280,699.60	0.81
28	600971	恒源煤电	1,044,800	8,253,920.00	0.81
29	000567	海德股份	543,205	8,039,434.00	0.79
30	002176	江特电机	316,300	7,920,152.00	0.78

31	603959	百利科技	646,696	7,837,955.52	0.77
32	002950	奥美医疗	607,800	7,670,436.00	0.75
33	002085	万丰奥威	1,425,300	7,653,861.00	0.75
34	300143	盈康生命	670,500	7,610,175.00	0.75
35	300131	英唐智控	1,450,900	7,602,716.00	0.75
36	600771	广誉远	212,900	7,483,435.00	0.74
37	300233	金城医药	259,600	7,406,388.00	0.73
38	300477	合纵科技	959,800	7,390,460.00	0.73
39	300226	上海钢联	324,900	7,358,985.00	0.72
40	600211	西藏药业	177,000	7,347,270.00	0.72
41	688388	嘉元科技	86,325	7,326,402.75	0.72
42	603979	金诚信	379,258	7,323,471.98	0.72
43	300761	立华股份	182,900	7,270,275.00	0.71
44	688066	航天宏图	91,200	7,186,560.00	0.71
45	300346	南大光电	199,510	7,178,369.80	0.71
46	603387	基蛋生物	501,640	7,153,386.40	0.70
47	600395	盘江股份	810,000	7,103,700.00	0.70
48	002389	航天彩虹	378,400	6,947,424.00	0.68
49	300382	斯莱克	442,800	6,938,676.00	0.68
50	600129	太极集团	315,800	6,938,126.00	0.68
51	603690	至纯科技	170,900	6,887,270.00	0.68
52	000543	皖能电力	1,722,600	6,873,174.00	0.68
53	688106	金宏气体	348,100	6,805,355.00	0.67
54	300170	汉得信息	741,500	6,680,915.00	0.66
55	002267	陕天然气	950,100	6,641,199.00	0.65
56	603313	梦百合	546,886	6,562,632.00	0.65
57	300130	新国都	527,537	6,467,603.62	0.64
58	688166	博瑞医药	263,900	6,373,185.00	0.63
59	002378	章源钨业	762,900	6,164,232.00	0.61
60	603098	森特股份	166,500	5,970,690.00	0.59
61	600773	西藏城投	302,300	5,955,310.00	0.59
62	601212	白银有色	2,082,000	5,746,320.00	0.56
63	300398	飞凯材料	249,775	5,709,856.50	0.56
64	600305	恒顺醋业	442,500	5,708,250.00	0.56
65	603989	艾华集团	201,912	5,693,918.40	0.56
66	002216	三全食品	289,900	5,679,141.00	0.56
67	002151	北斗星通	178,100	5,620,836.00	0.55
68	603179	新泉股份	189,460	5,494,340.00	0.54
69	688520	神州细胞	103,900	5,374,747.00	0.53
70	000059	华锦股份	884,015	5,233,368.80	0.51
71	603093	南华期货	482,000	5,104,380.00	0.50
72	002428	云南锗业	354,700	4,582,724.00	0.45

73	603328	依顿电子	718,400	4,561,840.00	0.45
74	300861	美畅股份	47,200	4,374,968.00	0.43
75	002344	海宁皮城	930,942	4,347,499.14	0.43
76	600996	贵广网络	630,200	4,335,776.00	0.43
77	002738	中矿资源	45,720	4,234,129.20	0.42
78	300204	舒泰神	311,500	4,180,330.00	0.41
79	600391	航发科技	213,700	4,105,177.00	0.40
80	688680	海优新材	20,600	4,093,220.00	0.40
81	688027	国盾量子	39,976	4,037,576.00	0.40
82	688298	东方生物	33,580	3,833,157.00	0.38
83	002291	星期六	192,300	3,799,848.00	0.37
84	300663	科蓝软件	235,400	3,643,992.00	0.36
85	300438	鹏辉能源	58,885	3,618,483.25	0.36
86	300684	中石科技	248,700	3,469,365.00	0.34
87	002850	科达利	21,500	3,418,500.00	0.34
88	603995	甬金股份	101,400	3,413,124.00	0.34
89	300224	正海磁材	217,900	3,333,870.00	0.33
90	002303	美盈森	959,400	3,309,930.00	0.33
91	002192	融捷股份	20,400	3,135,480.00	0.31
92	688399	硕世生物	25,900	2,953,118.00	0.29
93	600125	铁龙物流	552,500	2,950,350.00	0.29
94	002041	登海种业	125,059	2,637,494.31	0.26
95	600389	江山股份	43,400	2,635,682.00	0.26
96	603599	广信股份	92,980	2,617,387.00	0.26
97	300682	朗新科技	100,000	2,519,000.00	0.25
98	002318	久立特材	156,904	2,508,894.96	0.25
99	300596	利安隆	55,200	2,434,872.00	0.24
100	300428	立中集团	72,340	2,390,837.00	0.24
101	300855	图南股份	56,900	2,377,851.00	0.23
102	000893	亚钾国际	68,800	2,367,408.00	0.23
103	300748	金力永磁	63,600	2,340,480.00	0.23
104	688598	金博股份	7,738	2,280,388.60	0.22
105	002545	东方铁塔	193,400	2,200,892.00	0.22
106	002100	天康生物	209,300	2,034,396.00	0.20
107	002643	万润股份	96,100	2,004,646.00	0.20
108	300593	新雷能	47,700	1,980,027.00	0.19
109	300035	中科电气	70,500	1,970,475.00	0.19
110	600172	黄河旋风	222,800	1,942,816.00	0.19
111	300910	瑞丰新材	30,200	1,909,244.00	0.19
112	688063	派能科技	6,100	1,904,420.00	0.19
113	300696	爱乐达	43,200	1,898,640.00	0.19
114	002906	华阳集团	41,500	1,880,365.00	0.18

115	601330	绿色动力	239,900	1,878,417.00	0.18
116	603583	捷昌驱动	55,500	1,853,145.00	0.18
117	002747	埃斯顿	73,500	1,800,750.00	0.18
118	688508	芯朋微	23,910	1,781,295.00	0.18
119	603596	伯特利	22,200	1,779,996.00	0.17
120	600873	梅花生物	157,500	1,776,600.00	0.17
121	603187	海容冷链	46,500	1,699,575.00	0.17
122	002733	雄韬股份	95,100	1,655,691.00	0.16
123	688037	芯源微	11,416	1,654,977.52	0.16
124	300423	昇辉科技	151,200	1,635,984.00	0.16
125	600481	双良节能	96,300	1,622,655.00	0.16
126	002645	华宏科技	71,950	1,569,949.00	0.15
127	002472	双环传动	49,100	1,563,344.00	0.15
128	300662	科锐国际	30,100	1,561,889.00	0.15
129	601666	平煤股份	113,260	1,539,203.40	0.15
130	600456	宝钛股份	25,500	1,514,700.00	0.15
131	688408	中信博	16,000	1,479,680.00	0.15
132	002215	诺普信	262,800	1,469,052.00	0.14
133	688278	特宝生物	49,000	1,444,520.00	0.14
134	000762	西藏矿业	25,800	1,442,994.00	0.14
135	601677	明泰铝业	59,100	1,406,580.00	0.14
136	002832	比音勒芬	55,200	1,391,040.00	0.14
137	600151	航天机电	125,000	1,388,750.00	0.14
138	300604	长川科技	28,900	1,304,835.00	0.13
139	601231	环旭电子	90,600	1,301,016.00	0.13
140	300439	美康生物	103,200	1,252,848.00	0.12
141	600378	昊华科技	32,400	1,248,048.00	0.12
142	002446	盛路通信	176,000	1,219,680.00	0.12
143	600639	浦东金桥	89,400	1,214,946.00	0.12
144	300502	新易盛	46,356	1,214,527.20	0.12
145	300616	尚品宅配	42,400	1,206,280.00	0.12
146	000810	创维数字	73,400	1,189,814.00	0.12
147	603919	金徽酒	34,900	1,186,251.00	0.12
148	603348	文灿股份	22,000	1,179,200.00	0.12
149	301031	中熔电气	8,200	1,175,716.00	0.12
150	600328	中盐化工	49,200	1,158,660.00	0.11
151	300487	蓝晓科技	18,900	1,152,900.00	0.11
152	688200	华峰测控	3,200	1,140,480.00	0.11
153	688016	心脉医疗	5,800	1,129,898.00	0.11
154	300634	彩讯股份	87,600	1,112,520.00	0.11
155	600458	时代新材	111,900	1,096,620.00	0.11
156	300455	康拓红外	125,800	1,078,106.00	0.11

157	688023	安恒信息	7,100	1,048,386.00	0.10
158	601001	晋控煤业	57,800	1,025,950.00	0.10
159	600997	开滦股份	133,800	1,019,556.00	0.10
160	000969	安泰科技	111,300	992,796.00	0.10
161	600590	泰豪科技	150,500	982,765.00	0.10
162	002182	云海金属	37,900	950,532.00	0.09
163	603489	八方股份	4,700	914,103.00	0.09
164	600877	声光电科	79,700	891,046.00	0.09
165	300666	江丰电子	14,400	878,400.00	0.09
166	601606	长城军工	73,700	855,657.00	0.08
167	300394	天孚通信	31,600	855,412.00	0.08
168	603337	杰克股份	39,500	848,460.00	0.08
169	002737	葵花药业	52,400	819,536.00	0.08
170	300328	宜安科技	95,300	810,050.00	0.08
171	603713	密尔克卫	5,900	806,530.00	0.08
172	000915	华特达因	19,000	785,650.00	0.08
173	603129	春风动力	6,700	761,924.00	0.07
174	688233	神工股份	13,200	741,840.00	0.07
175	300045	华力创通	95,500	732,485.00	0.07
176	603212	赛伍技术	27,100	721,131.00	0.07
177	603529	爱玛科技	13,740	719,701.20	0.07
178	603429	集友股份	55,300	711,158.00	0.07
179	300432	富临精工	32,000	704,000.00	0.07
180	300151	昌红科技	37,000	699,300.00	0.07
181	300180	华峰超纤	173,600	696,136.00	0.07
182	002635	安洁科技	42,300	692,451.00	0.07
183	002585	双星新材	37,900	685,611.00	0.07
184	002261	拓维信息	105,200	674,332.00	0.07
185	688033	天宜上佳	30,800	654,192.00	0.06
186	603396	金辰股份	6,800	619,004.00	0.06
187	000048	京基智农	32,900	610,953.00	0.06
188	300829	金丹科技	18,600	603,012.00	0.06
189	603279	景津装备	19,300	598,493.00	0.06
190	600688	上海石化	187,800	597,204.00	0.06
191	600063	皖维高新	77,400	586,692.00	0.06
192	002573	清新环境	95,500	554,855.00	0.05
193	000902	新洋丰	32,800	553,992.00	0.05
194	300776	帝尔激光	3,200	552,960.00	0.05
195	603906	龙蟠科技	13,600	502,384.00	0.05
196	688116	天奈科技	2,935	497,423.80	0.05
197	600559	老白干酒	17,211	493,783.59	0.05
198	605123	派克新材	3,400	478,448.00	0.05

199	002960	青鸟消防	17,000	465,630.00	0.05
200	300149	睿智医药	40,700	459,096.00	0.05
201	600876	洛阳玻璃	18,300	457,866.00	0.05
202	002959	小熊电器	7,000	436,310.00	0.04
203	300054	鼎龙股份	20,400	431,868.00	0.04
204	688333	铂力特	2,300	420,279.00	0.04
205	603305	旭升股份	13,800	417,036.00	0.04
206	688133	泰坦科技	2,300	406,272.00	0.04
207	603063	禾望电气	10,400	399,880.00	0.04
208	002759	天际股份	12,800	347,904.00	0.03
209	605168	三人行	3,200	346,016.00	0.03
210	002895	川恒股份	10,000	338,100.00	0.03
211	600523	贵航股份	14,200	333,700.00	0.03
212	002639	雪人股份	28,600	327,756.00	0.03
213	300397	天和防务	31,000	322,710.00	0.03
214	601567	三星医疗	24,000	318,720.00	0.03
215	300827	上能电气	5,700	291,555.00	0.03
216	600343	航天动力	26,600	283,024.00	0.03
217	601126	四方股份	16,800	272,328.00	0.03
218	002171	楚江新材	29,000	270,570.00	0.03
219	300039	上海凯宝	36,300	230,142.00	0.02
220	601137	博威合金	11,900	210,630.00	0.02
221	300772	运达股份	8,200	208,608.00	0.02
222	002314	南山控股	47,900	198,306.00	0.02
223	300386	飞天诚信	17,100	192,717.00	0.02
224	300768	迪普科技	11,800	190,570.00	0.02
225	300378	鼎捷软件	10,800	177,876.00	0.02
226	000539	粤电力 A	40,700	170,940.00	0.02
227	300657	弘信电子	14,000	162,680.00	0.02
228	601369	陕鼓动力	16,900	162,240.00	0.02
229	002782	可立克	9,500	161,880.00	0.02
230	600363	联创光电	7,100	159,466.00	0.02
231	688617	惠泰医疗	700	153,356.00	0.02
232	301071	力量钻石	900	139,617.00	0.01
233	600888	新疆众和	13,400	123,280.00	0.01
234	002400	省广集团	24,100	118,813.00	0.01
235	000517	荣安地产	36,700	116,706.00	0.01
236	003040	楚天龙	5,600	115,136.00	0.01
237	300171	东富龙	3,300	111,903.00	0.01
238	603229	奥翔药业	2,900	110,374.00	0.01
239	000801	四川九洲	16,000	108,960.00	0.01
240	688128	中国电研	3,800	92,530.00	0.01

241	600223	鲁商发展	7,000	73,360.00	0.01
242	300065	海兰信	4,300	56,330.00	0.01
243	600575	淮河能源	17,900	55,848.00	0.01
244	002043	兔宝宝	4,700	54,520.00	0.01
245	603826	坤彩科技	800	47,088.00	0.00
246	002034	旺能环境	2,000	41,060.00	0.00
247	300183	东软载波	2,700	39,933.00	0.00
248	000795	英洛华	4,600	35,420.00	0.00
249	600933	爱柯迪	2,100	34,398.00	0.00
250	600449	宁夏建材	2,800	34,076.00	0.00
251	600557	康缘药业	2,200	32,318.00	0.00
252	002245	蔚蓝锂芯	1,200	27,852.00	0.00
253	600416	湘电股份	1,100	20,856.00	0.00
254	000968	蓝焰控股	1,300	13,585.00	0.00
255	300755	华致酒行	300	13,155.00	0.00
256	300803	指南针	200	11,756.00	0.00
257	002539	云图控股	400	6,396.00	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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300647	超频三	762,700	8,572,748.00	0.84
2	002468	申通快递	686,800	8,186,656.00	0.80
3	002947	恒铭达	440,500	8,105,200.00	0.80
4	688819	天能股份	207,000	7,158,060.00	0.70
5	600392	盛和资源	316,660	7,156,516.00	0.70
6	688521	芯原股份	130,400	6,441,760.00	0.63
7	688008	澜起科技	103,200	6,251,856.00	0.61
8	601390	中国中铁	991,000	6,084,740.00	0.60
9	300572	安车检测	387,200	5,796,384.00	0.57
10	002120	韵达股份	306,700	5,232,302.00	0.51
11	603613	国联股份	58,750	5,205,250.00	0.51
12	600486	扬农化工	38,600	5,144,608.00	0.51
13	300389	艾比森	480,838	4,995,906.82	0.49
14	603813	原尚股份	329,100	4,992,447.00	0.49
15	603586	金麒麟	372,200	4,808,824.00	0.47
16	603968	醋化股份	214,800	4,424,880.00	0.43
17	688589	力合微	90,300	4,047,246.00	0.40
18	688567	孚能科技	142,200	4,039,902.00	0.40
19	300902	国安达	96,500	3,417,065.00	0.34
20	600383	金地集团	223,230	3,000,211.20	0.29
21	002756	永兴材料	19,500	2,968,095.00	0.29

22	601933	永辉超市	682,700	2,921,956.00	0.29
23	300566	激智科技	128,000	2,316,800.00	0.23
24	002032	苏泊尔	40,900	2,304,306.00	0.23
25	600879	航天电子	312,900	2,030,721.00	0.20
26	603681	永冠新材	75,900	1,865,622.00	0.18
27	000402	金融街	298,500	1,776,075.00	0.17
28	300481	濮阳惠成	74,800	1,757,800.00	0.17
29	002562	兄弟科技	251,800	1,631,664.00	0.16
30	002865	钧达股份	14,700	1,401,792.00	0.14
31	300017	网宿科技	251,400	1,347,504.00	0.13
32	002240	盛新锂能	21,900	1,321,884.00	0.13
33	002943	宇晶股份	25,000	1,287,500.00	0.13
34	600160	巨化股份	96,800	1,272,920.00	0.13
35	300618	寒锐钴业	21,600	1,251,072.00	0.12
36	300341	麦克奥迪	131,300	1,193,517.00	0.12
37	688559	海目星	15,400	1,119,580.00	0.11
38	300244	迪安诊断	34,600	1,076,060.00	0.11
39	300733	西菱动力	44,200	978,588.00	0.10
40	300712	永福股份	16,600	951,844.00	0.09
41	603050	科林电气	69,500	951,455.00	0.09
42	688596	正帆科技	47,479	941,033.78	0.09
43	000726	鲁泰 A	120,600	862,290.00	0.08
44	603360	百傲化学	55,900	784,277.00	0.08
45	002009	天奇股份	41,900	775,150.00	0.08
46	300739	明阳电路	46,400	743,328.00	0.07
47	688550	瑞联新材	10,300	706,477.00	0.07
48	601865	福莱特	17,400	662,940.00	0.07
49	603317	天味食品	22,900	651,963.00	0.06
50	300890	翔丰华	11,762	650,673.84	0.06
51	000831	五矿稀土	19,700	615,625.00	0.06
52	603538	美诺华	19,281	614,099.85	0.06
53	603800	道森股份	22,900	582,347.00	0.06
54	688313	仕佳光子	48,941	557,927.40	0.05
55	300820	英杰电气	8,500	548,675.00	0.05
56	600380	健康元	43,800	540,930.00	0.05
57	600985	淮北矿业	34,300	499,408.00	0.05
58	300257	开山股份	31,500	471,240.00	0.05
59	002128	电投能源	31,000	443,920.00	0.04
60	603719	良品铺子	14,900	426,587.00	0.04
61	688518	联赢激光	11,700	397,683.00	0.04
62	600079	人福医药	24,600	393,600.00	0.04
63	002300	太阳电缆	53,000	384,250.00	0.04

64	600686	金龙汽车	52,000	361,920.00	0.04
65	600256	广汇能源	33,900	357,306.00	0.04
66	300402	宝色股份	17,700	356,655.00	0.04
67	002785	万里石	14,900	351,640.00	0.03
68	002249	大洋电机	56,600	347,524.00	0.03
69	688123	聚辰股份	3,200	340,864.00	0.03
70	300745	欣锐科技	6,800	339,184.00	0.03
71	300511	雪榕生物	49,500	331,650.00	0.03
72	688609	九联科技	39,700	331,098.00	0.03
73	688378	奥来德	8,380	326,903.80	0.03
74	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.03
75	603618	杭电股份	44,800	275,968.00	0.03
76	003019	宸展光电	10,380	261,991.20	0.03
77	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.02
78	603379	三美股份	10,800	240,300.00	0.02
79	688220	翱捷科技	3,331	228,473.29	0.02
80	000922	佳电股份	25,300	214,291.00	0.02
81	688234	天岳先进	3,283	214,018.77	0.02
82	603699	纽威股份	24,600	206,886.00	0.02
83	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.02
84	600236	桂冠电力	28,200	171,738.00	0.02
85	002196	方正电机	16,800	163,968.00	0.02
86	300275	梅安森	11,500	152,605.00	0.02
87	300265	通光线缆	17,200	151,360.00	0.01
88	688282	理工导航	3,185	144,503.45	0.01
89	000983	山西焦煤	8,800	117,832.00	0.01
90	000552	靖远煤电	26,400	113,784.00	0.01
91	603978	深圳新星	5,000	106,550.00	0.01
92	002459	晶澳科技	1,120	88,368.00	0.01
93	300681	英搏尔	1,500	86,655.00	0.01
94	002783	凯龙股份	9,300	82,398.00	0.01
95	301238	瑞泰新材	2,441	78,282.87	0.01
96	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
97	688575	亚辉龙	2,900	60,668.00	0.01
98	003038	鑫铂股份	1,100	55,440.00	0.01
99	001227	兰州银行	7,868	38,710.56	0.00
100	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
101	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
102	001323	慕思股份	573	28,111.38	0.00
103	603191	望变电气	1,149	26,197.20	0.00
104	001318	阳光乳业	1,142	25,249.62	0.00
105	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.00

106	301302	华如科技	423	23,865.66	0.00
107	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
108	301216	万凯新材	747	22,290.48	0.00
109	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
110	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
111	001228	永泰运	383	20,739.45	0.00
112	001308	康冠科技	667	19,456.39	0.00
113	301127	天源环保	1,685	18,754.05	0.00
114	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
115	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
116	301207	华兰疫苗	318	17,941.56	0.00
117	301219	腾远钴业	202	17,739.64	0.00
118	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
119	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
120	603070	万控智造	775	16,197.50	0.00
121	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
122	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
123	001319	铭科精技	536	15,474.32	0.00
124	001313	粤海饲料	1,232	15,104.32	0.00
125	301151	冠龙节能	703	15,086.38	0.00
126	301123	奕东电子	568	14,421.52	0.00
127	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
128	603097	江苏华辰	577	13,617.20	0.00
129	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
130	001266	宏英智能	247	12,298.13	0.00
131	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
132	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
133	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
134	300834	星辉环材	360	10,810.80	0.00
135	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
136	603272	联翔股份	443	9,723.85	0.00
137	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
138	301196	唯科科技	247	9,267.44	0.00
139	001234	泰慕士	333	9,017.64	0.00
140	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
141	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
142	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
143	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
144	301158	德石股份	379	7,724.02	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	300769	德方纳米	26,529,185.40	3.88
2	603236	移远通信	21,819,983.43	3.19
3	002850	科达利	21,623,588.00	3.16
4	300602	飞荣达	20,852,977.00	3.05
5	600929	雪天盐业	19,854,718.72	2.90
6	688516	奥特维	17,524,894.31	2.56
7	600330	天通股份	17,350,023.76	2.54
8	688116	天奈科技	17,169,453.11	2.51
9	688339	亿华通	17,076,553.07	2.50
10	002041	登海种业	16,665,554.47	2.44
11	002597	金禾实业	16,600,460.04	2.43
12	603305	旭升股份	16,546,337.95	2.42
13	300170	汉得信息	16,492,200.00	2.41
14	002215	诺普信	16,167,732.00	2.36
15	600456	宝钛股份	16,047,953.00	2.35
16	002738	中矿资源	15,979,861.40	2.34
17	002176	江特电机	15,825,829.00	2.31
18	300476	胜宏科技	15,667,781.09	2.29
19	300761	立华股份	15,520,426.46	2.27
20	688388	嘉元科技	15,401,103.93	2.25
21	600211	西藏药业	15,126,679.42	2.21
22	300477	合纵科技	14,935,644.00	2.18
23	300568	星源材质	14,916,824.16	2.18
24	002635	安洁科技	14,872,848.50	2.17
25	300034	钢研高纳	14,752,613.00	2.16
26	300393	中来股份	14,678,981.30	2.15
27	600604	市北高新	14,559,986.00	2.13
28	300118	东方日升	14,468,206.00	2.12
29	002240	盛新锂能	14,286,421.00	2.09
30	688066	航天宏图	14,233,999.37	2.08
31	300035	中科电气	14,228,376.19	2.08
32	688298	东方生物	13,951,604.35	2.04
33	002344	海宁皮城	13,928,782.72	2.04
34	002733	雄韬股份	13,867,808.00	2.03
35	300373	扬杰科技	13,840,631.00	2.02
36	300438	鹏辉能源	13,816,624.62	2.02

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	300769	德方纳米	33,704,725.36	4.93
2	688116	天奈科技	23,792,027.28	3.48
3	002204	大连重工	23,418,220.03	3.42
4	300602	飞荣达	21,085,933.40	3.08
5	002850	科达利	20,354,651.00	2.98
6	002738	中矿资源	19,379,329.36	2.83
7	300035	中科电气	19,293,596.00	2.82
8	600123	兰花科创	18,041,856.99	2.64
9	300775	三角防务	17,934,892.00	2.62
10	600330	天通股份	17,489,511.36	2.56
11	603305	旭升股份	17,154,518.83	2.51
12	300390	天华超净	17,092,277.00	2.50
13	600456	宝钛股份	16,842,825.82	2.46
14	300073	当升科技	16,562,730.47	2.42
15	000968	蓝焰控股	16,239,352.00	2.37
16	600360	华微电子	16,016,179.00	2.34
17	300054	鼎龙股份	15,524,072.75	2.27
18	300034	钢研高纳	15,258,354.39	2.23
19	300476	胜宏科技	15,178,639.00	2.22
20	300607	拓斯达	15,108,644.01	2.21
21	002635	安洁科技	14,994,583.63	2.19
22	002215	诺普信	14,879,287.00	2.18
23	002436	兴森科技	14,721,423.68	2.15
24	603383	顶点软件	14,706,621.00	2.15
25	688202	美迪西	14,625,543.13	2.14
26	002733	雄韬股份	14,569,787.16	2.13
27	002041	登海种业	14,365,863.91	2.10
28	600559	老白干酒	14,288,232.05	2.09
29	300352	北信源	14,219,106.63	2.08
30	300428	立中集团	14,212,823.24	2.08
31	002240	盛新锂能	14,015,970.11	2.05
32	603236	移远通信	13,942,511.48	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	3,859,975,867.70
卖出股票收入(成交)总额	3,530,797,013.07

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 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

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中,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	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	9,857,578.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,857,578.90

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	58,500	6,958.29	111,263,477.64	27.33	295,796,305.48	72.67
万家中证 1000 指数增强 C	55,785	6,864.29	115,591,860.73	30.19	267,332,687.67	69.81
合计	112,860	6,999.68	226,855,338.37	28.72	563,128,993.15	71.28

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	万家中证 1000 指数增强 A	665,995.32	0.1636
	万家中证 1000 指数增强 C	2,709.28	0.0007

人员持有本基金			
	合计	668,704.60	0.0846

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	10~50
	万家中证 1000 指数增强 C	0~10
	合计	10~50
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	0~10
	万家中证 1000 指数增强 C	0
	合计	0~10

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	1.25	9,887,305.69	1.25	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	1.25	9,887,305.69	1.25	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	230,974,168.43	277,913,407.67
本报告期基金总申购份额	336,648,476.14	569,625,531.44

减：本报告期基金总赎回份额	160,562,861.45	464,614,390.71
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	407,059,783.12	382,924,548.40

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

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

报告期期为基金进行审计的会计师事务所未发生变更。

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	3	7,379,579,430.01	100.00	4,539,847.57	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；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。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	万家基金管理有限公司关于旗下万家中证 1000 指数增强基金在华泰证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-01-01
2	万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	指定媒介	2022-01-21
3	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在广发证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-03-04
4	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在光大证券开通定投的公告	指定媒介	2022-03-17
5	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金调整最低申购金额的公告	指定媒介	2022-03-22
6	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宜信普泽为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-03-24

7	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在山西证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-03-29
8	万家基金管理有限公司关于旗下基金在招商证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-03-30
9	万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2021 年年度报告	指定媒介	2022-03-30
10	万家基金管理有限公司关于旗下基金在湘财证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-04-06
11	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商银行招赢通平台为销售机构并开通相关业务的公告	指定媒介	2022-04-11
12	万家基金管理有限公司关于旗下基金在华安证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-04-13
13	万家基金管理有限公司关于旗下基金在华龙证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-04-14
14	万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	指定媒介	2022-04-21
15	万家基金管理有限公司关于旗下基金在申万宏源及申万宏源西部证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-04-28
16	万家基金管理有限公司关于旗下基金在上海证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-05-24
17	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中欧财富为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-05-26
18	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增奕丰基金为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-05-31
19	万家基金管理有限公司关于旗下基金在九州证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-06-18
20	万家基金管理有限公司关于旗下基金在泰信财富证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-06-21

§ 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

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 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、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 2022 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

2022 年 8 月 30 日