

万家中证 1000 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：招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。

基金托管人招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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
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
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	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
§ 6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§ 7 年度财务报表	20
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
§ 8 投资组合报告	58

8.1 期末基金资产组合情况	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	59
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	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	71
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	94
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	94
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	94
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	94
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	94
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	94
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	94
8.12 投资组合报告附注	95
§ 9 基金份额持有人信息	95
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	95
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	96
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	96
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	96
§ 10 开放式基金份额变动	97
§ 11 重大事件揭示	97
11.1 基金份额持有人大会决议	97
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	97
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	97
11.4 基金投资策略的改变	98
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	98
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	98
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	98
11.8 其他重大事件	99
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	102
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	102
§ 13 备查文件目录	102
13.1 备查文件目录	102
13.2 存放地点	102
13.3 查阅方式	102

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	万家中证 1000 指数增强	
基金主代码	005313	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 12 月 3 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,401,747,304.36 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	万家中证 1000 指数增强 A	万家中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	005313	005314
报告期末下属分级基金的份额总额	1,797,157,489.39 份	1,604,589,814.97 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金，采取量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，在力求有效跟踪标的指数基础上，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型指数产品，在标的指数成份股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整。具体策略包括：1、股票投资策略；2、债券投资策略；3、中小企业私募债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、可转换债券投资策略；6、证券公司短期公司债券投资策略；7、衍生产品投资策略：（1）权证投资策略；（2）股指期货投资策略；（3）国债期货投资策略；（4）股票期权投资策略；（5）其他金融衍生产品；8、融资及转融通证券出借业务投资策略；9、其他。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率*95%+一年期人民币定期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	万家基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑
	联系电话	021-38909626
	电子邮箱	lanj@wjasset.com
		张燕
		0755-83199084
		yan_zhang@cmbchina.com

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年		2021 年		2020 年	
	万家中证 1000 指数增强 A	万家中证 1000 指数增强 C	万家中证 1000 指数增强 A	万家中证 1000 指数增强 C	万家中证 1000 指数增强 A	万家中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	-60,919,498.79	-60,598,720.17	30,954,962.41	37,745,976.49	4,294,744.55	3,263,838.47
本期利润	-102,238,299.33	-128,567,997.95	32,942,128.46	35,834,064.42	3,933,740.47	3,263,635.62
加权平均基金份额本期利润	-0.1338	-0.1540	0.2880	0.2525	0.3410	0.3462
本期加权	-10.66%	-12.29%	23.89%	20.62%	26.99%	28.40%

平均 净值 利润 率						
本期 基金 份额 净值 增长 率	-8.65%	-9.02%	29.98%	29.47%	33.58%	33.01%
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	410,034,503.71	356,426,156.05	79,562,180.78	95,402,086.94	4,146,667.13	781,361.27
期末 可供 分配 基金 份额 利润	0.2282	0.2221	0.3445	0.3433	0.3729	0.3658
期末 基金 资产 净值	2,207,191,993.10	1,961,015,971.02	310,536,349.21	373,315,494.61	15,267,628.92	92,917,676.64
期末 基金 份额 净值	1.2282	1.2221	1.3445	1.3433	1.3729	1.3658
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	109.11%	106.21%	128.91%	126.66%	76.11%	75.06%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家中证 1000 指数增强 A

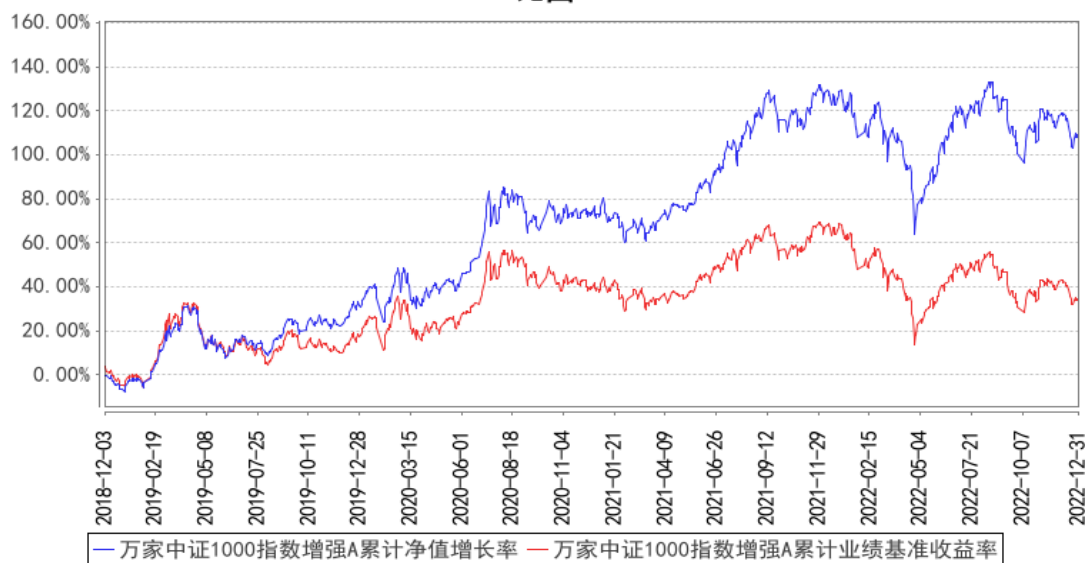
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.11%	1.18%	2.47%	1.14%	1.64%	0.04%
过去六个月	-4.75%	1.21%	-9.64%	1.21%	4.89%	0.00%
过去一年	-8.65%	1.53%	-20.44%	1.51%	11.79%	0.02%
过去三年	58.61%	1.46%	12.87%	1.45%	45.74%	0.01%
自基金合同生效起至今	109.11%	1.44%	34.28%	1.45%	74.83%	-0.01%

万家中证 1000 指数增强 C

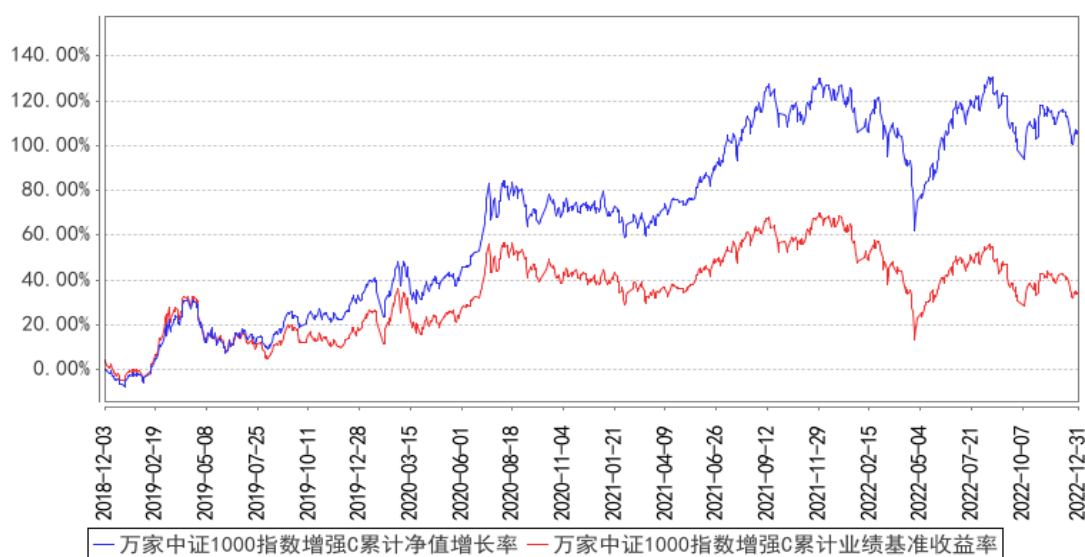
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.00%	1.18%	2.47%	1.14%	1.53%	0.04%
过去六个月	-4.95%	1.21%	-9.64%	1.21%	4.69%	0.00%
过去一年	-9.02%	1.52%	-20.44%	1.51%	11.42%	0.01%
过去三年	56.68%	1.46%	12.87%	1.45%	43.81%	0.01%
自基金合同生效起至今	106.21%	1.44%	34.28%	1.45%	71.93%	-0.01%

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1000指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



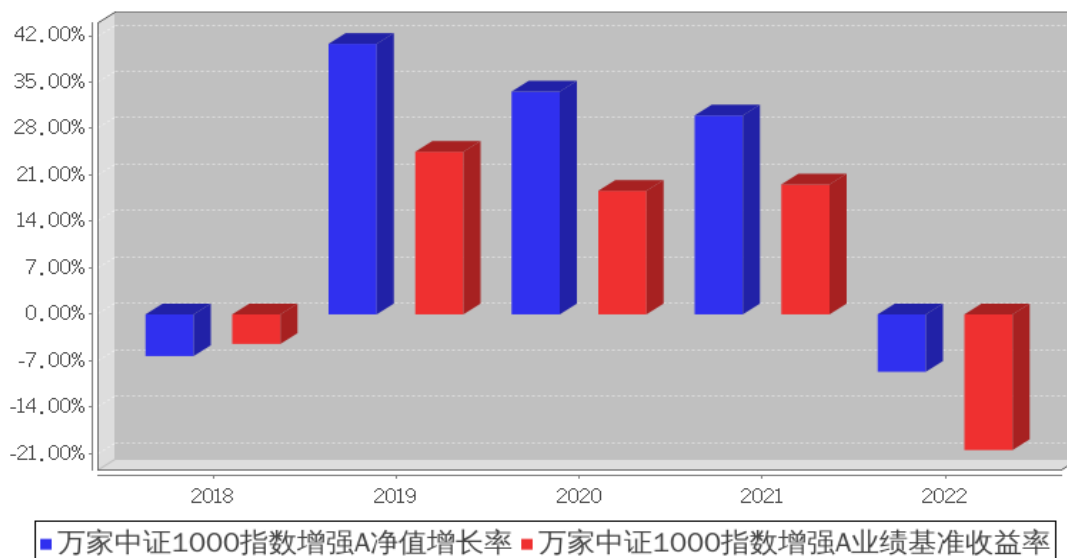
万家中证1000指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



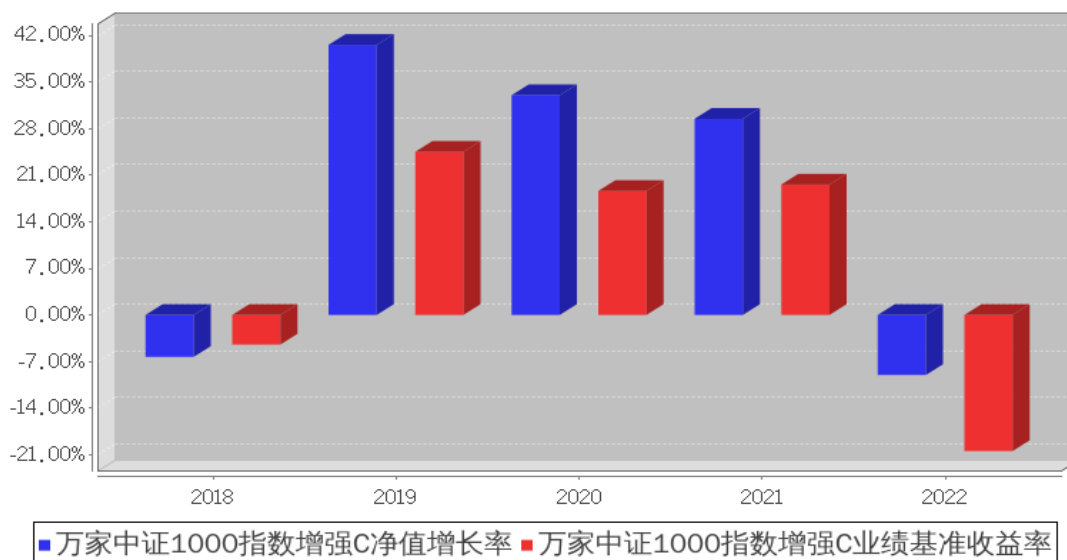
注：本基金合同生效日期为 2018 年 12 月 3 日，基金建仓期为基金合同生效后六个月，基金合同生效后各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

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

万家中证1000指数增强A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1000指数增强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 1000 指数增强 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	3.3000	3,568,145.64	116,516.50	3,684,662.14	-
2020 年	0.3920	426,301.86	11,913.86	438,215.72	-
合计	3.6920	3,994,447.50	128,430.36	4,122,877.86	-

万家中证 1000 指数增强 C

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	3.2000	567,997.74	140,136.25	708,133.99	-
2020 年	0.3840	66,295.69	17,540.85	83,836.54	-
合计	3.5840	634,293.43	157,677.10	791,970.53	-

§ 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混合型证券投资基金、万家创业板指	2019 年 8 月 21 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。

	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遵规守信情况的说明

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

本基金为指数增强型股票基金，采取量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，在力求有效跟踪标的指数基础上，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金采用量化多因子选股策略，控制行业权重偏离度、个股集中度，通过量化多因子选股的方式选取一篮子股票组合。在行业和风格配置相对于业绩基准指数相对均衡，无重仓行业或具体风格，在量化选股方面精选行业内质优个股组合，持股较为分散。采用量化风险模型合理控制组合风险，保证较小的跟踪误差，投资目标是获取在既定跟踪误差下的超额收益最大化。本基金股票组合中 80%以上权重为中证 1000 成分股，保持了跟标的指数的风格基本一致。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家中证 1000 指数增强 A 的基金份额净值为 1.2282 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.65%，同期业绩比较基准收益率为-20.44%，截至本报告期末万家中证 1000 指数增强 C 的基金份额净值为 1.2221 元，本报告期基金份额净值增长率为-9.02%，同期业绩比较基准收益率为-20.44%。基金报告期末 A 份额、C 份额日均跟踪偏离度分别为 0.1968%、0.1965%，年跟

跟踪误差分别为 3.9401%、3.9355%，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 2023 年 1 月 16 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 0.229 元，C 类每 10 份基金份额派发红利 0.223 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

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	信会师报字[2023]第 ZA30258 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“万家中证 1000 指数增强”）财务报表，包括 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 1000 指数增强 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 1000 指数增强，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
管理层和治理层对财务报表的责任	万家中证 1000 指数增强的基金管理人万家基金管理有限公司管理层（以下简称管理层）负责按照企业会计准则和中国

	<p>证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估万家中证 1000 指数增强的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督万家中证 1000 指数增强的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对万家中证 1000 指数增强持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致万家中证 1000 指数增强不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与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。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>立信会计师事务所（特殊普通合伙）</p>

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 03 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 1000 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
资产：			
银行存款	7.4.7.1	68,342,332.22	17,729,574.45
结算备付金		210,880,419.89	25,899,350.66
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	3,923,631,186.49	641,995,114.15
其中：股票投资		3,923,631,186.49	641,995,114.15
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		13,507,550.97	4,297,967.09
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	4,503.15
资产总计		4,216,361,489.57	689,926,509.50
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		42,529,875.64	5,022,354.83
应付管理人报酬		3,700,561.22	587,407.88
应付托管费		740,112.23	117,481.56
应付销售服务费		725,010.44	130,286.67
应付投资顾问费		-	-
应交税费		32.05	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	457,933.87	217,134.74
负债合计		48,153,525.45	6,074,665.68
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	3,401,747,304.36	508,887,576.10
其他综合收益	7.4.7.8	-	-
未分配利润	7.4.7.9	766,460,659.76	174,964,267.72
净资产合计		4,168,207,964.12	683,851,843.82
负债和净资产总计		4,216,361,489.57	689,926,509.50

注：1、报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 3,401,747,304.36 份，其中万家中证 1000 指数增强 A 基金份额净值 1.2282 元，基金份额总额 1,797,157,489.39 份；万家中证 1000 指数增强 C 基金份额净值 1.2221 元，基金份额总额 1,604,589,814.97 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 1000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 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
一、营业总收入		-202,792,534.40	80,627,652.43
1. 利息收入		415,200.63	71,924.36
其中：存款利息收入	7.4.7.10	414,247.34	71,924.36
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		953.29	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-100,802,043.46	78,350,350.85
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-106,475,460.11	77,148,934.63
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	5,673,416.65	1,201,416.22
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	-109,288,078.32	75,253.98
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	6,882,386.75	2,130,123.24
减：二、营业总支出		28,013,762.88	11,851,459.55
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	19,538,374.22	3,095,610.05
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,907,674.82	619,121.92
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	4,080,245.14	691,987.11
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		3.43	-
8. 其他费用	7.4.7.20	487,465.27	7,444,740.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-230,806,297.28	68,776,192.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-230,806,297.28	68,776,192.88
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-230,806,297.28	68,776,192.88

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 1000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 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)	508,887,576.10	-	174,964,267.72	683,851,843.82
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	508,887,576.10	-	174,964,267.72	683,851,843.82
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,892,859,728.26	-	591,496,392.04	3,484,356,120.30
(一)、综合收益总额	-	-	-230,806,297.28	-230,806,297.28
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以	2,892,859,728.26	-	822,302,689.32	3,715,162,417.58

“-”号填列)				
其中:1. 基金申购款	5,332,403,704.53	-	1,421,598,792.92	6,754,002,497.45
2. 基金赎回款	-2,439,543,976.27	-	-599,296,103.60	-3,038,840,079.87
(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)	3,401,747,304.36	-	766,460,659.76	4,168,207,964.12
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)	13,257,277.16	-	4,928,028.40	18,185,305.56
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本 期初 净 资 产(基 金 净 值)	13,257,277.16	-	4,928,028.40	18,185,305.56
三、本 期 增 减 变 动 额(减 少以“- ” 号 填 列)	495,630,298.94	-	170,036,239.32	665,666,538.26
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	68,776,192.88	68,776,192.88
(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)	495,630,298.94	-	105,652,842.57	601,283,141.51
其中:1. 基 金 申 购 款	1,135,985,474.64	-	232,561,923.39	1,368,547,398.03
2 .基 金 赎 回 款	-640,355,175.70	-	-126,909,080.82	-767,264,256.52
(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)	-	-	-4,392,796.13	-4,392,796.13
(四)、 其 他 综 合 收 益 结 转 留	-	-	-	-

存收益				
四、本期期末净资产(基金净值)	508,887,576.10	-	174,964,267.72	683,851,843.82

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）、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，本基金在履行适当程序后可将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率*95%+一年期人民币定期存款利率（税后）*5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编

制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》中国证监会制定的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》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商业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。

转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称证券金融公司）出借证券，证券金融公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时计入转融通证券出借业务利息收入。

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

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

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红

利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

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

5、本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

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

应付管理人报酬	摊余成本	587,407.88	摊余成本	587,407.88
应付托管费	摊余成本	117,481.56	摊余成本	117,481.56
应付销售服务费	摊余成本	130,286.67	摊余成本	130,286.67
其他负债	摊余成本	217,134.74	摊余成本	217,134.74

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	68,342,332.22	17,729,574.45

等于：本金	68,332,158.12	17,729,574.45
加：应计利息	10,174.10	-
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	68,342,332.22	17,729,574.45

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	4,031,964,255.77	-	3,923,631,186.49	-108,333,069.28
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	4,031,964,255.77	-	3,923,631,186.49	-108,333,069.28
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	641,040,105.11	-	641,995,114.15	955,009.04
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	641,040,105.11	-	641,995,114.15	955,009.04

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	-	4,503.15
合计	-	4,503.15

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	14,640.34	3,987.18
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	285,000.00	165,000.00
应付指数使用费	158,293.53	48,147.56
合计	457,933.87	217,134.74

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

万家中证 1000 指数增强 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	230,974,168.43	230,974,168.43
本期申购	2,094,546,799.47	2,094,546,799.47
本期赎回 (以“-”号填列)	-528,363,478.51	-528,363,478.51
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	1,797,157,489.39	1,797,157,489.39

万家中证 1000 指数增强 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	277,913,407.67	277,913,407.67
本期申购	3,237,856,905.06	3,237,856,905.06
本期赎回 (以“-”号填列)	-1,911,180,497.76	-1,911,180,497.76
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	1,604,589,814.97	1,604,589,814.97

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 1000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	102,433,125.81	-22,870,945.03	79,562,180.78
本期利润	-60,919,498.79	-41,318,800.54	-102,238,299.33
本期基金份额交易产生的变动数	570,073,284.60	-137,362,662.34	432,710,622.26
其中：基金申购款	764,307,005.73	-194,621,263.45	569,685,742.28
基金赎回款	-194,233,721.13	57,258,601.11	-136,975,120.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	611,586,911.62	-201,552,407.91	410,034,503.71

万家中证 1000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	122,892,126.51	-27,490,039.57	95,402,086.94
本期利润	-60,598,720.17	-67,969,277.78	-128,567,997.95
本期基金份额交易产生	473,977,541.20	-84,385,474.14	389,592,067.06

的变动数			
其中：基金申购款	1,164,156,957.75	-312,243,907.11	851,913,050.64
基金赎回款	-690,179,416.55	227,858,432.97	-462,320,983.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	536,270,947.54	-179,844,791.49	356,426,156.05

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	147,192.52	43,675.10
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	261,843.66	5.59
其他	5,211.16	28,243.67
合计	414,247.34	71,924.36

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	-106,475,460.11	77,148,934.63
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	-106,475,460.11	77,148,934.63

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	18,046,249,100.29	2,834,483,178.06
减：卖出股票成本总额	18,106,932,446.21	2,757,334,243.43

减：交易费用	45,792,114.19	-
买卖股票差价收入	-106,475,460.11	77,148,934.63

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	5,673,416.65	1,201,416.22
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	5,673,416.65	1,201,416.22

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	-109,288,078.32	75,253.98
股票投资	-109,288,078.32	75,253.98
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	-109,288,078.32	75,253.98

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	6,866,574.46	2,106,186.28
基金转换费收入	15,812.29	23,936.96
合计	6,882,386.75	2,130,123.24

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	45,000.00	45,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	9,451.28	7,060.79
指数使用费	312,613.99	58,147.56
其他	400.00	-
交易费用	-	7,214,532.12
合计	487,465.27	7,444,740.47

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

1、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；

2、根据相关法规以及本基金收益分配政策，本基金的基金管理人于 2023 年 1 月 12 日宣告 2022 年度第 1 次分红，向截至 2023 年 1 月 16 日止登记在册的全体基金份额持有人，按每 10 份 A 类基金份额派发红利 0.229 元，每 10 份 C 类基金份额派发红利 0.223 元。

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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
万家共赢资产管理有限公司（“万家共赢”）	基金管理人的子公司
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
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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	19,538,374.22	3,095,610.05
其中：支付销售机构的客户维护费	6,203,729.84	1,258,610.39

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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托管费	3,907,674.82	619,121.92

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

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	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家中证 1000 指数增 强 A	万家中证 1000 指数增 强 C	合计
	万家基金	-	454,586.24
中泰证券	-	6,127.73	6,127.73
招商银行	-	491,576.92	491,576.92
合计	-	952,290.89	952,290.89
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 1000 指数增 强 A	万家中证 1000 指数增 强 C	合计
	万家基金	-	82,542.39
中泰证券	-	343.00	343.00
招商银行	-	11,933.79	11,933.79
合计	-	94,819.18	94,819.18

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

计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
	万家中证 1000 指数增强 A	万家中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日(2018 年 12 月 3 日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	9,887,305.69	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	9,887,305.69	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.5502%	-
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
	万家中证 1000 指数增强 A	万家中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日(2018 年 12 月 3 日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	9,887,305.69	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	9,887,305.69	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.9429%	-

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
招商银行	68,342,332.22	147,192.52	17,729,574.45	43,675.10

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

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

根据相关法规以及本基金收益分配政策，本基金的基金管理人于 2023 年 1 月 12 日宣告 2022 年度第 1 次分红，向截至 2023 年 1 月 16 日止登记在册的全体基金份额持有人，按每 10 份 A 类基金份额派发红利 0.229 元，每 10 份 C 类基金份额派发红利 0.223 元。

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	985	17,907.30	17,454.20	-
301175	中科环保	2022年6月30日	6个月	新股流通受限	3.82	6.01	6,370	24,333.40	38,283.70	-
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	815	21,418.20	14,775.95	-
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	575	19,348.75	40,066.00	-
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	1,006	51,185.28	66,597.20	-
301269	华大 九天	2022 年 7 月 21 日	6 个月	新股流 通受限	32.69	87.94	996	32,559.24	87,588.24	-
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	434	13,184.92	10,958.50	-

		日									
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		-
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	1,042	18,953.98	15,525.80		-
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	228	8,892.00	5,576.88		-
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	191	15,050.80	14,699.36		-
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	2022年	6个月	新股流	18.78	15.59	913	17,146.14	14,233.67		-

	宝	9月2日		通受限							
301349	信德新材	2022年8月30日	6个月	新股流通受限	138.88	103.52	180	24,998.40	18,633.60		-
301356	天振股份	2022年11月3日	6个月	新股流通受限	63.00	43.33	614	38,682.00	26,604.62		-
301363	美好医疗	2022年9月28日	6个月	新股流通受限	30.66	37.85	445	13,643.70	16,843.25		-
301366	一博科技	2022年9月19日	6个月	新股流通受限	65.35	45.09	268	17,513.80	12,084.12		-
301367	怡和嘉业	2022年10月21日	6个月	新股流通受限	119.88	175.78	223	26,733.24	39,198.94		-
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	1,269	28,552.50	21,776.04		-
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		-
688147	微导纳米	2022年12月16日	6个月	新股流通受限	24.21	23.91	6,293	152,353.53	150,465.63		-
688231	隆达股份	2022年7月13日	6个月	新股流通受限	39.08	35.14	7,835	306,191.80	275,321.90		-
688375	国博电子	2022年7月13日	6个月	新股流通受限	70.88	94.20	5,969	423,082.72	562,279.80		-
688420	美腾科技	2022年12月1日	6个月	新股流通受限	48.96	39.04	2,408	117,895.68	94,008.32		-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 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, 通过约定申报方式参与转融通证券出借业务的, 基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行必要的尽职调查与严格的准入管理, 对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整, 借券证券公司最近 1 年的分类结果应为 A 类, 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
资产							
银行存款	68,342,332.22	-	-	-	-	-	68,342,332.22
结算备付金	210,880,419.89	-	-	-	-	-	210,880,419.89
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-3,923,631,186.49	3,923,631,186.49
应收申购款	178,035.75	-	-	-	-	13,329,515.22	13,507,550.97
资产总计	279,400,787.86	-	-	-	-	-3,936,960,701.71	4,216,361,489.57
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	42,529,875.64	42,529,875.64
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,700,561.22	3,700,561.22
应付托管费	-	-	-	-	-	740,112.23	740,112.23
应付销售服务费	-	-	-	-	-	725,010.44	725,010.44
应交税费	-	-	-	-	-	32.05	32.05
其他负债	-	-	-	-	-	457,933.87	457,933.87
负债总计	-	-	-	-	-	48,153,525.45	48,153,525.45
利率敏感度缺口	279,400,787.86	-	-	-	-	-3,888,807,176.26	4,168,207,964.12
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	17,729,574.45	-	-	-	-	-	17,729,574.45
结算备付金	25,899,350.66	-	-	-	-	-	25,899,350.66
交易性金融资产	-	-	-	-	-	641,995,114.15	641,995,114.15
应收申购款	3,149.00	-	-	-	-	4,294,818.09	4,297,967.09
其他资产	-	-	-	-	-	4,503.15	4,503.15
资产总计	43,632,074.11	-	-	-	-	646,294,435.39	689,926,509.50
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,022,354.83	5,022,354.83
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	587,407.88	587,407.88
应付托管费	-	-	-	-	-	117,481.56	117,481.56
应付销售服务费	-	-	-	-	-	130,286.67	130,286.67

其他负债	-	-	-	-	217,134.74	217,134.74
负债总计	-	-	-	-	6,074,665.68	6,074,665.68
利率敏感度缺口	43,632,074.11	-	-	-	640,219,769.71	683,851,843.82

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

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	3,923,631,186.49	94.13	641,995,114.15	93.88
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,923,631,186.49	94.13	641,995,114.15	93.88

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	-38,498,843.98	-6,811,216.66
	2. 股票基准指数上升 100 个基点	38,498,843.98	6,811,216.66

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	3,921,824,557.59	640,187,977.61
第二层次	-	1,807,136.54
第三层次	1,806,628.90	-
合计	3,923,631,186.49	641,995,114.15

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	-	1,662,603.39	1,662,603.39
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	-	144,025.51	144,025.51
其中：计入损益的利得或损失	-	144,025.51	144,025.51
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,806,628.90	1,806,628.90
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	-	144,025.51	144,025.51
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	1,806,628.90	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	3,923,631,186.49	93.06
	其中：股票	3,923,631,186.49	93.06
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	279,222,752.11	6.62
8	其他各项资产	13,507,550.97	0.32
9	合计	4,216,361,489.57	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	3,261,497.60	0.08
B	采矿业	69,159,547.30	1.66
C	制造业	2,427,287,412.15	58.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	90,109,195.08	2.16
E	建筑业	82,872,416.04	1.99
F	批发和零售业	78,199,226.01	1.88
G	交通运输、仓储和邮政业	18,505,885.97	0.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	233,305,968.68	5.60
J	金融业	39,923,486.00	0.96
K	房地产业	27,836,641.65	0.67
L	租赁和商务服务业	53,650,219.00	1.29
M	科学研究和技术服务业	40,046,688.09	0.96
N	水利、环境和公共设施管理业	3,931,227.70	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	47,502,841.34	1.14
R	文化、体育和娱乐业	21,738,768.26	0.52
S	综合	-	-
	合计	3,237,331,020.87	77.67

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	-	-

B	采矿业	7,590,640.00	0.18
C	制造业	455,283,515.84	10.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,541,939.63	0.13
E	建筑业	9,797,180.00	0.24
F	批发和零售业	48,517,167.09	1.16
G	交通运输、仓储和邮政业	13,756,646.24	0.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	74,203,015.71	1.78
J	金融业	36,620,945.15	0.88
K	房地产业	7,029,371.87	0.17
L	租赁和商务服务业	605,631.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	36,966.88	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	10,878,049.00	0.26
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,839,847.20	0.04
R	文化、体育和娱乐业	48,301.22	0.00
S	综合	14,550,948.79	0.35
	合计	686,300,165.62	16.47

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	300596	利安隆	847,391	46,242,126.87	1.11
2	301035	润丰股份	517,020	45,032,442.00	1.08
3	002123	梦网科技	3,906,810	43,873,476.30	1.05
4	002675	东诚药业	2,611,300	43,243,128.00	1.04
5	603118	共进股份	5,388,600	42,839,370.00	1.03
6	002085	万丰奥威	6,958,100	41,400,695.00	0.99
7	000860	顺鑫农业	1,380,788	41,175,098.16	0.99

8	300348	长亮科技	3,941,241	40,121,833.38	0.96
9	300607	拓斯达	2,753,132	40,058,070.60	0.96
10	600305	恒顺醋业	3,226,040	39,712,552.40	0.95
11	002324	普利特	2,364,190	37,827,040.00	0.91
12	603612	索通发展	1,428,304	37,164,470.08	0.89
13	300662	科锐国际	744,636	36,487,164.00	0.88
14	002746	仙坛股份	3,937,653	36,068,901.48	0.87
15	603313	梦百合	3,400,189	36,042,003.40	0.86
16	605507	国邦医药	1,353,351	35,823,200.97	0.86
17	600197	伊力特	1,458,753	35,797,798.62	0.86
18	300856	科思股份	667,731	34,822,171.65	0.84
19	300328	宜安科技	5,761,866	34,455,958.68	0.83
20	000913	钱江摩托	1,862,625	34,421,310.00	0.83
21	600685	中船防务	1,630,668	33,852,667.68	0.81
22	300134	大富科技	4,332,868	33,623,055.68	0.81
23	600211	西藏药业	919,817	33,039,826.64	0.79
24	600933	爱柯迪	1,799,393	32,766,946.53	0.79
25	300487	蓝晓科技	466,000	32,428,940.00	0.78
26	601908	京运通	4,902,353	32,208,459.21	0.77
27	600789	鲁抗医药	4,394,702	31,905,536.52	0.77
28	300143	盈康生命	3,106,248	31,590,542.16	0.76
29	600481	双良节能	2,425,900	31,391,146.00	0.75
30	603396	金辰股份	374,029	31,134,173.96	0.75
31	002807	江阴银行	7,824,800	31,064,456.00	0.75
32	603920	世运电路	2,145,000	30,845,100.00	0.74
33	603960	克来机电	1,738,617	30,825,679.41	0.74
34	000539	粤电力 A	5,523,840	30,657,312.00	0.74
35	300602	飞荣达	2,099,573	30,212,855.47	0.72
36	688037	芯源微	192,459	30,119,833.50	0.72
37	003021	兆威机电	621,165	29,859,401.55	0.72
38	600129	太极集团	973,113	29,251,776.78	0.70
39	002158	汉钟精机	1,217,438	29,157,640.10	0.70
40	688268	华特气体	390,943	29,027,517.75	0.70
41	002461	珠江啤酒	3,612,773	28,938,311.73	0.69
42	600502	安徽建工	6,000,484	28,802,323.20	0.69
43	603328	依顿电子	4,397,500	28,539,775.00	0.68
44	300634	彩讯股份	1,857,800	28,331,450.00	0.68
45	300567	精测电子	555,288	27,875,457.60	0.67
46	000048	京基智农	1,558,098	27,812,049.30	0.67
47	600688	上海石化	8,770,000	27,274,700.00	0.65
48	002851	麦格米特	1,045,277	27,135,390.92	0.65
49	600966	博汇纸业	2,965,547	26,363,712.83	0.63
50	600073	上海梅林	3,234,654	25,715,499.30	0.62

51	300527	中船应急	3,782,208	25,076,039.04	0.60
52	688520	神州细胞	401,425	24,326,355.00	0.58
53	300118	东方日升	968,359	24,034,670.38	0.58
54	002733	雄韬股份	1,373,559	23,556,536.85	0.57
55	002055	得润电子	2,714,532	23,399,265.84	0.56
56	688586	江航装备	1,435,126	23,392,553.80	0.56
57	300377	赢时胜	2,814,334	23,105,682.14	0.55
58	601886	江河集团	2,918,971	22,592,835.54	0.54
59	002421	达实智能	6,381,300	22,079,298.00	0.53
60	002697	红旗连锁	3,835,600	21,594,428.00	0.52
61	002649	博彦科技	2,081,500	21,418,635.00	0.51
62	600266	城建发展	4,561,181	21,209,491.65	0.51
63	002204	大连重工	3,927,600	20,384,244.00	0.49
64	000902	新洋丰	1,747,120	20,109,351.20	0.48
65	600850	电科数字	988,680	19,852,694.40	0.48
66	605388	均瑶健康	1,273,300	19,150,432.00	0.46
67	000710	贝瑞基因	1,660,900	18,950,869.00	0.45
68	603368	柳药集团	1,010,953	18,874,492.51	0.45
69	603108	润达医疗	1,836,150	18,563,476.50	0.45
70	603678	火炬电子	445,376	18,233,693.44	0.44
71	603466	风语筑	1,332,942	18,034,705.26	0.43
72	002698	博实股份	1,280,820	17,944,288.20	0.43
73	300203	聚光科技	524,947	17,795,703.30	0.43
74	002993	奥海科技	516,700	17,572,967.00	0.42
75	000603	盛达资源	1,374,300	17,261,208.00	0.41
76	002291	遥望科技	1,320,235	17,163,055.00	0.41
77	000601	韶能股份	3,604,978	16,943,396.60	0.41
78	300443	金雷股份	420,290	16,929,281.20	0.41
79	300910	瑞丰新材	136,874	16,877,932.94	0.40
80	000690	宝新能源	2,513,000	16,334,500.00	0.39
81	688127	蓝特光学	1,024,385	16,318,453.05	0.39
82	688333	铂力特	113,042	16,136,745.50	0.39
83	300114	中航电测	1,571,475	16,123,333.50	0.39
84	301060	兰卫医学	811,438	15,912,299.18	0.38
85	603129	春风动力	139,689	15,717,806.28	0.38
86	002237	恒邦股份	1,489,000	15,694,060.00	0.38
87	300737	科顺股份	1,238,820	15,584,355.60	0.37
88	600583	海油工程	2,520,425	15,273,775.50	0.37
89	688559	海目星	262,800	15,200,352.00	0.36
90	000426	兴业矿业	2,225,800	13,555,122.00	0.33
91	000921	海信家电	1,022,876	13,471,276.92	0.32
92	688085	三友医疗	485,100	13,461,525.00	0.32
93	600995	南网储能	921,600	13,289,472.00	0.32

94	603529	爱玛科技	289,080	13,260,099.60	0.32
95	603533	掌阅科技	871,042	12,621,398.58	0.30
96	300319	麦捷科技	1,583,500	12,319,630.00	0.30
97	300666	江丰电子	177,011	12,249,161.20	0.29
98	002276	万马股份	1,432,200	11,815,650.00	0.28
99	002534	西子洁能	812,580	11,766,158.40	0.28
100	600612	老凤祥	271,700	11,628,760.00	0.28
101	601567	三星医疗	848,241	11,434,288.68	0.27
102	300855	图南股份	241,385	11,294,404.15	0.27
103	600720	祁连山	1,091,022	10,833,848.46	0.26
104	000789	万年青	1,260,158	10,761,749.32	0.26
105	002967	广电计量	630,200	10,574,756.00	0.25
106	002768	国恩股份	359,400	10,429,788.00	0.25
107	688066	航天宏图	119,356	10,204,938.00	0.24
108	603208	江山欧派	163,220	10,021,708.00	0.24
109	688389	普门科技	555,600	9,906,348.00	0.24
110	002240	盛新锂能	252,100	9,451,229.00	0.23
111	601369	陕鼓动力	809,700	9,279,162.00	0.22
112	600864	哈投股份	1,884,900	8,859,030.00	0.21
113	600869	远东股份	1,728,800	8,730,440.00	0.21
114	300397	天和防务	941,674	8,719,901.24	0.21
115	600248	陕西建工	2,071,160	8,698,872.00	0.21
116	300900	广联航空	299,497	8,604,548.81	0.21
117	603179	新泉股份	215,100	8,279,199.00	0.20
118	603609	禾丰股份	697,183	8,254,646.72	0.20
119	600363	联创光电	346,340	8,246,355.40	0.20
120	002928	华夏航空	584,125	8,078,448.75	0.19
121	600496	精工钢构	2,024,500	7,996,775.00	0.19
122	600072	中船科技	668,200	7,951,580.00	0.19
123	002484	江海股份	347,800	7,780,286.00	0.19
124	300616	尚品宅配	387,651	7,613,465.64	0.18
125	300748	金力永磁	248,334	7,266,252.84	0.17
126	301015	百洋医药	302,900	7,221,136.00	0.17
127	002312	川发龙蟒	675,300	7,104,156.00	0.17
128	688408	中信博	70,600	6,947,040.00	0.17
129	002518	科士达	120,200	6,923,520.00	0.17
130	000762	西藏矿业	178,900	6,907,329.00	0.17
131	002302	西部建设	947,700	6,870,825.00	0.16
132	600105	永鼎股份	1,990,400	6,787,264.00	0.16
133	600284	浦东建设	998,700	6,731,238.00	0.16
134	603279	景津装备	225,420	6,645,381.60	0.16
135	601975	招商南油	1,629,800	6,421,412.00	0.15
136	002239	奥特佳	2,561,900	6,404,750.00	0.15

137	603008	喜临门	222,100	6,340,955.00	0.15
138	002727	一心堂	201,000	6,333,510.00	0.15
139	601069	西部黄金	531,300	6,317,157.00	0.15
140	300298	三诺生物	185,200	6,246,796.00	0.15
141	688639	华恒生物	38,100	5,915,025.00	0.14
142	000550	江铃汽车	438,469	5,888,638.67	0.14
143	600773	西藏城投	321,000	5,826,150.00	0.14
144	605090	九丰能源	276,800	5,715,920.00	0.14
145	002865	钧达股份	30,600	5,664,060.00	0.14
146	300791	仙乐健康	148,508	5,460,639.16	0.13
147	600872	中炬高新	148,100	5,460,447.00	0.13
148	300590	移为通信	553,394	5,428,795.14	0.13
149	300382	斯莱克	279,900	5,284,512.00	0.13
150	603826	坤彩科技	98,991	5,188,118.31	0.12
151	688148	芳源股份	339,800	4,957,682.00	0.12
152	002959	小熊电器	79,500	4,795,440.00	0.12
153	600742	一汽富维	571,500	4,777,740.00	0.11
154	300393	中来股份	317,482	4,705,083.24	0.11
155	688161	威高骨科	89,779	4,685,566.01	0.11
156	003009	中天火箭	116,500	4,595,925.00	0.11
157	600997	开滦股份	668,437	4,532,002.86	0.11
158	603505	金石资源	114,240	4,526,188.80	0.11
159	002163	海南发展	393,738	4,492,550.58	0.11
160	003040	楚天龙	257,000	4,482,080.00	0.11
161	603801	志邦家居	165,700	4,454,016.00	0.11
162	002139	拓邦股份	428,455	4,443,078.35	0.11
163	002906	华阳集团	133,500	4,434,870.00	0.11
164	300428	立中集团	178,800	4,425,300.00	0.11
165	002782	可立克	255,000	4,391,100.00	0.11
166	300185	通裕重工	1,819,400	4,366,560.00	0.10
167	000028	国药一致	131,900	4,338,191.00	0.10
168	002664	信质集团	330,986	4,332,606.74	0.10
169	600508	上海能源	302,000	4,327,660.00	0.10
170	002446	盛路通信	452,600	4,326,856.00	0.10
171	603730	岱美股份	268,840	4,322,947.20	0.10
172	002918	蒙娜丽莎	237,700	4,273,846.00	0.10
173	601222	林洋能源	494,700	4,249,473.00	0.10
174	300725	药石科技	49,800	4,008,900.00	0.10
175	600662	外服控股	671,026	4,006,025.22	0.10
176	300101	振芯科技	158,900	3,893,050.00	0.09
177	000546	金圆股份	321,200	3,892,944.00	0.09
178	600578	京能电力	1,185,600	3,853,200.00	0.09
179	603098	森特股份	127,676	3,603,016.72	0.09

180	300887	谱尼测试	110,169	3,592,611.09	0.09
181	688139	海尔生物	56,700	3,589,110.00	0.09
182	688556	高测股份	47,800	3,585,956.00	0.09
183	688516	奥特维	17,809	3,579,609.00	0.09
184	002987	京北方	133,700	3,555,083.00	0.09
185	688776	国光电气	19,764	3,460,281.12	0.08
186	603938	三孚股份	100,000	3,450,000.00	0.08
187	688499	利元亨	21,720	3,418,293.60	0.08
188	002011	盾安环境	256,700	3,370,471.00	0.08
189	600158	中体产业	378,400	3,303,432.00	0.08
190	601137	博威合金	222,900	3,301,149.00	0.08
191	000795	英洛华	505,900	3,283,291.00	0.08
192	000543	皖能电力	732,600	3,282,048.00	0.08
193	601890	亚星锚链	370,479	3,271,329.57	0.08
194	002234	民和股份	168,640	3,261,497.60	0.08
195	000682	东方电子	400,507	3,220,076.28	0.08
196	300068	南都电源	149,900	3,192,870.00	0.08
197	001270	铖昌科技	25,600	3,123,200.00	0.07
198	603690	至纯科技	82,175	3,109,502.00	0.07
199	688131	皓元医药	28,200	3,056,316.00	0.07
200	002126	银轮股份	234,800	2,913,868.00	0.07
201	300395	菲利华	51,967	2,858,185.00	0.07
202	300765	新诺威	180,200	2,843,556.00	0.07
203	688001	华兴源创	101,600	2,733,040.00	0.07
204	002541	鸿路钢构	92,500	2,709,325.00	0.06
205	300438	鹏辉能源	34,600	2,698,454.00	0.06
206	002232	启明信息	207,700	2,610,789.00	0.06
207	688676	金盘科技	70,500	2,550,690.00	0.06
208	605376	博迁新材	54,500	2,530,435.00	0.06
209	600581	八一钢铁	608,480	2,409,580.80	0.06
210	300696	爱乐达	90,500	2,400,965.00	0.06
211	002859	洁美科技	83,900	2,368,497.00	0.06
212	301050	雷电微力	30,500	2,353,685.00	0.06
213	600285	羚锐制药	178,300	2,325,032.00	0.06
214	600416	湘电股份	115,285	2,167,358.00	0.05
215	600984	建设机械	381,055	2,080,560.30	0.05
216	002389	航天彩虹	100,700	2,071,399.00	0.05
217	002020	京新药业	168,700	2,054,766.00	0.05
218	603997	继峰股份	134,300	2,052,104.00	0.05
219	600645	中源协和	120,200	2,044,602.00	0.05
220	002428	云南锗业	208,400	1,942,288.00	0.05
221	000049	德赛电池	43,400	1,887,032.00	0.05
222	300205	天喻信息	170,800	1,878,800.00	0.05

223	300772	运达股份	124,190	1,846,705.30	0.04
224	601965	中国汽研	94,300	1,827,534.00	0.04
225	300894	火星人	64,973	1,642,517.44	0.04
226	003006	百亚股份	118,500	1,636,485.00	0.04
227	300224	正海磁材	121,666	1,524,474.98	0.04
228	000811	冰轮环境	131,900	1,464,090.00	0.04
229	600114	东睦股份	170,500	1,449,250.00	0.03
230	000829	天音控股	130,800	1,273,992.00	0.03
231	300236	上海新阳	45,600	1,267,224.00	0.03
232	600963	岳阳林纸	230,900	1,258,405.00	0.03
233	300639	凯普生物	65,500	1,103,675.00	0.03
234	688518	联赢激光	36,300	1,060,323.00	0.03
235	688399	硕世生物	11,700	1,026,207.00	0.02
236	688019	安集科技	5,642	1,015,560.00	0.02
237	603979	金诚信	38,700	991,107.00	0.02
238	000657	中钨高新	61,900	980,496.00	0.02
239	002837	英维克	27,600	919,356.00	0.02
240	300219	鸿利智汇	135,200	903,136.00	0.02
241	000951	中国重汽	58,300	865,172.00	0.02
242	002777	久远银海	57,600	864,000.00	0.02
243	600691	阳煤化工	266,600	837,124.00	0.02
244	000560	我爱我家	320,400	801,000.00	0.02
245	688368	晶丰明源	6,800	759,560.00	0.02
246	002979	雷赛智能	33,100	748,391.00	0.02
247	301155	海力风电	7,700	672,595.00	0.02
248	300842	帝科股份	12,900	662,931.00	0.02
249	688686	奥普特	5,000	660,000.00	0.02
250	301039	中集车辆	77,000	613,690.00	0.01
251	688366	昊海生科	5,955	580,850.70	0.01
252	600929	雪天盐业	59,600	477,396.00	0.01
253	688578	艾力斯	23,800	468,384.00	0.01
254	300633	开立医疗	8,200	449,606.00	0.01
255	002605	姚记科技	28,900	406,045.00	0.01
256	300860	锋尚文化	7,700	400,631.00	0.01
257	688711	宏微科技	3,800	352,640.00	0.01
258	600771	广誉远	12,100	336,622.00	0.01
259	301089	拓新药业	3,800	273,600.00	0.01
260	300502	新易盛	8,900	211,375.00	0.01
261	300315	掌趣科技	57,200	183,612.00	0.00
262	300394	天孚通信	6,500	164,775.00	0.00
263	603308	应流股份	5,453	116,148.90	0.00
264	300593	新雷能	2,490	105,775.20	0.00
265	300085	银之杰	9,322	86,694.60	0.00

266	002463	沪电股份	5,100	60,690.00	0.00
267	002891	中宠股份	2,200	49,082.00	0.00
268	301175	中科环保	6,370	38,283.70	0.00
269	001258	立新能源	3,188	33,346.48	0.00
270	300346	南大光电	900	26,145.00	0.00
271	300846	首都在线	1,100	10,703.00	0.00
272	301238	瑞泰新材	441	9,918.09	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	1,238,900	40,041,248.00	0.96
2	000717	中南股份	11,855,000	33,786,750.00	0.81
3	002560	通达股份	4,068,083	27,744,326.06	0.67
4	300274	阳光电源	247,668	27,689,282.40	0.66
5	300624	万兴科技	914,914	26,861,875.04	0.64
6	000906	浙商中拓	2,954,305	26,618,288.05	0.64
7	300043	星辉娱乐	8,793,100	26,115,507.00	0.63
8	002674	兴业科技	2,085,600	22,545,336.00	0.54
9	603787	新日股份	1,200,900	21,736,290.00	0.52
10	601231	环旭电子	1,245,819	20,219,642.37	0.49
11	300115	长盈精密	1,934,273	19,981,040.09	0.48
12	002536	飞龙股份	2,603,100	19,497,219.00	0.47
13	601881	中国银河	2,033,808	18,894,076.32	0.45
14	002353	杰瑞股份	583,500	16,285,485.00	0.39
15	300684	中石科技	1,076,540	15,943,557.40	0.38
16	002957	科瑞技术	1,045,000	15,810,850.00	0.38
17	600212	绿能慧充	1,867,901	14,550,948.79	0.35
18	603527	众源新材	970,100	13,659,008.00	0.33
19	300207	欣旺达	610,162	12,904,926.30	0.31
20	603056	德邦股份	596,778	12,430,885.74	0.30
21	600054	黄山旅游	853,850	10,878,049.00	0.26
22	603528	多伦科技	1,622,900	10,467,705.00	0.25
23	603083	剑桥科技	827,700	9,303,348.00	0.22
24	300570	太辰光	640,700	9,264,522.00	0.22
25	600667	太极实业	1,739,000	8,973,240.00	0.22
26	688258	卓易信息	206,900	8,462,210.00	0.20
27	603939	益丰药房	131,200	8,375,808.00	0.20
28	600549	厦门钨业	426,963	8,347,126.65	0.20
29	601319	中国人保	1,524,500	7,957,890.00	0.19
30	603233	大参林	182,400	7,223,040.00	0.17
31	300314	戴维医疗	492,400	6,391,352.00	0.15
32	300491	通合科技	458,700	6,339,234.00	0.15

33	600064	南京高科	938,067	6,200,622.87	0.15
34	002900	哈三联	409,700	5,592,405.00	0.13
35	600027	华电国际	938,601	5,518,973.88	0.13
36	600827	百联股份	431,500	5,229,780.00	0.13
37	002952	亚世光电	321,100	4,810,078.00	0.12
38	000541	佛山照明	965,794	4,751,706.48	0.11
39	300227	光韵达	704,000	4,674,560.00	0.11
40	600871	石化油服	2,136,300	4,229,874.00	0.10
41	300290	荣科科技	907,100	4,081,950.00	0.10
42	002338	奥普光电	167,800	3,740,262.00	0.09
43	600919	江苏银行	506,700	3,693,843.00	0.09
44	002632	道明光学	543,400	3,466,892.00	0.08
45	002442	龙星化工	679,200	3,436,752.00	0.08
46	601808	中海油服	202,700	3,360,766.00	0.08
47	002673	西部证券	551,400	3,358,026.00	0.08
48	600699	均胜电子	233,600	3,282,080.00	0.08
49	688819	天能股份	88,100	3,236,794.00	0.08
50	603681	永冠新材	150,400	3,215,552.00	0.08
51	603086	先达股份	239,000	3,128,510.00	0.08
52	688678	福立旺	161,700	3,103,023.00	0.07
53	688138	清溢光电	169,400	3,083,080.00	0.07
54	603421	鼎信通讯	361,400	3,024,918.00	0.07
55	002409	雅克科技	57,300	2,886,201.00	0.07
56	002547	春兴精工	577,200	2,643,576.00	0.06
57	000686	东北证券	402,400	2,615,600.00	0.06
58	002250	联化科技	156,300	2,422,650.00	0.06
59	002273	水晶光电	203,300	2,396,907.00	0.06
60	002688	金河生物	453,100	2,328,934.00	0.06
61	603786	科博达	34,200	2,251,386.00	0.05
62	300258	精锻科技	191,400	2,225,982.00	0.05
63	300427	红相股份	122,200	2,055,404.00	0.05
64	300365	恒华科技	260,200	1,980,122.00	0.05
65	600408	安泰集团	732,900	1,956,843.00	0.05
66	600588	用友网络	80,700	1,950,519.00	0.05
67	002360	同德化工	267,700	1,881,931.00	0.05
68	603076	乐惠国际	48,000	1,766,400.00	0.04
69	000516	国际医学	141,600	1,733,184.00	0.04
70	600521	华海药业	75,200	1,643,872.00	0.04
71	603856	东宏股份	138,500	1,605,215.00	0.04
72	300830	金现代	203,700	1,580,712.00	0.04
73	002653	海思科	69,210	1,539,922.50	0.04
74	600118	中国卫星	66,400	1,430,920.00	0.03
75	002111	威海广泰	139,400	1,389,818.00	0.03

76	600026	中远海能	107,800	1,298,990.00	0.03
77	002169	智光电气	167,200	1,279,080.00	0.03
78	603378	亚士创能	108,815	1,254,636.95	0.03
79	001206	依依股份	47,582	1,157,194.24	0.03
80	301018	申菱环境	33,100	1,133,675.00	0.03
81	603628	清源股份	73,700	1,130,558.00	0.03
82	603663	三祥新材	87,400	1,110,854.00	0.03
83	688195	腾景科技	47,650	1,089,279.00	0.03
84	603214	爱婴室	58,400	1,055,872.00	0.03
85	600732	爱旭股份	24,100	911,462.00	0.02
86	000656	金科股份	433,900	828,749.00	0.02
87	600170	上海建工	316,900	823,940.00	0.02
88	600307	酒钢宏兴	451,900	745,635.00	0.02
89	002068	黑猫股份	62,200	744,534.00	0.02
90	688311	盟升电子	7,700	625,394.00	0.02
91	603569	长久物流	68,900	605,631.00	0.01
92	688375	国博电子	5,969	562,279.80	0.01
93	688596	正帆科技	13,800	468,510.00	0.01
94	688567	孚能科技	16,664	450,427.92	0.01
95	688002	睿创微纳	10,500	390,495.00	0.01
96	688231	隆达股份	7,835	275,321.90	0.01
97	300125	聆达股份	11,400	226,176.00	0.01
98	002783	凯龙股份	24,997	212,224.53	0.01
99	300802	矩子科技	10,700	196,666.00	0.00
100	688147	微导纳米	6,293	150,465.63	0.00
101	300776	帝尔激光	880	110,880.00	0.00
102	603611	诺力股份	6,700	108,473.00	0.00
103	688420	美腾科技	2,408	94,008.32	0.00
104	301269	华大九天	996	87,588.24	0.00
105	000584	哈工智能	12,500	86,000.00	0.00
106	601136	首创证券	4,739	82,553.38	0.00
107	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.00
108	301267	华夏眼科	1,006	66,597.20	0.00
109	001269	欧晶科技	546	54,185.04	0.00
110	001330	博纳影业	3,564	42,696.72	0.00
111	301239	普瑞眼科	575	40,066.00	0.00
112	301367	怡和嘉业	223	39,198.94	0.00
113	300690	双一科技	2,200	35,508.00	0.00
114	001338	永顺泰	1,649	34,826.88	0.00
115	603058	永吉股份	4,100	29,848.00	0.00
116	301301	川宁生物	3,574	26,912.22	0.00
117	601022	宁波远洋	1,983	26,770.50	0.00
118	301356	天振股份	614	26,604.62	0.00

119	001322	箭牌家居	1,595	24,244.00	0.00
120	603255	鼎际得	489	21,956.10	0.00
121	301389	隆扬电子	1,269	21,776.04	0.00
122	301391	卡莱特	247	19,999.59	0.00
123	001236	弘业期货	1,399	18,956.45	0.00
124	301349	信德新材	180	18,633.60	0.00
125	301171	易点天下	985	17,454.20	0.00
126	603057	紫燕食品	549	17,277.03	0.00
127	301363	美好医疗	445	16,843.25	0.00
128	001339	智微智能	812	16,516.08	0.00
129	603211	晋拓股份	1,287	16,164.72	0.00
130	301296	新巨丰	1,042	15,525.80	0.00
131	603237	五芳斋	325	15,323.75	0.00
132	301223	中荣股份	815	14,775.95	0.00
133	301328	维峰电子	191	14,699.36	0.00
134	001298	好上好	403	14,379.04	0.00
135	301339	通行宝	913	14,233.67	0.00
136	301311	昆船智能	832	13,195.52	0.00
137	301297	富乐德	1,015	13,184.85	0.00
138	603130	云中马	480	13,176.00	0.00
139	301230	泓博医药	269	12,998.08	0.00
140	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
141	301280	珠城科技	279	12,499.20	0.00
142	301112	信邦智能	399	12,404.91	0.00
143	001256	炜冈科技	474	12,390.36	0.00
144	001333	光华股份	426	12,332.70	0.00
145	301366	一博科技	268	12,084.12	0.00
146	001300	三柏硕	763	11,826.50	0.00
147	001299	美能能源	576	11,635.20	0.00
148	301290	东星医疗	330	11,592.90	0.00
149	001331	胜通能源	385	11,330.55	0.00
150	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
151	301379	天山电子	449	11,058.87	0.00
152	301282	金禄电子	434	10,958.50	0.00
153	001238	浙江正特	374	10,797.38	0.00
154	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
155	001222	源飞宠物	434	10,758.86	0.00
156	301220	亚香股份	285	10,496.55	0.00
157	301273	瑞晨环保	277	10,467.83	0.00
158	603182	嘉华股份	546	9,778.86	0.00
159	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00
160	001229	魅视科技	347	9,313.48	0.00
161	301176	逸豪新材	544	9,188.16	0.00

162	603280	南方路机	363	8,893.50	0.00
163	301227	森鹰窗业	284	8,375.16	0.00
164	001231	农心科技	355	8,037.20	0.00
165	301197	工大科雅	380	7,630.40	0.00
166	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
167	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
168	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
169	001336	楚环科技	274	6,770.54	0.00
170	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
171	301300	远翔新材	211	6,197.07	0.00
172	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
173	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
174	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
175	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
176	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
177	301316	慧博云通	359	5,140.88	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	000902	新洋丰	93,506,856.56	13.67
2	300748	金力永磁	85,257,425.80	12.47
3	600211	西藏药业	83,795,616.10	12.25
4	002239	奥特佳	83,713,529.00	12.24
5	603612	索通发展	83,306,433.02	12.18
6	600685	中船防务	82,936,619.68	12.13
7	000860	顺鑫农业	82,786,991.70	12.11
8	002733	雄韬股份	82,064,586.08	12.00
9	600481	双良节能	79,393,829.52	11.61
10	600305	恒顺醋业	78,649,966.77	11.50
11	300602	飞荣达	78,643,531.31	11.50
12	600073	上海梅林	75,315,495.96	11.01
13	688066	航天宏图	75,097,435.28	10.98
14	688063	派能科技	74,017,847.92	10.82
15	300118	东方日升	73,764,084.20	10.79
16	300438	鹏辉能源	72,802,909.94	10.65
17	002085	万丰奥威	72,695,949.00	10.63
18	600129	太极集团	72,614,252.71	10.62
19	002413	雷科防务	72,428,081.28	10.59
20	300666	江丰电子	71,641,942.58	10.48
21	688567	孚能科技	69,595,677.21	10.18
22	601231	环旭电子	68,992,474.34	10.09

23	002746	仙坛股份	68,744,936.67	10.05
24	603328	依顿电子	68,611,887.72	10.03
25	600502	安徽建工	68,175,606.40	9.97
26	603713	密尔克卫	67,788,067.20	9.91
27	300662	科锐国际	66,953,426.33	9.79
28	002851	麦格米特	66,010,853.66	9.65
29	000651	格力电器	65,988,010.00	9.65
30	600581	八一钢铁	65,647,892.29	9.60
31	300143	盈康生命	64,940,893.20	9.50
32	688037	芯源微	64,912,556.12	9.49
33	002291	遥望科技	64,525,645.30	9.44
34	600266	城建发展	64,449,411.13	9.42
35	002807	江阴银行	63,987,224.40	9.36
36	300328	宜安科技	62,998,562.06	9.21
37	300900	广联航空	62,641,350.84	9.16
38	688019	安集科技	62,196,613.44	9.10
39	300607	拓斯达	61,135,351.97	8.94
40	601886	江河集团	60,990,063.54	8.92
41	601567	三星医疗	60,658,437.10	8.87
42	002025	航天电器	60,507,462.58	8.85
43	300373	扬杰科技	60,282,165.91	8.82
44	002906	华阳集团	59,775,304.86	8.74
45	002123	梦网科技	59,339,565.80	8.68
46	002850	科达利	59,073,274.00	8.64
47	301035	润丰股份	58,380,299.64	8.54
48	603920	世运电路	58,190,000.00	8.51
49	002204	大连重工	57,416,104.00	8.40
50	603609	禾丰股份	57,198,409.11	8.36
51	002171	楚江新材	56,742,374.31	8.30
52	688680	海优新材	56,727,081.15	8.30
53	688516	奥特维	56,709,659.71	8.29
54	300856	科思股份	56,591,580.92	8.28
55	603313	梦百合	56,526,292.75	8.27
56	002643	万润股份	56,096,855.45	8.20
57	002675	东诚药业	56,092,116.00	8.20
58	002484	江海股份	56,036,033.00	8.19
59	603596	伯特利	55,826,672.70	8.16
60	300776	帝尔激光	55,727,119.16	8.15
61	002055	得润电子	55,344,167.46	8.09
62	600197	伊力特	54,882,104.01	8.03
63	300596	利安隆	54,822,001.82	8.02
64	603118	共进股份	54,713,652.00	8.00
65	688586	江航装备	54,516,409.89	7.97

66	002192	融捷股份	54,091,077.40	7.91
67	300233	金城医药	53,844,084.58	7.87
68	600391	航发科技	53,754,945.64	7.86
69	000762	西藏矿业	53,670,708.00	7.85
70	300684	中石科技	52,753,388.00	7.71
71	300348	长亮科技	52,596,359.85	7.69
72	603678	火炬电子	52,488,951.56	7.68
73	300035	中科电气	52,443,392.75	7.67
74	002100	天康生物	52,146,150.89	7.63
75	600929	雪天盐业	51,940,579.97	7.60
76	000539	粤电力 A	51,793,359.16	7.57
77	300527	中船应急	51,703,035.29	7.56
78	600789	鲁抗医药	51,638,770.46	7.55
79	600933	爱柯迪	50,641,620.59	7.41
80	002276	万马股份	50,431,890.00	7.37
81	002993	奥海科技	50,385,468.40	7.37
82	601908	京运通	50,124,553.19	7.33
83	600997	开滦股份	49,865,105.05	7.29
84	600496	精工钢构	49,694,476.60	7.27
85	300568	星源材质	49,267,488.45	7.20
86	601881	中国银河	49,234,989.26	7.20
87	603236	移远通信	49,061,271.85	7.17
88	000710	贝瑞基因	48,971,615.00	7.16
89	000543	皖能电力	48,275,600.00	7.06
90	002312	川发龙蟒	48,077,370.00	7.03
91	002768	国恩股份	47,625,314.45	6.96
92	688388	嘉元科技	47,325,891.95	6.92
93	000795	英洛华	47,252,655.00	6.91
94	603368	柳药集团	47,214,460.72	6.90
95	300114	中航电测	47,208,886.00	6.90
96	603108	润达医疗	46,958,191.32	6.87
97	000913	钱江摩托	46,228,378.66	6.76
98	002324	普利特	46,226,287.78	6.76
99	300203	聚光科技	46,218,833.16	6.76
100	603690	至纯科技	46,097,936.95	6.74
101	002446	盛路通信	45,911,632.11	6.71
102	002967	广电计量	45,763,143.00	6.69
103	002215	诺普信	45,730,909.00	6.69
104	605507	国邦医药	45,685,264.77	6.68
105	300624	万兴科技	45,399,274.92	6.64
106	300131	英唐智控	45,322,372.00	6.63
107	600114	东睦股份	45,265,610.00	6.62
108	300487	蓝晓科技	45,103,091.50	6.60

109	688520	神州细胞	44,956,251.68	6.57
110	002738	中矿资源	44,915,772.37	6.57
111	000601	韶能股份	44,846,414.40	6.56
112	300696	爱乐达	44,182,303.22	6.46
113	300657	弘信电子	44,014,514.40	6.44
114	600578	京能电力	43,567,824.00	6.37
115	300134	大富科技	43,441,933.60	6.35
116	003021	兆威机电	43,440,927.70	6.35
117	002782	可立克	42,973,064.00	6.28
118	300855	图南股份	42,612,420.56	6.23
119	300428	立中集团	42,259,373.26	6.18
120	002237	恒邦股份	42,089,461.13	6.15
121	000048	京基智农	41,651,896.84	6.09
122	600869	远东股份	41,536,665.98	6.07
123	300236	上海新阳	41,518,871.38	6.07
124	002560	通达股份	41,492,222.72	6.07
125	600512	腾达建设	41,329,815.36	6.04
126	300115	长盈精密	41,326,950.30	6.04
127	000931	中关村	41,248,829.06	6.03
128	603308	应流股份	41,229,670.48	6.03
129	600395	盘江股份	41,177,251.81	6.02
130	600057	厦门象屿	40,893,339.77	5.98
131	300054	鼎龙股份	40,663,440.98	5.95
132	601137	博威合金	40,316,471.00	5.90
133	000615	奥园美谷	40,280,827.63	5.89
134	300101	振芯科技	40,113,520.00	5.87
135	300765	新诺威	39,792,796.86	5.82
136	300761	立华股份	39,664,437.90	5.80
137	600966	博汇纸业	39,341,403.21	5.75
138	300393	中来股份	39,240,051.30	5.74
139	603396	金辰股份	39,072,164.36	5.71
140	002959	小熊电器	38,873,175.00	5.68
141	000672	上峰水泥	38,829,482.40	5.68
142	000717	中南股份	38,784,880.00	5.67
143	002163	海南发展	38,758,065.68	5.67
144	000090	天健集团	38,718,605.84	5.66
145	688166	博瑞医药	38,709,382.59	5.66
146	688268	华特气体	38,640,447.42	5.65
147	000810	创维数字	38,476,577.40	5.63
148	688127	蓝特光学	38,438,883.33	5.62
149	603960	克来机电	38,430,040.10	5.62
150	600284	浦东建设	38,321,882.60	5.60
151	300842	帝科股份	38,072,642.00	5.57

152	002421	达实智能	37,743,666.00	5.52
153	603129	春风动力	37,650,502.77	5.51
154	300659	中孚信息	37,633,849.36	5.50
155	002895	川恒股份	37,622,267.40	5.50
156	300346	南大光电	37,599,637.29	5.50
157	300443	金雷股份	37,554,207.80	5.49
158	003009	中天火箭	37,354,331.00	5.46
159	000688	国城矿业	37,344,847.08	5.46
160	600750	江中药业	37,000,283.25	5.41
161	000612	焦作万方	36,862,536.00	5.39
162	688033	天宜上佳	36,850,085.29	5.39
163	300775	三角防务	36,777,019.68	5.38
164	300634	彩讯股份	36,752,510.00	5.37
165	603688	石英股份	36,743,176.12	5.37
166	000657	中钨高新	36,668,988.00	5.36
167	002285	世联行	36,653,887.56	5.36
168	600771	广誉远	36,501,196.60	5.34
169	603098	森特股份	36,430,688.10	5.33
170	002697	红旗连锁	36,381,841.00	5.32
171	603599	广信股份	36,248,199.50	5.30
172	300725	药石科技	36,019,367.20	5.27
173	002594	比亚迪	35,921,139.13	5.25
174	601666	平煤股份	35,900,483.01	5.25
175	600657	信达地产	35,889,246.00	5.25
176	300274	阳光电源	35,652,682.48	5.21
177	002376	新北洋	35,581,965.00	5.20
178	002158	汉钟精机	35,518,374.50	5.19
179	600688	上海石化	35,516,251.00	5.19
180	300604	长川科技	35,490,855.00	5.19
181	603105	芯能科技	35,478,642.00	5.19
182	000768	中航西飞	35,193,202.10	5.15
183	600027	华电国际	35,143,371.90	5.14
184	300894	火星人	35,016,826.50	5.12
185	000541	佛山照明	34,940,788.48	5.11
186	002918	蒙娜丽莎	34,781,554.08	5.09
187	603826	坤彩科技	34,625,720.04	5.06
188	603529	爱玛科技	34,594,836.00	5.06
189	600667	太极实业	34,519,566.00	5.05
190	000893	亚钾国际	34,477,090.92	5.04
191	002747	埃斯顿	34,400,669.40	5.03
192	300850	新强联	34,331,517.20	5.02
193	300861	美畅股份	34,206,850.82	5.00
194	300149	睿智医药	34,159,439.05	5.00

195	002468	申通快递	34,060,737.00	4.98
196	300043	星辉娱乐	33,613,433.00	4.92
197	002698	博实股份	33,529,451.95	4.90
198	688085	三友医疗	33,445,991.52	4.89
199	600565	迪马股份	33,361,839.00	4.88
200	600720	祁连山	33,355,040.24	4.88
201	600583	海油工程	33,326,682.18	4.87
202	300331	苏大维格	33,301,815.78	4.87
203	000567	海德股份	33,254,164.00	4.86
204	688408	中信博	33,049,495.61	4.83
205	600223	鲁商发展	33,004,744.50	4.83
206	000682	东方电子	32,991,944.65	4.82
207	002234	民和股份	32,829,600.26	4.80
208	601958	金钼股份	32,696,927.93	4.78
209	002545	东方铁塔	32,586,609.35	4.77
210	300397	天和防务	32,576,104.64	4.76
211	002338	奥普光电	32,537,796.00	4.76
212	300298	三诺生物	32,496,496.42	4.75
213	600338	西藏珠峰	32,482,132.10	4.75
214	603959	百利科技	32,450,715.52	4.75
215	002409	雅克科技	32,398,135.00	4.74
216	002674	兴业科技	32,300,582.00	4.72
217	600328	中盐化工	32,235,789.68	4.71
218	600063	皖维高新	32,088,341.00	4.69
219	300226	上海钢联	32,062,233.12	4.69
220	300647	超频三	31,902,221.00	4.67
221	603583	捷昌驱动	31,867,149.41	4.66
222	688266	泽璟制药	31,790,250.83	4.65
223	002314	南山控股	31,736,840.00	4.64
224	600990	四创电子	31,435,383.69	4.60
225	002461	珠江啤酒	31,182,466.42	4.56
226	300377	赢时胜	31,153,031.02	4.56
227	300068	南都电源	31,138,785.00	4.55
228	601212	白银有色	31,117,071.25	4.55
229	688333	铂力特	30,881,010.28	4.52
230	300194	福安药业	30,813,326.76	4.51
231	603800	道森股份	30,696,304.00	4.49
232	300567	精测电子	30,671,462.00	4.49
233	002500	山西证券	30,535,309.00	4.47
234	600072	中船科技	30,359,160.92	4.44
235	603466	风语筑	30,249,578.52	4.42
236	300224	正海磁材	30,194,880.50	4.42
237	002649	博彦科技	30,133,985.00	4.41

238	600645	中源协和	30,133,655.00	4.41
239	600876	洛阳玻璃	30,098,774.94	4.40
240	600864	哈投股份	29,880,147.48	4.37
241	300394	天孚通信	29,765,613.24	4.35
242	603997	继峰股份	29,722,328.00	4.35
243	002302	西部建设	29,703,065.00	4.34
244	600330	天通股份	29,690,120.76	4.34
245	000951	中国重汽	29,381,983.28	4.30
246	601609	金田股份	28,956,886.00	4.23
247	002400	省广集团	28,722,951.73	4.20
248	600206	有研新材	28,718,292.00	4.20
249	002258	利尔化学	28,690,447.20	4.20
250	002389	航天彩虹	28,646,483.00	4.19
251	000969	安泰科技	28,395,313.00	4.15
252	600882	妙可蓝多	28,358,713.00	4.15
253	000906	浙商中拓	28,239,865.88	4.13
254	301050	雷电微力	28,229,971.59	4.13
255	002673	西部证券	28,109,086.00	4.11
256	000517	荣安地产	28,068,618.00	4.10
257	601369	陕鼓动力	28,016,846.00	4.10
258	002597	金禾实业	28,010,264.04	4.10
259	603989	艾华集团	27,948,734.04	4.09
260	000521	长虹美菱	27,930,481.00	4.08
261	603528	多伦科技	27,855,195.00	4.07
262	002340	格林美	27,793,847.76	4.06
263	300130	新国都	27,758,565.04	4.06
264	600850	电科数字	27,751,572.50	4.06
265	603279	景津装备	27,734,833.86	4.06
266	301060	兰卫医学	27,717,154.10	4.05
267	000401	冀东水泥	27,682,809.66	4.05
268	600105	永鼎股份	27,672,006.80	4.05
269	603212	赛伍技术	27,494,711.72	4.02
270	002182	云海金属	27,470,754.00	4.02
271	688598	金博股份	27,455,569.00	4.01
272	002240	盛新锂能	27,415,648.00	4.01
273	605123	派克新材	27,405,988.50	4.01
274	300432	富临精工	27,396,541.68	4.01
275	000550	江铃汽车	27,350,704.91	4.00
276	002947	恒铭达	27,272,448.60	3.99
277	002176	江特电机	27,234,418.00	3.98
278	000735	罗牛山	27,220,795.99	3.98
279	003012	东鹏控股	27,190,460.53	3.98
280	002957	科瑞技术	26,910,748.00	3.94

281	600604	市北高新	26,891,432.00	3.93
282	600662	外服控股	26,847,468.67	3.93
283	600248	陕西建工	26,747,941.40	3.91
284	300769	德方纳米	26,529,185.40	3.88
285	601686	友发集团	26,338,486.00	3.85
286	603019	中科曙光	26,192,717.20	3.83
287	300352	北信源	26,189,796.00	3.83
288	603306	华懋科技	26,179,792.00	3.83
289	601069	西部黄金	25,994,065.40	3.80
290	002139	拓邦股份	25,988,414.55	3.80
291	688366	昊海生科	25,983,690.74	3.80
292	300633	开立医疗	25,915,669.00	3.79
293	603533	掌阅科技	25,784,934.42	3.77
294	300510	金冠股份	25,770,117.00	3.77
295	600559	老白干酒	25,740,401.76	3.76
296	603995	甬金股份	25,658,093.20	3.75
297	688499	利元亨	25,611,643.77	3.75
298	300378	鼎捷软件	25,505,636.00	3.73
299	600030	中信证券	25,282,909.85	3.70
300	300477	合纵科技	25,282,251.12	3.70
301	002081	金螳螂	25,186,414.17	3.68
302	002344	海宁皮城	25,180,202.72	3.68
303	688106	金宏气体	25,178,557.67	3.68
304	688578	艾力斯	25,093,161.44	3.67
305	603229	奥翔药业	24,944,197.60	3.65
306	000426	兴业矿业	24,897,060.00	3.64
307	300682	朗新科技	24,836,671.58	3.63
308	688139	海尔生物	24,762,959.92	3.62
309	300014	亿纬锂能	24,759,000.58	3.62
310	600971	恒源煤电	24,689,482.38	3.61
311	002169	智光电气	24,684,144.00	3.61
312	600184	光电股份	24,568,088.00	3.59
313	300395	菲利华	24,489,052.16	3.58
314	600699	均胜电子	24,310,283.00	3.55
315	600732	爱旭股份	24,221,710.00	3.54
316	603919	金徽酒	24,115,067.00	3.53
317	300763	锦浪科技	24,114,881.08	3.53
318	002950	奥美医疗	24,085,142.18	3.52
319	603093	南华期货	23,751,707.00	3.47
320	688389	普门科技	23,751,133.21	3.47
321	300791	仙乐健康	23,730,321.90	3.47
322	002865	钧达股份	23,613,951.00	3.45
323	600363	联创光电	23,593,516.40	3.45

324	300590	移为通信	23,592,063.30	3.45
325	600098	广州发展	23,535,237.00	3.44
326	000950	重药控股	23,483,936.00	3.43
327	002664	信质集团	23,431,763.01	3.43
328	300326	凯利泰	23,359,491.00	3.42
329	603327	福蓉科技	23,353,109.30	3.41
330	300439	美康生物	23,265,022.00	3.40
331	002279	久其软件	23,202,790.65	3.39
332	300185	通裕重工	23,109,654.00	3.38
333	002120	韵达股份	22,965,372.55	3.36
334	300638	广和通	22,929,298.90	3.35
335	300170	汉得信息	22,877,468.04	3.35
336	603787	新日股份	22,829,405.00	3.34
337	605388	均瑶健康	22,795,803.00	3.33
338	600993	马应龙	22,776,606.70	3.33
339	000829	天音控股	22,741,609.01	3.33
340	003040	楚天龙	22,694,865.00	3.32
341	002099	海翔药业	22,690,945.72	3.32
342	300294	博雅生物	22,632,415.00	3.31
343	600459	贵研铂业	22,602,659.10	3.31
344	002536	飞龙股份	22,596,866.00	3.30
345	601606	长城军工	22,589,867.00	3.30
346	300523	辰安科技	22,445,304.14	3.28
347	300496	中科创达	22,421,417.72	3.28
348	300735	光弘科技	22,374,487.07	3.27
349	688298	东方生物	22,362,952.24	3.27
350	600456	宝钛股份	22,331,606.00	3.27
351	600161	天坛生物	22,249,003.92	3.25
352	300429	强力新材	22,203,611.00	3.25
353	300382	斯莱克	22,119,925.00	3.23
354	002705	新宝股份	22,074,097.50	3.23
355	603979	金诚信	22,061,641.08	3.23
356	600635	大众公用	22,009,348.29	3.22
357	300803	指南针	21,924,055.00	3.21
358	300318	博晖创新	21,911,118.00	3.20
359	002353	杰瑞股份	21,811,933.00	3.19
360	300132	青松股份	21,679,834.00	3.17
361	600236	桂冠电力	21,671,796.00	3.17
362	603076	乐惠国际	21,547,207.00	3.15
363	688339	亿华通	21,480,640.44	3.14
364	300502	新易盛	21,361,665.49	3.12
365	300910	瑞丰新材	21,272,117.72	3.11
366	603323	苏农银行	21,268,576.30	3.11

367	603387	基蛋生物	21,256,781.00	3.11
368	300772	运达股份	21,233,644.50	3.11
369	600963	岳阳林纸	21,218,942.70	3.10
370	002436	兴森科技	21,199,843.93	3.10
371	600151	航天机电	21,121,420.99	3.09
372	002225	濮耐股份	21,041,737.00	3.08
373	300238	冠昊生物	21,014,987.44	3.07
374	000627	天茂集团	20,784,444.20	3.04
375	601126	四方股份	20,761,335.10	3.04
376	600549	厦门钨业	20,744,440.21	3.03
377	000014	沙河股份	20,708,306.00	3.03
378	300219	鸿利智汇	20,627,766.00	3.02
379	000989	九芝堂	20,623,900.20	3.02
380	300034	钢研高纳	20,600,270.00	3.01
381	000936	华西股份	20,319,093.00	2.97
382	002810	山东赫达	20,186,205.65	2.95
383	603530	神马电力	20,028,819.00	2.93
384	002337	赛象科技	20,002,345.00	2.92
385	600575	淮河能源	19,851,767.00	2.90
386	600872	中炬高新	19,792,344.55	2.89
387	601677	明泰铝业	19,704,746.18	2.88
388	002131	利欧股份	19,618,714.00	2.87
389	603305	旭升集团	19,616,629.35	2.87
390	600449	宁夏建材	19,616,129.00	2.87
391	603301	振德医疗	19,554,669.60	2.86
392	688559	海目星	19,545,687.86	2.86
393	300311	任子行	19,540,960.47	2.86
394	600984	建设机械	19,397,098.60	2.84
395	688278	特宝生物	19,385,277.40	2.83
396	603730	岱美股份	19,349,873.47	2.83
397	688617	惠泰医疗	19,289,472.10	2.82
398	002562	兄弟科技	19,262,678.74	2.82
399	688008	澜起科技	19,243,082.93	2.81
400	002405	四维图新	19,209,905.00	2.81
401	603179	新泉股份	19,205,492.30	2.81
402	300593	新雷能	19,188,168.30	2.81
403	301071	力量钻石	19,113,474.00	2.79
404	300498	温氏股份	19,044,337.12	2.78
405	000603	盛达资源	19,018,152.00	2.78
406	600873	梅花生物	19,014,971.00	2.78
407	688116	天奈科技	19,000,890.61	2.78
408	600207	安彩高科	18,956,109.00	2.77
409	300737	科顺股份	18,949,668.00	2.77

410	000921	海信家电	18,947,622.84	2.77
411	300532	今天国际	18,810,280.00	2.75
412	002847	盐津铺子	18,798,359.24	2.75
413	601001	晋控煤业	18,722,997.66	2.74
414	300570	太辰光	18,717,859.00	2.74
415	002783	凯龙股份	18,588,767.00	2.72
416	600773	西藏城投	18,583,367.00	2.72
417	600495	晋西车轴	18,565,222.00	2.71
418	300616	尚品宅配	18,558,442.12	2.71
419	601225	陕西煤业	18,543,987.00	2.71
420	603856	东宏股份	18,530,446.07	2.71
421	600259	广晟有色	18,510,811.00	2.71
422	603378	亚士创能	18,494,983.39	2.70
423	002996	顺博合金	18,429,093.00	2.69
424	600600	青岛啤酒	18,378,492.00	2.69
425	603733	仙鹤股份	18,290,708.11	2.67
426	002035	华帝股份	18,220,283.00	2.66
427	301015	百洋医药	18,132,862.00	2.65
428	688258	卓易信息	18,087,720.14	2.64
429	600416	湘电股份	18,060,734.01	2.64
430	002567	唐人神	18,050,947.85	2.64
431	601319	中国人保	18,027,598.22	2.64
432	603439	贵州三力	17,977,759.00	2.63
433	000690	宝新能源	17,932,133.00	2.62
434	600389	江山股份	17,865,640.97	2.61
435	603681	永冠新材	17,757,469.00	2.60
436	000875	吉电股份	17,714,439.00	2.59
437	000789	万年青	17,546,396.59	2.57
438	002952	亚世光电	17,531,027.46	2.56
439	600089	特变电工	17,503,069.00	2.56
440	300085	银之杰	17,422,535.00	2.55
441	002534	西子洁能	17,393,837.20	2.54
442	688161	威高骨科	17,371,397.28	2.54
443	600007	中国国贸	17,329,098.21	2.53
444	600590	泰豪科技	17,277,789.09	2.53
445	002635	安洁科技	17,263,247.50	2.52
446	688027	国盾量子	17,208,162.10	2.52
447	000885	城发环境	17,179,333.30	2.51
448	002277	友阿股份	17,172,749.00	2.51
449	000062	深圳华强	17,115,932.69	2.50
450	600064	南京高科	17,054,670.11	2.49
451	002041	登海种业	17,034,478.47	2.49
452	002216	三全食品	16,832,824.94	2.46

453	603728	鸣志电器	16,821,915.00	2.46
454	002428	云南锗业	16,584,174.00	2.43
455	601390	中国中铁	16,505,478.00	2.41
456	000928	中钢国际	16,493,078.00	2.41
457	600639	浦东金桥	16,476,958.00	2.41
458	002489	浙江永强	16,436,866.31	2.40
459	603337	杰克股份	16,398,534.84	2.40
460	600740	山西焦化	16,383,169.41	2.40
461	002945	华林证券	16,315,652.00	2.39
462	600973	宝胜股份	16,272,145.68	2.38
463	000059	华锦股份	16,111,757.00	2.36
464	688202	美迪西	16,036,217.31	2.34
465	002399	海普瑞	16,014,420.89	2.34
466	603056	德邦股份	15,960,071.10	2.33
467	688028	沃尔德	15,867,120.45	2.32
468	300613	富瀚微	15,800,862.70	2.31
469	000968	蓝焰控股	15,754,493.00	2.30
470	300476	胜宏科技	15,667,781.09	2.29
471	001206	依依股份	15,655,234.21	2.29
472	300205	天喻信息	15,642,938.00	2.29
473	002498	汉缆股份	15,563,333.00	2.28
474	600212	绿能慧充	15,531,440.30	2.27
475	300073	当升科技	15,513,860.40	2.27
476	603666	亿嘉和	15,484,252.00	2.26
477	600909	华安证券	15,445,058.50	2.26
478	002042	华孚时尚	15,442,580.00	2.26
479	603348	文灿股份	15,435,839.70	2.26
480	603936	博敏电子	15,368,966.40	2.25
481	688819	天能股份	15,360,555.57	2.25
482	002079	苏州固锝	15,251,751.88	2.23
483	603527	众源新材	15,250,644.00	2.23
484	600919	江苏银行	15,250,188.00	2.23
485	603345	安井食品	15,238,870.00	2.23
486	300263	隆华科技	15,201,114.32	2.22
487	600118	中国卫星	15,165,508.15	2.22
488	002928	华夏航空	15,128,032.41	2.21
489	002539	云图控股	15,082,205.00	2.21
490	603968	醋化股份	15,066,858.82	2.20
491	603227	雪峰科技	14,967,126.00	2.19
492	688017	绿的谐波	14,940,989.81	2.18
493	000034	神州数码	14,918,984.75	2.18
494	600123	兰花科创	14,894,157.00	2.18
495	002318	久立特材	14,705,240.87	2.15

496	002756	永兴材料	14,657,719.00	2.14
497	688023	安恒信息	14,593,964.70	2.13
498	300520	科大国创	14,543,608.00	2.13
499	688399	硕世生物	14,490,922.15	2.12
500	002460	赣锋锂业	14,388,332.00	2.10
501	300639	凯普生物	14,366,134.40	2.10
502	601007	金陵饭店	14,295,823.00	2.09
503	601186	中国铁建	14,279,229.00	2.09
504	600285	羚锐制药	14,247,033.53	2.08
505	603208	江山欧派	14,142,765.60	2.07
506	300398	飞凯材料	14,141,456.50	2.07
507	603906	龙蟠科技	14,139,075.18	2.07
508	600710	苏美达	13,997,456.00	2.05
509	601058	赛轮轮胎	13,945,326.91	2.04
510	600054	黄山旅游	13,896,962.00	2.03
511	300712	永福股份	13,819,993.00	2.02
512	688001	华兴源创	13,743,578.96	2.01
513	300207	欣旺达	13,742,737.22	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 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300438	鹏辉能源	77,619,633.79	11.35
2	688063	派能科技	74,665,376.68	10.92
3	002239	奥特佳	73,611,297.22	10.76
4	688567	孚能科技	72,482,816.12	10.60
5	002413	雷科防务	72,229,210.69	10.56
6	300748	金力永磁	72,089,441.55	10.54
7	603713	密尔克卫	69,871,492.77	10.22
8	600581	八一钢铁	67,991,315.00	9.94
9	000902	新洋丰	66,211,126.52	9.68
10	688066	航天宏图	62,681,689.80	9.17
11	002025	航天电器	61,601,875.55	9.01
12	002733	雄韬股份	61,534,392.16	9.00
13	688019	安集科技	60,806,838.74	8.89
14	300035	中科电气	60,245,195.03	8.81
15	300233	金城医药	60,112,854.18	8.79
16	300373	扬杰科技	59,443,833.36	8.69
17	300900	广联航空	57,502,328.42	8.41
18	688680	海优新材	57,317,450.79	8.38
19	002643	万润股份	57,022,960.37	8.34
20	002171	楚江新材	56,535,445.99	8.27

21	300666	江丰电子	55,009,361.98	8.04
22	603596	伯特利	54,774,288.68	8.01
23	002850	科达利	54,401,017.16	7.96
24	688516	奥特维	54,270,228.96	7.94
25	600266	城建发展	54,181,913.60	7.92
26	002192	融捷股份	53,667,715.32	7.85
27	600929	雪天盐业	53,536,923.74	7.83
28	600685	中船防务	53,459,496.84	7.82
29	600391	航发科技	52,679,114.59	7.70
30	002738	中矿资源	51,688,909.37	7.56
31	300568	星源材质	51,192,442.04	7.49
32	600073	上海梅林	51,185,714.00	7.48
33	603609	禾丰股份	50,451,686.53	7.38
34	300118	东方日升	50,076,270.82	7.32
35	002204	大连重工	49,725,814.91	7.27
36	002906	华阳集团	49,207,866.70	7.20
37	688388	嘉元科技	48,512,775.10	7.09
38	600211	西藏药业	47,864,548.42	7.00
39	601567	三星医疗	47,862,853.19	7.00
40	000543	皖能电力	47,553,500.42	6.95
41	603236	移远通信	47,501,525.75	6.95
42	600129	太极集团	47,259,947.90	6.91
43	300602	飞荣达	47,205,372.40	6.90
44	002484	江海股份	47,203,311.29	6.90
45	600481	双良节能	47,149,498.20	6.89
46	002100	天康生物	46,708,204.57	6.83
47	601666	平煤股份	46,531,812.98	6.80
48	000615	奥园美谷	46,462,726.55	6.79
49	600657	信达地产	46,418,969.58	6.79
50	300776	帝尔激光	46,111,399.20	6.74
51	300054	鼎龙股份	45,971,723.49	6.72
52	601231	环旭电子	45,769,249.00	6.69
53	600114	东睦股份	45,404,209.00	6.64
54	600057	厦门象屿	45,401,927.13	6.64
55	603308	应流股份	45,100,421.18	6.60
56	000762	西藏矿业	44,613,220.78	6.52
57	601958	金钼股份	44,090,989.70	6.45
58	603690	至纯科技	43,950,038.38	6.43
59	600496	精工钢构	43,855,855.99	6.41
60	600395	盘江股份	43,680,264.00	6.39
61	600305	恒顺醋业	43,492,623.23	6.36
62	000795	英洛华	43,283,078.00	6.33
63	002215	诺普信	43,174,602.77	6.31

64	300428	立中集团	43,010,989.15	6.29
65	600512	腾达建设	42,648,745.52	6.24
66	688033	天宜上佳	42,611,764.86	6.23
67	600502	安徽建工	42,269,353.00	6.18
68	600997	开滦股份	42,139,498.00	6.16
69	603612	索通发展	42,098,080.03	6.16
70	300131	英唐智控	41,942,970.50	6.13
71	000672	上峰水泥	41,821,728.40	6.12
72	300346	南大光电	41,779,242.38	6.11
73	300761	立华股份	41,714,442.62	6.10
74	002446	盛路通信	41,701,572.23	6.10
75	002376	新北洋	41,459,209.00	6.06
76	300775	三角防务	41,281,840.90	6.04
77	000688	国城矿业	41,041,765.26	6.00
78	000931	中关村	40,606,430.98	5.94
79	002895	川恒股份	40,593,556.52	5.94
80	000810	创维数字	40,575,055.00	5.93
81	600578	京能电力	40,536,543.00	5.93
82	002291	遥望科技	40,500,080.00	5.92
83	603599	广信股份	40,164,745.38	5.87
84	000860	顺鑫农业	39,451,961.02	5.77
85	300657	弘信电子	39,430,893.45	5.77
86	300765	新诺威	39,365,847.31	5.76
87	300101	振芯科技	39,187,810.00	5.73
88	300842	帝科股份	38,928,113.80	5.69
89	603328	依顿电子	38,744,491.69	5.67
90	300331	苏大维格	38,691,504.50	5.66
91	300696	爱乐达	38,507,212.39	5.63
92	002285	世联行	38,482,503.54	5.63
93	002747	埃斯顿	38,318,654.20	5.60
94	300684	中石科技	37,963,672.69	5.55
95	601886	江河集团	37,918,918.64	5.54
96	002851	麦格米特	37,896,461.00	5.54
97	300143	盈康生命	37,755,560.75	5.52
98	000657	中钨高新	37,723,500.64	5.52
99	000090	天健集团	37,687,209.71	5.51
100	002782	可立克	37,622,166.00	5.50
101	000768	中航西飞	37,607,414.82	5.50
102	002468	申通快递	37,602,073.50	5.50
103	300236	上海新阳	37,282,605.78	5.45
104	002314	南山控股	37,140,260.00	5.43
105	600750	江中药业	37,093,931.24	5.42
106	002276	万马股份	36,893,040.99	5.39

107	002312	川发龙蟒	36,844,750.50	5.39
108	002163	海南发展	36,591,870.00	5.35
109	603105	芯能科技	36,520,495.00	5.34
110	688166	博瑞医药	36,498,706.07	5.34
111	000612	焦作万方	36,421,078.68	5.33
112	300894	火星人	36,337,419.18	5.31
113	002768	国恩股份	35,900,871.87	5.25
114	603688	石英股份	35,684,820.03	5.22
115	000567	海德股份	35,473,582.16	5.19
116	300149	睿智医药	35,469,369.00	5.19
117	000893	亚钾国际	35,268,385.75	5.16
118	601137	博威合金	35,129,576.10	5.14
119	603959	百利科技	35,042,422.52	5.12
120	603800	道森股份	35,005,159.00	5.12
121	600771	广誉远	34,648,305.62	5.07
122	688037	芯源微	34,575,179.08	5.06
123	603678	火炬电子	34,132,264.14	4.99
124	600223	鲁商发展	34,055,794.67	4.98
125	688106	金宏气体	33,913,491.77	4.96
126	003009	中天火箭	33,832,289.10	4.95
127	002959	小熊电器	33,822,286.00	4.95
128	300662	科锐国际	33,791,107.65	4.94
129	002594	比亚迪	33,745,729.14	4.93
130	300769	德方纳米	33,704,725.36	4.93
131	300659	中孚信息	33,352,719.20	4.88
132	300393	中来股份	33,225,441.00	4.86
133	600565	迪马股份	33,201,651.00	4.86
134	300850	新强联	33,086,139.91	4.84
135	688586	江航装备	32,918,200.76	4.81
136	002746	仙坛股份	32,856,501.50	4.80
137	688598	金博股份	32,570,571.49	4.76
138	600559	老白干酒	32,280,221.73	4.72
139	300194	福安药业	32,199,988.00	4.71
140	600284	浦东建设	32,128,622.94	4.70
141	300604	长川科技	32,123,383.28	4.70
142	002993	奥海科技	32,107,105.90	4.70
143	603098	森特股份	32,014,948.27	4.68
144	002918	蒙娜丽莎	31,890,018.46	4.66
145	002807	江阴银行	31,873,452.00	4.66
146	300725	药石科技	31,871,121.00	4.66
147	688266	泽璟制药	31,732,840.73	4.64
148	300855	图南股份	31,698,546.50	4.64
149	300068	南都电源	31,471,705.00	4.60

150	601212	白银有色	31,177,063.82	4.56
151	002597	金禾实业	30,972,460.70	4.53
152	600338	西藏珠峰	30,859,107.93	4.51
153	603368	柳药集团	30,856,938.22	4.51
154	688366	昊海生科	30,837,026.22	4.51
155	600876	洛阳玻璃	30,791,343.00	4.50
156	000651	格力电器	30,598,507.32	4.47
157	603997	继峰股份	30,557,642.00	4.47
158	002500	山西证券	30,439,791.00	4.45
159	300735	光弘科技	30,405,170.27	4.45
160	002947	恒铭达	30,399,674.40	4.45
161	300114	中航电测	30,380,921.00	4.44
162	603826	坤彩科技	30,289,167.84	4.43
163	300352	北信源	30,287,981.63	4.43
164	603989	艾华集团	30,272,764.52	4.43
165	002085	万丰奥威	30,231,556.00	4.42
166	000517	荣安地产	30,219,264.00	4.42
167	603583	捷昌驱动	30,151,399.70	4.41
168	600027	华电国际	30,101,407.67	4.40
169	600063	皖维高新	30,057,200.00	4.40
170	600330	天通股份	30,047,119.36	4.39
171	600990	四创电子	29,984,766.27	4.38
172	002545	东方铁塔	29,799,428.30	4.36
173	600869	远东股份	29,772,091.00	4.35
174	600328	中盐化工	29,762,463.64	4.35
175	688408	中信博	29,662,268.07	4.34
176	300226	上海钢联	29,589,610.46	4.33
177	601881	中国银河	29,563,117.00	4.32
178	600206	有研新材	29,480,633.39	4.31
179	002967	广电计量	29,400,452.00	4.30
180	000969	安泰科技	29,219,472.90	4.27
181	601609	金田股份	29,054,340.00	4.25
182	000710	贝瑞基因	29,026,341.00	4.24
183	002340	格林美	28,815,083.16	4.21
184	300394	天孚通信	28,800,574.53	4.21
185	000951	中国重汽	28,783,472.84	4.21
186	300130	新国都	28,768,398.36	4.21
187	300294	博雅生物	28,748,142.60	4.20
188	300203	聚光科技	28,613,864.00	4.18
189	300647	超频三	28,436,513.50	4.16
190	000539	粤电力 A	28,422,590.26	4.16
191	300224	正海磁材	28,376,250.41	4.15
192	300633	开立医疗	28,354,526.61	4.15

193	002234	民和股份	28,341,798.00	4.14
194	300861	美畅股份	28,209,857.28	4.13
195	000521	长虹美菱	28,090,082.00	4.11
196	002409	雅克科技	28,033,821.52	4.10
197	000682	东方电子	28,029,789.60	4.10
198	002258	利尔化学	28,003,714.00	4.09
199	002182	云海金属	27,674,013.80	4.05
200	605123	派克新材	27,588,818.88	4.03
201	002389	航天彩虹	27,425,898.14	4.01
202	002400	省广集团	27,393,872.00	4.01
203	002237	恒邦股份	27,328,309.54	4.00
204	002176	江特电机	27,265,446.72	3.99
205	000735	罗牛山	27,127,144.00	3.97
206	300432	富临精工	27,120,431.23	3.97
207	600662	外服控股	27,035,250.98	3.95
208	603306	华懋科技	26,985,862.11	3.95
209	002344	海宁皮城	26,857,185.28	3.93
210	000401	冀东水泥	26,769,141.86	3.91
211	003012	东鹏控股	26,689,006.47	3.90
212	000601	韶能股份	26,656,256.68	3.90
213	600882	妙可蓝多	26,589,547.00	3.89
214	301050	雷电微力	26,513,720.72	3.88
215	600604	市北高新	26,121,421.52	3.82
216	603108	润达医疗	25,987,851.54	3.80
217	300510	金冠股份	25,972,544.73	3.80
218	600971	恒源煤电	25,954,785.06	3.80
219	688116	天奈科技	25,722,583.38	3.76
220	603995	甬金股份	25,687,536.10	3.76
221	000541	佛山照明	25,676,148.52	3.75
222	600645	中源协和	25,663,329.54	3.75
223	603212	赛伍技术	25,430,233.00	3.72
224	603229	奥翔药业	25,421,563.60	3.72
225	603019	中科曙光	25,368,709.36	3.71
226	300328	宜安科技	25,281,529.00	3.70
227	002081	金螳螂	25,276,311.00	3.70
228	300527	中船应急	24,939,718.00	3.65
229	601606	长城军工	24,840,787.84	3.63
230	002055	得润电子	24,683,489.03	3.61
231	002673	西部证券	24,646,978.00	3.60
232	300311	任子行	24,623,462.44	3.60
233	600030	中信证券	24,510,923.65	3.58
234	300014	亿纬锂能	24,470,799.81	3.58
235	300298	三诺生物	24,463,227.05	3.58

236	601126	四方股份	24,402,096.00	3.57
237	002950	奥美医疗	24,378,959.76	3.56
238	300429	强力新材	24,271,760.55	3.55
239	300378	鼎捷软件	24,233,737.46	3.54
240	002120	韵达股份	24,133,975.82	3.53
241	600456	宝钛股份	24,133,358.82	3.53
242	600789	鲁抗医药	24,119,894.00	3.53
243	603327	福蓉科技	24,052,812.00	3.52
244	002338	奥普光电	24,019,579.12	3.51
245	603920	世运电路	24,015,885.67	3.51
246	300498	温氏股份	23,953,067.38	3.50
247	601686	友发集团	23,940,091.38	3.50
248	300439	美康生物	23,930,592.11	3.50
249	300477	合纵科技	23,869,488.08	3.49
250	000950	重药控股	23,849,058.00	3.49
251	600667	太极实业	23,758,272.42	3.47
252	300803	指南针	23,677,270.04	3.46
253	600184	光电股份	23,632,012.20	3.46
254	688085	三友医疗	23,629,737.52	3.46
255	300763	锦浪科技	23,248,925.36	3.40
256	300170	汉得信息	23,235,966.18	3.40
257	603439	贵州三力	23,215,157.00	3.39
258	603530	神马电力	23,143,900.21	3.38
259	688339	亿华通	23,114,521.18	3.38
260	600993	马应龙	23,090,368.71	3.38
261	300682	朗新科技	23,053,644.69	3.37
262	600459	贵研铂业	23,038,371.11	3.37
263	688520	神州细胞	23,002,269.90	3.36
264	002279	久其软件	22,930,402.00	3.35
265	688578	艾力斯	22,895,161.94	3.35
266	600161	天坛生物	22,886,041.45	3.35
267	002302	西部建设	22,839,611.00	3.34
268	600098	广州发展	22,749,218.73	3.33
269	600699	均胜电子	22,722,325.20	3.32
270	603919	金徽酒	22,662,293.14	3.31
271	600864	哈投股份	22,554,674.52	3.30
272	600732	爱旭股份	22,512,725.00	3.29
273	002099	海翔药业	22,482,437.38	3.29
274	300502	新易盛	22,309,287.95	3.26
275	300443	金雷股份	22,296,138.00	3.26
276	600720	祁连山	22,292,057.07	3.26
277	300326	凯利泰	22,195,472.00	3.25
278	600635	大众公用	22,178,037.85	3.24

279	600236	桂冠电力	22,136,573.00	3.24
280	300318	博晖创新	21,880,500.00	3.20
281	688278	特宝生物	21,849,737.24	3.20
282	300397	天和防务	21,839,020.08	3.19
283	002139	拓邦股份	21,759,681.00	3.18
284	300523	辰安科技	21,729,057.50	3.18
285	603279	景津装备	21,724,360.00	3.18
286	300607	拓斯达	21,715,095.01	3.18
287	603093	南华期货	21,684,328.00	3.17
288	000014	沙河股份	21,653,150.80	3.17
289	300856	科思股份	21,647,704.80	3.17
290	600123	兰花科创	21,620,943.99	3.16
291	600583	海油工程	21,540,921.18	3.15
292	603323	苏农银行	21,479,475.50	3.14
293	000627	天茂集团	21,375,041.50	3.13
294	600151	航天机电	21,373,188.00	3.13
295	000936	华西股份	21,346,729.00	3.12
296	300791	仙乐健康	21,334,551.00	3.12
297	002562	兄弟科技	21,295,711.86	3.11
298	603733	仙鹤股份	21,253,723.83	3.11
299	002436	兴森科技	21,220,052.68	3.10
300	300034	钢研高纳	21,209,492.39	3.10
301	603387	基蛋生物	21,070,687.68	3.08
302	002225	濮耐股份	20,971,366.00	3.07
303	600105	永鼎股份	20,966,811.50	3.07
304	603305	旭升集团	20,956,467.63	3.06
305	600007	中国国贸	20,950,269.19	3.06
306	300395	菲利华	20,936,501.20	3.06
307	603979	金诚信	20,928,292.65	3.06
308	000829	天音控股	20,713,626.30	3.03
309	000989	九芝堂	20,699,438.00	3.03
310	002865	钧达股份	20,692,462.50	3.03
311	002169	智光电气	20,598,081.00	3.01
312	688202	美迪西	20,536,095.61	3.00
313	603129	春风动力	20,489,340.00	3.00
314	688499	利元亨	20,410,870.68	2.98
315	300115	长盈精密	20,408,226.00	2.98
316	300638	广和通	20,335,689.00	2.97
317	600072	中船科技	20,325,618.24	2.97
318	601369	陕鼓动力	20,237,038.00	2.96
319	300238	冠昊生物	20,180,633.52	2.95
320	603076	乐惠国际	20,124,517.60	2.94
321	300073	当升科技	20,077,108.47	2.94

322	688008	澜起科技	20,057,013.02	2.93
323	300496	中科创达	20,044,855.80	2.93
324	002847	盐津铺子	20,039,289.00	2.93
325	603301	振德医疗	20,006,348.00	2.93
326	600449	宁夏建材	20,002,898.00	2.93
327	002405	四维图新	19,819,703.00	2.90
328	600600	青岛啤酒	19,747,353.74	2.89
329	000550	江铃汽车	19,718,620.00	2.88
330	002337	赛象科技	19,615,962.00	2.87
331	300590	移为通信	19,587,310.29	2.86
332	600389	江山股份	19,549,364.36	2.86
333	600963	岳阳林纸	19,481,269.30	2.85
334	688298	东方生物	19,450,797.92	2.84
335	601001	晋控煤业	19,413,416.00	2.84
336	300772	运达股份	19,386,482.70	2.83
337	300593	新雷能	19,302,514.48	2.82
338	600259	广晟有色	19,232,056.00	2.81
339	603313	梦百合	19,204,017.82	2.81
340	002664	信质集团	19,097,726.00	2.79
341	300382	斯莱克	19,063,495.00	2.79
342	000968	蓝焰控股	18,912,435.00	2.77
343	002131	利欧股份	18,873,908.00	2.76
344	688139	海尔生物	18,871,303.04	2.76
345	002705	新宝股份	18,715,936.34	2.74
346	002810	山东赫达	18,701,399.96	2.73
347	600207	安彩高科	18,680,177.44	2.73
348	300085	银之杰	18,668,601.00	2.73
349	600966	博汇纸业	18,662,114.00	2.73
350	300132	青松股份	18,610,124.00	2.72
351	002783	凯龙股份	18,556,623.77	2.71
352	603529	爱玛科技	18,553,814.60	2.71
353	000059	华锦股份	18,553,039.63	2.71
354	688127	蓝特光学	18,512,013.59	2.71
355	688027	国盾量子	18,342,789.62	2.68
356	300624	万兴科技	18,280,301.00	2.67
357	000928	中钢国际	18,270,892.87	2.67
358	600495	晋西车轴	18,267,490.00	2.67
359	300185	通裕重工	18,206,303.00	2.66
360	002489	浙江永强	18,178,164.34	2.66
361	000062	深圳华强	18,171,585.54	2.66
362	603728	鸣志电器	18,127,892.00	2.65
363	002421	达实智能	18,106,790.54	2.65
364	600984	建设机械	18,070,236.60	2.64

365	002635	安洁科技	17,955,649.63	2.63
366	600873	梅花生物	17,954,109.00	2.63
367	601225	陕西煤业	17,932,663.50	2.62
368	002240	盛新锂能	17,917,698.11	2.62
369	002035	华帝股份	17,915,177.40	2.62
370	688617	惠泰医疗	17,690,616.10	2.59
371	600197	伊力特	17,656,653.08	2.58
372	601677	明泰铝业	17,502,623.00	2.56
373	300390	天华超净	17,502,177.00	2.56
374	003040	楚天龙	17,447,949.00	2.55
375	600575	淮河能源	17,426,496.00	2.55
376	002041	登海种业	17,317,266.43	2.53
377	300219	鸿利智汇	17,315,381.00	2.53
378	300532	今天国际	17,049,809.72	2.49
379	603528	多伦科技	17,024,155.00	2.49
380	600590	泰豪科技	17,000,486.34	2.49
381	600089	特变电工	16,948,594.00	2.48
382	002498	汉缆股份	16,940,529.00	2.48
383	000875	吉电股份	16,800,379.00	2.46
384	002697	红旗连锁	16,781,685.00	2.45
385	002079	苏州固锔	16,780,890.11	2.45
386	603466	风语筑	16,537,632.28	2.42
387	002042	华孚时尚	16,526,820.34	2.42
388	002996	顺博合金	16,518,116.00	2.42
389	601069	西部黄金	16,483,645.16	2.41
390	300613	富瀚微	16,450,895.98	2.41
391	603968	醋化股份	16,327,118.00	2.39
392	002756	永兴材料	16,308,225.00	2.38
393	600248	陕西建工	16,305,075.00	2.38
394	301071	力量钻石	16,193,832.00	2.37
395	601390	中国中铁	16,192,247.00	2.37
396	002567	唐人神	16,174,225.70	2.37
397	600639	浦东金桥	16,074,410.00	2.35
398	603856	东宏股份	16,022,294.00	2.34
399	600360	华微电子	16,016,179.00	2.34
400	603345	安井食品	16,004,000.00	2.34
401	002539	云图控股	15,954,790.00	2.33
402	002216	三全食品	15,905,322.12	2.33
403	688333	铂力特	15,884,758.80	2.32
404	600740	山西焦化	15,866,717.50	2.32
405	002945	华林证券	15,799,897.00	2.31
406	603337	杰克股份	15,792,382.90	2.31
407	600933	爱柯迪	15,740,076.40	2.30

408	000885	城发环境	15,727,252.12	2.30
409	688050	爱博医疗	15,691,376.25	2.29
410	600909	华安证券	15,634,011.40	2.29
411	603378	亚士创能	15,594,201.11	2.28
412	603681	永冠新材	15,538,367.27	2.27
413	002277	友阿股份	15,491,484.00	2.27
414	000966	长源电力	15,461,596.00	2.26
415	601007	金陵饭店	15,428,924.50	2.26
416	603730	岱美股份	15,376,686.12	2.25
417	000034	神州数码	15,263,493.77	2.23
418	300476	胜宏科技	15,178,639.00	2.22
419	688315	诺禾致源	15,155,698.66	2.22
420	300204	舒泰神	15,114,432.00	2.21
421	688389	普门科技	15,083,970.03	2.21
422	688023	安恒信息	15,014,598.91	2.20
423	002318	久立特材	15,001,793.95	2.19
424	600973	宝胜股份	14,902,367.09	2.18
425	300520	科大国创	14,891,431.60	2.18
426	002399	海普瑞	14,837,504.70	2.17
427	603348	文灿股份	14,775,923.96	2.16
428	600416	湘电股份	14,752,160.16	2.16
429	600919	江苏银行	14,717,837.00	2.15
430	603383	顶点软件	14,706,621.00	2.15
431	000933	神火股份	14,701,259.00	2.15
432	688017	绿的谐波	14,688,181.26	2.15
433	300398	飞凯材料	14,432,740.62	2.11
434	600773	西藏城投	14,414,759.00	2.11
435	603227	雪峰科技	14,388,131.00	2.10
436	603906	龙蟠科技	14,341,247.11	2.10
437	600118	中国卫星	14,326,998.00	2.10
438	603666	亿嘉和	14,319,277.44	2.09
439	300700	岱勒新材	14,267,341.50	2.09
440	688123	聚辰股份	14,232,886.96	2.08
441	002428	云南锗业	14,231,095.00	2.08
442	688028	沃尔德	14,141,050.99	2.07
443	600710	苏美达	14,134,279.00	2.07
444	603169	兰石重装	14,131,558.00	2.07
445	300263	隆华科技	14,019,870.82	2.05
446	301060	兰卫医学	14,015,005.67	2.05
447	001206	依依股份	13,962,479.40	2.04
448	601186	中国铁建	13,937,123.00	2.04
449	002460	赣锋锂业	13,936,414.00	2.04
450	688819	天能股份	13,895,123.15	2.03

451	003000	劲仔食品	13,894,575.00	2.03
452	000596	古井贡酒	13,820,126.40	2.02
453	002303	美盈森	13,808,412.00	2.02
454	600363	联创光电	13,784,126.00	2.02
455	002123	梦网科技	13,777,656.00	2.01
456	002698	博实股份	13,721,556.00	2.01
457	300712	永福股份	13,717,779.42	2.01
458	300205	天喻信息	13,684,576.90	2.00

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	21,497,856,596.87
卖出股票收入（成交）总额	18,046,249,100.29

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	13,507,550.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,507,550.97

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 1000 指数增强 A	103,551	17,355.29	1,124,225,680.35	62.56	672,931,809.04	37.44
万家中证 1000 指数增强 C	100,307	15,996.79	780,357,055.03	48.63	824,232,759.94	51.37
合计	200,930	16,930.01	1,904,582,735.38	55.99	1,497,164,568.98	44.01

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 1000 指数增强 A	421,718.07	0.0235
	万家中证 1000 指数增强 C	41,569.80	0.0026
	合计	463,287.87	0.0136

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 1000 指数增强 A	10~50
	万家中证 1000 指数增强 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	万家中证 1000 指数增强 A	10~50
	万家中证 1000 指数增强 C	0
	合计	10~50

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	9,887,305.69	0.29	9,887,305.69	0.29	3 年

基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	9,887,305.69	0.29	9,887,305.69	0.29	3 年

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家中证 1000 指数增强 A	万家中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日 (2018 年 12 月 3 日) 基金份额总额	25,339.33	595,564.60
本报告期期初基金份额总额	230,974,168.43	277,913,407.67
本报告期基金总申购份额	2,094,546,799.47	3,237,856,905.06
减：本报告期基金总赎回份额	528,363,478.51	1,911,180,497.76
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,797,157,489.39	1,604,589,814.97

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

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：

自 2022 年 07 月 15 日起，孙乐女士担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期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

本报告期内，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

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 (%)	
浙商证券	3	39,515,221,624.27	100.00	24,505,710.62	100.00	-

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

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

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

- 4) 资金划付、交收、调整、差异处理及时，且基金交易、结算、对账等数据的提供能满足券

商结算模式下 T+0 估值的时效性要求。

3、基金证券经纪商的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定证券经营机构，然后基金管理人、基金托管人和证券经纪商签订证券经纪服务协议。

4、交易佣金包含已由证券经纪商扣收的一级交易费用（包括经手费、证管费、风险金），但不包括印花税、上海市场过户费、港股通交易相关费用等税费。

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	万家基金管理有限公司关于旗下万家中证 1000 指数增强基金在华泰证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-01-01
2	万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	指定媒介	2022-01-21
3	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在广发证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-03-04
4	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在光大证券开通定投的公告	指定媒介	2022-03-17
5	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金调整最低申购金额的公告	指定媒介	2022-03-22
6	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宜信普泽为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-03-24
7	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在山西证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-03-29
8	万家基金管理有限公司关于旗下基金在招商证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-03-30
9	万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2021 年年度报告	指定媒介	2022-03-30
10	万家基金管理有限公司关于旗下基金在湘财证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-04-06
11	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商银行招赢通平台为销售机构并开通相关业务的公告	指定媒介	2022-04-11

12	万家基金管理有限公司关于旗下基金在华安证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-04-13
13	万家基金管理有限公司关于旗下基金在华龙证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-04-14
14	万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	指定媒介	2022-04-21
15	万家基金管理有限公司关于旗下基金在申万宏源及申万宏源西部证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-04-28
16	万家基金管理有限公司关于旗下基金在上海证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-05-24
17	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中欧财富为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-05-26
18	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增奕丰基金为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-05-31
19	万家基金管理有限公司关于旗下基金在九州证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-06-18
20	万家基金管理有限公司关于旗下基金在泰信财富证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-06-21
21	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增苏宁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	2022-07-12
22	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增新兰德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	2022-07-14
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 1000 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基金	指定媒介	2022-07-27

	在海银基金开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告		
26	万家基金管理有限公司关于新增平安银行股份有限公司行 E 通为万家基金管理有限公司旗下基金销售机构并开通转换、基金定投业务的公告	指定媒介	2022-08-01
27	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增浙商银行作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	2022-08-02
28	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
29	万家基金管理有限公司关于旗下部分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	2022-08-10
30	万家基金管理有限公司关于旗下基金在华西证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-08-18
31	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在银泰证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-08-25
32	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
33	万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2022 年中期报告	指定媒介	2022-08-30
34	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在西南证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-09-01
35	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在平安证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-09-01
36	万家基金管理有限公司关于旗下基金在东兴证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-09-28
37	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、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-09-28
38	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
39	万家中证 1000 指数增强型发起式证	指定媒介	2022-10-25

	券投资基金 2022 年第 3 季度报告		
40	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在国联证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-10-27
41	万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书（2022 年第 1 号）	指定媒介	2022-11-05
42	万家中证 1000 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	2022-11-05
43	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增邮储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	2022-11-21
44	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增新浪仓石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	2022-12-03
45	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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》。
- 3、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 4、本报告期内在中国证监会指定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 1000 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 1000 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》。

13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人网站：www.wjasset.com。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司

2023 年 3 月 30 日