

万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资
基金
2023 年年度报告

2023 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：2024 年 3 月 29 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 2024 年 3 月 28 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 2023 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	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
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	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
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	19
§ 5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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	19
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	20
§ 6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息	20
6.2 审计报告的基本内容	20
§ 7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表	22
7.2 利润表	23
7.3 净资产变动表	24
7.4 报表附注	27
§ 8 投资组合报告	61

8.1 期末基金资产组合情况	61
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	61
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	63
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	79
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	86
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	86
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	86
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	86
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	86
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	86
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	86
8.12 投资组合报告附注	86
§ 9 基金份额持有人信息	87
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	87
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	88
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	88
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	88
§ 10 开放式基金份额变动	88
§ 11 重大事件揭示	89
11.1 基金份额持有人大会决议	89
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	89
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	89
11.4 基金投资策略的改变	89
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	89
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	89
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	90
11.8 其他重大事件	90
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	94
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	94
§ 13 备查文件目录	94
13.1 备查文件目录	94
13.2 存放地点	95
13.3 查阅方式	95

§ 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	4,915,436,395.10 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	2,263,670,662.89 份	2,651,765,732.21 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
		张姗
		400-61-95555
		zhangshan_1027@cmbchina.com

客户服务电话	4008880800	400-61-95555
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	2023 年		2022 年		2021 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	-344,716,03 5.81	-430,406,78 7.35	-60,919,498 .79	-60,598,720 .17	30,954,962 .41	37,745,976 .49
本 期	-324,025,77 3.13	-507,435,29 9.57	-102,238,29 9.33	-128,567,99 7.95	32,942,128 .46	35,834,064 .42

利润						
加权平均基金份额本期利润	-0.1283	-0.1602	-0.1338	-0.1540	0.2880	0.2525
本期加权平均净值利润率	-10.28%	-12.85%	-10.66%	-12.29%	23.89%	20.62%
本期基金份额净值增长率	-6.39%	-6.76%	-8.65%	-9.02%	29.98%	29.47%
3.1 .2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	

期末可供分配利润	292,776,929 .33	317,492,372 .50	410,034,503 .71	356,426,156 .05	79,562,180 .78	95,402,086 .94
期末可供分配基金份额利润	0.1293	0.1197	0.2282	0.2221	0.3445	0.3433
期末基金资产净值	2,556,447,5 92.22	2,969,258,1 04.71	2,207,191,9 93.10	1,961,015,9 71.02	310,536,34 9.21	373,315,49 4.61
期末基金份额净值	1.1293	1.1197	1.2282	1.2221	1.3445	1.3433
3.1 .3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基	95.75%	92.27%	109.11%	106.21%	128.91%	126.66%

金 份 额 累 计 净 值 增 长 率						
--	--	--	--	--	--	--

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	-4.37%	0.96%	-2.97%	0.98%	-1.40%	-0.02%
过去六个月	-12.29%	0.97%	-10.25%	0.95%	-2.04%	0.02%
过去一年	-6.39%	0.91%	-5.85%	0.90%	-0.54%	0.01%
过去三年	11.15%	1.22%	-10.43%	1.21%	21.58%	0.01%
过去五年	109.01%	1.36%	32.31%	1.37%	76.70%	-0.01%
自基金合同生效 起至今	95.75%	1.35%	26.42%	1.36%	69.33%	-0.01%

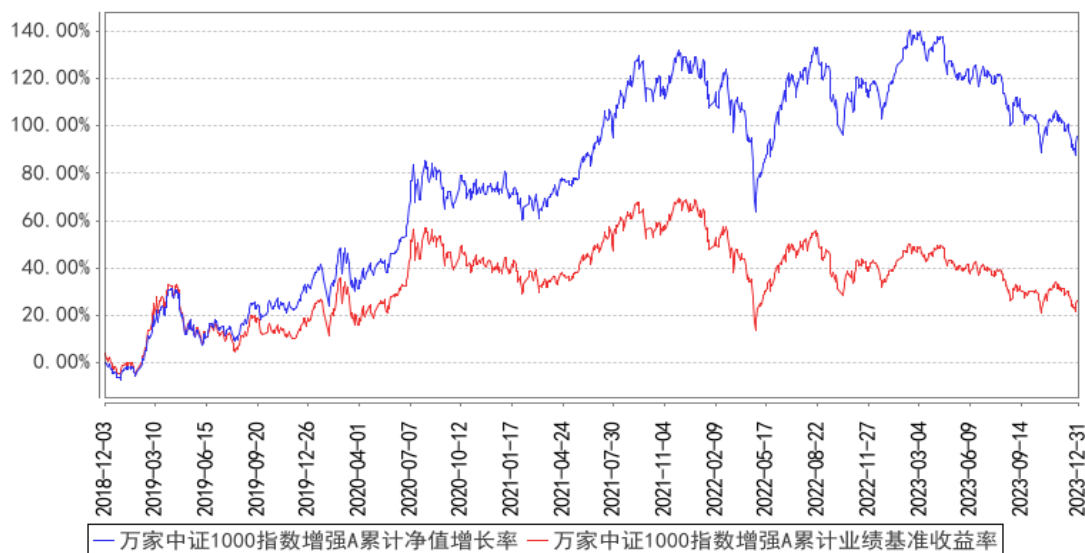
万家中证 1000 指数增强 C

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	-4.47%	0.96%	-2.97%	0.98%	-1.50%	-0.02%

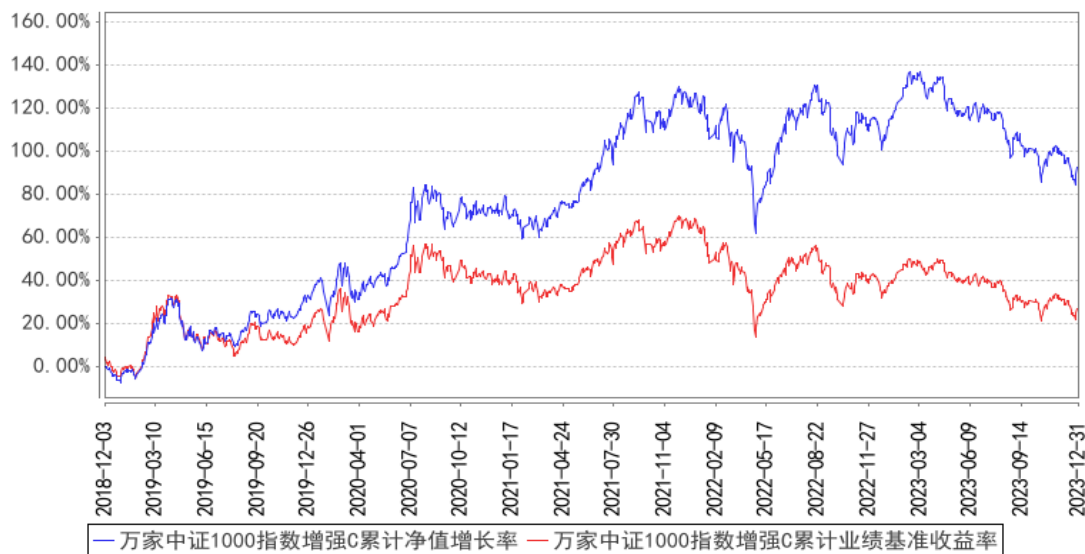
过去六个月	-12.47%	0.97%	-10.25%	0.95%	-2.22%	0.02%
过去一年	-6.76%	0.91%	-5.85%	0.90%	-0.91%	0.01%
过去三年	9.83%	1.22%	-10.43%	1.21%	20.26%	0.01%
过去五年	105.35%	1.36%	32.31%	1.37%	73.04%	-0.01%
自基金合同生效起至今	92.27%	1.35%	26.42%	1.36%	65.85%	-0.01%

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

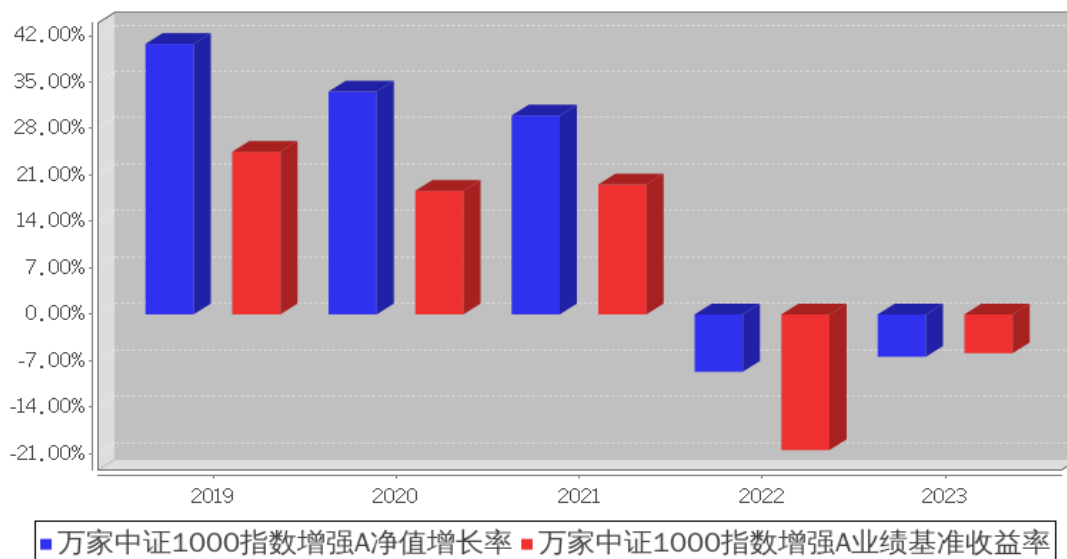


注：本基金于 2018 年 12 月 3 日成立，根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。

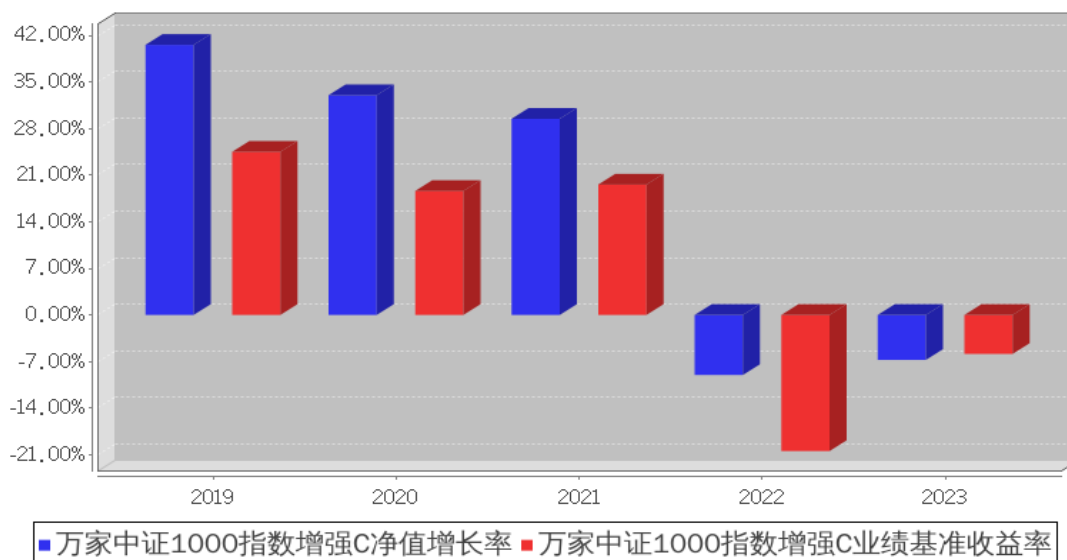
建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

3.2.3 过去五年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
2023 年	0.2290	29,705,399.28	12,288,180.35	41,993,579.63	-
2022 年	-	-	-	-	-

2021 年	3.3000	3,568,145.64	116,516.50	3,684,662.14	-
合计	3.5290	33,273,544.92	12,404,696.85	45,678,241.77	-

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
2023 年	0.2230	22,971,928.90	13,739,289.97	36,711,218.87	-
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	3.2000	567,997.74	140,136.25	708,133.99	-
合计	3.4230	23,539,926.64	13,879,426.22	37,419,352.86	-

§ 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，住所：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层），办公地点：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层），注册资本 3 亿元人民币。截至报告期末，公司共管理一百四十只开放式基金，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、家家家享中短债债券型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家瑞祥

灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家 1-3 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家瑞隆混合型证券投资基金、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家现金增利货币市场基金、万家消费成长股票型证券投资基金、万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家玖盛纯债 9 个月定期开放债券型证券投资基金、万家天添宝货币市场基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、万家家瑞债券型证券投资基金、万家臻选混合型证券投资基金、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金、万家成长优选灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金、万家经济新动能混合型证券投资基金、万家潜力价值灵活配置混合型证券投资基金、万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家新机遇龙头企业灵活配置混合型证券投资基金、万家智造优势混合型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型证券投资基金、万家人工智能混合型证券投资基金、万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金（LOF）、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、万家平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、万家科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、万家鑫盛纯债债券型证券投资基金、万家民安增利 12 个月定期开放债券型证券投资基金、万家汽车新趋势混合型证券投资基金、万家惠享 39 个月定期开放债券型证券投资基金、万家科技创新混合型证券投资基金、万家自主创新混合型证券投资基金、万家民丰回报一年持有期混合型证券投资基金、万家可转债债券型证券投资基金、万家民瑞祥和 6 个月持有期债券型证券投资基金、万家价值优势一年持有期混合型证券投资基金、万家养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、万家鑫动力月月购一年滚动持有混合型证券投资基金、万家科创板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家创业板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家周期优势企业混合型证券投资基金、万家健康产业混合型证券投资基金、万家互联互通中国优势量化策略混合型证券投资基金、万家战略发展产业混合型证券投资基金、万家创业板指数增强型证券投资基金、万家陆家嘴金融城金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家内需增长一年持有期混合型证券投资基金、万家互联互通核心资产量化策略混合型证券投资基金、万家民瑞祥明 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家瑞泽回报一年持有期混合型证券投资基金、万家惠裕回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家悦兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金、万家稳鑫 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、万家全球成长一年持有期混合型证券投资基金（QDII）、万家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、万家中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金、万家沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家元贞量化选股股票型证券投资基金、万家 CFETS0-3 年期政策性金融债指数证券投资基金、万家中证软件服务指数型发起式证券投资基金、万家先进制造混合型发起式证券投资基金、万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金、万家颐德一年持有期混合型证券投资基金、万家北证 50 成份指数型发起式证券投资基金、万家恒生互联网科技业指数型发起式证券投资基金 (QDII)、万家中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家欣优混合型证券投资基金、万家集利债券型发起式证券投资基金、万家远见先锋一年持有期混合型证券投资基金、万家国证 2000 指数增强型证券投资基金、万家纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII)、万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金、万家稳安 60 天持有期债券型证券投资基金、万家周期驱动股票型发起式证券投资基金、万家优选积极三个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、万家养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、万家红利量化选股混合型发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
乔亮	公司领导副总经理；万家中证 1000 指数增强型发起式	2019 年 8 月 21 日	-	17 年	国籍：中国；学历：美国斯坦福大学工商管理博士，2019 年 7 月入职万家基金管理有限公司，现任公司副总经理、基金经理，历任总经理助理、量化投资部总监（兼）。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

	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、万家元贞量化选股股票型证券投资基金、万家创业板指数增强型证券投资基金、万家国证 2000 指数增强型证券投资基金、万家家瑞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、万家量化睿选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的基金经理				公司量化投资部基金经理，南方基金管理有限公司数量化投资部投资经理，通联数据股份公司联合创始人、首席投资官，上海寻乾资产管理有限公司投资总监、总经理，巨杉（上海）资产管理有限公司量化投资部投资总监等职。
--	---	--	--	--	--

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的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内，本基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律、法规和监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋取最大利益，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《万家基金管理有限公司公平交易管理办法》，涵盖了研究、授权、投资决策和交易执行等投资管理活动的各个环节，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送，确保公平对待不同投资组合。

在投资决策上：(1)公司投资管理实行分层次决策，投资决策委员会根据公募基金和私募投资组合的规模、风格特征等因素合理确定各投资组合经理的投资权限，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需经过严格的逐级审批程序。(2)公司研究员撰写的研究报告等均通过统一的投研管理平台发布，确保各投资组合经理在获得投资信息、投资建议和实施决策方面享有公平的机会。

在交易执行上：(1)公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度；(2)对于交易公开竞价交易，所有指令必须通过系统下达，公司执行交易系统中的公平交易程序；(3)对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，原则上公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；(4)对于银行间交易，交易部按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。

在行为监控上，公司定期对不同投资组合的同向交易价差、反向交易，场外交易对手议价的价格公允性及其他异常交易情况进行监控及分析，基金经理对异常交易情况进行合理性解释并留存记录，并定期编制公平交易分析报告，由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司定期进行同向交易价差分析，即采集公司旗下管理的所有组合，连续四个季度期间内，不同时间窗下(日内、3日内、5日内)的同向交易样本，对两两组合之间的同向交易价差均值进行原假设为 0, 95%的置信水平下的 t 检验，并对结论进行跟踪分析，分析结果显示在样本数量大于 30 的前提下，组合之间在同向交易方面不存在违反公平交易行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 40 次，均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。

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 1.1293 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.39%，同期业绩比较基准收益率为-5.85%；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 1.1197 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.76%，同期业绩比较基准收益率为-5.85%。

基金报告期末 A 份额、C 份额日均跟踪偏离度分别为 0.1531%、0.1534%，年跟踪误差分别为 3.2534%、3.2558%，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

2024 年初 A 股市场出现了阶段性的恐慌下跌，超出了基于基本面理解的跌幅，当前主要宽基

指数的估值均处于历史较低位置。随着中央汇金公司发布公告表示，充分认可当前 A 股市场配置价值，扩大 ETF 指数基金增持范围，并将持续加大增持力度、扩大增持规模，市场流动性得到改善。展望后市，1 月社融数据好于预期、春节消费数据亮点频出，此前市场对经济过于悲观的预期有望得到修复，但持续性有待进一步观察，未来经济核心需要观察地产和出口数据。近期监管召开系列座谈会，就加强资本市场监管、防范化解风险、推动资本市场高质量发展广泛听取各方意见建议，为资本市场的健康发展凝聚信心。总体来看，当前 A 股整体估值处于较低区间，随着国内政策继续发力、海外经济需求回暖，未来 A 股指数有望开启震荡向上的行情走势。

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；本基金于 2024 年 1 月 12 日进行本基金的 2023 年年度收益分配，A 类每 10 份基金份额派发红利 0.130 元，C 类每 10 份基金份额派发红利 0.120 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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

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

本年度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[2024]第 ZA30204 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 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产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，公允反映了万家中证 1000 指数增强 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。
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（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估万家中证

	<p>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）评价基金管理人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）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对万家中证 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>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>朱颖 杨利敏</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>中国·上海</p>
<p>审计报告日期</p>	<p>2024 年 03 月 28 日</p>

§ 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：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	61,519,293.87	68,342,332.22
结算备付金		259,972,852.99	210,880,419.89
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	5,217,054,852.49	3,923,631,186.49
其中：股票投资		5,217,054,852.49	3,923,631,186.49
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		6,326,995.74	13,507,550.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		5,544,873,995.09	4,216,361,489.57
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 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		11,733,813.07	42,529,875.64

应付管理人报酬		4,964,499.02	3,700,561.22
应付托管费		992,899.80	740,112.23
应付销售服务费		1,044,299.95	725,010.44
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	432,786.32	457,933.87
负债合计		19,168,298.16	48,153,525.45
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	4,915,436,395.10	3,401,747,304.36
其他综合收益	7.4.7.8	-	-
未分配利润	7.4.7.9	610,269,301.83	766,460,659.76
净资产合计		5,525,705,696.93	4,168,207,964.12
负债和净资产总计		5,544,873,995.09	4,216,361,489.57

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 4,915,436,395.10 份，其中万家中证 1000 指数增强 A 基金份额净值 1.1293 元，基金份额总额 2,263,670,662.89 份；万家中证 1000 指数增强 C 基金份额净值 1.1197 元，基金份额总额 2,651,765,732.21 份。

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-729,480,093.50	-202,792,534.40
1. 利息收入		1,422,412.22	415,200.63
其中：存款利息收入	7.4.7.10	1,422,247.59	414,247.34
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		-	-
其他利息收入		164.63	953.29
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-682,470,251.35	-100,802,043.46
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-755,970,595.93	-106,475,460.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	306,735.47	-
资产支持证券投资	7.4.7.13	-	-
投资收益		-	-

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	73,193,609.11	5,673,416.65
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	-56,338,249.54	-109,288,078.32
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	7,905,995.17	6,882,386.75
减：二、营业总支出		101,980,979.20	28,013,762.88
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	70,758,159.16	19,538,374.22
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	14,151,631.84	3,907,674.82
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	15,730,353.73	4,080,245.14
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		0.60	3.43
8. 其他费用	7.4.7.20	1,340,833.87	487,465.27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-831,461,072.70	-230,806,297.28
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-831,461,072.70	-230,806,297.28
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-831,461,072.70	-230,806,297.28

注：上年度可比期间利润表中“证券出借利息收入”项目与“其他利息收入”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他利息收入”项目的“上年度可比期间”金额。

7.3 净资产变动表

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	3,401,747,304. 36	-	766,460,659.76	4,168,207,964.1 2
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	3,401,747,304. 36	-	766,460,659.76	4,168,207,964.1 2
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,513,689,090. 74	-	-156,191,357.9 3	1,357,497,732.8 1
(一)、综合收益总额	-	-	-831,461,072.7 0	-831,461,072.70
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	1,513,689,090. 74	-	753,974,513.27	2,267,663,604.0 1
其中：1. 基金申购款	8,576,272,412. 35	-	2,561,233,307. 83	11,137,505,720. 18
2. 基金赎回款	-7,062,583,321 .61	-	-1,807,258,794 .56	-8,869,842,116. 17
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-78,704,798.50	-78,704,798.50
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	4,915,436,395. 10	-	610,269,301.83	5,525,705,696.9 3
项目	上年度可比期间			
	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	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	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净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	2,892,859,728.26	-	822,302,689.32	3,715,162,417.58
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净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	3,401,747,304.36	-	766,460,659.76	4,168,207,964.12

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

方一天

陈广益

尹超

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）由万家裕裕债券型证券投资基金转型而来。根据万家裕裕债券型证券投资基金基金份额持有人大会审议通过的《关于修改万家裕裕债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》以及相关法律法规的规定，并向中国证券监督管理委员会备案，万家裕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证券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 2023 年 12 月 31 日的财

务状况以及 2023 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

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

2、金融负债分类

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。

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

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。

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

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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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。

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(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

(一) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税；

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

根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	61,519,293.87	68,342,332.22
等于：本金	61,509,768.02	68,332,158.12
加：应计利息	9,525.85	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	61,519,293.87	68,342,332.22

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		5,381,726,171.31	-	5,217,054,852.49	-164,671,318.82
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		5,381,726,171.31	-	5,217,054,852.49	-164,671,318.82
项目		上年度末 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

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未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,118.57	14,640.34
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,250.00	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	1,250.00	-
应付利息	-	-
预提费用	170,000.00	285,000.00
应付指数使用费	260,417.75	158,293.53
合计	432,786.32	457,933.87

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,797,157,489.39	1,797,157,489.39
本期申购	2,562,467,583.33	2,562,467,583.33
本期赎回（以“-”号填列）	-2,095,954,409.83	-2,095,954,409.83
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	2,263,670,662.89	2,263,670,662.89

万家中证 1000 指数增强 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,604,589,814.97	1,604,589,814.97
本期申购	6,013,804,829.02	6,013,804,829.02
本期赎回（以“-”号填列）	-4,966,628,911.78	-4,966,628,911.78
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	2,651,765,732.21	2,651,765,732.21

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
上年度末	611,586,911.62	-201,552,407.91	410,034,503.71
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	611,586,911.62	-201,552,407.91	410,034,503.71
本期利润	-344,716,035.81	20,690,262.68	-324,025,773.13
本期基金份额交易产生的变动数	259,404,145.75	-10,642,367.37	248,761,778.38
其中：基金申购款	979,998,536.19	-208,869,177.52	771,129,358.67
基金赎回款	-720,594,390.44	198,226,810.15	-522,367,580.29
本期已分配利润	-41,993,579.63	-	-41,993,579.63
本期末	484,281,441.93	-191,504,512.60	292,776,929.33

万家中证 1000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	536,270,947.54	-179,844,791.49	356,426,156.05
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	536,270,947.54	-179,844,791.49	356,426,156.05
本期利润	-430,406,787.35	-77,028,512.22	-507,435,299.57
本期基金份额交易产生的变动数	473,007,006.18	32,205,728.71	505,212,734.89
其中：基金申购款	2,251,498,501.28	-461,394,552.12	1,790,103,949.16
基金赎回款	-1,778,491,495.10	493,600,280.83	-1,284,891,214.27
本期已分配利润	-36,711,218.87	-	-36,711,218.87
本期末	542,159,947.50	-224,667,575.00	317,492,372.50

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	402,824.12	147,192.52
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	1,012,285.68	261,843.66
其他	7,137.79	5,211.16

合计	1,422,247.59	414,247.34
----	--------------	------------

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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-755,970,595.93	-106,475,460.11
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	-755,970,595.93	-106,475,460.11

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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	50,144,689,192.95	18,046,249,100.29
减：卖出股票成本总额	50,787,756,276.54	18,106,932,446.21
减：交易费用	112,903,512.34	45,792,114.19
买卖股票差价收入	-755,970,595.93	-106,475,460.11

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	295,651.37	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收	11,084.10	-

入		
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	306,735.47	-

7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	100,028,610.96	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	99,618,855.68	-
减：应计利息总额	396,971.18	-
减：交易费用	1,700.00	-
买卖债券差价收入	11,084.10	-

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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	73,193,609.11	5,673,416.65
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	73,193,609.11	5,673,416.65

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-56,338,249.54	-109,288,078.32
股票投资	-56,338,249.54	-109,288,078.32
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	-56,338,249.54	-109,288,078.32

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	7,826,546.97	6,866,574.46
基金转换费收入	79,448.20	15,812.29
合计	7,905,995.17	6,882,386.75

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	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	23,703.38	9,451.28
账户维护费	15,000.00	-
指数使用费	1,132,130.49	312,613.99
其他	-	400.00
合计	1,340,833.87	487,465.27

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、2024 年 2 月 20 日，基金管理人万家基金管理有限公司控制的上海万家朴智投资管理有限公司已办理完成工商注销手续。

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 2024 年 1 月 10 日宣告 2023 年度第 1 次分红，向截至 2024 年 1 月 12 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 0.130 元，每 10 份 C 类基金份额派发红利 0.120 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
山东省新动能基金管理有限公司	基金管理人的股东
万家财富基金销售（天津）有限公司（“万家财富”）	基金管理人的子公司、基金销售机构
万家共赢资产管理有限公司（“万家共赢”）	基金管理人的子公司
上海万家朴智投资管理有限公司（“万家朴智”）	基金管理人控制的公司
山东能源集团有限公司	基金管理人的实际控制人
齐河众鑫投资有限公司	基金管理人的股东

注：1、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。

2、2024 年 2 月 20 日，基金管理人万家基金管理有限公司控制的上海万家朴智投资管理有限公司已办理完成工商注销手续。

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 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	70,758,159.16	19,538,374.22
其中：应支付销售机构的客户维护费	20,579,694.35	6,203,729.84
应支付基金管理人的净管理费	50,178,464.81	13,334,644.38

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 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	14,151,631.84	3,907,674.82

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付，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取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	-	3,339,190.99	3,339,190.99
招商银行	-	393,633.98	393,633.98
中泰证券	-	20,682.77	20,682.77
合计	-	3,753,507.74	3,753,507.74
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家中证 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	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

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付，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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减:报告期内赎回/卖出总份额	9,887,305.69	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-
项目	上年度可比期间 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	-
报告期内申购/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%	-

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 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	61,519,293.87	402,824.12	68,342,332.22	147,192.52

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，存款按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方所承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间没有需作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

万家中证 1000 指数增强 A								
序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2023年1月16日	-	2023年1月16日	0.2290	29,705,399.28	12,288,180.35	41,993,579.63	-
合计	-	-	-	0.2290	29,705,399.28	12,288,180.35	41,993,579.63	-
万家中证 1000 指数增强 C								
序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2023年1月16日	-	2023年1月16日	0.2230	22,971,928.90	13,739,289.97	36,711,218.87	-

合计	-	-	-	0.2230	22,971,928.90	13,739,289.97	36,711,218.87	-
----	---	---	---	--------	---------------	---------------	---------------	---

注：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 2024 年 1 月 10 日宣告 2023 年度第 1 次分红，向截至 2024 年 1 月 12 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 0.130 元，每 10 份 C 类基金份额派发红利 0.120 元。

7.4.12 期末（2023 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
001239	永达股份	2023 年 12 月 4 日	6 个月	新股流通受限	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001306	夏厦精密	2023 年 11 月 9 日	6 个月	新股流通受限	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
001358	兴欣新材	2023 年 12 月 14 日	6 个月	新股流通受限	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
001378	德冠新材	2023 年 10 月 23 日	6 个月	新股流通受限	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-
300904	威力传动	2023 年 8 月 2 日	6 个月	新股流通受限	35.41	61.53	304	10,764.64	18,705.12	-
301172	君逸数码	2023 年 7 月 19 日	6 个月	新股流通受限	31.33	38.16	438	13,722.54	16,714.08	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通受限	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301210	金	2023	6 个月	新股	57.88	45.48	281	16,264.28	12,779.88	-

	杨股份	年6月21日		流通受限						
301251	威尔高	2023年8月30日	6个月	新股流通受限	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301272	英华特	2023年7月6日	6个月	新股流通受限	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.35	583	11,654.17	11,281.05	-
301329	信音电子	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301348	蓝箭电子	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-
301372	科净源	2023年8月3日	6个月	新股流通受限	45.00	43.59	231	10,395.00	10,069.29	-
301393	昊帆生物	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.68	18.69	520	13,873.60	9,718.80	-
301413	安培龙	2023年12月11日	6个月	新股流通受限	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301456	盘古智能	2023年7月6日	6个月	新股流通受限	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-

301459	丰茂股份	2023年12月6日	6个月	新股流通受限	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
301469	恒达新材	2023年8月10日	6个月	新股流通受限	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	57.66	47.25	482	27,792.12	22,774.50	-
301487	盟固利	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
301499	维科精密	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
301500	飞南资源	2023年9月13日	6个月	新股流通受限	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-
301505	苏州规划	2023年7月12日	6个月	新股流通受限	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301507	民生健康	2023年8月24日	6个月	新股流通受限	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301510	固高科技	2023年8月4日	6个月	新股流通受限	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301511	德福科技	2023年8月8日	6个月	新股流通受限	28.00	22.67	982	27,496.00	22,261.94	-
301516	中远通	2023年12月1日	6个月	新股流通受限	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕西	2023年10	6个月	新股流通	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-

	华达	月9日		受限						
301518	长华化学	2023年7月26日	6个月	新股流通受限	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-
301519	舜禹股份	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-
301520	万邦医药	2023年9月18日	6个月	新股流通受限	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
301525	儒竞科技	2023年8月23日	6个月	新股流通受限	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-
301526	国际复材	2023年12月19日	6个月	新股流通受限	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-
301528	多浦乐	2023年8月17日	6个月	新股流通受限	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
301529	福赛科技	2023年8月31日	6个月	新股流通受限	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301548	崇德科技	2023年9月11日	6个月	新股流通受限	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-
301550	斯菱股份	2023年9月6日	6个月	新股流通受限	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-
301555	惠柏新材	2023年10月24日	6个月	新股流通受限	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301558	三态股	2023年9月21日	6个月	新股流通受限	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-

	份									
301559	中集环科	2023年9月26日	6个月	新股流通受限	24.22	18.24	1,315	31,849.30	23,985.60	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股流通受限	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301568	思泰克	2023年11月21日	6个月	新股流通受限	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301578	辰奕智能	2023年12月21日	6个月	新股流通受限	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
601083	锦江航运	2023年11月28日	6个月	新股流通受限	11.25	11.07	1,263	14,208.75	13,981.41	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	新股流通受限	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-
603004	鼎龙科技	2023年12月20日	6个月	新股流通受限	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603062	麦加芯彩	2023年10月31日	6个月	新股流通受限	58.08	57.81	126	7,318.08	7,284.06	-
603075	热威股份	2023年9月1日	6个月	新股流通受限	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
603107	上海汽配	2023年10月25日	6个月	新股流通受限	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-
603119	浙江荣	2023年7月21日	6个月	新股流通受限	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-

	泰									
603193	润本股份	2023年10月9日	6个月	新股流通受限	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-
603231	索宝蛋白	2023年12月6日	6个月	新股流通受限	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-
603270	金帝股份	2023年8月25日	6个月	新股流通受限	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-
603273	天元智能	2023年10月16日	6个月	新股流通受限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒兴新材	2023年9月18日	6个月	新股流通受限	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603373	安邦护卫	2023年12月13日	6个月	新股流通受限	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688548	广钢气体	2023年8月8日	6个月	新股流通受限	9.87	12.75	4,048	39,953.76	51,612.00	-
688549	中巨芯	2023年8月30日	6个月	新股流通受限	5.18	8.09	4,294	22,242.92	34,738.46	-
688563	航材股份	2023年7月12日	6个月	新股流通受限	78.99	60.49	1,501	118,563.99	90,795.49	-
688573	信宇人	2023年8月9日	6个月	新股流通受限	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	-
688591	泰	2023	6个月	新股	24.98	28.02	681	17,011.38	19,081.62	-

	凌微	年8月18日		流通受限						
688602	康鹏科技	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-
688610	埃科光电	2023年7月10日	6个月	新股流通受限	73.33	51.00	275	20,165.75	14,025.00	-
688612	威迈斯	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	47.29	37.97	422	19,956.38	16,023.34	-
688627	精智达	2023年7月11日	6个月	新股流通受限	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-
688648	中邮科技	2023年11月6日	6个月	新股流通受限	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688651	盛邦安全	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月	新股流通受限	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
688653	康希通信	2023年11月10日	6个月	新股流通受限	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
688657	浩辰软件	2023年9月25日	6个月	新股流通受限	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688671	碧兴物联	2023年8月2日	6个月	新股流通受限	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-

688693	锴威特	2023年8月10日	6个月	新股流通受限	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
688702	盛科通信	2023年9月6日	6个月	新股流通受限	42.66	48.18	549	23,420.34	26,450.82	-
688716	中研股份	2023年9月13日	6个月	新股流通受限	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-
688719	爱科赛博	2023年9月20日	6个月	新股流通受限	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-
688720	艾森股份	2023年11月29日	6个月	新股流通受限	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000801	四川九洲	2023年12月21日	重大事项停牌	7.70	2024年01月05日	8.47	4,134,300	34,153,140.86	31,834,110.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 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 2023 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 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资。(2022 年 12 月 31 日：同)

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。因此，除在附注 7.4.12 中列示的本基金期末持有的流通受限证券外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金资产的流动性风险进行管理，基金管理人建立了健全的流动性风险管理的内部控制体系，在申购赎回确认、投资交易、估值和信息披露等运作过程中专业审慎、勤勉尽责地管控基金的流动性风险，维护投资者的合法权益，公平对待投资者。本基金开放期间管理人对组合持仓集中度、短期变现能力、流动性受限资产比例、现金类资产比例等流动性指标进行持续的监测和分析，通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，对交易对手进行必要的尽职调查和准入，加强逆回购的流动性风险和交易对手风险的管理，并健全了逆回购交易质押品管理制度。

本基金所持有的证券大部分具有良好的流动性，部分证券流通暂时受限的情况参见附注 7.4.12 “期末（2023 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 2023 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							
货币资金	61,519,293.87	-	-	-	-	-	61,519,293.87
结算备付金	259,972,852.99	-	-	-	-	-	259,972,852.99
交易性金融资产	-	-	-	-	-	5,217,054,852.49	5,217,054,852.49
应收申购款	8,341.33	-	-	-	-	6,318,654.41	6,326,995.74

资产总计	321,500,488.19	-	-	-	-	-5,223,373,506.90	5,544,873,995.09
负债							
应付赎回款		-	-	-	-	11,733,813.07	11,733,813.07
应付管理人报酬		-	-	-	-	4,964,499.02	4,964,499.02
应付托管费		-	-	-	-	992,899.80	992,899.80
应付销售服务费		-	-	-	-	1,044,299.95	1,044,299.95
其他负债		-	-	-	-	432,786.32	432,786.32
负债总计		-	-	-	-	19,168,298.16	19,168,298.16
利率敏感度缺口	321,500,488.19	-	-	-	-	-5,204,205,208.74	5,525,705,696.93
上年度末 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							
货币资金	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

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 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2022 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（2022 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 2023年12月31日		上年度末 2022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	5,217,054,852.49	94.41	3,923,631,186.49	94.13
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	5,217,054,852.49	94.41	3,923,631,186.49	94.13

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		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	1. 股票基准指数下降100个基点	-53,500,862.09	-38,498,843.98
2. 股票基准指数上升100个基点	53,500,862.09	38,498,843.98	

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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	5,184,120,099.51	3,921,824,557.59
第二层次	31,834,110.00	-
第三层次	1,100,642.98	1,806,628.90
合计	5,217,054,852.49	3,923,631,186.49

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

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	-	1,806,628.90	1,806,628.90
当期购买	-	949,574.88	949,574.88

当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	2,141,534.78	2,141,534.78
当期利得或损失总额	-	485,973.98	485,973.98
其中：计入损益的利得或损失	-	485,973.98	485,973.98
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,100,642.98	1,100,642.98
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	-	151,068.10	151,068.10
项目	上年度可比期间 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

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	1,100,642.98	亚式期权模型	预期波动率	0.1962-2.1988	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
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

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	5,217,054,852.49	94.09
	其中：股票	5,217,054,852.49	94.09
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	321,492,146.86	5.80
8	其他各项资产	6,326,995.74	0.11
9	合计	5,544,873,995.09	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	56,775,143.42	1.03
B	采矿业	77,724,724.90	1.41

C	制造业	2,765,889,391.52	50.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	61,384,799.76	1.11
E	建筑业	81,191,299.00	1.47
F	批发和零售业	79,839,246.22	1.44
G	交通运输、仓储和邮政业	36,026,187.94	0.65
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	626,001,668.17	11.33
J	金融业	172,734,228.92	3.13
K	房地产业	49,818,586.24	0.90
L	租赁和商务服务业	9,840,217.52	0.18
M	科学研究和技术服务业	115,463,604.03	2.09
N	水利、环境和公共设施管理业	44,874,084.00	0.81
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	25,814,194.50	0.47
R	文化、体育和娱乐业	42,050,340.49	0.76
S	综合	-	-
	合计	4,245,427,716.63	76.83

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	4,784,310.00	0.09
B	采矿业	14,227,579.00	0.26
C	制造业	609,583,039.75	11.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	60,012,932.32	1.09
E	建筑业	11,040,288.00	0.20
F	批发和零售业	9,346,137.20	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	1,330,117.41	0.02
H	住宿和餐饮业	5,038,150.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,252,954.38	0.69
J	金融业	160,580,252.91	2.91

K	房地产业	11,058,854.00	0.20
L	租赁和商务服务业	20,526,133.00	0.37
M	科学研究和技术服务业	16,390,866.78	0.30
N	水利、环境和公共设施管理业	2,944,135.11	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	6,511,386.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	971,627,135.86	17.58

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300232	洲明科技	6,021,800	52,991,840.00	0.96
2	300319	麦捷科技	5,463,700	52,670,068.00	0.95
3	688158	优刻得	3,117,400	51,281,230.00	0.93
4	300432	富临精工	4,574,330	48,030,465.00	0.87
5	002948	青岛银行	15,033,040	45,850,772.00	0.83
6	688018	乐鑫科技	438,645	45,158,502.75	0.82
7	603396	金辰股份	815,308	44,556,582.20	0.81
8	300458	全志科技	1,929,130	43,771,959.70	0.79
9	688235	百济神州	312,597	43,463,486.88	0.79
10	002773	康弘药业	2,342,616	43,197,839.04	0.78
11	002993	奥海科技	1,091,780	41,596,818.00	0.75
12	605589	圣泉集团	1,828,748	40,927,380.24	0.74
13	002745	木林森	4,661,500	40,368,590.00	0.73
14	000035	中国天楹	8,136,700	40,195,298.00	0.73
15	002405	四维图新	4,488,800	39,950,320.00	0.72
16	688116	天奈科技	1,372,400	39,854,496.00	0.72
17	301080	百普赛斯	672,350	39,628,309.00	0.72
18	300327	中颖电子	1,639,094	37,371,343.20	0.68
19	600449	宁夏建材	2,081,903	37,328,520.79	0.68

20	601001	晋控煤业	3,022,000	37,261,260.00	0.67
21	601963	重庆银行	5,336,602	37,142,749.92	0.67
22	600252	中恒集团	14,586,003	36,610,867.53	0.66
23	002467	二六三	7,748,600	35,953,504.00	0.65
24	600577	精达股份	8,504,000	35,206,560.00	0.64
25	603087	甘李药业	662,400	34,875,360.00	0.63
26	002706	良信股份	3,840,000	33,907,200.00	0.61
27	000969	安泰科技	3,603,828	32,398,413.72	0.59
28	000801	四川九洲	4,134,300	31,834,110.00	0.58
29	300369	绿盟科技	3,370,600	31,784,758.00	0.58
30	603919	金徽酒	1,288,500	31,722,870.00	0.57
31	603678	火炬电子	1,193,200	31,584,004.00	0.57
32	300180	华峰超纤	7,138,100	31,550,402.00	0.57
33	300735	光弘科技	1,339,996	31,543,505.84	0.57
34	688106	金宏气体	1,299,909	31,314,807.81	0.57
35	688007	光峰科技	1,193,160	30,878,980.80	0.56
36	300166	东方国信	3,241,445	30,469,583.00	0.55
37	688083	中望软件	304,152	30,275,290.08	0.55
38	603236	移远通信	563,219	30,273,021.25	0.55
39	600645	中源协和	1,483,083	30,062,092.41	0.54
40	002245	蔚蓝锂芯	3,478,500	29,636,820.00	0.54
41	300035	中科电气	2,773,600	29,233,744.00	0.53
42	002100	天康生物	3,327,400	29,181,298.00	0.53
43	300348	长亮科技	2,830,100	29,178,331.00	0.53
44	002124	天邦食品	8,020,800	29,115,504.00	0.53
45	600850	电科数字	1,325,000	28,818,750.00	0.52
46	600507	方大特钢	6,213,800	28,645,618.00	0.52
47	600266	城建发展	5,821,376	28,175,459.84	0.51
48	605376	博迁新材	976,600	27,540,120.00	0.50
49	601375	中原证券	6,696,900	25,649,127.00	0.46
50	300233	金城医药	1,539,500	25,648,070.00	0.46
51	600446	金证股份	2,190,205	25,340,671.85	0.46
52	300377	赢时胜	3,212,800	24,931,328.00	0.45
53	603730	岱美股份	1,695,351	24,565,635.99	0.44
54	603033	三维股份	1,485,553	23,486,592.93	0.43
55	300768	迪普科技	1,581,944	23,381,132.32	0.42
56	002125	湘潭电化	2,150,900	22,993,121.00	0.42
57	301219	腾远钴业	576,406	22,693,104.22	0.41
58	603906	龙蟠科技	1,803,900	22,476,594.00	0.41
59	300770	新媒股份	576,500	22,299,020.00	0.40
60	688131	皓元医药	426,213	22,188,648.78	0.40
61	600667	太极实业	3,125,700	21,973,671.00	0.40
62	688209	英集芯	1,205,640	21,532,730.40	0.39

63	603583	捷昌驱动	1,074,434	21,520,913.02	0.39
64	600284	浦东建设	3,401,600	21,430,080.00	0.39
65	000690	宝新能源	4,826,000	21,379,180.00	0.39
66	002036	联创电子	2,019,700	20,621,137.00	0.37
67	300841	康华生物	265,000	20,548,100.00	0.37
68	002215	诺普信	2,476,800	20,458,368.00	0.37
69	601918	新集能源	3,832,500	20,197,275.00	0.37
70	600216	浙江医药	1,868,000	20,043,640.00	0.36
71	601801	皖新传媒	2,844,600	19,769,970.00	0.36
72	603055	台华新材	1,599,600	19,259,184.00	0.35
73	300767	震安科技	1,100,500	19,126,690.00	0.35
74	301078	孩子王	2,328,982	19,120,942.22	0.35
75	688368	晶丰明源	176,207	19,019,783.58	0.34
76	002239	奥特佳	5,832,600	18,955,950.00	0.34
77	002351	漫步者	1,072,400	18,949,308.00	0.34
78	688016	心脉医疗	96,717	18,824,029.71	0.34
79	002436	兴森科技	1,258,900	18,543,597.00	0.34
80	688739	成大生物	564,558	18,353,780.58	0.33
81	601606	长城军工	1,476,700	17,986,206.00	0.33
82	000686	东北证券	2,529,500	17,959,450.00	0.33
83	688128	中国电研	870,848	17,869,800.96	0.32
84	002724	海洋王	2,154,300	17,708,346.00	0.32
85	002537	海联金汇	2,652,100	17,662,986.00	0.32
86	300113	顺网科技	1,251,300	17,518,200.00	0.32
87	002635	安洁科技	1,064,300	17,380,019.00	0.31
88	300747	锐科激光	738,523	17,377,446.19	0.31
89	002396	星网锐捷	961,662	17,377,232.34	0.31
90	600480	凌云股份	1,819,342	16,574,205.62	0.30
91	300087	荃银高科	1,964,600	16,463,348.00	0.30
92	600596	新安股份	1,766,700	16,112,304.00	0.29
93	601528	瑞丰银行	3,123,600	15,461,820.00	0.28
94	000090	天健集团	3,333,100	15,332,260.00	0.28
95	603129	春风动力	148,200	15,151,968.00	0.27
96	002287	奇正藏药	671,629	15,104,936.21	0.27
97	001696	宗申动力	2,275,360	15,085,636.80	0.27
98	300725	药石科技	381,187	14,969,213.49	0.27
99	300679	电连技术	357,800	14,848,700.00	0.27
100	301171	易点天下	736,500	14,560,605.00	0.26
101	002961	瑞达期货	957,900	14,272,710.00	0.26
102	002649	博彦科技	1,145,100	14,050,377.00	0.25
103	003012	东鹏控股	1,678,400	13,846,800.00	0.25
104	000818	航锦科技	431,900	13,553,022.00	0.25
105	002516	旷达科技	2,677,900	13,202,047.00	0.24

106	301050	雷电微力	226,000	13,166,760.00	0.24
107	688100	威胜信息	450,243	13,021,027.56	0.24
108	601126	四方股份	918,100	13,000,296.00	0.24
109	000550	江铃汽车	682,600	12,989,878.00	0.24
110	300596	利安隆	436,500	12,902,940.00	0.23
111	688680	海优新材	191,412	12,566,197.80	0.23
112	002646	天佑德酒	912,801	12,423,221.61	0.22
113	000923	河钢资源	726,700	12,208,560.00	0.22
114	688027	国盾量子	95,280	12,186,312.00	0.22
115	688499	利元亨	319,067	12,150,071.36	0.22
116	600710	苏美达	1,710,100	12,124,609.00	0.22
117	000727	冠捷科技	4,523,900	12,124,052.00	0.22
118	002946	新乳业	1,055,700	12,119,436.00	0.22
119	000791	甘肃能源	2,164,500	12,056,265.00	0.22
120	300685	艾德生物	532,500	11,704,350.00	0.21
121	300618	寒锐钴业	413,200	11,689,428.00	0.21
122	002378	章源钨业	2,052,750	11,618,565.00	0.21
123	600201	生物股份	1,073,600	11,562,672.00	0.21
124	002061	浙江交科	3,151,600	11,503,340.00	0.21
125	000600	建投能源	2,290,476	11,475,284.76	0.21
126	002206	海利得	2,275,500	11,423,010.00	0.21
127	002068	黑猫股份	974,300	11,301,880.00	0.20
128	603005	晶方科技	504,750	11,084,310.00	0.20
129	688408	中信博	151,458	10,867,111.50	0.20
130	001213	中铁特货	2,563,000	10,764,600.00	0.19
131	688578	艾力斯	257,583	10,730,907.78	0.19
132	603328	依顿电子	1,307,200	10,653,680.00	0.19
133	300409	道氏技术	942,700	10,501,678.00	0.19
134	002967	广电计量	695,711	10,442,622.11	0.19
135	600285	羚锐制药	609,500	10,428,545.00	0.19
136	600623	华谊集团	1,606,800	10,347,792.00	0.19
137	600075	新疆天业	2,343,400	10,123,488.00	0.18
138	301239	普瑞眼科	117,400	10,096,400.00	0.18
139	603477	巨星农牧	261,486	9,797,880.42	0.18
140	300346	南大光电	351,610	9,707,952.10	0.18
141	688327	云从科技	575,200	9,697,872.00	0.18
142	603989	艾华集团	442,400	9,520,448.00	0.17
143	688366	昊海生科	87,031	9,424,586.99	0.17
144	002840	华统股份	452,900	9,415,791.00	0.17
145	002851	麦格米特	382,697	9,414,346.20	0.17
146	601137	博威合金	601,400	9,339,742.00	0.17
147	688023	安恒信息	83,535	9,263,196.15	0.17
148	603733	仙鹤股份	570,300	9,204,642.00	0.17

149	688568	中科星图	186,646	9,156,852.76	0.17
150	603063	禾望电气	366,200	9,155,000.00	0.17
151	000990	诚志股份	1,110,800	9,119,668.00	0.17
152	601567	三星医疗	443,800	9,097,900.00	0.16
153	688206	概伦电子	416,689	9,083,820.20	0.16
154	688733	壹石通	309,100	9,047,357.00	0.16
155	600602	云赛智联	764,272	8,842,627.04	0.16
156	603128	华贸物流	1,189,000	8,786,710.00	0.16
157	002541	鸿路钢构	402,700	8,750,671.00	0.16
158	603013	亚普股份	500,000	8,640,000.00	0.16
159	002901	大博医疗	211,400	8,580,726.00	0.16
160	688318	财富趋势	67,924	8,578,801.20	0.16
161	688798	艾为电子	123,909	8,553,438.27	0.15
162	300358	楚天科技	790,200	8,455,140.00	0.15
163	301308	江波龙	91,200	8,394,960.00	0.15
164	000676	智度股份	956,600	8,351,118.00	0.15
165	603713	密尔克卫	156,200	8,311,402.00	0.15
166	603393	新天然气	271,200	8,290,584.00	0.15
167	300303	聚飞光电	1,379,400	8,179,842.00	0.15
168	301165	锐捷网络	213,349	8,083,793.61	0.15
169	603439	贵州三力	426,200	8,046,656.00	0.15
170	688017	绿的谐波	51,379	7,886,676.50	0.14
171	601222	林洋能源	1,232,500	7,875,675.00	0.14
172	601952	苏垦农发	766,900	7,853,056.00	0.14
173	301267	华夏眼科	242,750	7,789,847.50	0.14
174	688322	奥比中光	205,700	7,730,206.00	0.14
175	603489	八方股份	140,311	7,710,089.45	0.14
176	300260	新莱应材	249,800	7,601,414.00	0.14
177	300382	斯莱克	763,600	7,582,548.00	0.14
178	603108	润达医疗	370,500	7,539,675.00	0.14
179	603197	保隆科技	131,268	7,403,515.20	0.13
180	000034	神州数码	246,100	7,360,851.00	0.13
181	002839	张家港行	1,882,500	7,304,100.00	0.13
182	002261	拓维信息	485,501	7,301,935.04	0.13
183	688019	安集科技	45,475	7,265,086.00	0.13
184	600685	中船防务	281,029	7,180,290.95	0.13
185	300002	神州泰岳	807,400	7,145,490.00	0.13
186	002697	红旗连锁	1,418,700	7,065,126.00	0.13
187	002701	奥瑞金	1,705,300	7,059,942.00	0.13
188	600458	时代新材	765,500	7,050,255.00	0.13
189	301015	百洋医药	194,600	6,978,356.00	0.13
190	000682	东方电子	853,937	6,874,192.85	0.12
191	002567	唐人神	900,100	6,750,750.00	0.12

192	300674	宇信科技	403,700	6,572,236.00	0.12
193	600320	振华重工	1,970,302	6,541,402.64	0.12
194	000650	仁和药业	975,700	6,468,891.00	0.12
195	600330	天通股份	746,700	6,444,021.00	0.12
196	605090	九丰能源	221,300	6,180,909.00	0.11
197	688037	芯源微	46,100	6,159,421.00	0.11
198	688326	经纬恒润	52,764	6,123,262.20	0.11
199	000049	德赛电池	223,957	6,073,713.84	0.11
200	300393	中来股份	578,600	5,982,724.00	0.11
201	688127	蓝特光学	256,628	5,976,866.12	0.11
202	300663	科蓝软件	422,300	5,971,322.00	0.11
203	300762	上海瀚讯	391,800	5,908,344.00	0.11
204	000921	海信家电	287,400	5,862,960.00	0.11
205	000403	派林生物	212,800	5,796,672.00	0.10
206	600750	江中药业	275,500	5,752,440.00	0.10
207	603093	南华期货	473,200	5,678,400.00	0.10
208	688050	爱博医疗	32,693	5,624,503.72	0.10
209	002895	川恒股份	293,900	5,584,100.00	0.10
210	603666	亿嘉和	176,579	5,542,814.81	0.10
211	002318	久立特材	275,200	5,470,976.00	0.10
212	000681	视觉中国	370,900	5,452,230.00	0.10
213	300451	创业慧康	830,300	5,438,465.00	0.10
214	300973	立高食品	111,700	5,423,035.00	0.10
215	600206	有研新材	434,900	5,388,411.00	0.10
216	688617	惠泰医疗	13,836	5,375,286.00	0.10
217	600556	天下秀	899,600	5,316,636.00	0.10
218	688261	东微半导	62,909	5,258,563.31	0.10
219	603348	文灿股份	135,280	5,248,864.00	0.09
220	002302	西部建设	810,000	5,248,800.00	0.09
221	300894	火星入	323,095	5,247,062.80	0.09
222	603212	赛伍技术	295,572	5,134,085.64	0.09
223	600158	中体产业	658,500	5,123,130.00	0.09
224	300765	新诺威	138,900	5,086,518.00	0.09
225	000422	湖北宜化	484,900	5,072,054.00	0.09
226	000915	华特达因	172,237	4,987,983.52	0.09
227	002226	江南化工	1,132,600	4,960,788.00	0.09
228	300298	三诺生物	162,000	4,924,800.00	0.09
229	000821	京山轻机	309,186	4,912,965.54	0.09
230	600575	淮河能源	1,998,900	4,817,349.00	0.09
231	300039	上海凯宝	718,400	4,777,360.00	0.09
232	000061	农产品	735,100	4,756,097.00	0.09
233	300887	谱尼测试	395,950	4,676,169.50	0.08
234	002847	盐津铺子	66,250	4,603,050.00	0.08

235	300755	华致酒行	250,100	4,574,329.00	0.08
236	002145	中核钛白	1,016,300	4,553,024.00	0.08
237	600456	宝钛股份	144,249	4,527,976.11	0.08
238	601028	玉龙股份	399,000	4,273,290.00	0.08
239	688388	嘉元科技	210,500	4,268,940.00	0.08
240	688707	振华新材	208,000	4,264,000.00	0.08
241	600775	南京熊猫	313,700	4,156,525.00	0.08
242	300133	华策影视	706,000	4,144,220.00	0.07
243	603985	恒润股份	165,700	4,117,645.00	0.07
244	300662	科锐国际	148,146	4,091,792.52	0.07
245	300860	锋尚文化	74,423	4,065,728.49	0.07
246	301060	兰卫医学	302,700	4,022,883.00	0.07
247	002585	双星新材	490,300	3,976,333.00	0.07
248	600510	黑牡丹	702,800	3,970,820.00	0.07
249	600688	上海石化	1,371,223	3,921,697.78	0.07
250	002219	新里程	1,288,800	3,905,064.00	0.07
251	600971	恒源煤电	341,700	3,809,955.00	0.07
252	603279	景津装备	171,860	3,799,824.60	0.07
253	002815	崇达技术	389,600	3,732,368.00	0.07
254	600586	金晶科技	555,301	3,709,410.68	0.07
255	002978	安宁股份	116,500	3,688,390.00	0.07
256	688711	宏微科技	88,578	3,675,101.22	0.07
257	000881	中广核技	504,400	3,656,900.00	0.07
258	603043	广州酒家	186,900	3,650,157.00	0.07
259	301095	广立微	48,800	3,646,824.00	0.07
260	688262	国芯科技	123,100	3,611,754.00	0.07
261	605222	起帆电缆	184,640	3,559,859.20	0.06
262	688789	宏华数科	35,449	3,541,709.59	0.06
263	300034	钢研高纳	169,800	3,455,430.00	0.06
264	000627	天茂集团	1,202,500	3,415,100.00	0.06
265	002283	天润工业	583,400	3,412,890.00	0.06
266	603871	嘉友国际	210,979	3,346,126.94	0.06
267	300630	普利制药	147,200	3,329,664.00	0.06
268	300077	国民技术	291,000	3,285,390.00	0.06
269	603025	大豪科技	245,800	3,259,308.00	0.06
270	000560	我爱我家	1,439,000	3,237,750.00	0.06
271	002556	辉隆股份	536,400	3,154,032.00	0.06
272	688315	诺禾致源	131,377	3,066,339.18	0.06
273	300820	英杰电气	52,600	3,012,928.00	0.05
274	605333	沪光股份	150,300	2,990,970.00	0.05
275	603997	继峰股份	220,050	2,964,073.50	0.05
276	601886	江河集团	442,700	2,948,382.00	0.05
277	000555	神州信息	259,800	2,933,142.00	0.05

278	002221	东华能源	283,600	2,921,080.00	0.05
279	002174	游族网络	252,700	2,895,942.00	0.05
280	600933	爱柯迪	131,700	2,889,498.00	0.05
281	688066	航天宏图	67,800	2,863,872.00	0.05
282	000718	苏宁环球	1,103,460	2,857,961.40	0.05
283	002705	新宝股份	196,100	2,857,177.00	0.05
284	300623	捷捷微电	178,126	2,826,859.62	0.05
285	300737	科顺股份	446,500	2,741,510.00	0.05
286	000928	中钢国际	467,800	2,727,274.00	0.05
287	600225	卓朗科技	716,900	2,724,220.00	0.05
288	603105	芯能科技	234,700	2,717,826.00	0.05
289	002991	甘源食品	37,800	2,701,188.00	0.05
290	002130	沃尔核材	356,000	2,687,800.00	0.05
291	300455	航天智装	225,100	2,687,694.00	0.05
292	000719	中原传媒	275,000	2,675,750.00	0.05
293	603595	东尼电子	70,800	2,604,732.00	0.05
294	688185	康希诺	34,657	2,582,639.64	0.05
295	603588	高能环境	394,300	2,578,722.00	0.05
296	688238	和元生物	279,500	2,512,705.00	0.05
297	603306	华懋科技	92,028	2,494,879.08	0.05
298	301155	海力风电	41,400	2,448,810.00	0.04
299	688559	海目星	68,123	2,431,991.10	0.04
300	300639	凯普生物	258,354	2,413,026.36	0.04
301	688598	金博股份	34,400	2,404,560.00	0.04
302	300170	汉得信息	289,100	2,402,421.00	0.04
303	002941	新疆交建	183,200	2,385,264.00	0.04
304	300687	赛意信息	108,200	2,356,596.00	0.04
305	603008	喜临门	136,200	2,316,762.00	0.04
306	600312	平高电气	180,600	2,291,814.00	0.04
307	002335	科华数据	82,000	2,269,760.00	0.04
308	000030	富奥股份	420,600	2,246,004.00	0.04
309	301071	力量钻石	69,300	2,238,390.00	0.04
310	300263	隆华科技	317,000	2,231,680.00	0.04
311	603983	丸美股份	86,200	2,178,274.00	0.04
312	000006	深振业 A	469,400	2,154,546.00	0.04
313	601200	上海环境	233,600	2,100,064.00	0.04
314	300398	飞凯材料	133,113	2,097,860.88	0.04
315	002163	海南发展	230,700	2,094,756.00	0.04
316	300158	振东制药	305,600	2,062,800.00	0.04
317	002428	云南锗业	166,700	2,055,411.00	0.04
318	600389	江山股份	116,385	2,025,099.00	0.04
319	002222	福晶科技	68,500	2,022,805.00	0.04
320	300573	兴齐眼药	11,020	2,009,166.40	0.04

321	603566	普莱柯	86,400	1,956,960.00	0.04
322	688392	骄成超声	23,400	1,951,794.00	0.04
323	603915	国茂股份	117,880	1,942,662.40	0.04
324	300634	彩讯股份	94,400	1,932,368.00	0.03
325	600601	方正科技	667,800	1,929,942.00	0.03
326	300620	光库科技	42,600	1,929,780.00	0.03
327	002534	西子洁能	153,600	1,918,464.00	0.03
328	300366	创意信息	145,200	1,905,024.00	0.03
329	688700	东威科技	30,687	1,872,520.74	0.03
330	002043	兔宝宝	209,400	1,855,284.00	0.03
331	600966	博汇纸业	293,122	1,820,287.62	0.03
332	688173	希荻微	103,000	1,811,770.00	0.03
333	300666	江丰电子	30,900	1,810,122.00	0.03
334	600691	阳煤化工	561,500	1,802,415.00	0.03
335	300783	三只松鼠	99,700	1,799,585.00	0.03
336	000966	长源电力	405,100	1,794,593.00	0.03
337	600657	信达地产	492,500	1,768,075.00	0.03
338	000736	中交地产	176,200	1,724,998.00	0.03
339	600223	福瑞达	174,700	1,682,361.00	0.03
340	002832	比音勒芬	51,900	1,645,230.00	0.03
341	002006	精工科技	104,500	1,596,760.00	0.03
342	002312	川发龙蟒	217,900	1,557,985.00	0.03
343	600729	重庆百货	54,800	1,545,360.00	0.03
344	600675	中华企业	483,300	1,522,395.00	0.03
345	600073	上海梅林	210,600	1,434,186.00	0.03
346	688696	极米科技	12,547	1,417,560.06	0.03
347	603888	新华网	56,165	1,414,796.35	0.03
348	688556	高测股份	36,000	1,403,640.00	0.03
349	002041	登海种业	105,700	1,398,411.00	0.03
350	300772	运达股份	131,100	1,394,904.00	0.03
351	300475	香农芯创	40,900	1,382,011.00	0.03
352	688278	特宝生物	26,365	1,380,207.75	0.02
353	002544	普天科技	67,700	1,375,664.00	0.02
354	301238	瑞泰新材	76,500	1,341,045.00	0.02
355	000951	中国重汽	91,440	1,221,638.40	0.02
356	300821	东岳硅材	144,200	1,196,860.00	0.02
357	300188	国投智能	74,600	1,195,092.00	0.02
358	301047	义翘神州	13,840	1,140,416.00	0.02
359	002777	久远银海	44,500	1,117,395.00	0.02
360	603301	振德医疗	45,500	1,114,750.00	0.02
361	603187	海容冷链	73,400	1,112,744.00	0.02
362	000737	北方铜业	191,600	1,111,280.00	0.02
363	603533	掌阅科技	54,700	1,087,436.00	0.02

364	688268	华特气体	16,100	1,084,818.00	0.02
365	601609	金田股份	158,400	1,072,368.00	0.02
366	603208	江山欧派	35,800	1,062,902.00	0.02
367	688333	铂力特	9,000	1,043,100.00	0.02
368	300031	宝通科技	55,400	1,027,116.00	0.02
369	000058	深赛格	138,400	992,328.00	0.02
370	688046	药康生物	47,600	959,140.00	0.02
371	603229	奥翔药业	72,000	951,120.00	0.02
372	688033	天宜上佳	55,800	943,020.00	0.02
373	002242	九阳股份	73,100	929,101.00	0.02
374	001301	尚太科技	25,200	922,824.00	0.02
375	002099	海翔药业	127,200	914,568.00	0.02
376	002891	中宠股份	33,796	890,524.60	0.02
377	002545	东方铁塔	124,500	890,175.00	0.02
378	300315	掌趣科技	166,700	858,505.00	0.02
379	601949	中国出版	101,400	819,312.00	0.01
380	002171	楚江新材	108,800	813,824.00	0.01
381	688001	华兴源创	23,214	811,329.30	0.01
382	002307	北新路桥	187,800	796,272.00	0.01
383	688133	泰坦科技	16,983	787,162.05	0.01
384	600055	万东医疗	44,900	766,892.00	0.01
385	600552	凯盛科技	57,200	762,476.00	0.01
386	600477	杭萧钢构	228,800	752,752.00	0.01
387	600612	老凤祥	10,600	731,400.00	0.01
388	688166	博瑞医药	20,600	721,000.00	0.01
389	000811	冰轮环境	53,100	720,567.00	0.01
390	600882	妙可蓝多	32,900	528,703.00	0.01
391	000603	盛达资源	47,700	527,085.00	0.01
392	603179	新泉股份	10,300	522,313.00	0.01
393	603556	海兴电力	17,707	514,034.21	0.01
394	600963	岳阳林纸	63,800	375,782.00	0.01
395	000016	深康佳A	84,800	353,616.00	0.01
396	301216	万凯新材	24,300	343,359.00	0.01
397	002645	华宏科技	27,900	315,270.00	0.01
398	300406	九强生物	14,500	276,950.00	0.01
399	002015	协鑫能科	16,800	207,984.00	0.00
400	300134	大富科技	17,300	178,536.00	0.00
401	688289	圣湘生物	5,900	115,345.00	0.00
402	002932	明德生物	4,769	109,543.93	0.00
403	002101	广东鸿图	5,100	77,673.00	0.00
404	300693	盛弘股份	1,697	50,757.27	0.00
405	603505	金石资源	1,186	32,199.90	0.00
406	002158	汉钟精机	1,400	31,164.00	0.00

407	300497	富祥药业	2,500	23,400.00	0.00
-----	--------	------	-------	-----------	------

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688169	石头科技	133,675	37,823,341.25	0.68
2	603028	赛福天	2,511,000	27,997,650.00	0.51
3	601198	东兴证券	3,333,417	27,434,021.91	0.50
4	000932	华菱钢铁	5,241,900	26,995,785.00	0.49
5	601878	浙商证券	2,404,100	25,074,763.00	0.45
6	600025	华能水电	2,825,204	24,381,510.52	0.44
7	603520	司太立	1,649,354	23,222,904.32	0.42
8	600569	安阳钢铁	9,798,086	20,869,923.18	0.38
9	601688	华泰证券	1,407,800	19,638,810.00	0.36
10	600369	西南证券	4,662,600	19,070,034.00	0.35
11	601377	兴业证券	3,025,300	17,758,511.00	0.32
12	000039	中集集团	2,265,400	17,330,310.00	0.31
13	600438	通威股份	647,800	16,214,434.00	0.29
14	300279	和晶科技	2,496,500	16,152,355.00	0.29
15	603110	东方材料	664,100	16,004,810.00	0.29
16	603682	锦和商管	2,385,900	13,695,066.00	0.25
17	601985	中国核电	1,808,600	13,564,500.00	0.25
18	300595	欧普康视	599,459	13,535,784.22	0.24
19	300368	汇金股份	1,862,700	12,703,614.00	0.23
20	300016	北陆药业	1,770,200	12,603,824.00	0.23
21	601881	中国银河	1,034,200	12,462,110.00	0.23
22	002559	亚威股份	1,027,400	11,845,922.00	0.21
23	603053	成都燃气	1,131,700	11,588,608.00	0.21
24	300213	佳讯飞鸿	1,411,600	10,163,520.00	0.18
25	300043	星辉娱乐	2,633,300	9,769,543.00	0.18
26	600150	中国船舶	329,600	9,703,424.00	0.18
27	601390	中国中铁	1,692,300	9,612,264.00	0.17
28	600030	中信证券	458,200	9,333,534.00	0.17
29	300746	汉嘉设计	902,360	9,068,718.00	0.16
30	002988	豪美新材	375,500	8,963,185.00	0.16
31	002500	山西证券	1,619,400	8,728,566.00	0.16
32	300473	德尔股份	465,500	8,509,340.00	0.15
33	688699	明微电子	210,751	8,503,802.85	0.15
34	600426	华鲁恒升	306,600	8,459,094.00	0.15
35	688468	科美诊断	757,273	8,170,975.67	0.15
36	603660	苏州科达	874,600	7,687,734.00	0.14
37	600732	爱旭股份	426,480	7,523,107.20	0.14
38	300709	精研科技	239,200	7,460,648.00	0.14
39	301201	诚达药业	289,500	7,361,985.00	0.13

40	603727	博迈科	567,800	7,114,534.00	0.13
41	601225	陕西煤业	340,500	7,113,045.00	0.13
42	000876	新希望	755,300	7,039,396.00	0.13
43	002878	元隆雅图	366,900	6,828,009.00	0.12
44	603196	日播时尚	493,400	6,665,834.00	0.12
45	300322	硕贝德	597,038	6,662,944.08	0.12
46	688159	有方科技	175,900	6,622,635.00	0.12
47	601318	中国平安	161,900	6,524,570.00	0.12
48	300625	三雄极光	437,700	6,486,714.00	0.12
49	002673	西部证券	1,006,300	6,410,131.00	0.12
50	002730	电光科技	675,900	6,407,532.00	0.12
51	002664	信质集团	367,200	6,106,536.00	0.11
52	601108	财通证券	776,400	6,024,864.00	0.11
53	600702	舍得酒业	58,000	5,608,600.00	0.10
54	688095	福昕软件	79,200	5,532,120.00	0.10
55	300719	安达维尔	410,450	5,471,298.50	0.10
56	300584	海辰药业	231,300	5,384,664.00	0.10
57	600333	长春燃气	1,053,000	5,328,180.00	0.10
58	002367	康力电梯	701,400	5,274,528.00	0.10
59	301007	德迈仕	310,300	5,247,173.00	0.09
60	000717	中南股份	2,041,500	5,185,410.00	0.09
61	300769	德方纳米	83,600	5,102,108.00	0.09
62	600754	锦江酒店	168,500	5,038,150.00	0.09
63	603800	道森股份	185,000	4,884,000.00	0.09
64	300522	世名科技	355,600	4,800,600.00	0.09
65	600745	闻泰科技	113,400	4,797,954.00	0.09
66	300498	温氏股份	238,500	4,784,310.00	0.09
67	688208	道通科技	199,185	4,730,643.75	0.09
68	000519	中兵红箭	330,400	4,638,816.00	0.08
69	002795	永和智控	600,400	4,484,988.00	0.08
70	300184	力源信息	753,500	4,483,325.00	0.08
71	300136	信维通信	185,400	4,375,440.00	0.08
72	603788	宁波高发	292,900	4,372,997.00	0.08
73	688277	天智航	326,081	4,297,747.58	0.08
74	000925	众合科技	484,600	4,196,636.00	0.08
75	300957	贝泰妮	58,375	3,979,423.75	0.07
76	600346	恒力石化	300,800	3,961,536.00	0.07
77	603258	电魂网络	170,100	3,908,898.00	0.07
78	600213	亚星客车	414,300	3,828,132.00	0.07
79	300606	金太阳	111,600	3,812,256.00	0.07
80	000069	华侨城 A	1,224,200	3,807,262.00	0.07
81	301052	果麦文化	84,900	3,716,922.00	0.07
82	300896	爱美客	12,400	3,649,692.00	0.07

83	002641	公元股份	722,400	3,633,672.00	0.07
84	300030	阳普医疗	458,600	3,554,150.00	0.06
85	300751	迈为股份	27,259	3,530,313.09	0.06
86	600765	中航重机	175,000	3,344,250.00	0.06
87	603387	基蛋生物	303,628	3,339,908.00	0.06
88	002826	易明医药	281,100	3,336,657.00	0.06
89	300001	特锐德	164,991	3,316,319.10	0.06
90	300917	特发服务	127,600	3,230,832.00	0.06
91	000790	华神科技	631,500	3,195,390.00	0.06
92	002687	乔治白	587,500	3,131,375.00	0.06
93	600567	山鹰国际	1,580,900	3,066,946.00	0.06
94	000757	浩物股份	637,500	3,060,000.00	0.06
95	300542	新晨科技	228,700	2,995,970.00	0.05
96	600292	远达环保	481,900	2,925,133.00	0.05
97	688595	芯海科技	65,580	2,839,614.00	0.05
98	600576	祥源文旅	375,600	2,794,464.00	0.05
99	688393	安必平	110,700	2,764,179.00	0.05
100	300238	冠昊生物	194,900	2,642,844.00	0.05
101	002662	京威股份	748,500	2,627,235.00	0.05
102	002820	桂发祥	226,100	2,582,062.00	0.05
103	300446	航天智造	164,400	2,576,148.00	0.05
104	688300	联瑞新材	48,307	2,557,855.65	0.05
105	688165	埃夫特	222,500	2,549,850.00	0.05
106	688550	瑞联新材	63,672	2,526,504.96	0.05
107	000656	金科股份	1,384,200	2,505,402.00	0.05
108	603379	三美股份	72,000	2,448,000.00	0.04
109	603610	麒盛科技	200,700	2,392,344.00	0.04
110	601633	长城汽车	94,400	2,380,768.00	0.04
111	600236	桂冠电力	422,420	2,340,206.80	0.04
112	603278	大业股份	172,800	2,177,280.00	0.04
113	688229	博睿数据	44,600	2,143,922.00	0.04
114	000661	长春高新	14,700	2,143,260.00	0.04
115	001896	豫能控股	488,000	2,132,560.00	0.04
116	601577	长沙银行	310,900	2,120,338.00	0.04
117	603313	梦百合	199,900	2,098,950.00	0.04
118	688138	清溢光电	91,200	2,062,944.00	0.04
119	301152	天力锂能	54,500	1,993,610.00	0.04
120	002558	巨人网络	176,600	1,967,324.00	0.04
121	603259	药明康德	25,900	1,884,484.00	0.03
122	600594	益佰制药	325,600	1,852,664.00	0.03
123	300551	古鳌科技	105,100	1,828,740.00	0.03
124	002793	罗欣药业	314,800	1,687,328.00	0.03
125	688373	盟科药业	252,000	1,645,560.00	0.03

126	603956	威派格	204,400	1,622,936.00	0.03
127	600301	华锡有色	129,000	1,622,820.00	0.03
128	002892	科力尔	100,300	1,613,827.00	0.03
129	300882	万胜智能	65,400	1,593,144.00	0.03
130	300514	友讯达	97,600	1,590,880.00	0.03
131	301149	隆华新材	128,000	1,583,360.00	0.03
132	300902	国安达	43,800	1,543,950.00	0.03
133	688332	中科蓝讯	20,100	1,515,942.00	0.03
134	002133	广宇集团	434,200	1,515,358.00	0.03
135	300660	江苏雷利	48,700	1,473,662.00	0.03
136	002949	华阳国际	105,000	1,466,850.00	0.03
137	688418	震有科技	77,036	1,452,898.96	0.03
138	300429	强力新材	112,700	1,449,322.00	0.03
139	603929	亚翔集成	59,700	1,428,024.00	0.03
140	688222	成都先导	88,776	1,330,752.24	0.02
141	600798	宁波海运	359,600	1,316,136.00	0.02
142	003035	南网能源	245,900	1,293,434.00	0.02
143	688306	均普智能	226,691	1,262,668.87	0.02
144	002947	恒铭达	38,400	1,235,712.00	0.02
145	301339	通行宝	60,900	1,228,962.00	0.02
146	002497	雅化集团	90,400	1,183,336.00	0.02
147	603327	福蓉科技	88,700	1,182,371.00	0.02
148	300193	佳士科技	149,500	1,161,615.00	0.02
149	300534	陇神戎发	116,800	1,152,816.00	0.02
150	300500	启迪设计	80,300	1,150,699.00	0.02
151	688510	航亚科技	64,300	1,132,966.00	0.02
152	000652	泰达股份	282,100	1,097,369.00	0.02
153	600126	杭钢股份	198,700	1,059,071.00	0.02
154	300129	泰胜风能	98,300	1,058,691.00	0.02
155	603076	乐惠国际	38,400	1,029,120.00	0.02
156	300218	安利股份	74,200	1,005,410.00	0.02
157	002372	伟星新材	67,800	981,066.00	0.02
158	603855	华荣股份	44,900	896,204.00	0.02
159	300706	阿石创	32,600	843,688.00	0.02
160	300582	英飞特	63,800	766,238.00	0.01
161	603519	立霸股份	53,500	697,640.00	0.01
162	605188	国光连锁	80,600	685,906.00	0.01
163	002608	江苏国信	103,100	677,367.00	0.01
164	603501	韦尔股份	6,310	673,340.10	0.01
165	688258	卓易信息	12,538	620,631.00	0.01
166	300005	探路者	86,000	569,320.00	0.01
167	300870	欧陆通	12,600	557,802.00	0.01
168	003007	直真科技	16,700	546,090.00	0.01

169	002821	凯莱英	4,500	522,450.00	0.01
170	688180	君实生物	12,371	517,478.93	0.01
171	600481	双良节能	58,100	491,526.00	0.01
172	688601	力芯微	9,200	481,988.00	0.01
173	600581	八一钢铁	133,800	480,342.00	0.01
174	000703	恒逸石化	59,400	399,168.00	0.01
175	688099	晶晨股份	6,350	397,700.50	0.01
176	601568	北元集团	83,205	394,391.70	0.01
177	300403	汉宇集团	41,000	362,850.00	0.01
178	300380	安硕信息	15,800	335,118.00	0.01
179	600184	光电股份	26,400	301,752.00	0.01
180	603686	福龙马	28,300	289,509.00	0.01
181	300228	富瑞特装	39,300	279,030.00	0.01
182	300589	江龙船艇	19,900	276,212.00	0.00
183	002007	华兰生物	11,800	261,134.00	0.00
184	688177	百奥泰	6,080	250,739.20	0.00
185	603848	好太太	14,600	226,008.00	0.00
186	600351	亚宝药业	32,400	223,560.00	0.00
187	300645	正元智慧	11,000	200,090.00	0.00
188	301333	诺思格	2,800	180,544.00	0.00
189	688563	航材股份	1,501	90,795.49	0.00
190	688108	赛诺医疗	6,700	84,085.00	0.00
191	603116	红蜻蜓	8,300	51,958.00	0.00
192	688548	广钢气体	4,048	51,612.00	0.00
193	300730	科创信息	3,200	43,520.00	0.00
194	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.00
195	301487	盟固利	867	35,512.32	0.00
196	688549	中巨芯	4,294	34,738.46	0.00
197	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
198	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
199	688582	芯动联科	648	25,058.16	0.00
200	301559	中集环科	1,315	23,985.60	0.00
201	301486	致尚科技	482	22,774.50	0.00
202	301511	德福科技	982	22,261.94	0.00
203	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
204	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
205	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
206	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
207	688591	泰凌微	681	19,081.62	0.00
208	300904	威力传动	304	18,705.12	0.00
209	301172	君逸数码	438	16,714.08	0.00
210	688612	威迈斯	422	16,023.34	0.00
211	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00

212	301393	昊帆生物	260	15,436.20	0.00
213	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.00
214	601083	锦江航运	1,263	13,981.41	0.00
215	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
216	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
217	301210	金杨股份	281	12,779.88	0.00
218	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
219	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
220	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
221	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
222	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
223	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
224	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
225	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
226	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
227	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
228	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
229	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
230	301372	科净源	231	10,069.29	0.00
231	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
232	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
233	301395	仁信新材	520	9,718.80	0.00
234	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
235	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
236	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
237	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
238	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
239	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
240	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
241	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
242	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
243	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
244	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
245	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
246	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
247	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
248	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
249	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
250	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
251	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
252	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
253	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
254	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00

255	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
256	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
257	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
258	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
259	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
260	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
261	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
262	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
263	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
264	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
265	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
266	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
267	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
268	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
269	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
270	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
271	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
272	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002261	拓维信息	235,074,576.63	5.64
2	002463	沪电股份	215,060,813.76	5.16
3	605589	圣泉集团	195,323,652.93	4.69
4	300502	新易盛	168,683,894.26	4.05
5	688158	优刻得	158,846,575.08	3.81
6	688318	财富趋势	157,848,438.36	3.79
7	300379	东方通	154,218,315.46	3.70
8	688408	中信博	153,749,424.63	3.69
9	000860	顺鑫农业	150,944,940.68	3.62
10	688007	光峰科技	148,998,276.15	3.57
11	002402	和而泰	147,927,614.93	3.55
12	605507	国邦医药	147,676,815.40	3.54
13	300432	富临精工	145,593,422.97	3.49
14	600997	开滦股份	143,843,657.61	3.45
15	300188	国投智能	139,988,306.74	3.36
16	688148	芳源股份	139,729,152.79	3.35
17	600197	伊力特	137,049,457.82	3.29
18	603236	移远通信	136,853,840.03	3.28
19	000928	中钢国际	136,275,952.00	3.27
20	300438	鹏辉能源	135,112,401.84	3.24

21	603396	金辰股份	134,349,989.87	3.22
22	600559	老白干酒	132,060,190.20	3.17
23	002222	福晶科技	131,380,726.16	3.15
24	300768	迪普科技	131,236,766.37	3.15
25	601688	华泰证券	131,012,082.11	3.14
26	601963	重庆银行	129,839,872.39	3.12
27	600977	中国电影	129,538,287.70	3.11
28	002234	民和股份	128,694,559.89	3.09
29	002126	银轮股份	127,373,584.70	3.06
30	300803	指南针	127,204,515.65	3.05
31	603919	金徽酒	127,157,579.00	3.05
32	600789	鲁抗医药	126,668,380.62	3.04
33	002317	众生药业	126,275,629.00	3.03
34	603118	共进股份	125,704,343.60	3.02
35	002948	青岛银行	124,165,237.00	2.98
36	601377	兴业证券	121,415,773.22	2.91
37	002782	可立克	118,694,139.53	2.85
38	688617	惠泰医疗	118,037,714.49	2.83
39	300035	中科电气	117,812,577.32	2.83
40	600338	西藏珠峰	116,737,257.36	2.80
41	688235	百济神州	116,482,696.38	2.79
42	688368	晶丰明源	116,359,277.08	2.79
43	688578	艾力斯	115,635,568.59	2.77
44	600502	安徽建工	115,083,733.61	2.76
45	603108	润达医疗	114,940,625.00	2.76
46	688508	芯朋微	114,165,582.14	2.74
47	600073	上海梅林	114,155,043.80	2.74
48	688018	乐鑫科技	114,109,630.41	2.74
49	002237	恒邦股份	113,643,324.50	2.73
50	603997	继峰股份	113,225,474.34	2.72
51	600572	康恩贝	113,105,070.85	2.71
52	300759	康龙化成	112,950,984.10	2.71
53	002727	一心堂	112,901,880.12	2.71
54	600583	海油工程	112,460,732.65	2.70
55	688066	航天宏图	112,309,402.09	2.69
56	000682	东方电子	112,205,608.26	2.69
57	688023	安恒信息	111,776,349.20	2.68
58	601169	北京银行	111,744,567.00	2.68
59	300348	长亮科技	111,659,627.00	2.68
60	600688	上海石化	110,342,389.38	2.65
61	300567	精测电子	110,239,610.87	2.64
62	300118	东方日升	109,955,884.15	2.64
63	600266	城建发展	109,518,909.64	2.63

64	600750	江中药业	109,146,870.00	2.62
65	300031	宝通科技	109,054,296.68	2.62
66	300458	全志科技	108,761,679.31	2.61
67	002518	科士达	108,715,810.00	2.61
68	300393	中来股份	107,548,611.00	2.58
69	002254	泰和新材	106,928,239.90	2.57
70	600483	福能股份	106,824,546.16	2.56
71	002928	华夏航空	106,698,874.55	2.56
72	002020	京新药业	106,635,709.05	2.56
73	002773	康弘药业	105,812,462.10	2.54
74	603208	江山欧派	104,748,764.09	2.51
75	601939	建设银行	104,337,743.00	2.50
76	002335	科华数据	104,142,588.14	2.50
77	600456	宝钛股份	103,719,662.41	2.49
78	301039	中集车辆	103,512,786.00	2.48
79	300206	理邦仪器	103,475,793.15	2.48
80	603609	禾丰股份	102,954,377.77	2.47
81	600284	浦东建设	102,698,635.84	2.46
82	600667	太极实业	100,742,637.35	2.42
83	600990	四创电子	100,731,586.00	2.42
84	300725	药石科技	100,551,680.41	2.41
85	688321	微芯生物	100,497,237.30	2.41
86	688366	昊海生科	100,308,978.41	2.41
87	300319	麦捷科技	100,257,708.00	2.41
88	688660	电气风电	99,823,083.92	2.39
89	600449	宁夏建材	99,280,649.17	2.38
90	300894	火星人	99,171,806.47	2.38
91	300369	绿盟科技	99,166,645.88	2.38
92	300068	南都电源	98,968,941.58	2.37
93	002233	塔牌集团	98,908,794.82	2.37
94	300096	ST 易联众	98,840,348.80	2.37
95	600645	中源协和	97,932,687.63	2.35
96	000801	四川九洲	97,746,875.00	2.35
97	688520	神州细胞	97,664,460.15	2.34
98	300377	赢时胜	96,185,857.00	2.31
99	002675	东诚药业	95,825,127.70	2.30
100	002389	航天彩虹	95,630,366.83	2.29
101	688798	艾为电子	95,593,135.55	2.29
102	000657	中钨高新	95,220,713.29	2.28
103	600602	云赛智联	94,271,016.26	2.26
104	300232	洲明科技	94,179,875.00	2.26
105	300394	天孚通信	94,177,682.48	2.26
106	002287	奇正藏药	93,039,029.00	2.23

107	300659	中孚信息	92,853,927.21	2.23
108	688116	天奈科技	92,264,060.11	2.21
109	002698	博实股份	92,108,930.30	2.21
110	603179	新泉股份	91,914,815.00	2.21
111	600158	中体产业	90,856,695.00	2.18
112	002068	黑猫股份	90,408,926.00	2.17
113	000690	宝新能源	89,967,800.00	2.16
114	002534	西子洁能	89,793,013.10	2.15
115	688277	天智航	89,701,370.55	2.15
116	002405	四维图新	89,698,435.00	2.15
117	002851	麦格米特	89,274,795.49	2.14
118	000528	柳工	88,940,872.55	2.13
119	688499	利元亨	88,607,745.07	2.13
120	000676	智度股份	88,471,460.00	2.12
121	603308	应流股份	88,358,092.79	2.12
122	603368	柳药集团	87,911,429.01	2.11
123	601801	皖新传媒	87,843,219.98	2.11
124	603517	绝味食品	86,703,787.61	2.08
125	300002	神州泰岳	86,373,916.00	2.07
126	603505	金石资源	86,231,324.07	2.07
127	688389	普门科技	86,121,711.21	2.07
128	000550	江铃汽车	85,885,096.64	2.06
129	600685	中船防务	85,705,433.97	2.06
130	300303	聚飞光电	85,552,079.00	2.05
131	600966	博汇纸业	85,508,340.77	2.05
132	002320	海峡股份	85,343,540.97	2.05
133	002558	巨人网络	85,083,674.00	2.04
134	600933	爱柯迪	85,022,825.39	2.04
135	600675	中华企业	84,894,284.18	2.04
136	300166	东方国信	84,760,952.57	2.03
137	600038	中直股份	84,587,136.00	2.03
138	000969	安泰科技	84,531,132.48	2.03
139	603728	鸣志电器	84,516,396.00	2.03
140	600586	金晶科技	84,255,827.13	2.02
141	300087	荃银高科	83,863,971.32	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	002463	沪电股份	252,156,561.44	6.05
2	002261	拓维信息	225,550,034.18	5.41
3	000860	顺鑫农业	204,826,872.52	4.91

4	603118	共进股份	195,444,094.46	4.69
5	300188	国投智能	193,035,789.40	4.63
6	688318	财富趋势	169,828,339.57	4.07
7	300567	精测电子	167,301,160.17	4.01
8	605589	圣泉集团	165,924,138.78	3.98
9	605507	国邦医药	164,590,650.71	3.95
10	600197	伊力特	162,980,634.22	3.91
11	300379	东方通	156,498,105.97	3.75
12	600789	鲁抗医药	155,361,579.30	3.73
13	600502	安徽建工	152,408,547.97	3.66
14	300502	新易盛	146,343,437.87	3.51
15	000928	中钢国际	143,088,143.12	3.43
16	300114	中航电测	142,518,312.58	3.42
17	603108	润达医疗	142,502,106.26	3.42
18	600997	开滦股份	142,058,714.32	3.41
19	002222	福晶科技	140,213,785.82	3.36
20	300348	长亮科技	136,027,082.15	3.26
21	600073	上海梅林	134,143,080.06	3.22
22	002402	和而泰	133,723,333.54	3.21
23	002675	东诚药业	131,922,201.78	3.16
24	002126	银轮股份	131,810,576.36	3.16
25	688408	中信博	129,860,326.37	3.12
26	300118	东方日升	128,539,979.45	3.08
27	002234	民和股份	125,825,509.72	3.02
28	600688	上海石化	125,239,112.00	3.00
29	600977	中国电影	125,205,577.73	3.00
30	000539	粤电力 A	125,122,440.44	3.00
31	600559	老白干酒	124,980,938.10	3.00
32	002237	恒邦股份	124,785,982.50	2.99
33	688578	艾力斯	124,347,124.16	2.98
34	002317	众生药业	123,152,227.46	2.95
35	600583	海油工程	122,534,969.10	2.94
36	688520	神州细胞	121,792,258.38	2.92
37	300803	指南针	121,562,091.92	2.92
38	603368	柳药集团	120,217,276.23	2.88
39	688148	芳源股份	118,436,451.67	2.84
40	600685	中船防务	118,221,881.70	2.84
41	688007	光峰科技	118,125,482.88	2.83
42	300487	蓝晓科技	117,319,968.28	2.81
43	600933	爱柯迪	116,966,707.09	2.81
44	002020	京新药业	116,909,249.17	2.80
45	002698	博实股份	115,780,166.10	2.78
46	603396	金辰股份	115,507,563.91	2.77

47	688617	惠泰医疗	114,866,644.46	2.76
48	002851	麦格米特	113,517,987.38	2.72
49	603997	继峰股份	112,428,997.42	2.70
50	301039	中集车辆	111,472,563.65	2.67
51	300438	鹏辉能源	109,304,423.87	2.62
52	601169	北京银行	109,080,456.04	2.62
53	688066	航天宏图	108,223,722.37	2.60
54	601688	华泰证券	108,208,433.65	2.60
55	002782	可立克	107,235,263.75	2.57
56	600338	西藏珠峰	106,559,883.44	2.56
57	002518	科士达	105,706,220.44	2.54
58	688158	优刻得	104,196,925.13	2.50
59	000682	东方电子	103,360,334.28	2.48
60	002727	一心堂	103,237,447.09	2.48
61	600572	康恩贝	102,347,735.00	2.46
62	600266	城建发展	102,122,309.63	2.45
63	002534	西子洁能	102,088,722.16	2.45
64	603208	江山欧派	101,741,538.85	2.44
65	002233	塔牌集团	101,414,690.38	2.43
66	603236	移远通信	101,086,622.15	2.43
67	300768	迪普科技	101,060,024.25	2.42
68	688508	芯朋微	100,008,826.04	2.40
69	300432	富临精工	99,848,775.37	2.40
70	601939	建设银行	99,564,612.86	2.39
71	300607	拓斯达	99,554,115.99	2.39
72	002697	红旗连锁	99,529,862.80	2.39
73	300659	中孚信息	99,477,041.28	2.39
74	300096	ST 易联众	99,452,518.84	2.39
75	300328	宜安科技	99,419,326.41	2.39
76	688389	普门科技	99,377,695.08	2.38
77	300393	中来股份	98,904,390.05	2.37
78	688037	芯源微	98,755,567.52	2.37
79	600667	太极实业	98,682,141.96	2.37
80	300527	中船应急	98,570,420.68	2.36
81	603466	风语筑	98,124,201.55	2.35
82	603179	新泉股份	98,104,498.70	2.35
83	601377	兴业证券	98,070,294.20	2.35
84	600483	福能股份	97,708,833.23	2.34
85	300759	康龙化成	97,118,739.80	2.33
86	600456	宝钛股份	96,880,673.92	2.32
87	688023	安恒信息	96,860,080.47	2.32
88	600750	江中药业	96,804,129.60	2.32
89	300602	飞荣达	96,722,461.13	2.32

90	300143	盈康生命	96,378,193.16	2.31
91	601949	中国出版	96,078,725.48	2.31
92	002389	航天彩虹	96,029,632.92	2.30
93	300031	宝通科技	95,782,355.13	2.30
94	002320	海峡股份	95,553,279.26	2.29
95	300596	利安隆	95,461,076.12	2.29
96	603919	金徽酒	94,704,632.83	2.27
97	603609	禾丰股份	93,582,308.00	2.25
98	002254	泰和新材	93,347,902.13	2.24
99	600158	中体产业	92,863,483.53	2.23
100	600966	博汇纸业	92,617,603.00	2.22
101	300394	天孚通信	92,341,190.89	2.22
102	600990	四创电子	92,232,249.70	2.21
103	688660	电气风电	92,162,437.48	2.21
104	000657	中钨高新	92,130,261.88	2.21
105	688366	昊海生科	91,942,298.69	2.21
106	002335	科华数据	91,850,863.39	2.20
107	603960	克来机电	89,761,063.04	2.15
108	002446	盛路通信	89,584,060.23	2.15
109	600363	联创光电	89,439,055.10	2.15
110	300206	理邦仪器	89,071,018.00	2.14
111	603533	掌阅科技	88,186,482.41	2.12
112	300303	聚飞光电	87,875,899.31	2.11
113	300068	南都电源	87,320,953.03	2.09
114	300672	国科微	87,058,607.61	2.09
115	600129	太极集团	87,058,159.13	2.09
116	300377	赢时胜	87,036,782.87	2.09
117	000426	兴业银锡	86,099,659.00	2.07
118	002421	达实智能	85,790,335.70	2.06
119	600587	新华医疗	85,477,986.57	2.05
120	600072	中船科技	85,221,342.00	2.04
121	688368	晶丰明源	85,214,439.55	2.04
122	603505	金石资源	85,049,503.86	2.04
123	688798	艾为电子	84,932,552.83	2.04
124	002928	华夏航空	84,876,659.29	2.04
125	688277	天智航	84,834,055.38	2.04
126	603660	苏州科达	84,797,457.07	2.03
127	600284	浦东建设	84,552,584.07	2.03
128	000528	柳工	84,346,095.57	2.02
129	603517	绝味食品	84,164,546.19	2.02
130	600211	西藏药业	83,930,176.16	2.01
131	300773	拉卡拉	83,648,501.20	2.01

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	52,137,518,192.08
卖出股票收入（成交）总额	50,144,689,192.95

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，青岛银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会青岛监管局的处罚，本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门

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。

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	6,326,995.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,326,995.74

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	138,558	16,337.35	889,973,628.93	39.32	1,373,697,033.96	60.68

增强 A						
万家中证 1000 指数增强 C	102,194	25,948.35	1,113,307,066.11	41.98	1,538,458,666.10	58.02
合计	236,522	20,782.15	2,003,280,695.04	40.75	2,912,155,700.06	59.25

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	689,687.48	0.0305
	万家中证 1000 指数增强 C	53,711.10	0.0020
	合计	743,398.58	0.0151

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

本基金成立后有 9,887,305.69 份为发起式份额，发起份额承诺的有效期限为 2018 年 12 月 3 日（合同生效日）起 3 年。截至本报告期末，最低持有期限届满，发起资金持有份额为 0.00 份。

§ 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	1,797,157,489.39	1,604,589,814.97
本报告期基金总申购份额	2,562,467,583.33	6,013,804,829.02
减：本报告期基金总赎回份额	2,095,954,409.83	4,966,628,911.78
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,263,670,662.89	2,651,765,732.21

§ 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：

2023 年 11 月 22 日，公司聘任乔亮先生担任公司副总经理。

基金托管人：

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况未发生改变。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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，基金托管人及其高级管理人员没有受到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	102,255,255,873.92	100.00	63,530,468.10	100.00	-

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

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

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用券商结算模式进行证券交易和结算的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持；
- 4) 资金划付、交收、调整、差异处理及时，且基金交易、结算、对账等数据的提供能满足券商结算模式下 T+0 估值的时效性要求。

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

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于新增平安银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通基金定投	指定媒介	2023 年 1 月 5 日

	业务及参与其费率优惠活动的公告		
2	关于万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	指定媒介	2023 年 1 月 9 日
3	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增攀赢基金为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 1 月 11 日
4	万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金分红公告	指定媒介	2023 年 1 月 12 日
5	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中证金牛(北京)基金销售有限公司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	2023 年 1 月 13 日
6	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在渤海证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 1 月 16 日
7	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在红塔证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 1 月 17 日
8	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在济安财富开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 1 月 18 日
9	关于万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金恢复大额申购（含转换转入、定期定额投资）的公告	指定媒介	2023 年 1 月 18 日
10	万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	指定媒介	2023 年 1 月 20 日
11	万家基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在北京中植基金销售有限公司定投起点的公告	指定媒介	2023 年 1 月 20 日
12	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在东莞证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 1 月 31 日
13	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳前海微众银行股份有限公司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	2023 年 2 月 13 日
14	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在民生证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 2 月 14 日
15	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东莞银行为销售机构并开通	指定媒介	2023 年 2 月 15 日

	转换、基金定投业务的公告		
16	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在万联证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 2 月 16 日
17	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增民商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	2023 年 2 月 16 日
18	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在江海证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 2 月 17 日
19	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在东北证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 2 月 18 日
20	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在粤开证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 2 月 28 日
21	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金参加湘财证券股份有限公司费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 3 月 1 日
22	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在兴业证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 3 月 8 日
23	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在华林证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 3 月 9 日
24	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在方正证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 3 月 9 日
25	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在国盛证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 3 月 23 日
26	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	指定媒介	2023 年 3 月 30 日
27	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在陆享基金开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 4 月 4 日
28	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华夏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	2023 年 4 月 10 日
29	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在东方证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 4 月 13 日

30	万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	指定媒介	2023 年 4 月 21 日
31	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增泉州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	2023 年 4 月 26 日
32	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增光大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	2023 年 4 月 27 日
33	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在华创证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 5 月 16 日
34	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增杭州银行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	2023 年 5 月 17 日
35	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在天风证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 6 月 2 日
36	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在东方证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 7 月 6 日
37	万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	指定媒介	2023 年 7 月 20 日
38	关于新增农业银行为万家基金管理有限公司旗下基金销售机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	指定媒介	2023 年 7 月 27 日
39	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在西部证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 8 月 8 日
40	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在中航证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 8 月 11 日
41	万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年中期报告	指定媒介	2023 年 8 月 30 日
42	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海浦东发展银行股份有限公司为销售机构并开通转换、基金定投业务的公告	指定媒介	2023 年 9 月 7 日
43	万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书更新(2023 年第 1 号)	指定媒介	2023 年 9 月 19 日
44	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	2023 年 9 月 19 日
45	万家基金管理有限公司关于旗下基金	指定媒介	2023 年 10 月 12 日

	在麦高证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告		
46	万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	指定媒介	2023 年 10 月 24 日
47	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增博时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	2023 年 11 月 18 日
48	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在华福证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 11 月 29 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20231226-20231231	-	999,254,687.96	-	999,254,687.96	20.33
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。</p> <p>未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》。
- 4、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年年度报告原文。
- 5、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。
- 7、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。

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

2024 年 3 月 29 日