

万家中证 500 指数增强型发起式证券投资  
基金  
2022 年年度报告

2022 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：2023 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 2023 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无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2022 年 1 月 1 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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
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	18
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>20</b>
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 净资产（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	26
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>59</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	59
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	60
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	61
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	70
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	92
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 .....	92
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 .....	92
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 .....	92
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 .....	92
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	92
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	92
8.12 投资组合报告附注 .....	92
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>93</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	93
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	94
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情况 .....	94
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	94
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>95</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>95</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	95
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 .....	95
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	95
11.4 基金投资策略的改变 .....	95
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	96
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 .....	96
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	96
11.8 其他重大事件 .....	97
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>100</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 .....	100
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>101</b>
13.1 备查文件目录 .....	101
13.2 存放地点 .....	101
13.3 查阅方式 .....	101

## § 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	407,012,691.45 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	229,523,608.99 份	177,489,082.46 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	郭明
	联系电话	010-66105799
	021-38909626	

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	http://www.wjasset.com
基金年度报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）基金管理人办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市南京东路 61 号 4 楼新黄浦金融大厦
注册登记机构	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	2022 年		2021 年		2020 年	
	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	23,265,440.89	12,420,400.36	6,819,286.72	2,878,190.65	19,680,747.17	12,168,044.09
本期利润	12,377,798.06	10,368,395.38	6,697,729.38	2,030,908.98	14,377,707.09	8,127,770.73
加权平均基金份额本期利润	0.0995	0.0984	0.3480	0.1759	0.3544	0.3099
本期	6.97%	6.93%	20.13%	9.88%	26.08%	23.38%

加权平均净值利润率						
本期基金份额净值增长率	-10.43%	-10.79%	22.82%	22.34%	33.71%	33.16%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
期末可供分配利润	83,451,329.91	60,778,720.57	19,326,152.69	28,348,986.00	10,978,532.47	3,835,512.61
期末可供分配基金份额利润	0.3636	0.3424	0.8809	0.8578	0.5314	0.5186
期末基金资产净值	312,974,938.90	238,267,803.03	41,265,177.10	61,399,158.85	31,639,354.55	11,231,623.01
期末基金份额净值	1.3636	1.3424	1.8809	1.8578	1.5314	1.5186
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
基金份额累计净值增长率	76.80%	73.75%	97.40%	94.78%	60.72%	59.21%

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 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	2.25%	0.90%	2.53%	0.97%	-0.28%	-0.07%
过去六个月	-2.01%	0.99%	-8.63%	1.04%	6.62%	-0.05%
过去一年	-10.43%	1.28%	-19.25%	1.31%	8.82%	-0.03%
过去三年	47.09%	1.29%	11.34%	1.28%	35.75%	0.01%
自基金合同生效起至今	76.80%	1.24%	17.63%	1.25%	59.17%	-0.01%

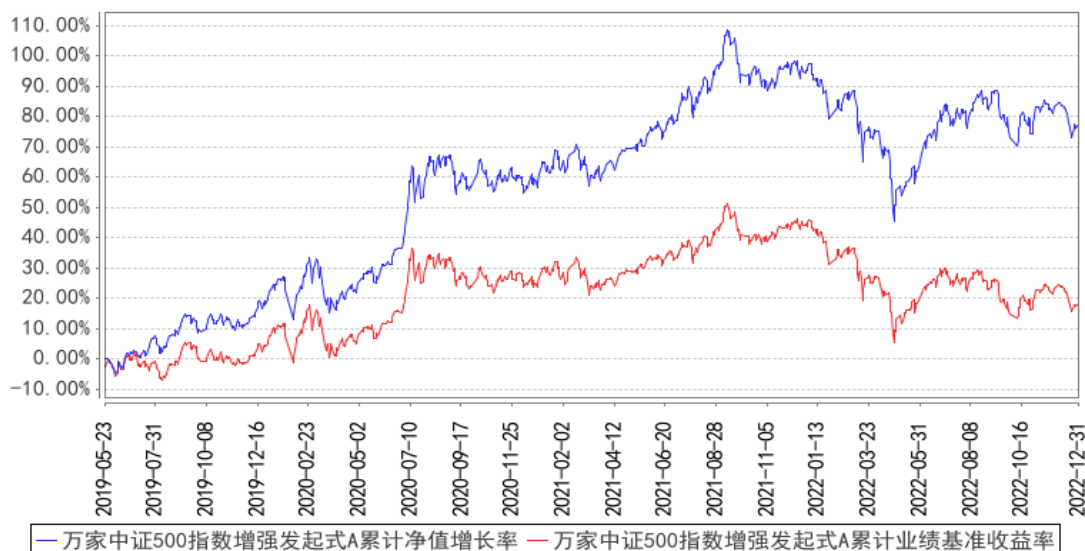
万家中证 500 指数增强发起式 C

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	2.15%	0.90%	2.53%	0.97%	-0.38%	-0.07%
过去六个月	-2.21%	0.99%	-8.63%	1.04%	6.42%	-0.05%
过去一年	-10.79%	1.28%	-19.25%	1.31%	8.46%	-0.03%
过去三年	45.32%	1.29%	11.34%	1.28%	33.98%	0.01%
自基金合同生效起至今	73.75%	1.24%	17.63%	1.25%	56.12%	-0.01%

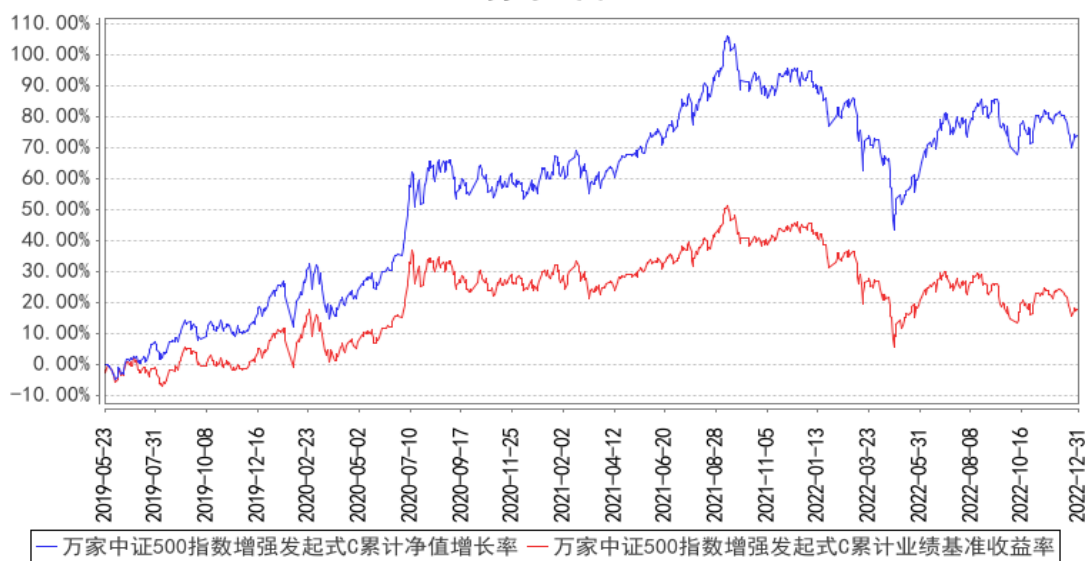


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

**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**



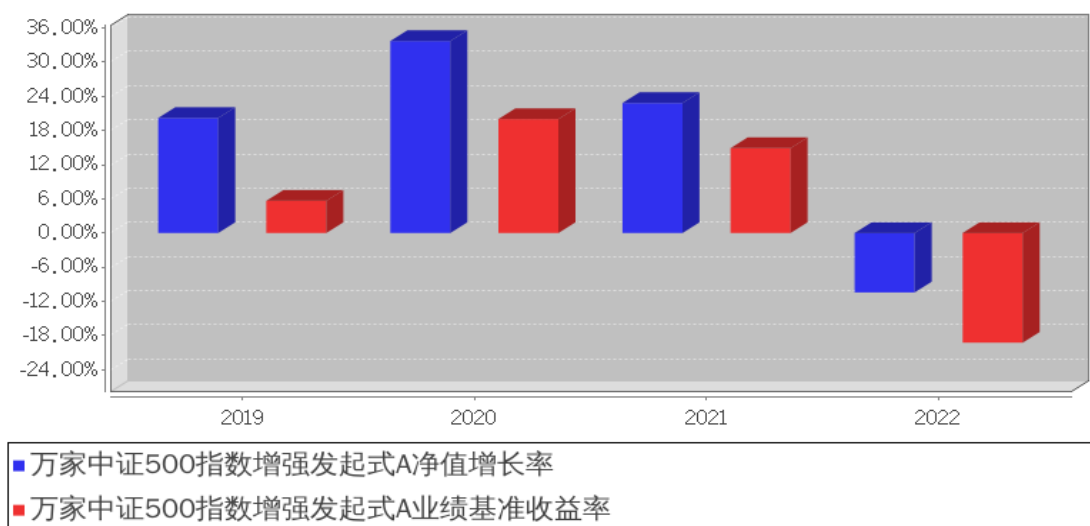
**万家中证500指数增强发起式C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



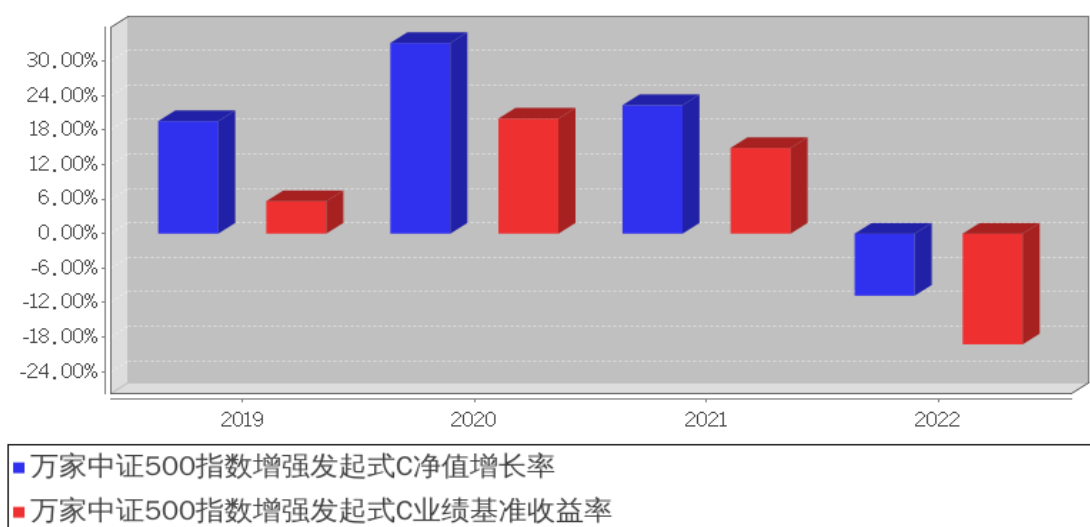
注：本基金于 2019 年 5 月 23 日成立，根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

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

万家中证500指数增强发起式A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



万家中证500指数增强发起式C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 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
2022 年	3.2570	31,628,478.56	6,056,365.34	37,684,843.90	-
2021 年	-	-	-	-	-
2020 年	0.5520	979,858.92	160,540.18	1,140,399.10	-
合计	3.8090	32,608,337.4	6,216,905.52	38,825,243.0	-

		8		0	
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
2022 年	3.2020	14,705,776.18	14,427,970.45	29,133,746.63	-
2021 年	-	-	-	-	-
2020 年	0.5380	391,918.93	64,603.92	456,522.85	-
合计	3.7400	15,097,695.11	14,492,574.37	29,590,269.48	-

## § 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。截至报告期末，公司的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。截至报告期末，公司共管理一百二十只开放式基金，分别为万家 180 指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金（LOF）、万家添利债券型证券投资基金（LOF）、万家新机遇价值驱动灵活配置混合型证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家上证 50 交易型开放式指数证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞和灵活配置混合型证券投资基金、万家颐达灵活配置混合型证券投资基金、万家颐和灵活配置混合型证券投资基金、万家恒瑞 18 个月定期开放债券型证券投资基金、万家 3-5 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家鑫安纯债债券型证券投资基金、万家鑫璟纯债债券型证券投资基金、万家沪深 300 指数增强型证券投资基金、万家家享中短债债券型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活

配置混合型证券投资基金、万家 1-3 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家瑞隆混合型证券投资基金、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家现金增利货币市场基金、万家消费成长股票型证券投资基金、万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家玖盛纯债 9 个月定期开放债券型证券投资基金、万家天添宝货币市场基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、万家家瑞债券型证券投资基金、万家臻选混合型证券投资基金、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金、万家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 三年持有期混合型发起式基金中基金 (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、万家匠心致远一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫融纯债债券型证券投资基金、万家颐远均衡一年持有期混合型发起式证券投资基金、万家鑫耀纯债债券型证券投资基金、万家欣远混合型证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家惠利债券型证券投资基金、万家鑫怡债券型证券投资基金、万家优享平衡混合型发起式证券投资基金、万家洞见进取混合型发起式证券投资基金、万家沪深 300 成长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	公司总经理助理、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家沪深 300 指数增强型证券投资基金、万家瑞瑞债券型证券投资基金、万家互联互通核心资产量化策略	2019 年 9 月 6 日	-	16 年	国籍：中国；学历：美国斯坦福大学工商管理博士；相关业务资格：证券投资基金从业资格；过往从业经历：2019 年 7 月入职万家基金管理有限公司，现任公司总经理助理、基金经理，历任量化投资部总监。曾任美国巴克莱国际投资管理公司投资部基金经理，加拿大退休基金国际投资管理公司量化投资部基金经理，南方基金管理有限公司量化投资部基金经理，通联数据股份有限公司联合创始人、首席投资官，上海寻乾资产管理有限公司投资总监、总经理，巨杉（上海）资产管理有限公司量化投资部投资总监等职。

	混合型证券投资基金、万家创业板指数增强型证券投资基金、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。				
--	--	--	--	--	--

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，公司执行交易系统内的公平交易程序；(3)对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，各投资组合经理在交易前独立

地确定各投资组合的交易价格和数量，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 13 次，为量化投资组合或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。

#### 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 的基金份额净值为 1.3636 元，本报告期基金份额净值增长率为-10.43%，同期业绩比较基准收益率为-19.25%，截至本报告期末万家中证 500 指数增强发起式 C 的基金份额净值为 1.3424 元，本报告期基金份额净值增长率为-10.79%，同期业绩比较基准收益率为-19.25%。基金报告期末 A 份额、C 份额日均跟踪偏离度分别为 0.1837%、0.1836%，年跟踪误差分别为 3.6350%、3.6344%，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 2023 年，随着防疫政策优化调整后的第一轮疫情快速达峰后回落，中国经济呈现出快速修复的势头，2023 年 1 月制造业 PMI 和服务业 PMI 均回升至景气水平，分别为 50.1%、54.4%。与此同时，春运旅客发送量明显走强，春节期间电影票房、旅游人次等也回升，指向消费恢复节奏或加快，使得服务业 PMI 回升较为明显。

2023 年是复苏之年，整体有利于风险资产；首先美联储加息接近尾声，预期后续美联储货币政策边际转松，在中美利差收窄之下，人民币升值将是大势所趋，以人民币计价的 A 股吸引力提升，外资配置中国资产意愿回升；其次，各项政策宽松措施也在加速落地，2023 年 1 月 28 日，国常会明确要求持续抓实当前经济社会发展工作，推动经济运行在年初稳步回升，后续随着宽松政策发力见效，内需潜力持续释放，复苏动能将进一步强化。综合来看，随着外资流入，稳增长政策预期拐点逐渐清晰明朗，经济处于复苏的轨道，A 股市场整体或呈现震荡向上格局。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

##### （一）加强风控文化建设

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

##### （二）制度流程建设

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

##### （三）定期和临时稽核工作

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

##### （四）绩效评估和风险管理工作

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

##### （五）员工行为管理与防控内幕交易

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



#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了估值委员会,定期评价现行估值政策和程序,在发生了影响估值政策和程序有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。估值委员会由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

根据基金合同规定:“在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最少为 1 次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%”。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况,本基金于 2022 年 1 月 14 日进行本基金的 2021 年年度收益分配, A 类每 10 份基金份额派发红利 0.881 元, C 类每 10 份基金份额派发红利 0.858 元,共计分配利润 4,892,964.66 元;本基金于 2022 年 6 月 24 日进行本基金的 2022 年年度收益分配, A 类每 10 份基金份额派发红利 2.376 元, C 类每 10 份基金份额派发红利 2.344 元,共计分配利润 61,925,625.87 元。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金,于 2022 年 5 月 22 日合同生效满 3 年,自 2022 年 5 月 23 日至 2022 年 12 月 30 日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。

2022 年 5 月 23 日之前,本基金暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的相关规定。

## § 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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

### 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 2022 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[2023]第 ZA30297 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	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 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	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

	<p>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>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<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>

	我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	朱颖	杨利敏
会计师事务所的地址	中国 上海	
审计报告日期	2023 年 3 月 29 日	

## § 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：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	54,047,632.99	6,049,943.16
结算备付金		3,085,919.15	526,585.31
存出保证金		105,880.12	14,911.18
交易性金融资产	7.4.7.2	515,731,786.13	96,912,244.86
其中：股票投资		515,731,786.13	96,912,244.86
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
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		207,368.22	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,261,729.48	194,399.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	897.77
资产总计		575,440,316.09	103,698,981.81
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2021 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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		20,945,598.99	455,253.32
应付管理人报酬		473,100.52	73,253.93
应付托管费		94,620.13	14,650.76
应付销售服务费		83,899.70	15,469.64
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	2,600,354.82	476,018.21
负债合计		24,197,574.16	1,034,645.86
<b>净 资 产:</b>			
实收基金	7.4.7.7	407,012,691.45	54,989,197.26
其他综合收益	7.4.7.8	-	-
未分配利润	7.4.7.9	144,230,050.48	47,675,138.69
净资产合计		551,242,741.93	102,664,335.95
负债和净资产总计		575,440,316.09	103,698,981.81

注：1、报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 407,012,691.45 份，其中万家中证 500 指数增强发起式 A 基金份额净值 1.3636 元，基金份额总额 229,523,608.99 份；万家中证 500 指数增强发起式 C 基金份额净值 1.3424 元，基金份额总额 177,489,082.46 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。

## 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		27,343,015.36	10,838,353.70
1. 利息收入		114,631.45	17,201.31

其中：存款利息收入	7.4.7.10	114,631.45	17,201.31
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）		39,595,121.52	11,653,574.62
其中：股票投资收益	7.4.7.11	35,094,234.46	11,276,460.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.13	-	-
收益			
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	4,500,887.06	377,114.61
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-12,939,647.81	-968,839.01
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	572,910.20	136,416.78
<b>减：二、营业总支出</b>		4,596,821.92	2,109,715.34
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,180,468.37	537,291.68
2. 托管费	7.4.10.2.2	636,093.66	107,458.28
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	582,636.93	82,189.01
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.20	197,622.96	1,382,776.37
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		22,746,193.44	8,728,638.36
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		22,746,193.44	8,728,638.36

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		22,746,193.44	8,728,638.36

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。

### 7.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	54,989,197.26	-	47,675,138.69	102,664,335.95
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)	54,989,197.26	-	47,675,138.69	102,664,335.95
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	352,023,494.19	-	96,554,911.79	448,578,405.98
(一)、综合收益总额	-	-	22,746,193.44	22,746,193.44
(二)、本期基金份额交易产	352,023,494.19	-	140,627,308.88	492,650,803.07

生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	650,209,191.14	-	271,260,808.70	921,469,999.84
2. 基金赎回款	-298,185,696.95	-	-130,633,499.82	-428,819,196.77
（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）	-	-	-66,818,590.53	-66,818,590.53
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产（基金净值）	407,012,691.45	-	144,230,050.48	551,242,741.93
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	28,056,932.48	-	14,814,045.08	42,870,977.56
加：会计政策变更	-	-	-	-



前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	28,056,932.48	-	14,814,045.08	42,870,977.56
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	26,932,264.78	-	32,861,093.61	59,793,358.39
(一)、综合收益总额	-	-	8,728,638.36	8,728,638.36
(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)	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
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”	-	-	-	-

号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	54,989,197.26	-	47,675,138.69	102,664,335.95

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

方一天

陈广益

尹超

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 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》、《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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《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

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

###### 1、金融资产分类

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。本基金现无金融资产分

类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金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。本基金现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。

### 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

自 2022 年 1 月 1 日起适用

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，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，确认为应计利息，包含在债券投资的账面价值中。对于其他

金融资产和以摊余成本计量的金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于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。

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

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，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。

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

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

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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。

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。

#### 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，按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（2）不存在活跃市场的金融工具，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，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 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

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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率或者合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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。

#### 7.4.4.10 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) 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。

在不违反法律法规、基金合同的约定以及对份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1)对于证券交易所上市的股票，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

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。

2022年1月1日各项资产和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)	6,049,943.16	摊余成本	6,050,597.23
结算备付金	摊余成本(应收款项)	526,585.31	摊余成本	526,822.31

存出保证金	摊余成本（应收款项）	14,911.18	摊余成本	14,917.88
交易性金融资产	以公允价值计量且其变动计入当期损益	96,912,244.86	以公允价值计量且其变动计入当期损益	96,912,244.86
应收利息	摊余成本（应收款项）	897.77	—	—
应收申购款	摊余成本（应收款项）	194,399.53	摊余成本	194,399.53
<b>金融负债</b>				
应付赎回款	摊余成本	455,253.32	摊余成本	455,253.32
应付管理人报酬	摊余成本	73,253.93	摊余成本	73,253.93
应付托管费	摊余成本	14,650.76	摊余成本	14,650.76
应付销售服务费	摊余成本	15,469.64	摊余成本	15,469.64
应付交易费用	摊余成本	345,713.50	—	—
其他负债	摊余成本	130,304.71	摊余成本	476,018.21

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

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非

货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

### (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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	54,047,632.99	6,049,943.16
等于: 本金	54,043,991.99	6,049,943.16
加: 应计利息	3,641.00	-
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	54,047,632.99	6,049,943.16

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	528,480,307.50	-	515,731,786.13	-12,748,521.37
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	528,480,307.50	-	515,731,786.13	-12,748,521.37

项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	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

#### 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

本基金本报告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 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	-
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
应计利息	-	897.77
合计	-	897.77

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	121.79	304.71
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	2,359,300.58	345,713.50
其中：交易所市场	2,359,300.58	345,713.50
银行间市场	-	-

应付利息	-	-
预提费用	220,000.00	100,000.00
应付指数使用费	20,932.45	30,000.00
合计	2,600,354.82	476,018.21

#### 7.4.7.7 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	21,939,024.41	21,939,024.41
本期申购	232,544,378.38	232,544,378.38
本期赎回（以“-”号填列）	-24,959,793.80	-24,959,793.80
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	229,523,608.99	229,523,608.99

##### 万家中证 500 指数增强发起式 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	33,050,172.85	33,050,172.85
本期申购	417,664,812.76	417,664,812.76
本期赎回（以“-”号填列）	-273,225,903.15	-273,225,903.15
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	177,489,082.46	177,489,082.46

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.8 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

#### 7.4.7.9 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
本期期初	21,130,933.35	-1,804,780.66	19,326,152.69
本期利润	23,265,440.89	-10,887,642.83	12,377,798.06
本期基金份额交易产生的变动数	123,813,856.41	-34,381,633.35	89,432,223.06



其中：基金申购款	140,804,806.89	-38,621,275.11	102,183,531.78
基金赎回款	-16,990,950.48	4,239,641.76	-12,751,308.72
本期已分配利润	-37,684,843.90	-	-37,684,843.90
本期末	130,525,386.75	-47,074,056.84	83,451,329.91

## 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
本期期初	31,038,507.09	-2,689,521.09	28,348,986.00
本期利润	12,420,400.36	-2,052,004.98	10,368,395.38
本期基金份额交易产生的变动数	82,409,149.00	-31,214,063.18	51,195,085.82
其中：基金申购款	240,379,009.20	-71,301,732.28	169,077,276.92
基金赎回款	-157,969,860.20	40,087,669.10	-117,882,191.10
本期已分配利润	-29,133,746.63	-	-29,133,746.63
本期末	96,734,309.82	-35,955,589.25	60,778,720.57

## 7.4.7.10 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	79,075.25	12,662.38
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	34,003.12	4,371.23
其他	1,553.08	167.70
合计	114,631.45	17,201.31

## 7.4.7.11 股票投资收益

## 7.4.7.11.1 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	35,094,234.46	11,276,460.01
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	35,094,234.46	11,276,460.01

#### 7.4.7.11.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	3,170,584,771.34	398,326,122.23
减：卖出股票成本总额	3,125,935,212.97	387,049,662.22
减：交易费用	9,555,323.91	-
买卖股票差价收入	35,094,234.46	11,276,460.01

#### 7.4.7.12 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 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	4,500,887.06	377,114.61
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	4,500,887.06	377,114.61

#### 7.4.7.17 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-12,939,647.81	-968,839.01
股票投资	-12,939,647.81	-968,839.01

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	-12,939,647.81	-968,839.01

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
基金赎回费收入	565,232.19	136,089.82
基金转换费收入	7,678.01	326.96
合计	572,910.20	136,416.78

#### 7.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
审计费用	20,000.00	20,000.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	847.00	493.00
指数使用费	56,775.96	40,000.00
交易费用	-	1,242,283.37
合计	197,622.96	1,382,776.37

#### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据中国证券监督管理委员会《关于核准万家基金管理有限公司变更实际控制人的批复》（证监许可[2023]215号），齐河众鑫投资有限公司将其持有的万家基金 11%股权转让给中泰证券股份

有限公司，股权变更后，中泰证券股份有限公司持股比例变更为 60%，山东能源集团有限公司为万家基金实际控制人。

#### 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（“万家基金”）	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”）	基金管理人的股东、基金销售机构
齐河众鑫投资有限公司	基金管理人的股东
新疆国际实业股份有限公司	基金管理人的股东
山东省新动能基金管理有限公司	基金管理人的股东
万家财富基金销售（天津）有限公司（“万家财富”）	基金管理人的子公司、基金销售机构
万家共赢资产管理有限公司（“万家共赢”）	基金管理人的子公司
上海万家朴智投资管理有限公司（“万家朴智”）	基金管理人控制的公司

注：1、2022 年 4 月，中国证监会下发《关于核准万家基金管理有限公司变更股权的批复》（证监许可[2022]795 号），核准新疆国际实业股份有限公司将持有的万家基金 40%股权转让给山东省新动能基金管理有限公司。2022 年 6 月，万家基金完成工商变更登记手续，万家基金股东变更为中泰证券、山东省新动能基金管理有限公司、齐河众鑫投资有限公司。

2、2023 年 1 月，中国证监会下发《关于核准万家基金管理有限公司变更实际控制人的批复》（证监许可[2023]215 号），核准山东能源集团有限公司成为万家基金实际控制人，对中泰证券股份有限公司依法受让齐河众鑫投资有限公司持有的万家基金 11%股权无异议。2023 年 2 月，万家基金完成工商变更登记手续，万家基金股东变更为中泰证券和山东省新动能基金管理有限公司。

3、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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	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	645,888,581.33	9.62	346,621,448.52	41.17

#### 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 2022年1月1日至2022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	578,911.40	9.96	578,911.40	24.54
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期 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

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,180,468.37	537,291.68
其中：支付销售机构的客户维护费	532,537.94	139,017.63

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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	636,093.66	107,458.28

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		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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	-	141,217.56	141,217.56
中泰证券	-	12,059.91	12,059.91
工商银行	-	13,704.39	13,704.39
合计	-	166,981.86	166,981.86
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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	-	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

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%。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均未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均未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	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 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	4.3573%	-
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
	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	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%	-

#### 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

本基金本报告期末及上年度末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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	54,047,632.99	79,075.25	6,049,943.16	12,662.38

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。

#### 7.4.10.8 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。

#### 7.4.11 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
--------------------



序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2022 年 1 月 14 日	-	2022 年 1 月 14 日	0.8810	1,702,360 .35	242,043.49	1,944,403 .84	-
2	2022 年 6 月 24 日	-	2022 年 6 月 24 日	2.3760	29,926,11 8.21	5,814,321. 85	35,740,44 0.06	-
合计	-	-	-	3.2570	31,628,47 8.56	6,056,365. 34	37,684,84 3.90	-

万家中证 500 指数增强发起式 C

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2022 年 1 月 14 日	-	2022 年 1 月 14 日	0.8580	1,049,059 .94	1,899,500. 88	2,948,560 .82	-
2	2022 年 6 月 24 日	-	2022 年 6 月 24 日	2.3440	13,656,71 6.24	12,528,469 .57	26,185,18 5.81	-
合计	-	-	-	3.2020	14,705,77 6.18	14,427,970 .45	29,133,74 6.63	-

7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限期	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单 位：股)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
301161	唯万 密封	2022 年 9 月 6 日	6 个月	新股流 通受限	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-
301171	易点 天下	2022 年 8 月 10 日	6 个月	新股流 通受限	18.18	17.72	621	11,289.78	11,004.12	-
301175	中科 环保	2022 年 6 月 30 日	6 个月	新股流 通受限	3.82	6.01	4,555	17,400.10	27,375.55	-
301176	逸豪 新材	2022 年 9 月 21 日	6 个月	新股流 通受限	23.88	16.89	544	12,990.72	9,188.16	-
301197	工大 科雅	2022 年 7 月 29 日	6 个月	新股流 通受限	25.50	20.08	380	9,690.00	7,630.40	-

301223	中荣股份	2022年 10月13日	6个月	新股流 通受限	26.28	18.13	657	17,265.96	11,911.41	-
301227	森鹰窗业	2022年 9月16日	6个月	新股流 通受限	38.25	29.49	284	10,863.00	8,375.16	-
301230	泓博医药	2022年 10月21日	6个月	新股流 通受限	40.00	48.32	269	10,760.00	12,998.08	-
301231	荣信文化	2022年 8月31日	6个月	新股流 通受限	25.49	20.38	275	7,009.75	5,604.50	-
301233	盛帮股份	2022年 6月24日	6个月	新股流 通受限	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40	-
301239	普瑞眼科	2022年 6月22日	6个月	新股流 通受限	33.65	69.68	551	18,541.15	38,393.68	-
301265	华新环保	2022年 12月8日	6个月	新股流 通受限	13.28	11.40	819	10,876.32	9,336.60	-
301267	华夏眼科	2022年 10月26日	6个月	新股流 通受限	50.88	66.20	322	16,383.36	21,316.40	-
301269	华大九天	2022年 7月21日	6个月	新股流 通受限	32.69	87.94	341	11,147.29	29,987.54	-
301270	汉仪股份	2022年 8月19日	6个月	新股流 通受限	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-
301273	瑞晨环保	2022年 10月11日	6个月	新股流 通受限	37.89	37.79	277	10,495.53	10,467.83	-
301277	新天地	2022年 11月9日	6个月	新股流 通受限	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-
301280	珠城科技	2022年 12月19日	6个月	新股流 通受限	67.40	44.80	279	18,804.60	12,499.20	-
301282	金禄电子	2022年 8月18日	6个月	新股流 通受限	30.38	25.25	390	11,848.20	9,847.50	-
301285	鸿日达	2022年 9月21日	6个月	新股流 通受限	14.60	12.60	565	8,249.00	7,119.00	-

		日									
301290	东星医疗	2022年11月23日	6个月	新股流通受限	44.09	35.13	330	14,549.70	11,592.90		-
301296	新巨丰	2022年8月26日	6个月	新股流通受限	18.19	14.90	816	14,843.04	12,158.40		-
301297	富乐德	2022年12月23日	6个月	新股流通受限	8.48	12.99	1,015	8,607.20	13,184.85		-
301300	远翔新材	2022年8月9日	6个月	新股流通受限	36.15	29.37	211	7,627.65	6,197.07		-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股流通受限	5.00	7.53	3,574	17,870.00	26,912.22		-
301306	西测测试	2022年7月19日	6个月	新股流通受限	43.23	42.29	255	11,023.65	10,783.95		-
301309	万得凯	2022年9月8日	6个月	新股流通受限	39.00	24.46	203	7,917.00	4,965.38		-
301311	昆船智能	2022年11月23日	6个月	新股流通受限	13.88	15.86	832	11,548.16	13,195.52		-
301313	凡拓数创	2022年9月22日	6个月	新股流通受限	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58		-
301316	慧博云通	2022年9月29日	6个月	新股流通受限	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88		-
301319	唯特偶	2022年9月22日	6个月	新股流通受限	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05		-
301328	维峰电子	2022年8月30日	6个月	新股流通受限	78.80	76.96	160	12,608.00	12,313.60		-
301338	凯格精机	2022年8月8日	6个月	新股流通受限	46.33	48.99	257	11,906.81	12,590.43		-
301339	通行宝	2022年9月2日	6个月	新股流通受限	18.78	15.59	605	11,361.90	9,431.95		-
301349	信德	2022年	6个月	新股流	138.88	103.52	79	10,971.52	8,178.08		-

	新材	8月30日		通受限							
301356	天振股份	2022年11月3日	6个月	新股流通受限	63.00	43.33	405	25,515.00	17,548.65		-
301363	美好医疗	2022年9月28日	6个月	新股流通受限	30.66	37.85	368	11,282.88	13,928.80		-
301366	一博科技	2022年9月19日	6个月	新股流通受限	65.35	45.09	211	13,788.85	9,513.99		-
301367	怡和嘉业	2022年10月21日	6个月	新股流通受限	119.88	175.78	131	15,704.28	23,027.18		-
301368	丰立智能	2022年12月7日	6个月	新股流通受限	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24		-
301379	天山电子	2022年10月19日	6个月	新股流通受限	31.51	24.63	449	14,147.99	11,058.87		-
301389	隆扬电子	2022年10月18日	6个月	新股流通受限	22.50	17.16	805	18,112.50	13,813.80		-
301391	卡莱特	2022年11月24日	6个月	新股流通受限	96.00	80.97	247	23,712.00	19,999.59		-
688141	杰华特	2022年12月16日	6个月	新股流通受限	38.26	43.89	6,664	254,964.64	292,482.96		-
688271	联影医疗	2022年8月12日	6个月	新股流通受限	109.88	171.68	1,915	210,420.20	328,767.20		-
688401	路维光电	2022年8月10日	6个月	新股流通受限	25.08	41.55	4,947	124,070.76	205,547.85		-
688448	磁谷科技	2022年9月13日	6个月	新股流通受限	32.90	22.84	1,985	65,306.50	45,337.40		-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名	停牌日期	停牌原	期末估值单价	复牌日	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	-----	------	-----	--------	-----	-------	-------	--------	--------	----

	称		因		期					
600038	中直股份	2022年12月26日	重大事项停牌	46.41	2023年1月10日	51.05	105,600	4,804,337.90	4,900,896.00	-
300850	新强联	2022年12月30日	重大事项停牌	53.28	2023年1月10日	56.88	13,700	802,650.52	729,936.00	-

#### 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 2022 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 2022 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%。

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。

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资。(2021 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。

##### 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（2022 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 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
<b>资产</b>							
银行存款	54,047,632.99	-	-	-	-	-	54,047,632.99
结算备付金	3,085,919.15	-	-	-	-	-	3,085,919.15
存出保证金	105,880.12	-	-	-	-	-	105,880.12
交易性金融资产	-	-	-	-	-	515,731,786.13	515,731,786.13
应收申购款	3,401.71	-	-	-	-	2,258,327.77	2,261,729.48
应收清算款	-	-	-	-	-	207,368.22	207,368.22
资产总计	57,242,833.97	-	-	-	-	518,197,482.12	575,440,316.09
<b>负债</b>							
应付赎回款	-	-	-	-	-	20,945,598.99	20,945,598.99
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	473,100.52	473,100.52
应付托管费	-	-	-	-	-	94,620.13	94,620.13
应付销售服务费	-	-	-	-	-	83,899.70	83,899.70
其他负债	-	-	-	-	-	2,600,354.82	2,600,354.82
负债总计	-	-	-	-	-	24,197,574.16	24,197,574.16
利率敏感度缺口	57,242,833.97	-	-	-	-	-493,999,907.96	551,242,741.93
<b>上年度末</b>							
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
<b>资产</b>							
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
应收申购款	-	-	-	-	-	194,399.53	194,399.53
其他资产	-	-	-	-	-	897.77	897.77
资产总计	6,591,439.65	-	-	-	-	97,107,542.16	103,698,981.81
<b>负债</b>							
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
其他负债	-	-	-	-	476,018.21	476,018.21
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

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 2022 年 12 月 31 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（2021 年 12 月 31 日：同）。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于标的指数成份股、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 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	515,731,786.13	93.56	96,912,244.86	94.40
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	515,731,786.13	93.56	96,912,244.86	94.40



#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除股票基准指数以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	1. 股票基准指数下降 100 个基点	-5,179,770.22	-949,482.93
	2. 股票基准指数上升 100 个基点	5,179,770.22	949,482.93

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	508,690,449.51	96,906,740.37
第二层次	5,630,832.00	5,504.49
第三层次	1,410,504.62	-
合计	515,731,786.13	96,912,244.86

###### 7.4.14.2.2 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。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	1,173,718.92	1,173,718.92
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	236,785.70	236,785.70
其中：计入损益的利得或损失	-	236,785.70	236,785.70
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,410,504.62	1,410,504.62
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	236,785.70	236,785.70
项目	上年度可比同期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-

期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动—公允价值变动损益	-	-	-
---	---	---	---

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,410,504.62	亚式期权模型	预期波动率	0.2063-2.4756	预期波动率越大公允价值越低
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 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、其他资产以及其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	515,731,786.13	89.62
	其中：股票	515,731,786.13	89.62
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	57,133,552.14	9.93
8	其他各项资产	2,574,977.82	0.45
9	合计	575,440,316.09	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	5,886,965.00	1.07
B	采矿业	18,568,490.22	3.37
C	制造业	259,444,890.12	47.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,750,803.01	2.86
E	建筑业	12,579,088.00	2.28
F	批发和零售业	19,807,654.10	3.59
G	交通运输、仓储和邮政业	12,655,461.70	2.30
H	住宿和餐饮业	1,257,360.00	0.23
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,603,743.14	3.56
J	金融业	31,339,545.21	5.69
K	房地产业	12,931,138.00	2.35
L	租赁和商务服务业	124,579.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	7,015,518.08	1.27
N	水利、环境和公共设施管理业	129,710.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,754,074.00	0.32
R	文化、体育和娱乐业	5,484,356.00	0.99
S	综合	-	-
	合计	424,333,375.58	76.98

### 8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	1,977,946.00	0.36
B	采矿业	2,918,715.00	0.53

C	制造业	57,414,042.58	10.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,538,856.23	0.28
E	建筑业	307,200.00	0.06
F	批发和零售业	3,006,949.51	0.55
G	交通运输、仓储和邮政业	1,063,740.50	0.19
H	住宿和餐饮业	99,195.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,395,971.17	2.61
J	金融业	3,654,240.83	0.66
K	房地产业	1,539,017.00	0.28
L	租赁和商务服务业	1,821,240.00	0.33
M	科学研究和技术服务业	104,796.88	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	27,375.55	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	405,195.00	0.07
Q	卫生和社会工作	980,590.08	0.18
R	文化、体育和娱乐业	48,301.22	0.01
S	综合	95,038.00	0.02
	合计	91,398,410.55	16.58

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

### 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600667	太极实业	1,423,800	7,346,808.00	1.33
2	000987	越秀资本	1,215,505	7,280,874.95	1.32
3	600118	中国卫星	336,700	7,255,885.00	1.32
4	600027	华电国际	1,165,800	6,854,904.00	1.24
5	600064	南京高科	1,019,600	6,739,556.00	1.22
6	002429	兆驰股份	1,863,100	6,502,219.00	1.18
7	002384	东山精密	261,205	6,459,599.65	1.17
8	002430	杭氧股份	154,377	6,076,278.72	1.10

9	300009	安科生物	647,751	6,062,949.36	1.10
10	600160	巨化股份	386,900	6,000,819.00	1.09
11	002131	利欧股份	3,389,600	5,999,592.00	1.09
12	002299	圣农发展	248,500	5,886,965.00	1.07
13	601231	环旭电子	358,700	5,821,701.00	1.06
14	002273	水晶光电	481,663	5,678,806.77	1.03
15	000729	燕京啤酒	534,300	5,674,266.00	1.03
16	002831	裕同科技	171,000	5,654,970.00	1.03
17	603345	安井食品	34,100	5,520,108.00	1.00
18	002353	杰瑞股份	188,900	5,272,199.00	0.96
19	300724	捷佳伟创	45,600	5,199,312.00	0.94
20	600489	中金黄金	634,700	5,198,193.00	0.94
21	600549	厦门钨业	262,800	5,137,740.00	0.93
22	000401	冀东水泥	622,900	5,126,467.00	0.93
23	688390	固德威	15,800	5,104,822.00	0.93
24	300144	宋城演艺	345,100	5,038,460.00	0.91
25	600038	中直股份	105,600	4,900,896.00	0.89
26	603233	大参林	121,972	4,830,091.20	0.88
27	600699	均胜电子	343,692	4,828,872.60	0.88
28	603658	安图生物	75,600	4,675,860.00	0.85
29	002572	索菲亚	256,959	4,666,375.44	0.85
30	600871	石化油服	2,265,200	4,485,096.00	0.81
31	002080	中材科技	206,200	4,418,866.00	0.80
32	600642	申能股份	803,249	4,409,837.01	0.80
33	600827	百联股份	360,061	4,363,939.32	0.79
34	601990	南京证券	543,200	4,307,576.00	0.78
35	300776	帝尔激光	34,000	4,284,000.00	0.78
36	002250	联化科技	271,734	4,211,877.00	0.76
37	002409	雅克科技	83,500	4,205,895.00	0.76
38	002372	伟星新材	193,159	4,122,013.06	0.75
39	300017	网宿科技	733,200	4,091,256.00	0.74
40	600529	山东药玻	142,800	4,055,520.00	0.74
41	601991	大唐发电	1,445,000	4,031,550.00	0.73
42	002444	巨星科技	206,600	3,921,268.00	0.71
43	688819	天能股份	106,100	3,898,114.00	0.71
44	688567	孚能科技	142,800	3,859,884.00	0.70
45	002468	申通快递	361,500	3,734,295.00	0.68
46	600096	云天化	171,300	3,604,152.00	0.65
47	000807	云铝股份	323,700	3,599,544.00	0.65
48	603056	德邦股份	172,600	3,595,258.00	0.65
49	600170	上海建工	1,375,200	3,575,520.00	0.65
50	603866	桃李面包	220,700	3,398,780.00	0.62
51	002242	九阳股份	205,700	3,389,936.00	0.61

52	600161	天坛生物	142,780	3,388,169.40	0.61
53	688002	睿创微纳	91,100	3,388,009.00	0.61
54	300115	长盈精密	325,900	3,366,547.00	0.61
55	002673	西部证券	548,000	3,337,320.00	0.61
56	600482	中国动力	218,100	3,334,749.00	0.60
57	600500	中化国际	503,958	3,331,162.38	0.60
58	002506	协鑫集成	1,122,700	3,267,057.00	0.59
59	603127	昭衍新药	55,788	3,258,577.08	0.59
60	688256	寒武纪	58,901	3,213,638.56	0.58
61	600909	华安证券	696,200	3,195,558.00	0.58
62	002901	大博医疗	93,200	3,171,596.00	0.58
63	600755	厦门国贸	433,117	3,092,455.38	0.56
64	002110	三钢闽光	654,700	3,077,090.00	0.56
65	601665	齐鲁银行	730,900	3,047,853.00	0.55
66	600998	九州通	232,405	3,030,561.20	0.55
67	000513	丽珠集团	93,200	3,027,136.00	0.55
68	600409	三友化工	454,100	3,001,601.00	0.54
69	600307	酒钢宏兴	1,786,300	2,947,395.00	0.53
70	002244	滨江集团	329,400	2,908,602.00	0.53
71	300676	华大基因	55,900	2,889,471.00	0.52
72	601000	唐山港	1,035,700	2,837,818.00	0.51
73	002945	华林证券	207,907	2,740,214.26	0.50
74	600487	亨通光电	176,400	2,656,584.00	0.48
75	300285	国瓷材料	94,700	2,610,879.00	0.47
76	600066	宇通客车	344,100	2,584,191.00	0.47
77	603939	益丰药房	37,600	2,400,384.00	0.44
78	603517	绝味食品	39,200	2,394,728.00	0.43
79	600376	首开股份	418,400	2,380,696.00	0.43
80	601699	潞安环能	134,952	2,273,941.20	0.41
81	603606	东方电缆	33,500	2,272,305.00	0.41
82	601233	桐昆股份	147,800	2,135,710.00	0.39
83	002500	山西证券	399,000	2,114,700.00	0.38
84	688777	中控技术	22,071	2,004,708.93	0.36
85	600399	抚顺特钢	139,500	1,996,245.00	0.36
86	688385	复旦微电	26,002	1,815,199.62	0.33
87	300244	迪安诊断	69,800	1,754,074.00	0.32
88	002966	苏州银行	220,100	1,712,378.00	0.31
89	600348	华阳股份	120,100	1,711,425.00	0.31
90	002081	金螳螂	341,600	1,656,760.00	0.30
91	000400	许继电气	82,900	1,655,513.00	0.30
92	603596	伯特利	20,400	1,627,920.00	0.30
93	601058	赛轮轮胎	162,200	1,625,244.00	0.29
94	002025	航天电器	24,300	1,609,875.00	0.29

95	688063	派能科技	5,000	1,578,250.00	0.29
96	601869	长飞光纤	46,700	1,523,821.00	0.28
97	000825	太钢不锈	327,700	1,415,664.00	0.26
98	600988	赤峰黄金	77,702	1,402,521.10	0.25
99	603786	科博达	21,200	1,395,596.00	0.25
100	603927	中科软	46,700	1,382,787.00	0.25
101	600026	中远海能	114,100	1,374,905.00	0.25
102	000988	华工科技	83,200	1,365,312.00	0.25
103	688521	芯原股份	30,495	1,343,914.65	0.24
104	300390	天华超净	23,900	1,335,532.00	0.24
105	603737	三棵树	11,700	1,331,811.00	0.24
106	603883	老百姓	32,700	1,323,369.00	0.24
107	600177	雅戈尔	209,000	1,322,970.00	0.24
108	600126	杭钢股份	318,400	1,314,992.00	0.24
109	603605	珀莱雅	7,800	1,306,344.00	0.24
110	002028	思源电气	33,900	1,295,658.00	0.24
111	002056	横店东磁	67,700	1,268,698.00	0.23
112	600258	首旅酒店	50,700	1,257,360.00	0.23
113	002152	广电运通	123,900	1,231,566.00	0.22
114	002683	广东宏大	45,400	1,223,984.00	0.22
115	002568	百润股份	27,600	1,031,136.00	0.19
116	002078	太阳纸业	88,400	1,018,368.00	0.18
117	000021	深科技	92,200	985,618.00	0.18
118	000547	航天发展	102,600	963,414.00	0.17
119	000975	银泰黄金	85,958	948,976.32	0.17
120	000039	中集集团	134,000	943,360.00	0.17
121	000629	钒钛股份	195,500	924,715.00	0.17
122	000656	金科股份	472,400	902,284.00	0.16
123	600006	东风汽车	161,600	901,728.00	0.16
124	300012	华测检测	38,900	867,470.00	0.16
125	002595	豪迈科技	37,300	863,495.00	0.16
126	600299	安迪苏	96,600	797,916.00	0.14
127	603868	飞科电器	11,664	785,337.12	0.14
128	600259	广晟有色	19,343	777,588.60	0.14
129	600316	洪都航空	30,800	775,852.00	0.14
130	600095	湘财股份	97,600	737,856.00	0.13
131	300850	新强联	13,700	729,936.00	0.13
132	600728	佳都科技	134,000	707,520.00	0.13
133	600906	财达证券	90,900	688,113.00	0.12
134	002434	万里扬	82,800	666,540.00	0.12
135	600879	航天电子	97,900	665,720.00	0.12
136	601577	长沙银行	97,500	659,100.00	0.12
137	600377	宁沪高速	78,735	647,201.70	0.12



138	603218	日月股份	29,400	596,820.00	0.11
139	603160	汇顶科技	11,800	592,360.00	0.11
140	600546	山煤国际	40,600	588,294.00	0.11
141	601128	常熟银行	75,800	572,290.00	0.10
142	600517	国网英大	117,800	570,152.00	0.10
143	600862	中航高科	24,900	555,021.00	0.10
144	300257	开山股份	36,504	547,560.00	0.10
145	000898	鞍钢股份	188,300	502,761.00	0.09
146	603885	吉祥航空	28,800	465,984.00	0.08
147	002531	天顺风能	30,400	459,952.00	0.08
148	601928	凤凰传媒	56,300	445,896.00	0.08
149	002153	石基信息	29,400	440,706.00	0.08
150	600707	彩虹股份	101,400	419,796.00	0.08
151	300677	英科医疗	18,200	382,746.00	0.07
152	600705	中航产融	114,500	375,560.00	0.07
153	002223	鱼跃医疗	11,000	350,460.00	0.06
154	002925	盈趣科技	18,800	310,576.00	0.06
155	002422	科伦药业	11,500	306,015.00	0.06
156	600339	中油工程	94,500	281,610.00	0.05
157	000598	兴蓉环境	56,400	275,796.00	0.05
158	000623	吉林敖东	18,000	269,820.00	0.05
159	300001	特锐德	16,800	255,528.00	0.05
160	601717	郑煤机	22,300	248,868.00	0.05
161	601958	金钼股份	19,300	222,915.00	0.04
162	600764	中国海防	9,700	222,712.00	0.04
163	002065	东华软件	34,000	192,440.00	0.03
164	300474	景嘉微	3,400	185,538.00	0.03
165	000027	深圳能源	28,100	178,716.00	0.03
166	600511	国药股份	6,400	178,560.00	0.03
167	600867	通化东宝	16,800	154,224.00	0.03
168	600131	国网信通	10,100	151,096.00	0.03
169	002653	海思科	5,900	131,275.00	0.02
170	603568	伟明环保	7,000	129,710.00	0.02
171	002738	中矿资源	1,900	126,654.00	0.02
172	600062	华润双鹤	7,000	125,230.00	0.02
173	002127	南极电商	25,900	124,579.00	0.02
174	600498	烽火通信	6,600	86,724.00	0.02
175	300682	朗新科技	2,400	52,752.00	0.01
176	600985	淮北矿业	3,300	42,240.00	0.01
177	600536	中国软件	400	23,332.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	000651	格力电器	169,600	5,481,472.00	0.99
2	002123	梦网科技	324,900	3,648,627.00	0.66
3	300043	星辉娱乐	1,166,100	3,463,317.00	0.63
4	600588	用友网络	136,100	3,289,537.00	0.60
5	600919	江苏银行	427,900	3,119,391.00	0.57
6	000906	浙商中拓	322,447	2,905,247.47	0.53
7	000717	中南股份	1,013,700	2,889,045.00	0.52
8	002324	普利特	179,400	2,870,400.00	0.52
9	300624	万兴科技	92,400	2,712,864.00	0.49
10	000913	钱江摩托	146,500	2,707,320.00	0.49
11	603612	索通发展	103,300	2,687,866.00	0.49
12	002560	通达股份	391,100	2,667,302.00	0.48
13	603787	新日股份	143,200	2,591,920.00	0.47
14	603768	常青股份	167,600	2,498,916.00	0.45
15	300684	中石科技	165,800	2,455,498.00	0.45
16	002338	奥普光电	101,900	2,271,351.00	0.41
17	300274	阳光电源	18,200	2,034,760.00	0.37
18	600688	上海石化	566,900	1,763,059.00	0.32
19	002115	三维通信	372,000	1,685,160.00	0.31
20	600795	国电电力	347,200	1,482,544.00	0.27
21	600197	伊力特	59,300	1,455,222.00	0.26
22	603283	赛腾股份	46,500	1,396,395.00	0.25
23	601808	中海油服	81,200	1,346,296.00	0.24
24	600346	恒力石化	75,200	1,167,856.00	0.21
25	002458	益生股份	84,000	1,167,600.00	0.21
26	601766	中国中车	226,400	1,156,904.00	0.21
27	601225	陕西煤业	61,400	1,140,812.00	0.21
28	300328	宜安科技	179,600	1,074,008.00	0.19
29	600211	西藏药业	28,500	1,023,720.00	0.19
30	300093	金刚光伏	22,800	976,752.00	0.18
31	002674	兴业科技	85,600	925,336.00	0.17
32	002547	春兴精工	198,300	908,214.00	0.16
33	002234	民和股份	41,900	810,346.00	0.15
34	002285	世联行	207,000	681,030.00	0.12
35	002428	云南锗业	72,900	679,428.00	0.12
36	601111	中国国航	58,700	622,220.00	0.11
37	000985	大庆华科	34,600	602,732.00	0.11
38	002753	永东股份	71,700	599,412.00	0.11
39	000425	徐工机械	115,600	586,092.00	0.11
40	600600	青岛啤酒	4,800	516,000.00	0.09
41	000516	国际医学	42,000	514,080.00	0.09
42	300348	长亮科技	48,400	492,712.00	0.09
43	300194	福安药业	135,600	488,160.00	0.09

44	688138	清溢光电	26,100	475,020.00	0.09
45	000584	哈工智能	66,000	454,080.00	0.08
46	000615	奥园美谷	52,700	435,302.00	0.08
47	600864	哈投股份	92,200	433,340.00	0.08
48	601069	西部黄金	36,300	431,607.00	0.08
49	600266	城建发展	90,900	422,685.00	0.08
50	600115	中国东航	75,000	414,750.00	0.08
51	300143	盈康生命	40,000	406,800.00	0.07
52	000526	学大教育	22,700	405,195.00	0.07
53	000534	万泽股份	27,500	387,750.00	0.07
54	300125	聆达股份	19,200	380,928.00	0.07
55	002632	道明光学	57,200	364,936.00	0.07
56	600129	太极集团	12,000	360,720.00	0.07
57	002902	铭普光磁	27,000	339,390.00	0.06
58	600571	信雅达	36,100	332,842.00	0.06
59	688271	联影医疗	1,915	328,767.20	0.06
60	002698	博实股份	23,100	323,631.00	0.06
61	600071	凤凰光学	15,100	318,308.00	0.06
62	002882	金龙羽	28,400	312,968.00	0.06
63	600502	安徽建工	64,000	307,200.00	0.06
64	300443	金雷股份	7,600	306,128.00	0.06
65	688141	杰华特	6,664	292,482.96	0.05
66	300403	汉宇集团	47,000	277,300.00	0.05
67	002111	威海广泰	26,900	268,193.00	0.05
68	002526	山东矿机	112,100	249,983.00	0.05
69	600408	安泰集团	92,900	248,043.00	0.04
70	002783	凯龙股份	27,500	233,475.00	0.04
71	601689	拓普集团	3,900	228,462.00	0.04
72	300380	安硕信息	12,300	217,710.00	0.04
73	600363	联创光电	9,000	214,290.00	0.04
74	002907	华森制药	10,400	211,744.00	0.04
75	688401	路维光电	4,947	205,547.85	0.04
76	603378	亚士创能	17,300	199,469.00	0.04
77	300203	聚光科技	5,600	189,840.00	0.03
78	603315	福鞍股份	10,700	182,970.00	0.03
79	601369	陕鼓动力	15,400	176,484.00	0.03
80	600469	风神股份	37,500	175,875.00	0.03
81	688408	中信博	1,600	157,440.00	0.03
82	002487	大金重工	3,800	157,206.00	0.03
83	301021	英诺激光	5,900	152,161.00	0.03
84	688108	赛诺医疗	25,600	146,176.00	0.03
85	000635	英力特	16,600	143,756.00	0.03
86	600771	广誉远	5,100	141,882.00	0.03

87	002654	万润科技	27,000	136,080.00	0.02
88	002068	黑猫股份	11,100	132,867.00	0.02
89	000902	新洋丰	11,400	131,214.00	0.02
90	002666	德联集团	26,000	126,360.00	0.02
91	300134	大富科技	15,800	122,608.00	0.02
92	300481	濮阳惠成	4,400	117,612.00	0.02
93	688268	华特气体	1,500	111,375.00	0.02
94	603058	永吉股份	13,900	101,192.00	0.02
95	600754	锦江酒店	1,700	99,195.00	0.02
96	600212	绿能慧充	12,200	95,038.00	0.02
97	002900	哈三联	6,600	90,090.00	0.02
98	688277	天智航	7,400	87,986.00	0.02
99	601136	首创证券	4,739	82,553.38	0.01
100	002727	一心堂	2,600	81,926.00	0.01
101	000931	中关村	12,100	74,415.00	0.01
102	002322	理工能科	8,100	72,333.00	0.01
103	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.01
104	601965	中国汽研	3,500	67,830.00	0.01
105	300337	银邦股份	8,500	65,960.00	0.01
106	002169	智光电气	8,400	64,260.00	0.01
107	000530	冰山冷热	13,700	61,376.00	0.01
108	688520	神州细胞	1,000	60,600.00	0.01
109	603289	泰瑞机器	6,500	58,370.00	0.01
110	001269	欧晶科技	546	54,185.04	0.01
111	300085	银之杰	5,200	48,360.00	0.01
112	688448	磁谷科技	1,985	45,337.40	0.01
113	001330	博纳影业	3,564	42,696.72	0.01
114	300068	南都电源	2,000	42,600.00	0.01
115	603396	金辰股份	500	41,620.00	0.01
116	301239	普瑞眼科	551	38,393.68	0.01
117	001338	永顺泰	1,649	34,826.88	0.01
118	300267	尔康制药	9,800	34,790.00	0.01
119	001258	立新能源	3,188	33,346.48	0.01
120	600973	宝胜股份	6,700	31,959.00	0.01
121	301269	华大九天	341	29,987.54	0.01
122	300290	荣科科技	6,400	28,800.00	0.01
123	301175	中科环保	4,555	27,375.55	0.00
124	301301	川宁生物	3,574	26,912.22	0.00
125	601022	宁波远洋	1,983	26,770.50	0.00
126	301367	怡和嘉业	131	23,027.18	0.00
127	001322	箭牌家居	1,488	22,617.60	0.00
128	603255	鼎际得	489	21,956.10	0.00
129	301267	华夏眼科	322	21,316.40	0.00

130	301391	卡莱特	247	19,999.59	0.00
131	001236	弘业期货	1,399	18,956.45	0.00
132	301356	天振股份	405	17,548.65	0.00
133	603057	紫燕食品	549	17,277.03	0.00
134	001339	智微智能	812	16,516.08	0.00
135	603211	晋拓股份	1,287	16,164.72	0.00
136	603237	五芳斋	325	15,323.75	0.00
137	001298	好上好	403	14,379.04	0.00
138	301363	美好医疗	368	13,928.80	0.00
139	301389	隆扬电子	805	13,813.80	0.00
140	301311	昆船智能	832	13,195.52	0.00
141	301297	富乐德	1,015	13,184.85	0.00
142	603130	云中马	480	13,176.00	0.00
143	301230	泓博医药	269	12,998.08	0.00
144	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
145	300315	掌趣科技	3,900	12,519.00	0.00
146	301280	珠城科技	279	12,499.20	0.00
147	001256	炜冈科技	474	12,390.36	0.00
148	001333	光华股份	426	12,332.70	0.00
149	301328	维峰电子	160	12,313.60	0.00
150	301296	新巨丰	816	12,158.40	0.00
151	301223	中荣股份	657	11,911.41	0.00
152	001300	三柏硕	763	11,826.50	0.00
153	001299	美能能源	576	11,635.20	0.00
154	301290	东星医疗	330	11,592.90	0.00
155	001331	胜通能源	385	11,330.55	0.00
156	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
157	301379	天山电子	449	11,058.87	0.00
158	301171	易点天下	621	11,004.12	0.00
159	300180	华峰超纤	2,800	10,808.00	0.00
160	001238	浙江正特	374	10,797.38	0.00
161	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
162	001222	源飞宠物	434	10,758.86	0.00
163	301273	瑞晨环保	277	10,467.83	0.00
164	301282	金禄电子	390	9,847.50	0.00
165	603182	嘉华股份	546	9,778.86	0.00
166	301366	一博科技	211	9,513.99	0.00
167	301339	通行宝	605	9,431.95	0.00
168	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00
169	001229	魅视科技	347	9,313.48	0.00
170	301176	逸豪新材	544	9,188.16	0.00
171	603280	南方路机	363	8,893.50	0.00
172	301227	森鹰窗业	284	8,375.16	0.00

173	301349	信德新材	79	8,178.08	0.00
174	001231	农心科技	355	8,037.20	0.00
175	301197	工大科雅	380	7,630.40	0.00
176	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
177	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
178	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
179	001336	楚环科技	274	6,770.54	0.00
180	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
181	301300	远翔新材	211	6,197.07	0.00
182	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
183	003022	联泓新科	200	6,070.00	0.00
184	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
185	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
186	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
187	301017	漱玉平民	300	5,397.00	0.00
188	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00
189	301309	万得凯	203	4,965.38	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	600549	厦门钨业	20,838,954.00	20.30
2	000738	航发控制	20,139,663.00	19.62
3	000401	冀东水泥	19,710,005.00	19.20
4	600862	中航高科	19,176,488.00	18.68
5	600732	爱旭股份	19,148,650.00	18.65
6	600118	中国卫星	19,009,737.00	18.52
7	600256	广汇能源	17,793,074.00	17.33
8	300009	安科生物	17,629,652.65	17.17
9	603866	桃李面包	16,904,124.73	16.47
10	600985	淮北矿业	16,825,220.47	16.39
11	600026	中远海能	16,700,208.00	16.27
12	002244	滨江集团	16,185,634.00	15.77
13	603605	珀莱雅	15,745,682.40	15.34
14	002180	纳思达	15,331,492.00	14.93
15	600879	航天电子	15,286,861.00	14.89
16	600380	健康元	15,276,331.00	14.88
17	600160	巨化股份	15,084,555.00	14.69
18	600064	南京高科	14,980,026.20	14.59
19	600372	中航电子	14,738,292.00	14.36
20	000729	燕京啤酒	14,550,621.00	14.17
21	600765	中航重机	14,385,635.60	14.01

22	603127	昭衍新药	14,376,529.84	14.00
23	601456	国联证券	14,375,812.00	14.00
24	000987	越秀资本	14,038,733.85	13.67
25	300724	捷佳伟创	14,006,897.08	13.64
26	688567	孚能科技	13,991,020.15	13.63
27	002250	联化科技	13,924,019.38	13.56
28	601699	潞安环能	13,918,052.76	13.56
29	603233	大参林	13,796,935.72	13.44
30	601098	中南传媒	13,750,010.00	13.39
31	000983	山西焦煤	13,704,846.00	13.35
32	600376	首开股份	13,610,441.00	13.26
33	600236	桂冠电力	13,527,993.28	13.18
34	002299	圣农发展	13,498,902.00	13.15
35	688777	中控技术	13,465,588.00	13.12
36	688521	芯原股份	13,410,651.61	13.06
37	600667	太极实业	13,385,454.00	13.04
38	600316	洪都航空	13,383,247.00	13.04
39	601128	常熟银行	13,242,944.00	12.90
40	300017	网宿科技	12,911,715.00	12.58
41	601298	青岛港	12,814,408.60	12.48
42	688819	天能股份	12,741,498.04	12.41
43	002131	利欧股份	12,657,649.00	12.33
44	002384	东山精密	12,571,641.15	12.25
45	600259	广晟有色	12,550,433.11	12.22
46	600233	圆通速递	12,540,685.60	12.22
47	600027	华电国际	12,491,907.00	12.17
48	002422	科伦药业	12,376,231.00	12.06
49	000402	金融街	12,361,167.00	12.04
50	002506	协鑫集成	12,335,719.00	12.02
51	600392	盛和资源	12,246,032.00	11.93
52	688390	固德威	11,978,186.57	11.67
53	600153	建发股份	11,924,666.00	11.62
54	688122	西部超导	11,883,928.20	11.58
55	000825	太钢不锈	11,744,066.00	11.44
56	601665	齐鲁银行	11,479,365.00	11.18
57	601869	长飞光纤	11,446,270.40	11.15
58	002468	申通快递	11,360,841.00	11.07
59	000970	中科三环	11,240,509.36	10.95
60	603317	天味食品	11,238,407.00	10.95
61	002353	杰瑞股份	11,082,139.00	10.79
62	600038	中直股份	11,031,990.20	10.75
63	002240	盛新锂能	10,991,400.00	10.71
64	603456	九洲药业	10,949,246.00	10.67

65	300073	当升科技	10,914,406.00	10.63
66	002155	湖南黄金	10,817,962.00	10.54
67	002085	万丰奥威	10,770,985.00	10.49
68	600998	九州通	10,748,023.60	10.47
69	002399	海普瑞	10,698,478.49	10.42
70	300001	特锐德	10,671,748.97	10.39
71	600325	华发股份	10,616,392.85	10.34
72	603345	安井食品	10,580,148.00	10.31
73	300699	光威复材	10,579,550.00	10.30
74	600521	华海药业	10,441,347.00	10.17
75	605117	德业股份	10,357,304.00	10.09
76	002444	巨星科技	10,322,858.00	10.05
77	601991	大唐发电	10,288,175.00	10.02
78	002081	金螳螂	10,244,232.00	9.98
79	601958	金钼股份	10,225,788.00	9.96
80	000553	安道麦 A	10,221,872.79	9.96
81	600211	西藏药业	10,196,682.00	9.93
82	600909	华安证券	10,174,771.40	9.91
83	300168	万达信息	10,115,441.00	9.85
84	600141	兴发集团	10,077,699.00	9.82
85	300144	宋城演艺	10,018,142.00	9.76
86	600901	江苏租赁	9,971,264.00	9.71
87	603613	国联股份	9,928,174.01	9.67
88	001914	招商积余	9,925,967.00	9.67
89	002078	太阳纸业	9,923,664.00	9.67
90	601872	招商轮船	9,885,248.60	9.63
91	600435	北方导航	9,781,376.00	9.53
92	600546	山煤国际	9,624,689.00	9.37
93	000090	天健集团	9,596,341.00	9.35
94	603885	吉祥航空	9,596,146.00	9.35
95	300012	华测检测	9,577,507.00	9.33
96	601000	唐山港	9,563,174.00	9.31
97	002429	兆驰股份	9,563,172.00	9.31
98	600988	赤峰黄金	9,528,353.56	9.28
99	601228	广州港	9,519,980.00	9.27
100	002653	海思科	9,450,501.00	9.21
101	600642	申能股份	9,399,979.63	9.16
102	600482	中国动力	9,380,885.00	9.14
103	600486	扬农化工	9,361,318.00	9.12
104	002128	电投能源	9,358,328.00	9.12
105	600529	山东药玻	9,354,389.00	9.11
106	002409	雅克科技	9,309,616.44	9.07
107	300285	国瓷材料	9,299,629.00	9.06



108	002156	通富微电	9,278,812.04	9.04
109	600415	小商品城	9,273,033.00	9.03
110	688099	晶晨股份	9,100,316.26	8.86
111	600348	华阳股份	9,095,157.04	8.86
112	603868	飞科电器	9,079,635.40	8.84
113	300244	迪安诊断	9,055,402.00	8.82
114	002831	裕同科技	9,019,734.00	8.79
115	002430	杭氧股份	8,995,531.46	8.76
116	688002	睿创微纳	8,963,104.42	8.73
117	600096	云天化	8,960,742.00	8.73
118	600699	均胜电子	8,937,557.88	8.71
119	300115	长盈精密	8,937,198.00	8.71
120	600522	中天科技	8,867,216.41	8.64
121	002340	格林美	8,734,048.00	8.51
122	603379	三美股份	8,711,666.00	8.49
123	600498	烽火通信	8,689,990.08	8.46
124	601390	中国中铁	8,657,873.00	8.43
125	002056	横店东磁	8,638,561.00	8.41
126	000878	云南铜业	8,614,236.00	8.39
127	000629	钒钛股份	8,609,501.00	8.39
128	002028	思源电气	8,600,850.00	8.38
129	601058	赛轮轮胎	8,580,769.00	8.36
130	000686	东北证券	8,548,607.00	8.33
131	600500	中化国际	8,530,187.71	8.31
132	603517	绝味食品	8,389,307.00	8.17
133	000975	银泰黄金	8,349,532.58	8.13
134	688321	微芯生物	8,317,269.23	8.10
135	601111	中国国航	8,289,568.00	8.07
136	000717	中南股份	8,206,482.49	7.99
137	002500	山西证券	8,170,515.00	7.96
138	002945	华林证券	8,158,637.50	7.95
139	002756	永兴材料	8,107,321.34	7.90
140	002966	苏州银行	8,069,822.50	7.86
141	000651	格力电器	8,023,081.00	7.81
142	300888	稳健医疗	8,006,669.86	7.80
143	600307	酒钢宏兴	7,951,435.00	7.75
144	002124	天邦食品	7,935,430.60	7.73
145	000937	冀中能源	7,898,499.00	7.69
146	600126	杭钢股份	7,894,823.00	7.69
147	002273	水晶光电	7,891,177.23	7.69
148	603056	德邦股份	7,840,195.00	7.64
149	300618	寒锐钴业	7,781,756.00	7.58
150	601717	郑煤机	7,750,332.00	7.55

151	000768	中航西飞	7,724,355.00	7.52
152	603658	安图生物	7,622,787.70	7.42
153	300769	德方纳米	7,543,949.78	7.35
154	688005	容百科技	7,453,988.84	7.26
155	601231	环旭电子	7,437,651.56	7.24
156	600578	京能电力	7,436,990.00	7.24
157	600795	国电电力	7,425,669.00	7.23
158	601992	金隅集团	7,359,548.00	7.17
159	600970	中材国际	7,332,346.00	7.14
160	600919	江苏银行	7,321,975.90	7.13
161	002625	光启技术	7,318,740.20	7.13
162	002382	蓝帆医疗	7,312,488.00	7.12
163	601928	凤凰传媒	7,309,604.00	7.12
164	600967	内蒙一机	7,297,479.00	7.11
165	600582	天地科技	7,245,071.00	7.06
166	600282	南钢股份	7,210,725.00	7.02
167	002413	雷科防务	7,119,439.60	6.93
168	600079	人福医药	7,117,773.00	6.93
169	300363	博腾股份	7,093,087.00	6.91
170	600499	科达制造	7,089,650.85	6.91
171	002080	中材科技	7,087,103.00	6.90
172	600177	雅戈尔	7,039,161.00	6.86
173	300212	易华录	7,005,197.50	6.82
174	600863	内蒙华电	6,988,900.00	6.81
175	002572	索菲亚	6,917,541.36	6.74
176	603719	良品铺子	6,905,088.00	6.73
177	000898	鞍钢股份	6,890,789.00	6.71
178	000060	中金岭南	6,865,902.00	6.69
179	300498	温氏股份	6,857,236.00	6.68
180	002123	梦网科技	6,751,213.79	6.58
181	600528	中铁工业	6,687,518.00	6.51
182	002705	新宝股份	6,671,500.39	6.50
183	600885	宏发股份	6,616,025.95	6.44
184	601225	陕西煤业	6,605,276.54	6.43
185	601718	际华集团	6,582,040.00	6.41
186	002249	大洋电机	6,570,072.00	6.40
187	002557	洽洽食品	6,555,048.22	6.38
188	603786	科博达	6,541,631.00	6.37
189	002603	以岭药业	6,502,082.00	6.33
190	601577	长沙银行	6,417,606.00	6.25
191	000400	许继电气	6,410,301.00	6.24
192	600299	安迪苏	6,377,062.00	6.21
193	300308	中际旭创	6,349,833.00	6.19

194	600497	驰宏锌锗	6,306,332.00	6.14
195	000869	张裕 A	6,305,294.00	6.14
196	002985	北摩高科	6,302,503.00	6.14
197	300763	锦浪科技	6,290,361.50	6.13
198	688180	君实生物	6,287,719.77	6.12
199	603939	益丰药房	6,264,999.00	6.10
200	603355	莱克电气	6,218,037.36	6.06
201	000519	中兵红箭	6,207,116.00	6.05
202	600120	浙江东方	6,198,421.30	6.04
203	000039	中集集团	6,177,022.50	6.02
204	600827	百联股份	6,170,028.93	6.01
205	002242	九阳股份	6,118,356.00	5.96
206	601005	重庆钢铁	6,050,488.00	5.89
207	300072	海新能科	6,049,884.00	5.89
208	601139	深圳燃气	6,048,304.40	5.89
209	600754	锦江酒店	6,016,762.00	5.86
210	300761	立华股份	5,997,598.00	5.84
211	600871	石化油服	5,997,437.00	5.84
212	600298	安琪酵母	5,996,718.60	5.84
213	601319	中国人保	5,956,661.00	5.80
214	603568	伟明环保	5,941,844.60	5.79
215	002281	光迅科技	5,864,388.00	5.71
216	002947	恒铭达	5,854,098.00	5.70
217	601186	中国铁建	5,834,793.00	5.68
218	300647	超频三	5,822,237.50	5.67
219	600673	东阳光	5,820,238.00	5.67
220	601003	柳钢股份	5,802,315.00	5.65
221	601990	南京证券	5,801,682.00	5.65
222	688256	寒武纪	5,779,001.45	5.63
223	000998	隆平高科	5,681,551.00	5.53
224	601689	拓普集团	5,664,852.20	5.52
225	002372	伟星新材	5,627,937.10	5.48
226	600764	中国海防	5,581,403.00	5.44
227	300251	光线传媒	5,553,653.00	5.41
228	002901	大博医疗	5,526,758.00	5.38
229	601698	中国卫通	5,515,285.00	5.37
230	000830	鲁西化工	5,451,334.00	5.31
231	600399	抚顺特钢	5,431,503.00	5.29
232	000960	锡业股份	5,369,806.00	5.23
233	600801	华新水泥	5,359,066.07	5.22
234	300676	华大基因	5,292,200.00	5.15
235	002497	雅化集团	5,290,245.00	5.15
236	600161	天坛生物	5,283,912.20	5.15

237	300238	冠昊生物	5,273,458.78	5.14
238	600170	上海建工	5,268,741.00	5.13
239	000883	湖北能源	5,262,353.00	5.13
240	600516	方大炭素	5,255,522.50	5.12
241	600487	亨通光电	5,253,437.00	5.12
242	000062	深圳华强	5,249,169.40	5.11
243	002673	西部证券	5,248,716.00	5.11
244	002423	中粮资本	5,220,954.54	5.09
245	601611	中国核建	5,218,960.00	5.08
246	601881	中国银河	5,192,265.00	5.06
247	601838	成都银行	5,191,488.00	5.06
248	601615	明阳智能	5,191,422.00	5.06
249	600639	浦东金桥	5,186,062.63	5.05
250	603768	常青股份	5,141,484.00	5.01
251	603267	鸿远电子	5,138,793.00	5.01
252	600039	四川路桥	5,122,699.00	4.99
253	600489	中金黄金	5,105,808.00	4.97
254	300832	新产业	5,092,216.00	4.96
255	300257	开山股份	5,060,981.68	4.93
256	000156	华数传媒	5,033,418.00	4.90
257	603589	口子窖	5,005,610.00	4.88
258	600511	国药股份	4,994,905.80	4.87
259	002120	韵达股份	4,977,691.00	4.85
260	002434	万里扬	4,970,339.00	4.84
261	603968	醋化股份	4,938,348.00	4.81
262	600383	金地集团	4,921,609.00	4.79
263	603228	景旺电子	4,914,852.00	4.79
264	300390	天华超净	4,894,024.00	4.77
265	000887	中鼎股份	4,882,938.00	4.76
266	000831	中国稀土	4,872,870.20	4.75
267	601766	中国中车	4,833,744.00	4.71
268	000537	广宇发展	4,833,694.00	4.71
269	603290	斯达半导	4,824,995.00	4.70
270	000733	振华科技	4,804,521.26	4.68
271	601865	福莱特	4,800,008.00	4.68
272	600166	福田汽车	4,787,295.92	4.66
273	300194	福安药业	4,770,209.00	4.65
274	600895	张江高科	4,756,168.00	4.63
275	688536	思瑞浦	4,740,980.96	4.62
276	600066	宇通客车	4,713,265.00	4.59
277	601668	中国建筑	4,667,440.00	4.55
278	300014	亿纬锂能	4,643,662.00	4.52
279	600409	三友化工	4,632,638.00	4.51

280	600604	市北高新	4,632,310.00	4.51
281	600959	江苏有线	4,631,023.00	4.51
282	300037	新宙邦	4,625,310.20	4.51
283	002268	电科网安	4,595,422.00	4.48
284	002595	豪迈科技	4,588,941.00	4.47
285	603650	彤程新材	4,563,139.00	4.44
286	002865	钧达股份	4,560,202.00	4.44
287	300776	帝尔激光	4,511,224.00	4.39
288	000739	普洛药业	4,472,292.00	4.36
289	603198	迎驾贡酒	4,424,191.00	4.31
290	000778	新兴铸管	4,394,365.00	4.28
291	002152	广电运通	4,383,056.00	4.27
292	000807	云铝股份	4,375,155.00	4.26
293	002405	四维图新	4,355,865.00	4.24
294	300136	信维通信	4,324,517.00	4.21
295	601156	东航物流	4,309,954.84	4.20
296	688586	江航装备	4,289,879.38	4.18
297	002948	青岛银行	4,278,350.00	4.17
298	600197	伊力特	4,273,282.00	4.16
299	603858	步长制药	4,272,968.00	4.16
300	601808	中海油服	4,243,438.00	4.13
301	002110	三钢闽光	4,225,187.00	4.12
302	002946	新乳业	4,219,675.00	4.11
303	601233	桐昆股份	4,200,691.00	4.09
304	601598	中国外运	4,154,698.00	4.05
305	300114	中航电测	4,134,034.00	4.03
306	000961	中南建设	4,125,990.00	4.02
307	000559	万向钱潮	4,095,377.84	3.99
308	600062	华润双鹤	4,077,907.00	3.97
309	300253	卫宁健康	4,074,462.00	3.97
310	600535	天士力	4,032,018.00	3.93
311	300223	北京君正	4,009,704.00	3.91
312	002683	广东宏大	3,976,493.00	3.87
313	600507	方大特钢	3,916,946.00	3.82
314	601077	渝农商行	3,878,871.00	3.78
315	002338	奥普光电	3,876,493.00	3.78
316	600502	安徽建工	3,863,717.00	3.76
317	600418	江淮汽车	3,841,538.00	3.74
318	600707	彩虹股份	3,840,075.00	3.74
319	688088	虹软科技	3,837,271.90	3.74
320	603708	家家悦	3,836,304.00	3.74
321	000547	航天发展	3,812,331.00	3.71
322	000988	华工科技	3,808,149.00	3.71

323	002204	大连重工	3,806,875.00	3.71
324	603883	老百姓	3,798,729.10	3.70
325	601998	中信银行	3,783,247.00	3.69
326	300482	万孚生物	3,767,577.00	3.67
327	000021	深科技	3,756,228.00	3.66
328	603927	中科软	3,739,601.20	3.64
329	603444	吉比特	3,732,077.00	3.64
330	600598	北大荒	3,713,217.00	3.62
331	688008	澜起科技	3,701,877.16	3.61
332	002324	普利特	3,657,765.00	3.56
333	600663	陆家嘴	3,645,567.00	3.55
334	002674	兴业科技	3,642,899.00	3.55
335	603596	伯特利	3,635,420.00	3.54
336	300429	强力新材	3,635,200.00	3.54
337	002458	益生股份	3,631,442.00	3.54
338	600258	首旅酒店	3,624,408.00	3.53
339	600956	新天绿能	3,616,581.00	3.52
340	300602	飞荣达	3,610,960.00	3.52
341	688065	凯赛生物	3,605,504.25	3.51
342	601696	中银证券	3,602,687.00	3.51
343	601117	中国化学	3,585,005.00	3.49
344	300328	宜安科技	3,559,815.02	3.47
345	300043	星辉娱乐	3,525,247.00	3.43
346	600728	佳都科技	3,513,712.00	3.42
347	000031	大悦城	3,501,755.00	3.41
348	002234	民和股份	3,483,559.00	3.39
349	600600	青岛啤酒	3,477,104.00	3.39
350	000913	钱江摩托	3,435,668.00	3.35
351	603218	日月股份	3,422,864.00	3.33
352	000906	浙商中拓	3,413,482.54	3.32
353	600688	上海石化	3,411,898.00	3.32
354	603026	胜华新材	3,394,651.00	3.31
355	600906	财达证券	3,377,860.00	3.29
356	000541	佛山照明	3,376,377.00	3.29
357	300570	太辰光	3,366,539.00	3.28
358	000513	丽珠集团	3,354,871.00	3.27
359	600875	东方电气	3,340,504.15	3.25
360	000581	威孚高科	3,335,578.00	3.25
361	002311	海大集团	3,330,931.00	3.24
362	600755	厦门国贸	3,309,012.37	3.22
363	000728	国元证券	3,297,341.75	3.21
364	300684	中石科技	3,283,343.00	3.20
365	300382	斯莱克	3,282,493.00	3.20

366	603612	索通发展	3,281,920.00	3.20
367	002560	通达股份	3,266,387.00	3.18
368	300816	艾可蓝	3,261,229.00	3.18
369	301035	润丰股份	3,260,622.00	3.18
370	002010	传化智联	3,230,166.00	3.15
371	002508	老板电器	3,196,899.13	3.11
372	600588	用友网络	3,190,412.00	3.11
373	300558	贝达药业	3,172,133.60	3.09
374	600329	达仁堂	3,158,210.00	3.08
375	002594	比亚迪	3,155,045.00	3.07
376	600073	上海梅林	3,117,144.00	3.04
377	600908	无锡银行	3,116,671.00	3.04
378	600580	卧龙电驱	3,101,980.00	3.02
379	600188	兖矿能源	3,082,302.00	3.00
380	300474	景嘉微	3,065,114.00	2.99
381	603609	禾丰股份	3,063,462.00	2.98
382	300890	翔丰华	3,047,072.00	2.97
383	002019	亿帆医药	3,037,919.00	2.96
384	000627	天茂集团	3,020,814.00	2.94
385	603527	众源新材	2,999,919.00	2.92
386	002312	川发龙蟒	2,983,224.00	2.91
387	600563	法拉电子	2,957,706.93	2.88
388	000027	深圳能源	2,934,968.00	2.86
389	603871	嘉友国际	2,933,001.00	2.86
390	600839	四川长虹	2,927,445.00	2.85
391	603787	新日股份	2,919,676.00	2.84
392	002100	天康生物	2,897,893.00	2.82
393	300624	万兴科技	2,888,641.00	2.81
394	600662	外服控股	2,859,029.00	2.78
395	000009	中国宝安	2,831,291.00	2.76
396	300427	红相股份	2,822,576.00	2.75
397	000048	京基智农	2,820,805.00	2.75
398	688385	复旦微电	2,820,224.20	2.75
399	300533	冰川网络	2,815,401.00	2.74
400	603983	丸美股份	2,799,473.00	2.73
401	002065	东华软件	2,798,486.00	2.73
402	002484	江海股份	2,794,479.00	2.72
403	001872	招商港口	2,778,245.00	2.71
404	002850	科达利	2,776,946.00	2.70
405	603538	美诺华	2,769,099.52	2.70
406	300143	盈康生命	2,760,235.00	2.69
407	601933	永辉超市	2,759,133.00	2.69
408	600015	华夏银行	2,723,871.00	2.65

409	603800	道森股份	2,720,627.00	2.65
410	300902	国安达	2,707,477.80	2.64
411	001206	依依股份	2,705,787.00	2.64
412	603528	多伦科技	2,703,100.00	2.63
413	600968	海油发展	2,700,505.00	2.63
414	603959	百利科技	2,661,002.00	2.59
415	000656	金科股份	2,657,304.00	2.59
416	688029	南微医学	2,645,189.97	2.58
417	601238	广汽集团	2,643,987.00	2.58
418	300331	苏大维格	2,642,690.00	2.57
419	601187	厦门银行	2,609,274.00	2.54
420	600060	海信视像	2,608,359.00	2.54
421	300274	阳光电源	2,600,347.00	2.53
422	603737	三棵树	2,596,925.00	2.53
423	600536	中国软件	2,595,130.60	2.53
424	688516	奥特维	2,568,348.05	2.50
425	002153	石基信息	2,552,987.00	2.49
426	600446	金证股份	2,543,185.00	2.48
427	605358	立昂微	2,540,712.68	2.47
428	002185	华天科技	2,540,132.00	2.47
429	603558	健盛集团	2,525,786.00	2.46
430	600658	电子城	2,517,032.00	2.45
431	601360	三六零	2,514,735.00	2.45
432	300181	佐力药业	2,512,350.00	2.45
433	002797	第一创业	2,492,702.00	2.43
434	000951	中国重汽	2,490,496.00	2.43
435	002669	康达新材	2,484,860.00	2.42
436	002002	鸿达兴业	2,481,479.00	2.42
437	600887	伊利股份	2,471,256.00	2.41
438	002768	国恩股份	2,470,368.00	2.41
439	300681	英搏尔	2,456,560.00	2.39
440	603098	森特股份	2,442,640.00	2.38
441	688589	力合微	2,419,924.20	2.36
442	688028	沃尔德	2,419,874.81	2.36
443	300389	艾比森	2,409,001.00	2.35
444	002840	华统股份	2,392,808.00	2.33
445	300700	岱勒新材	2,390,091.00	2.33
446	002416	爱施德	2,311,602.00	2.25
447	002258	利尔化学	2,309,968.00	2.25
448	300393	中来股份	2,288,327.00	2.23
449	600271	航天信息	2,283,595.76	2.22
450	603083	剑桥科技	2,250,615.00	2.19
451	688009	中国通号	2,246,152.04	2.19



452	300659	中孚信息	2,235,692.00	2.18
453	600315	上海家化	2,223,807.92	2.17
454	601198	东兴证券	2,204,512.00	2.15
455	688063	派能科技	2,197,265.01	2.14
456	603279	景津装备	2,191,165.00	2.13
457	603606	东方电缆	2,186,095.00	2.13
458	688550	瑞联新材	2,183,312.66	2.13
459	600266	城建发展	2,173,068.45	2.12
460	600807	济南高新	2,163,897.00	2.11
461	300347	泰格医药	2,147,366.00	2.09
462	600398	海澜之家	2,146,377.00	2.09
463	600660	福耀玻璃	2,126,326.00	2.07
464	300373	扬杰科技	2,123,324.54	2.07
465	603586	金麒麟	2,107,950.00	2.05
466	688520	神州细胞	2,105,071.19	2.05
467	603681	永冠新材	2,103,084.00	2.05
468	002807	江阴银行	2,095,267.00	2.04
469	300233	金城医药	2,084,048.00	2.03
470	688560	明冠新材	2,083,626.56	2.03
471	600572	康恩贝	2,074,095.00	2.02
472	603712	七一二	2,073,868.00	2.02
473	300662	科锐国际	2,071,844.00	2.02
474	600481	双良节能	2,064,372.00	2.01
475	300093	金刚光伏	2,064,221.00	2.01
476	300376	易事特	2,059,722.00	2.01

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000738	航发控制	20,412,963.81	19.88
2	600256	广汇能源	19,957,223.00	19.44
3	600732	爱旭股份	19,765,308.00	19.25
4	600862	中航高科	18,528,461.25	18.05
5	002180	纳思达	17,379,395.64	16.93
6	600985	淮北矿业	16,178,689.00	15.76
7	600026	中远海能	16,102,438.00	15.68
8	600549	厦门钨业	16,086,470.14	15.67
9	600372	中航电子	15,670,802.00	15.26
10	600879	航天电子	15,547,186.00	15.14
11	601456	国联证券	15,477,402.00	15.08
12	603605	珀莱雅	15,295,099.22	14.90
13	600765	中航重机	15,152,954.00	14.76

14	600380	健康元	15,033,726.58	14.64
15	000983	山西焦煤	14,264,722.00	13.89
16	000401	冀东水泥	13,996,870.05	13.63
17	601128	常熟银行	13,988,358.00	13.63
18	603866	桃李面包	13,876,928.12	13.52
19	002244	滨江集团	13,809,218.80	13.45
20	601098	中南传媒	13,716,057.00	13.36
21	600236	桂冠电力	13,656,245.00	13.30
22	600259	广晟有色	13,523,472.00	13.17
23	688521	芯原股份	13,485,132.21	13.14
24	600316	洪都航空	13,442,999.00	13.09
25	600233	圆通速递	13,305,841.44	12.96
26	600153	建发股份	13,162,883.00	12.82
27	000970	中科三环	13,116,532.90	12.78
28	601958	金钼股份	13,084,981.00	12.75
29	601872	招商轮船	12,800,633.00	12.47
30	601298	青岛港	12,722,879.00	12.39
31	601699	潞安环能	12,554,075.81	12.23
32	600392	盛和资源	12,511,292.00	12.19
33	002422	科伦药业	12,499,415.00	12.18
34	600118	中国卫星	12,303,801.10	11.98
35	603317	天味食品	12,219,913.60	11.90
36	688777	中控技术	11,862,464.26	11.55
37	603127	昭衍新药	11,842,336.73	11.54
38	000402	金融街	11,688,775.00	11.39
39	603456	九洲药业	11,597,094.00	11.30
40	600546	山煤国际	11,546,056.62	11.25
41	600160	巨化股份	11,290,066.84	11.00
42	300009	安科生物	11,242,396.86	10.95
43	600376	首开股份	11,212,807.00	10.92
44	688122	西部超导	11,075,933.06	10.79
45	002155	湖南黄金	11,063,697.00	10.78
46	600325	华发股份	10,992,053.71	10.71
47	002085	万丰奥威	10,968,456.00	10.68
48	300001	特锐德	10,762,624.35	10.48
49	002240	盛新锂能	10,723,731.00	10.45
50	605117	德业股份	10,704,402.00	10.43
51	600141	兴发集团	10,686,987.00	10.41
52	600521	华海药业	10,629,559.00	10.35
53	002506	协鑫集成	10,611,954.00	10.34
54	601869	长飞光纤	10,535,625.37	10.26
55	600435	北方导航	10,459,093.00	10.19
56	600901	江苏租赁	10,445,316.00	10.17

57	603233	大参林	10,394,719.52	10.12
58	688567	孚能科技	10,383,865.69	10.11
59	001914	招商积余	10,378,330.00	10.11
60	603613	国联股份	10,321,010.58	10.05
61	300168	万达信息	10,305,126.00	10.04
62	000729	燕京啤酒	10,189,775.00	9.93
63	300724	捷佳伟创	10,150,717.14	9.89
64	603379	三美股份	10,140,133.00	9.88
65	000825	太钢不锈	10,118,804.00	9.86
66	002128	电投能源	10,036,736.93	9.78
67	002340	格林美	9,950,129.00	9.69
68	300699	光威复材	9,947,206.00	9.69
69	000553	安道麦 A	9,899,283.98	9.64
70	002653	海思科	9,693,289.00	9.44
71	002399	海普瑞	9,654,749.50	9.40
72	300073	当升科技	9,566,749.00	9.32
73	000090	天健集团	9,544,426.00	9.30
74	002156	通富微电	9,507,952.76	9.26
75	601228	广州港	9,506,498.00	9.26
76	600415	小商品城	9,260,532.00	9.02
77	688099	晶晨股份	9,244,358.70	9.00
78	688005	容百科技	9,202,204.10	8.96
79	600211	西藏药业	9,178,358.60	8.94
80	688390	固德威	9,153,736.59	8.92
81	688819	天能股份	9,054,397.81	8.82
82	603868	飞科电器	9,048,043.00	8.81
83	300012	华测检测	9,019,619.00	8.79
84	300017	网宿科技	8,975,357.00	8.74
85	600522	中天科技	8,920,196.20	8.69
86	000878	云南铜业	8,871,658.00	8.64
87	603885	吉祥航空	8,824,999.00	8.60
88	000629	钒钛股份	8,778,167.98	8.55
89	002250	联化科技	8,730,152.00	8.50
90	002756	永兴材料	8,692,400.00	8.47
91	002124	天邦食品	8,677,799.40	8.45
92	601665	齐鲁银行	8,675,208.00	8.45
93	000686	东北证券	8,614,581.00	8.39
94	300618	寒锐钴业	8,605,104.39	8.38
95	002081	金螳螂	8,520,011.00	8.30
96	600498	烽火通信	8,472,641.00	8.25
97	002078	太阳纸业	8,433,443.00	8.21
98	688321	微芯生物	8,410,461.70	8.19
99	002299	圣农发展	8,372,375.00	8.16

100	600486	扬农化工	8,338,126.88	8.12
101	600885	宏发股份	8,294,349.20	8.08
102	002468	申通快递	8,292,427.00	8.08
103	600064	南京高科	8,280,743.80	8.07
104	600970	中材国际	8,274,344.00	8.06
105	600988	赤峰黄金	8,238,260.92	8.02
106	600497	驰宏锌锗	8,224,578.00	8.01
107	601390	中国中铁	8,199,645.00	7.99
108	000987	越秀资本	8,162,737.68	7.95
109	300212	易华录	8,116,849.71	7.91
110	300888	稳健医疗	8,113,291.00	7.90
111	000937	冀中能源	8,046,900.00	7.84
112	600998	九州通	7,896,244.00	7.69
113	000768	中航西飞	7,823,399.77	7.62
114	603719	良品铺子	7,822,804.40	7.62
115	600578	京能电力	7,760,941.00	7.56
116	600348	华阳股份	7,754,142.80	7.55
117	300244	迪安诊断	7,652,318.00	7.45
118	002028	思源电气	7,610,060.95	7.41
119	600027	华电国际	7,512,722.00	7.32
120	002413	雷科防务	7,483,305.70	7.29
121	300363	博腾股份	7,447,358.00	7.25
122	002249	大洋电机	7,390,759.00	7.20
123	601111	中国国航	7,380,529.00	7.19
124	600582	天地科技	7,343,472.00	7.15
125	000975	银泰黄金	7,326,651.00	7.14
126	600863	内蒙华电	7,313,027.00	7.12
127	300769	德方纳米	7,307,648.00	7.12
128	002603	以岭药业	7,277,791.00	7.09
129	601992	金隅集团	7,259,393.00	7.07
130	002625	光启技术	7,236,742.20	7.05
131	002382	蓝帆医疗	7,233,222.00	7.05
132	601717	郑煤机	7,205,078.00	7.02
133	600079	人福医药	7,192,099.00	7.01
134	601928	凤凰传媒	7,183,100.41	7.00
135	601000	唐山港	7,117,904.00	6.93
136	600499	科达制造	7,114,424.00	6.93
137	600909	华安证券	7,060,674.80	6.88
138	000060	中金岭南	7,014,206.00	6.83
139	600528	中铁工业	7,010,067.80	6.83
140	600967	内蒙一机	6,974,394.00	6.79
141	600282	南钢股份	6,964,149.00	6.78
142	603517	绝味食品	6,947,402.64	6.77

143	600673	东阳光	6,922,609.00	6.74
144	300285	国瓷材料	6,841,332.00	6.66
145	002444	巨星科技	6,840,202.00	6.66
146	002056	横店东磁	6,834,472.00	6.66
147	601689	拓普集团	6,816,291.00	6.64
148	300498	温氏股份	6,768,874.00	6.59
149	601718	际华集团	6,767,976.00	6.59
150	002557	洽洽食品	6,683,566.00	6.51
151	002966	苏州银行	6,668,768.80	6.50
152	000869	张裕 A	6,606,170.00	6.43
153	300308	中际旭创	6,595,505.00	6.42
154	600038	中直股份	6,538,114.00	6.37
155	601058	赛轮轮胎	6,515,027.00	6.35
156	603589	口子窖	6,488,296.52	6.32
157	601991	大唐发电	6,407,504.00	6.24
158	002384	东山精密	6,359,763.74	6.19
159	300761	立华股份	6,324,357.00	6.16
160	002131	利欧股份	6,305,022.00	6.14
161	603355	莱克电气	6,274,077.84	6.11
162	002281	光迅科技	6,263,060.00	6.10
163	600126	杭钢股份	6,254,624.00	6.09
164	002985	北摩高科	6,246,480.05	6.08
165	002947	恒铭达	6,230,532.15	6.07
166	603786	科博达	6,214,306.52	6.05
167	300763	锦浪科技	6,177,928.00	6.02
168	600120	浙江东方	6,163,072.86	6.00
169	300647	超频三	6,158,643.00	6.00
170	688180	君实生物	6,153,877.46	5.99
171	000898	鞍钢股份	6,127,239.00	5.97
172	601615	明阳智能	6,087,335.00	5.93
173	600482	中国动力	6,056,460.00	5.90
174	600299	安迪苏	6,055,617.00	5.90
175	600754	锦江酒店	6,050,461.00	5.89
176	000039	中集集团	6,048,592.50	5.89
177	002865	钧达股份	6,039,066.00	5.88
178	601319	中国人保	6,033,423.00	5.88
179	000998	隆平高科	6,023,181.00	5.87
180	600919	江苏银行	6,017,437.30	5.86
181	002705	新宝股份	5,908,462.79	5.76
182	000830	鲁西化工	5,892,449.00	5.74
183	300072	海新能科	5,865,301.00	5.71
184	601139	深圳燃气	5,762,314.40	5.61
185	601003	柳钢股份	5,744,708.00	5.60

186	002500	山西证券	5,722,765.00	5.57
187	601005	重庆钢铁	5,715,664.00	5.57
188	601698	中国卫通	5,703,873.00	5.56
189	600795	国电电力	5,690,170.00	5.54
190	600177	雅戈尔	5,646,414.00	5.50
191	603568	伟明环保	5,580,040.40	5.44
192	601186	中国铁建	5,578,676.00	5.43
193	002423	中粮资本	5,577,910.80	5.43
194	603345	安井食品	5,572,120.00	5.43
195	600500	中化国际	5,543,644.96	5.40
196	000400	许继电气	5,515,883.00	5.37
197	002946	新乳业	5,509,246.00	5.37
198	600298	安琪酵母	5,504,750.75	5.36
199	600642	申能股份	5,504,697.00	5.36
200	000062	深圳华强	5,489,045.65	5.35
201	601577	长沙银行	5,484,205.00	5.34
202	600529	山东药玻	5,458,340.00	5.32
203	600639	浦东金桥	5,451,058.00	5.31
204	688536	思瑞浦	5,417,470.15	5.28
205	000883	湖北能源	5,415,677.00	5.28
206	300251	光线传媒	5,408,406.00	5.27
207	600667	太极实业	5,377,162.00	5.24
208	300832	新产业	5,369,291.00	5.23
209	600516	方大炭素	5,318,998.42	5.18
210	000960	锡业股份	5,316,960.00	5.18
211	688002	睿创微纳	5,314,347.09	5.18
212	601881	中国银河	5,288,390.00	5.15
213	002409	雅克科技	5,286,179.98	5.15
214	000519	中兵红箭	5,282,325.00	5.15
215	600764	中国海防	5,273,894.00	5.14
216	000717	中南股份	5,269,909.00	5.13
217	603267	鸿远电子	5,259,581.00	5.12
218	000733	振华科技	5,244,765.00	5.11
219	300238	冠昊生物	5,216,262.91	5.08
220	300037	新宙邦	5,197,106.60	5.06
221	603968	醋化股份	5,151,719.00	5.02
222	601225	陕西煤业	5,143,888.00	5.01
223	300144	宋城演艺	5,128,270.00	5.00
224	002945	华林证券	5,124,933.00	4.99
225	600039	四川路桥	5,123,496.00	4.99
226	000887	中鼎股份	5,099,684.44	4.97
227	603290	斯达半导	5,081,907.00	4.95
228	600166	福田汽车	5,079,123.62	4.95

229	600801	华新水泥	5,058,463.00	4.93
230	601611	中国核建	5,049,354.00	4.92
231	002497	雅化集团	5,031,756.00	4.90
232	300014	亿纬锂能	4,999,380.00	4.87
233	300115	长盈精密	4,976,007.00	4.85
234	600511	国药股份	4,974,933.56	4.85
235	603056	德邦股份	4,965,818.00	4.84
236	600096	云天化	4,962,277.00	4.83
237	002120	韵达股份	4,953,036.00	4.82
238	600383	金地集团	4,944,445.00	4.82
239	002268	电科网安	4,938,953.00	4.81
240	603650	彤程新材	4,913,534.00	4.79
241	000156	华数传媒	4,909,409.00	4.78
242	603228	景旺电子	4,897,570.72	4.77
243	002353	杰瑞股份	4,855,853.00	4.73
244	000537	广宇发展	4,847,576.00	4.72
245	603198	迎驾贡酒	4,816,731.80	4.69
246	601838	成都银行	4,814,326.00	4.69
247	600307	酒钢宏兴	4,777,105.00	4.65
248	300194	福安药业	4,721,985.00	4.60
249	300257	开山股份	4,704,707.00	4.58
250	600895	张江高科	4,700,709.00	4.58
251	601865	福莱特	4,698,712.00	4.58
252	002405	四维图新	4,615,425.00	4.50
253	600959	江苏有线	4,581,453.00	4.46
254	600604	市北高新	4,562,782.00	4.44
255	002204	大连重工	4,559,700.00	4.44
256	600062	华润双鹤	4,520,552.00	4.40
257	000831	中国稀土	4,512,263.28	4.40
258	000559	万向钱潮	4,463,479.68	4.35
259	000739	普洛药业	4,460,216.00	4.34
260	601668	中国建筑	4,455,909.00	4.34
261	002434	万里扬	4,443,044.00	4.33
262	600418	江淮汽车	4,436,034.00	4.32
263	603858	步长制药	4,435,451.04	4.32
264	300136	信维通信	4,419,723.00	4.31
265	688586	江航装备	4,349,126.38	4.24
266	300114	中航电测	4,328,735.00	4.22
267	300223	北京君正	4,307,684.00	4.20
268	000961	中南建设	4,264,773.00	4.15
269	600487	亨通光电	4,213,915.20	4.10
270	002948	青岛银行	4,185,516.00	4.08
271	601598	中国外运	4,097,208.00	3.99

272	688088	虹软科技	4,075,014.56	3.97
273	600535	天士力	4,051,844.00	3.95
274	601156	东航物流	4,013,389.96	3.91
275	000778	新兴铸管	3,974,113.00	3.87
276	600699	均胜电子	3,971,564.48	3.87
277	601117	中国化学	3,964,418.00	3.86
278	300253	卫宁健康	3,906,533.00	3.81
279	601998	中信银行	3,879,872.00	3.78
280	601077	渝农商行	3,863,628.00	3.76
281	300382	斯莱克	3,852,867.00	3.75
282	603708	家家悦	3,805,533.00	3.71
283	600507	方大特钢	3,786,429.00	3.69
284	300429	强力新材	3,778,486.00	3.68
285	603444	吉比特	3,759,120.00	3.66
286	600956	新天绿能	3,708,415.00	3.61
287	688065	凯赛生物	3,701,543.31	3.61
288	603939	益丰药房	3,696,652.00	3.60
289	600502	安徽建工	3,689,463.00	3.59
290	600188	兖矿能源	3,688,895.00	3.59
291	600663	陆家嘴	3,662,857.00	3.57
292	000709	河钢股份	3,658,542.00	3.56
293	300482	万孚生物	3,657,279.00	3.56
294	601766	中国中车	3,643,761.00	3.55
295	002831	裕同科技	3,605,760.00	3.51
296	600598	北大荒	3,588,161.00	3.50
297	002595	豪迈科技	3,559,882.34	3.47
298	300890	翔丰华	3,539,268.00	3.45
299	600728	佳都科技	3,535,686.00	3.44
300	000728	国元证券	3,512,352.00	3.42
301	300602	飞荣达	3,503,462.00	3.41
302	300570	太辰光	3,468,255.00	3.38
303	600875	东方电气	3,466,869.41	3.38
304	002152	广电运通	3,399,251.00	3.31
305	002010	传化智联	3,390,566.00	3.30
306	000877	天山股份	3,369,364.00	3.28
307	603871	嘉友国际	3,366,867.00	3.28
308	688008	澜起科技	3,330,960.05	3.24
309	300700	岱勒新材	3,327,755.00	3.24
310	000988	华工科技	3,324,918.00	3.24
311	601696	中银证券	3,308,183.00	3.22
312	002123	梦网科技	3,299,884.79	3.21
313	600580	卧龙电驱	3,293,995.00	3.21
314	000031	大悦城	3,287,108.00	3.20



315	002311	海大集团	3,286,145.00	3.20
316	300816	艾可蓝	3,283,516.00	3.20
317	600329	达仁堂	3,279,968.00	3.19
318	300390	天华超净	3,251,988.00	3.17
319	002458	益生股份	3,239,360.00	3.16
320	300474	景嘉微	3,238,420.50	3.15
321	600707	彩虹股份	3,230,472.00	3.15
322	000997	新大陆	3,227,068.00	3.14
323	603026	胜华新材	3,225,529.00	3.14
324	000581	威孚高科	3,221,776.00	3.14
325	002572	索菲亚	3,202,257.68	3.12
326	301035	润丰股份	3,185,062.00	3.10
327	600563	法拉电子	3,173,519.65	3.09
328	688029	南微医学	3,167,134.58	3.08
329	002508	老板电器	3,164,195.84	3.08
330	600600	青岛啤酒	3,161,708.00	3.08
331	002185	华天科技	3,155,038.13	3.07
332	002430	杭氧股份	3,148,213.00	3.07
333	000627	天茂集团	3,127,525.00	3.05
334	600399	抚顺特钢	3,085,243.00	3.01
335	600073	上海梅林	3,081,580.00	3.00
336	002594	比亚迪	3,077,438.00	3.00
337	601808	中海油服	3,063,442.00	2.98
338	603983	丸美股份	3,041,517.00	2.96
339	603609	禾丰股份	3,024,149.00	2.95
340	603800	道森股份	3,013,964.00	2.94
341	600908	无锡银行	2,993,358.00	2.92
342	605358	立昂微	2,992,480.96	2.91
343	600662	外服控股	2,988,987.00	2.91
344	002294	信立泰	2,970,099.00	2.89
345	300558	贝达药业	2,933,694.00	2.86
346	002850	科达利	2,925,152.00	2.85
347	603218	日月股份	2,914,372.00	2.84
348	600839	四川长虹	2,906,935.00	2.83
349	300902	国安达	2,903,345.00	2.83
350	300331	苏大维格	2,896,212.00	2.82
351	002683	广东宏大	2,886,571.00	2.81
352	002312	川发龙蟒	2,885,782.00	2.81
353	002019	亿帆医药	2,859,464.00	2.79
354	603527	众源新材	2,855,723.00	2.78
355	002797	第一创业	2,853,583.29	2.78
356	600446	金证股份	2,851,923.00	2.78
357	601933	永辉超市	2,841,523.00	2.77

358	603528	多伦科技	2,822,168.00	2.75
359	001206	依依股份	2,819,049.80	2.75
360	600258	首旅酒店	2,809,792.00	2.74
361	300427	红相股份	2,806,518.00	2.73
362	603959	百利科技	2,778,260.36	2.71
363	000547	航天发展	2,772,068.00	2.70
364	688516	奥特维	2,738,866.55	2.67
365	002429	兆驰股份	2,733,628.00	2.66
366	000651	格力电器	2,732,304.00	2.66
367	002669	康达新材	2,716,992.00	2.65
368	001872	招商港口	2,709,323.00	2.64
369	002234	民和股份	2,709,042.00	2.64
370	600015	华夏银行	2,705,417.00	2.64
371	002484	江海股份	2,694,699.00	2.62
372	603098	森特股份	2,688,224.00	2.62
373	601238	广汽集团	2,679,030.00	2.61
374	603658	安图生物	2,678,825.05	2.61
375	600197	伊力特	2,672,088.56	2.60
376	000048	京基智农	2,663,008.00	2.59
377	300533	冰川网络	2,658,125.12	2.59
378	000541	佛山照明	2,649,773.00	2.58
379	002674	兴业科技	2,649,337.00	2.58
380	000009	中国宝安	2,649,125.00	2.58
381	000021	深科技	2,639,394.02	2.57
382	600060	海信视像	2,638,703.00	2.57
383	002242	九阳股份	2,588,046.00	2.52
384	603538	美诺华	2,575,689.28	2.51
385	601187	厦门银行	2,570,074.00	2.50
386	603768	常青股份	2,568,013.00	2.50
387	300733	西菱动力	2,567,287.00	2.50
388	603883	老百姓	2,566,468.00	2.50
389	002002	鸿达兴业	2,562,248.00	2.50
390	300389	艾比森	2,559,198.00	2.49
391	603927	中科软	2,556,725.00	2.49
392	600968	海油发展	2,554,482.00	2.49
393	300681	英搏尔	2,551,037.00	2.48
394	600536	中国软件	2,548,905.70	2.48
395	000951	中国重汽	2,544,331.00	2.48
396	000027	深圳能源	2,535,008.00	2.47
397	603558	健盛集团	2,521,949.00	2.46
398	002100	天康生物	2,514,995.00	2.45
399	300181	佐力药业	2,512,000.00	2.45
400	002065	东华软件	2,499,457.00	2.43

401	600315	上海家化	2,498,277.00	2.43
402	688589	力合微	2,492,238.81	2.43
403	002840	华统股份	2,475,515.00	2.41
404	600887	伊利股份	2,419,550.00	2.36
405	601360	三六零	2,418,349.00	2.36
406	600658	电子城	2,414,159.00	2.35
407	002258	利尔化学	2,413,739.60	2.35
408	600906	财达证券	2,407,267.00	2.34
409	688559	海目星	2,381,072.82	2.32
410	688550	瑞联新材	2,356,002.34	2.29
411	300143	盈康生命	2,350,064.00	2.29
412	300376	易事特	2,347,103.00	2.29
413	300393	中来股份	2,339,708.00	2.28
414	688009	中国通号	2,329,996.21	2.27
415	600271	航天信息	2,323,043.00	2.26
416	603279	景津装备	2,288,806.00	2.23
417	002416	爱施德	2,280,803.00	2.22
418	300328	宜安科技	2,276,028.34	2.22
419	600782	新钢股份	2,263,040.00	2.20
420	688520	神州细胞	2,248,732.90	2.19
421	300676	华大基因	2,246,488.00	2.19
422	603083	剑桥科技	2,244,574.00	2.19
423	300399	天利科技	2,240,998.00	2.18
424	600660	福耀玻璃	2,208,761.00	2.15
425	002273	水晶光电	2,202,323.00	2.15
426	300688	创业黑马	2,201,392.50	2.14
427	600623	华谊集团	2,197,966.00	2.14
428	688560	明冠新材	2,186,952.03	2.13
429	002153	石基信息	2,180,791.00	2.12
430	002939	长城证券	2,179,371.00	2.12
431	002901	大博医疗	2,174,937.45	2.12
432	300607	拓斯达	2,174,129.80	2.12
433	002768	国恩股份	2,170,409.00	2.11
434	300373	扬杰科技	2,169,731.99	2.11
435	600161	天坛生物	2,166,551.40	2.11
436	002745	木林森	2,160,531.70	2.10
437	600481	双良节能	2,144,963.00	2.09
438	002080	中材科技	2,139,018.00	2.08
439	688028	沃尔德	2,135,732.52	2.08
440	600066	宇通客车	2,131,283.00	2.08
441	600398	海澜之家	2,111,869.00	2.06
442	002918	蒙娜丽莎	2,097,468.15	2.04
443	603681	永冠新材	2,094,282.00	2.04

444	603586	金麒麟	2,072,250.00	2.02
-----	--------	-----	--------------	------

注：“卖出金额”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	3,557,694,402.05
卖出股票收入(成交)总额	3,170,584,771.34

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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行交易,以降低股票仓位调整的交易成本,提高投资效率,从而更好地实现投资目标。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金可基于谨慎原则运用国债期货对基本投资组合进行管理,提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的国债期货合约,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

##### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

#### 8.12 投资组合报告附注

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

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是否超出基金合同规定的备选股票库

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	105,880.12
2	应收清算款	207,368.22
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,261,729.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,574,977.82

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末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	10,116	22,689.17	170,612,529.59	74.33	58,911,079.40	25.67

万家中证 500 指数增强发起式 C	9,683	18,329.97	123,336,940.43	69.49	54,152,142.03	30.51
合计	19,341	21,044.04	293,949,470.02	72.22	113,063,221.43	27.78

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）。

## 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 指数增强发起式 A	40,773.68	0.0178
	万家中证 500 指数增强发起式 C	76,222.05	0.0429
	合计	116,995.73	0.0287

## 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	0~10
	万家中证 500 指数增强发起式 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	万家中证 500 指数增强发起式 A	0~10
	万家中证 500 指数增强发起式 C	0
	合计	0~10

## 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	2.46	10,001,000.10	2.46	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	2.46	10,001,000.10	2.46	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	21,939,024.41	33,050,172.85
本报告期基金总申购份额	232,544,378.38	417,664,812.76
减：本报告期基金总赎回份额	24,959,793.80	273,225,903.15
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	229,523,608.99	177,489,082.46

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 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：

2022 年 8 月 24 日，公司聘任莫海波先生担任公司副总经理。

基金托管人：

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
第一创业证券	2	808,609,466.58	12.04	591,329.75	10.17	-
财通证券	1	781,369,850.61	11.64	719,880.60	12.38	-
国元证券	3	708,744,592.36	10.56	518,311.53	8.92	-
东吴证券	1	667,877,977.83	9.95	622,004.23	10.70	-
中泰证券	1	645,888,581.33	9.62	578,911.40	9.96	-
东亚前海证券	2	602,684,562.91	8.98	561,266.85	9.66	-
湘财证券	1	582,215,639.51	8.67	542,207.55	9.33	-
山西证券	2	529,324,599.71	7.88	387,095.08	6.66	-
中信建投	1	485,146,343.75	7.23	451,843.91	7.77	-
国信证券	2	348,707,547.17	5.19	324,747.04	5.59	-
德邦证券	2	321,683,382.83	4.79	299,578.32	5.15	-
东方财富证券	1	231,889,794.18	3.45	215,966.44	3.72	-
广发证券	1	1,166.00	0.00	0.93	0.00	-



安信证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	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，本基金新增广发证券交易单元 1 个，减少长城证券交易单元 1 个。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）的公告	指定媒介	2022-01-05
2	关于万家基金管理有限公司旗下部分基金参加中国工商银行申购及定投优惠活动的公告	指定媒介	2022-01-05
3	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金分红公告	指定媒介	2022-01-12
4	关于万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金恢复大额申购（含转换	指定媒介	2022-01-14

	转入、定期定额投资)的公告		
5	万家中证 500 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
6	关于新增爱建证券及中天证券等机构为万家中证 500 指数增强基金销售机构的公告	指定媒介	2022-02-17
7	万家基金管理有限公司关于旗下基金新增新浪仓石等机构为销售机构并开通转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-02-21
8	万家基金管理有限公司关于旗下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	2022-02-25
9	万家基金管理有限公司关于旗下基金在恒泰证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-03-01
10	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在泰信财富开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-03-07
11	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
12	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
13	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	指定媒介	2022-03-30
14	万家基金管理有限公司关于旗下基金在国金证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-04-06
15	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增攀赢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	2022-04-12
16	万家中证 500 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
17	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增日照银行股份有限公司为销售机构并开通相关业务的公告	指定媒介	2022-05-13
18	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
19	关于万家中证 500 指数增强型发起式	指定媒介	2022-06-01

	证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告		
20	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
21	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金分红公告	指定媒介	2022-06-22
22	关于万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金恢复大额申购（含转换转入、定期定额投资）的公告	指定媒介	2022-06-25
23	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增万得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	2022-07-15
24	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	指定媒介	2022-07-20
25	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江南银行为销售机构并开通转换、基金定投业务的公告	指定媒介	2022-08-04
26	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江苏银行为销售机构并开通转换、基金定投业务的公告	指定媒介	2022-08-29
27	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2022 年中期报告	指定媒介	2022-08-30
28	万家基金管理有限公司关于旗下基金在中金财富证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-09-30
29	万家基金管理有限公司关于旗下基金在华创证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-10-11
30	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	2022-10-11
31	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	指定媒介	2022-10-25
32	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书更新(2022 年第 1 号)	指定媒介	2022-10-29
33	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	指定媒介	2022-10-29
34	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增浙江绍兴瑞丰农村商业银行股份有限公司为销售机构并开通基金定投业务的公告	指定媒介	2022-10-31

35	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在海通证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-11-11
36	万家基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在蚂蚁基金销售有限公司最低保有份额的公告	指定媒介	2022-11-18
37	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增贵州银行为销售机构并开通转换、基金定投业务及参加费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-12-06
38	关于万家基金管理有限公司旗下部分基金参加中国工商银行申购及定投优惠活动的公告	指定媒介	2022-12-13
39	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在东吴证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-12-15

## § 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	20220510 - 20220510; 20220517 - 20221019	-	83,579,817.07	14,111,946.28	69,467,870.79	17.07
	2	20220101 - 20220118; 20220126 - 20220213	11,345,221.53	54,863,282.22	44,117,619.51	22,090,884.24	5.43
	3	20220511 - 20220511	-	23,883,757.47	18,250,000.00	5,633,757.47	1.38

#### 产品特有风险

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。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。

## § 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 2022 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住所，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

2023 年 3 月 30 日