

万家颐达灵活配置混合型证券投资基金 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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	18
§ 6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	24
§ 8 投资组合报告	58

8.1 期末基金资产组合情况	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	59
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	106
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	106
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	106
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	106
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	106
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	106
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	106
8.12 投资组合报告附注	106
§ 9 基金份额持有人信息	107
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	107
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	108
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	108
§ 10 开放式基金份额变动	108
§ 11 重大事件揭示	109
11.1 基金份额持有人大会决议	109
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	109
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	109
11.4 基金投资策略的改变	109
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	109
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	109
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	109
11.8 其他重大事件	113
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	115
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	115
§ 13 备查文件目录	116
13.1 备查文件目录	116
13.2 存放地点	116
13.3 查阅方式	116

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家颐达灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	万家颐达	
基金主代码	519197	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 6 月 11 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	619,673,569.92 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	万家颐达 A	万家颐达 C
下属分级基金的交易代码	519197	019077
报告期末下属分级基金的份额总额	600,194,326.45 份	19,479,243.47 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1、资产配置策略；2、股票投资策略（（1）行业配置策略、（2）个股投资策略、（3）参与融资业务的投资策略、（4）存托凭证投资策略）；3、债券投资策略（（1）在债券投资方面，本基金将主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。（2）证券公司短期公司债券投资策略。（3）中小企业私募债投资策略）；4、资产支持证券投资策略；5、衍生产品投资策略（（1）股指期货投资策略、（2）国债期货投资策略、（3）期权投资策略、（4）权证投资策略、（5）本基金将关注其他金融衍生产品的推出情况，谨慎地进行投资）；6、其他。
业绩比较基准	50%×沪深 300 指数收益率+50%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、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	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	兰剑	龚小武
	联系电话	021-38909626	021-52629999-212056
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话		4008880800	95561
传真		021-38909627	021-62159217

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）	福建省福州市台江区江滨中大 道 398 号兴业银行大厦
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）	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码	200122	200120
法定代表人	方一天	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
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	2023 年 8 月 17 日-2023 年 12 月 31 日	2022 年	2021 年
	万家颐达 A	万家颐达 C	万家颐达 A	万家颐达 A
本期已实现 收益	-48,547,153.84	-323,423.84	-22,299,669.47	41,164,330.67
本期利润	-49,515,523.43	208,454.48	-29,449,101.10	28,523,445.77
加权平均基 金份额本期 利润	-0.0941	0.0130	-0.1080	0.0495
本期加权平 均净值利润 率	-8.58%	1.19%	-9.80%	4.39%
本期基金份 额净值增长 率	3.13%	-1.70%	-8.84%	4.69%
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	-41,909,883.90	-1,389,586.45	-3,976,649.34	38,042,984.03

期末可供分配基金份额利润	-0.0698	-0.0713	-0.0335	0.0858
期末基金资产净值	648,838,723.66	21,022,474.05	124,391,265.20	509,880,927.81
期末基金份额净值	1.0810	1.0792	1.0482	1.1499
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	19.03%	-1.70%	15.42%	26.62%

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）。

4、自 2023 年 8 月 17 日起，增设本基金 C 类份额，详情请参阅相关公告。

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

万家颐达 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	0.59%	1.11%	-3.14%	0.39%	3.73%	0.72%
过去六个月	-6.33%	1.10%	-4.64%	0.42%	-1.69%	0.68%
过去一年	3.13%	0.99%	-3.88%	0.42%	7.01%	0.57%
过去三年	-1.58%	0.70%	-13.10%	0.56%	11.52%	0.14%
自基金合同生效起至今	19.03%	0.61%	8.50%	0.58%	10.53%	0.03%

万家颐达 C

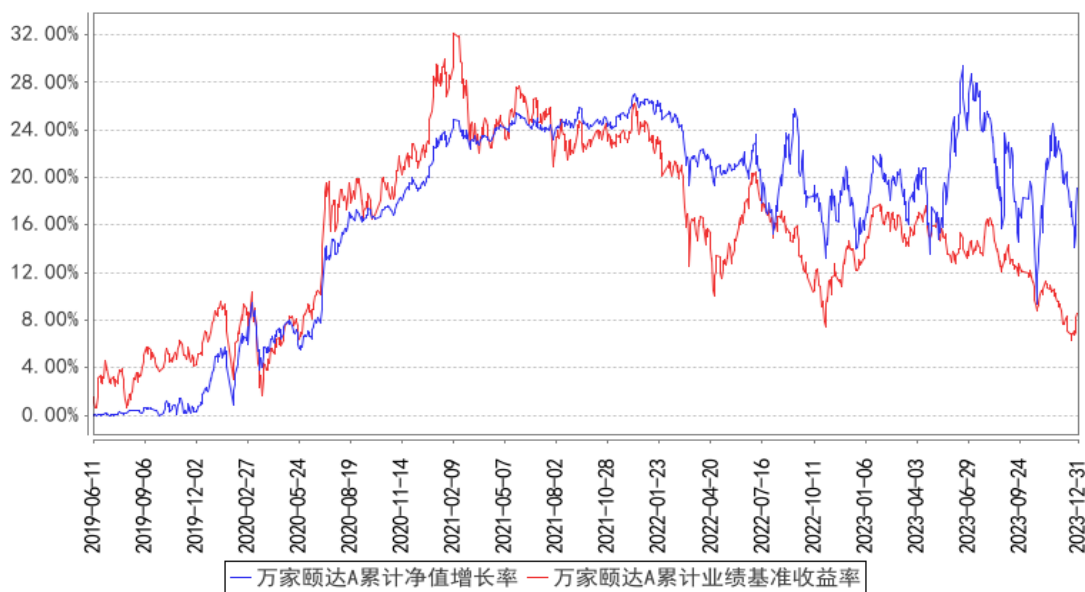
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

		②	率③	准差④		
过去三个月	0.50%	1.11%	-3.14%	0.39%	3.64%	0.72%
自基金合同生效起至今	-1.70%	1.19%	-4.84%	0.40%	3.14%	0.79%

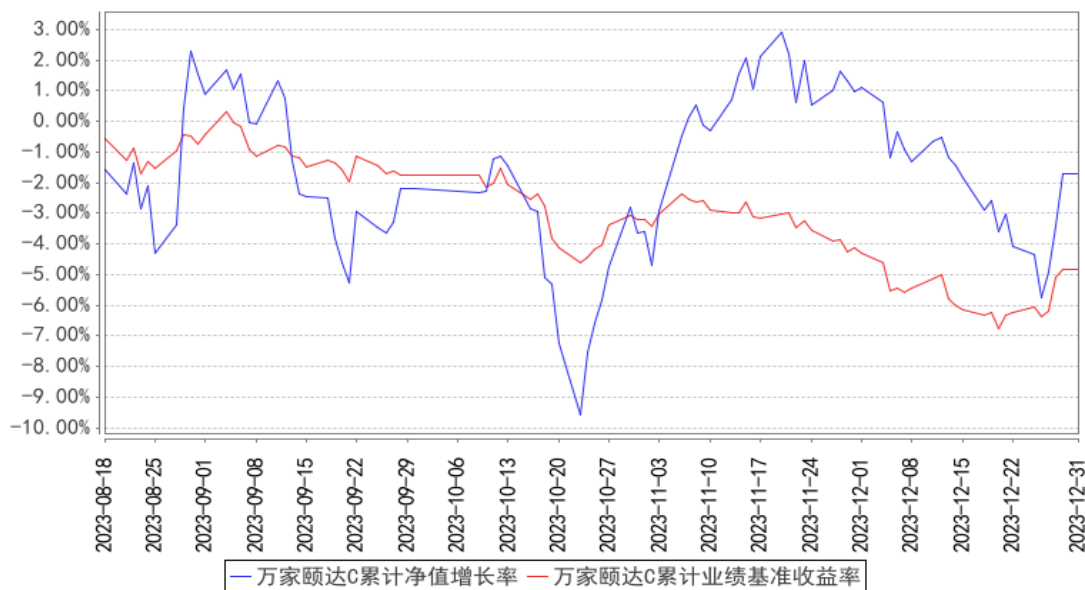
注：万家颐达 C 上述“自基金合同生效起至今”实际为“自基金份额类别首次确认起至今”，下同。

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

万家颐达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



万家颐达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



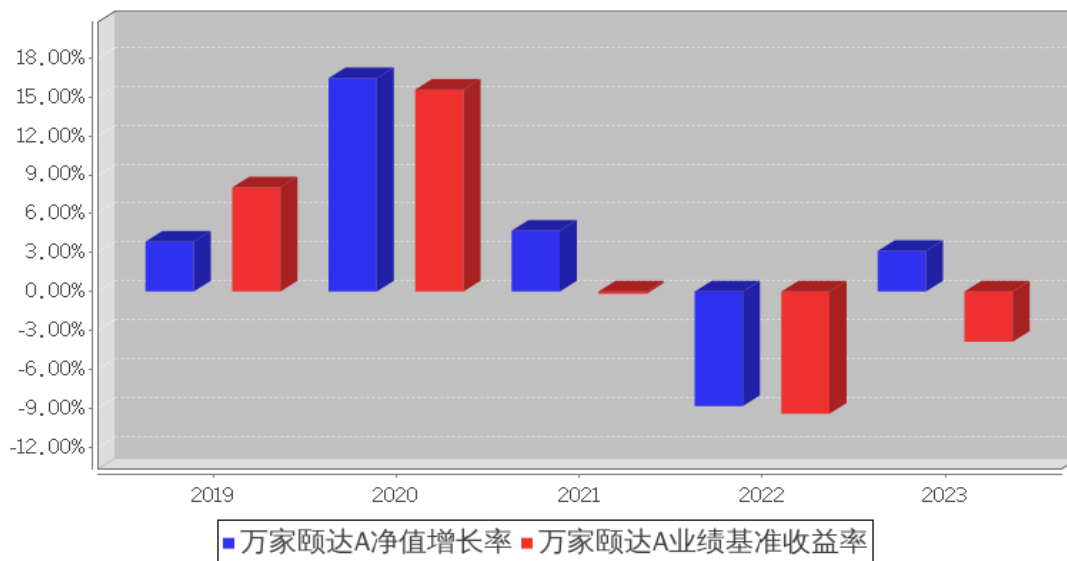
注：1、本基金于 2019 年 6 月 11 日成立，根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合

法律法规和基金合同要求。

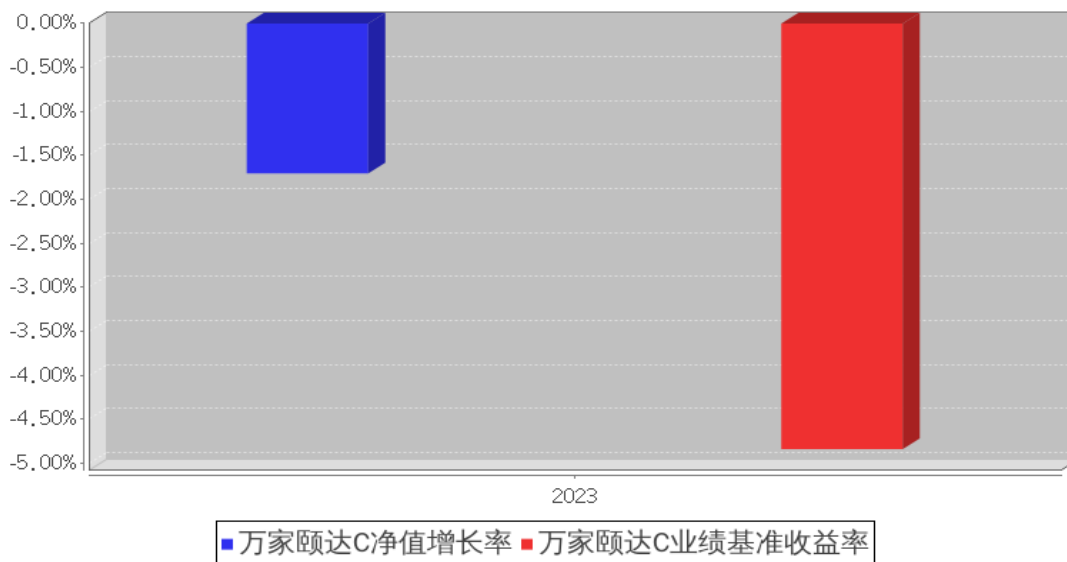
2、自 2023 年 8 月 17 日起增设本基金 C 类份额，2023 年 8 月 18 日起确认有 C 类份额登记在册。

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

万家颐达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



万家颐达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

本基金过去三年未分配利润。

§ 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、万家家享中短债债券型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家 1-3 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家瑞隆混合型证券投资基金、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家现金增利货币市场基金、万家消费成长股票型证券投资基金、万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家玖盛纯债 9 个月定期开放债券型证券投资基金、万家天添宝货币市场基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、万家家瑞债券型证券投资基金、万家臻选混合型证券投资基金、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金、万家成长优选灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金、万家经济新动能混合型证券投资基金、万家潜力价值灵活配置混合型证券投资基金、万家量化同顺多策略灵活配

置混合型证券投资基金、万家新机遇龙头企业灵活配置混合型证券投资基金、万家智造优势混合型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型证券投资基金、万家人工智能混合型证券投资基金、万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金（LOF）、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、万家平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、万家科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、万家鑫盛纯债债券型证券投资基金、万家民安增利 12 个月定期开放债券型证券投资基金、万家汽车新趋势混合型证券投资基金、万家惠享 39 个月定期开放债券型证券投资基金、万家科技创新混合型证券投资基金、万家自主创新混合型证券投资基金、万家民丰回报一年持有期混合型证券投资基金、万家可转债债券型证券投资基金、万家民瑞祥和 6 个月持有期债券型证券投资基金、万家价值优势一年持有期混合型证券投资基金、万家养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、万家鑫动力月月购一年滚动持有混合型证券投资基金、万家科创板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家创业板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家周期优势企业混合型证券投资基金、万家健康产业混合型证券投资基金、万家互联互通中国优势量化策略混合型证券投资基金、万家战略发展产业混合型证券投资基金、万家创业板指数增强型证券投资基金、万家陆家嘴金融城金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家内需增长一年持有期混合型证券投资基金、万家互联互通核心资产量化策略混合型证券投资基金、万家民瑞祥明 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家瑞泽回报一年持有期混合型证券投资基金、万家惠裕回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家悦兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金、万家稳鑫 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、万家全球成长一年持有期混合型证券投资基金（QDII）、万家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	2023 年 2 月 24 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。

	<p>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、万家瑞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</p>				
<p>章恒</p>	<p>万家双利债券型证券投资基金、万家惠利债券型证券投资基金、万家民丰回报一年持有期混合型证券投资基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家颐和</p>	<p>2022 年 6 月 22 日</p>	<p>2023 年 7 月 26 日</p>	<p>16.5 年</p>	<p>国籍：中国；学历：清华大学计算机科学与技术专业硕士，2019 年 1 月再次入职万家基金管理有限公司，现任权益投资部基金经理，同时兼任投资经理，历任投资研究部研究员、专户投资部投资经理。曾任东方基金管理股份有限公司投研部研究员，天弘基金管理有限公司投研部研究员，万家基金管理有限公司投资研究部研究员、基金经理，上海合象资产管理有限公司总经理兼投资总监等职。</p>

	灵活配置混合型证券投资基金、万家颐德一年持有期混合型证券投资基金、万家颐达灵活配置混合型证券投资基金、万家颐远均衡一年持有期混合型发起式证券投资基金的基金经理				
--	---	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

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

本产品投资策略以中、小盘股为股票池，通过我们的量化选股和行业配置策略，主动适应不同的市场风格，前瞻性选股，提高选股胜率，以追求能获得长期稳定的收益。万家颐达的股票投资在风格配置上相对均衡，行业配置偏向于行业景气度高的行业。在量化选股方面精选行业内质优个股组合，持股较为分散。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家颐达 A 的基金份额净值为 1.0810 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.13%，同期业绩比较基准收益率为-3.88%；截至本报告期末万家颐达 C 的基金份额净值为 1.0792 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.70%，同期业绩比较基准收益率为-4.84%。

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面意见建议，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

本基金本报告期内未实施利润分配，符合基金合同的规定。

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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在

本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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 ZA30184 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	万家颐达灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了万家颐达灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“万家颐达”）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。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（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，公允反映了万家颐达 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。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于万家颐达，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>万家颐达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。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估万家颐达的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运</p>

	<p>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颐达的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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，就可能对万家颐达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颐达不能持续经营。</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>
会计师事务所的名称	立信会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	朱颖 杨利敏
会计师事务所的地址	中国·上海
审计报告日期	2024 年 03 月 28 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：万家颐达灵活配置混合型证券投资基金

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	67,881,464.09	60,097,189.79
结算备付金		6,018,594.25	630,567.87
存出保证金		500,931.75	65,285.88
交易性金融资产	7.4.7.2	610,867,039.54	59,959,498.48
其中：股票投资		610,867,039.54	55,003,007.00
基金投资		-	-
债券投资		-	4,956,491.48
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	-	34,005,734.54
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		21,010,355.05	-
应收股利		-	-
应收申购款		77,465.58	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		706,355,850.26	154,758,276.56
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		4,199,843.34	50,609.54
应付赎回款		26,575,088.21	29,502,690.10
应付管理人报酬		755,119.54	241,896.83
应付托管费		125,853.26	40,316.16
应付销售服务费		9,560.72	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	8.45

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	4,829,187.48	531,490.28
负债合计		36,494,652.55	30,367,011.36
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	619,673,569.92	118,668,103.50
其他综合收益	7.4.7.8	-	-
未分配利润	7.4.7.9	50,187,627.79	5,723,161.70
净资产合计		669,861,197.71	124,391,265.20
负债和净资产总计		706,355,850.26	154,758,276.56

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 619,673,569.92 份，其中万家颐达 A 基金份额净值 1.0810 元，基金份额总额 600,194,326.45 份；万家颐达 C 基金份额净值 1.0792 元，基金份额总额 19,479,243.47 份。

7.2 利润表

会计主体：万家颐达灵活配置混合型证券投资基金

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		-40,134,496.24	-23,641,911.83
1. 利息收入		326,562.61	324,339.29
其中：存款利息收入	7.4.7.10	321,119.07	44,435.17
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		5,443.54	279,904.12
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-42,496,743.36	-16,965,379.59
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-47,109,205.27	-26,768,124.22
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	1,110,685.53	7,376,827.91
资产支持证券投资	7.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	3,501,776.38	2,425,916.72
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	-436,491.27	-7,149,431.63
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	2,472,175.78	148,560.10
减：二、营业总支出		9,172,572.71	5,807,189.27
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	7,662,525.61	4,587,746.48
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,277,087.56	764,624.43
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	32,189.60	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	231,237.69
其中：卖出回购金融资产支出		-	231,237.69
6. 信用减值损失	7.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		24.12	7,873.66
8. 其他费用	7.4.7.20	200,745.82	215,707.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-49,307,068.95	-29,449,101.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-49,307,068.95	-29,449,101.10
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-49,307,068.95	-29,449,101.10

7.3 净资产变动表

会计主体：万家颐达灵活配置混合型证券投资基金

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	118,668,103.50	-	5,723,161.70	124,391,265.20
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	118,668,103.50	-	5,723,161.70	124,391,265.20
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	501,005,466.42	-	44,464,466.09	545,469,932.51
(一)、综合收益总额	-	-	-49,307,068.95	-49,307,068.95
(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)	501,005,466.42	-	93,771,535.04	594,777,001.46
其中：1. 基金申购款	1,364,520,122.31	-	167,958,092.00	1,532,478,214.31
2. 基金赎回款	-863,514,655.89	-	-74,186,556.96	-937,701,212.85
(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	619,673,569.92	-	50,187,627.79	669,861,197.71
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	443,423,678.08	-	66,457,249.73	509,880,927.81
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	443,423,678.08	-	66,457,249.73	509,880,927.81
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-324,755,574.58	-	-60,734,088.03	-385,489,662.61

(一)、综合收益总额	-	-	-29,449,101.10	-29,449,101.10
(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)	-324,755,574.58	-	-31,284,986.93	-356,040,561.51
其中：1. 基金申购款	24,896,048.75	-	2,217,492.86	27,113,541.61
2. 基金赎回款	-349,651,623.33	-	-33,502,479.79	-383,154,103.12
(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	118,668,103.50	-	5,723,161.70	124,391,265.20

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

万家颐达灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由万家颐达保本混合型证券投资基金转型而来。根据原《万家颐达保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，万家颐达保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期后，转型为本基金，本次转型无需经基金份额持有人大会决议。自 2019 年 6 月 11 日起，《万家颐达保本混合型证券投资基金基金合同》失效，《万家颐达灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同时生效。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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《万家颐达灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，经与本基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，2023 年 8 月 17 日起，本基金增设 C 类基金份额。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会核准上市的股票、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、证券公司短期公司债、中小企业私募债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、国债期货、股指期货、期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可以参与融资交易。本基金的业绩比较基准为： $50\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+50\% \times$ 上证国债指数收益率。

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商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

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

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

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。

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、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多为 12 次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，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；基金份额持有人选择采取红利再投资形式的，分红资金将按红利发放日的该类基金份额净值转成相应类别的基金份额，红利再投资的份额免收申购费；同一投资者持有的某一类基金份额只能选择一种分红方式，如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；
- 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、本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；
- 5、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	上年度末
	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
活期存款	67,881,464.09	60,097,189.79
等于：本金	67,875,797.82	60,091,948.94
加：应计利息	5,666.27	5,240.85
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	67,881,464.09	60,097,189.79

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	617,484,043.91	-	610,867,039.54	-6,617,004.37
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	617,484,043.91	-	610,867,039.54	-6,617,004.37
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	61,170,819.30	-	55,003,007.00	-6,167,812.30
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	3,234.08	4,956,491.48	-12,700.80
	银行间市场	-	-	-
	合计	3,234.08	4,956,491.48	-12,700.80
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	66,136,777.50	3,234.08	59,959,498.48	-6,180,513.10

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2022年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	34,005,734.54	-
合计	34,005,734.54	-

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	63,718.15	-
应付证券出借违约金	-	-

应付交易费用	4,610,469.33	246,490.28
其中：交易所市场	4,610,469.33	244,633.39
银行间市场	-	1,856.89
应付利息	-	-
预提费用	155,000.00	285,000.00
合计	4,829,187.48	531,490.28

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

万家颐达 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	118,668,103.50	118,668,103.50
本期申购	1,296,745,344.73	1,296,745,344.73
本期赎回（以“-”号填列）	-815,219,121.78	-815,219,121.78
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	600,194,326.45	600,194,326.45

万家颐达 C

项目	本期 2023 年 8 月 17 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	67,774,777.58	67,774,777.58
本期赎回（以“-”号填列）	-48,295,534.11	-48,295,534.11
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	19,479,243.47	19,479,243.47

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

万家颐达 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,976,649.34	9,699,811.04	5,723,161.70
加：会计政策变更	-	-	-

前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-3,976,649.34	9,699,811.04	5,723,161.70
本期利润	-48,547,153.84	-968,369.59	-49,515,523.43
本期基金份额交易产生的变动数	10,613,919.28	81,822,839.66	92,436,758.94
其中：基金申购款	-22,979,558.89	185,323,967.35	162,344,408.46
基金赎回款	33,593,478.17	-103,501,127.69	-69,907,649.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-41,909,883.90	90,554,281.11	48,644,397.21

万家颐达 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-323,423.84	531,878.32	208,454.48
本期基金份额交易产生的变动数	-1,066,162.61	2,400,938.71	1,334,776.10
其中：基金申购款	-4,062,904.74	9,676,588.28	5,613,683.54
基金赎回款	2,996,742.13	-7,275,649.57	-4,278,907.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,389,586.45	2,932,817.03	1,543,230.58

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	240,173.26	30,144.65
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	68,531.30	13,258.86
其他	12,414.51	1,031.66
合计	321,119.07	44,435.17

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	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
股票投资收益——买卖	-47,109,205.27	-26,768,124.22

股票差价收入		
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	-47,109,205.27	-26,768,124.22

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	6,858,410,255.38	337,393,508.14
减：卖出股票成本总额	6,886,212,966.69	363,176,727.24
减：交易费用	19,306,493.96	984,905.12
买卖股票差价收入	-47,109,205.27	-26,768,124.22

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	6,701.28	5,719,705.57
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,103,984.25	1,657,122.34
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	1,110,685.53	7,376,827.91

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	6,080,321.65	606,214,024.01
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,965,958.20	594,184,974.69
减：应计利息总额	10,136.18	10,366,651.37
减：交易费用	243.02	5,275.61
买卖债券差价收入	1,103,984.25	1,657,122.34

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	3,501,776.38	2,425,916.72
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,501,776.38	2,425,916.72

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	-436,491.27	-7,149,431.63
股票投资	-449,192.07	-5,039,531.15
债券投资	12,700.80	-2,109,900.48
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	-436,491.27	-7,149,431.63

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	2,390,923.07	147,960.93
基金转换费收入	81,252.71	599.17
合计	2,472,175.78	148,560.10

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	35,000.00	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	8,865.82	13,807.01
账户维护费	36,880.00	36,900.00
合计	200,745.82	215,707.01

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

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。

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

兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	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
万家共赢资产管理有限公司（“万家共赢”）	基金管理人的子公司
万家财富基金销售（天津）有限公司（“万家财富”）	基金管理人的子公司、基金销售机构
上海万家朴智投资管理有限公司（“万家朴智”）	基金管理人控制的公司
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

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
中泰证券	1,609,443,385.49	11.26	392,905,108.78	62.61

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
中泰证券	-	-	51,846,731.51	47.85

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
中泰证券	-	-	1,322,600,000.00	89.49

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
中泰证券	1,498,881.67	11.31	-	-
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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
中泰证券	367,672.37	62.73	26,157.01	10.69

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	7,662,525.61	4,587,746.48
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,208,953.12	38,476.94
应支付基金管理人的净管理费	6,453,572.49	4,549,269.54

注：2023年8月21日前，基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率计提；自2023年8月21日起，基金管理费按前一日基金资产净值的1.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 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	1,277,087.56	764,624.43

注：2023 年 8 月 21 日前，本基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提；2023 年 8 月 21 日起，本基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等，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		
	万家颐达 A	万家颐达 C	合计
万家基金	-	1,740.15	1,740.15
合计	-	1,740.15	1,740.15
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		
	万家颐达 A	万家颐达 C	合计
合计	-	-	-

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 0.50%。

销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	本期 2023 年 8 月 17 日至 2023 年 12 月 31 日
	万家颐达 A	万家颐达 C
基金合同生效日（2019 年 6 月 11 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	9,411,709.34	-
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	9,411,709.34	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.5681%	-
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月	上年度可比期间 -

	31 日	
	万家颐达 A	万家颐达 C
基金合同生效日（2019 年 6 月 11 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	95,455,326.46	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	95,455,326.46	-
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	-	-

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

份额单位：份

万家颐达 A

关联方名称	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
万家共赢	5,329,895.42	0.8880	-	-
中泰证券	8,550,100.88	1.4246	-	-

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
兴业银行	67,881,464.09	240,173.26	60,097,189.79	30,144.65

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业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

本基金本报告期内未实施利润分配。

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	-
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	-
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	-
301348	蓝箭电	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	-

	子									
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	-
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	266	10,097.36	8,083.74	-
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	-
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	2023	6个月	新股	28.00	22.67	982	27,496.00	22,261.94	-

	福科技	年8月8日		流通受限						
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	陕西华达	2023年10月9日	6个月	新股流通受限	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
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	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	-

	份									
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	三态股份	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	-
301559	中集环科	2023年9月26日	6个月	新股流通受限	24.22	18.24	1,217	29,475.74	22,198.08	-
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	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	-

	份									
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	浙江荣泰	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	-
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	3,221	31,791.27	41,067.75	-
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	229	18,088.71	13,852.21	-

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	-
688591	泰凌微	2023年8月18日	6个月	新股流通受限	24.98	28.02	681	17,011.38	19,081.62	-
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	-
688610	埃科光电	2023年7月10日	6个月	新股流通受限	73.33	51.00	211	15,472.63	10,761.00	-
688612	威迈斯	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	47.29	37.97	410	19,388.90	15,567.70	-
688627	精智达	2023年7月11日	6个月	新股流通受限	46.77	87.72	196	9,166.92	17,193.12	-
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	锆威特	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	7.70	2024年1月5日	8.47	747,700	6,123,644.60	5,757,290.00	-

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，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。

7.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	4,956,491.48
未评级	-	-
合计	-	4,956,491.48

注：未评级债券包括政策性金融债。

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	67,881,464.09	-	-	-	-	-	67,881,464.09

结算备付金	6,018,594.25	-	-	-	-	-	6,018,594.25
存出保证金	500,931.75	-	-	-	-	-	500,931.75
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-610,867,039.54	610,867,039.54
应收申购款	0.10	-	-	-	-	77,465.48	77,465.58
应收清算款	-	-	-	-	-	21,010,355.05	21,010,355.05
资产总计	74,400,990.19	-	-	-	-	-631,954,860.07	706,355,850.26
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	26,575,088.21	26,575,088.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	755,119.54	755,119.54
应付托管费	-	-	-	-	-	125,853.26	125,853.26
应付清算款	-	-	-	-	-	4,199,843.34	4,199,843.34
应付销售服务费	-	-	-	-	-	9,560.72	9,560.72
其他负债	-	-	-	-	-	4,829,187.48	4,829,187.48
负债总计	-	-	-	-	-	36,494,652.55	36,494,652.55
利率敏感度缺口	74,400,990.19	-	-	-	-	-595,460,207.52	669,861,197.71
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	60,097,189.79	-	-	-	-	-	60,097,189.79
结算备付金	630,567.87	-	-	-	-	-	630,567.87
存出保证金	65,285.88	-	-	-	-	-	65,285.88
交易性金融资产	-	-	4,956,491.48	-	-	55,003,007.00	59,959,498.48
买入返售金融资产	34,005,734.54	-	-	-	-	-	34,005,734.54
资产总计	94,798,778.08	-	4,956,491.48	-	-	55,003,007.00	154,758,276.56
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	29,502,690.10	29,502,690.10
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	241,896.83	241,896.83
应付托管费	-	-	-	-	-	40,316.16	40,316.16
应付清算款	-	-	-	-	-	50,609.54	50,609.54
应交税费	-	-	-	-	-	8.45	8.45
其他负债	-	-	-	-	-	531,490.28	531,490.28
负债总计	-	-	-	-	-	30,367,011.36	30,367,011.36
利率敏感度缺口	94,798,778.08	-	4,956,491.48	-	-	24,635,995.64	124,391,265.20

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

假设	除市场利率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. 市场利率下降 25个基点	-	28,030.48
2. 市场利率上升 25个基点	-	-28,030.48	

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。

本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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	610,867,039.54	91.19	55,003,007.00	44.22
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	610,867,039.54	91.19	55,003,007.00	44.22
----	----------------	-------	---------------	-------

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	-5,526,328.94	-517,934.85
	2. 股票基准指数上升100个基点	5,526,328.94	517,934.85

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	604,246,075.59	59,959,498.48
第二层次	5,757,290.00	-
第三层次	863,673.95	-
合计	610,867,039.54	59,959,498.48

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	-	-	-
当期购买	-	689,700.96	689,700.96
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	-	173,972.99	173,972.99
其中：计入损益的利得或损失	-	173,972.99	173,972.99
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	863,673.95	863,673.95
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	-	173,972.99	173,972.99
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	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-

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

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	863,673.95	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
-	-	-	-	-	-

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	610,867,039.54	86.48
	其中：股票	610,867,039.54	86.48
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	73,900,058.34	10.46
8	其他各项资产	21,588,752.38	3.06
9	合计	706,355,850.26	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	4,440,682.20	0.66
B	采矿业	8,834,212.00	1.32
C	制造业	418,351,358.10	62.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,784,999.00	0.86
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	14,621,318.20	2.18
G	交通运输、仓储和邮政业	4,467,926.41	0.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	74,369,633.92	11.10
J	金融业	23,293,749.60	3.48
K	房地产业	12,564,233.00	1.88
L	租赁和商务服务业	4,817,568.00	0.72
M	科学研究和技术服务业	30,073,435.00	4.49
N	水利、环境和公共设施管理业	162,254.11	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,827,114.00	0.42
R	文化、体育和娱乐业	6,258,556.00	0.93
S	综合	-	-
	合计	610,867,039.54	91.19

8.2.2 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

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	688158	优刻得	549,500	9,039,275.00	1.35
2	300279	和晶科技	1,396,300	9,034,061.00	1.35
3	300514	友讯达	549,500	8,956,850.00	1.34
4	301007	德迈仕	485,600	8,211,496.00	1.23
5	002968	新大正	656,200	8,209,062.00	1.23
6	688018	乐鑫科技	78,848	8,117,401.60	1.21
7	300030	阳普医疗	1,046,200	8,108,050.00	1.21
8	300880	迦南智能	404,900	8,065,608.00	1.20
9	300675	建科院	529,200	8,017,380.00	1.20
10	688259	创耀科技	116,500	7,913,845.00	1.18
11	300136	信维通信	335,200	7,910,720.00	1.18
12	002826	易明医药	664,300	7,885,241.00	1.18
13	688049	炬芯科技	199,951	7,612,134.57	1.14
14	300625	三雄极光	498,300	7,384,806.00	1.10
15	300127	银河磁体	419,800	7,266,738.00	1.08
16	300368	汇金股份	1,061,000	7,236,020.00	1.08
17	300193	佳士科技	912,800	7,092,456.00	1.06
18	600710	苏美达	989,500	7,015,555.00	1.05
19	300746	汉嘉设计	668,900	6,722,445.00	1.00
20	688368	晶丰明源	61,298	6,616,506.12	0.99
21	300595	欧普康视	285,600	6,448,848.00	0.96
22	688007	光峰科技	248,107	6,421,009.16	0.96
23	688170	德龙激光	156,400	6,107,420.00	0.91
24	688229	博睿数据	124,100	5,965,487.00	0.89
25	000801	四川九洲	747,700	5,757,290.00	0.86
26	301052	果麦文化	130,600	5,717,668.00	0.85
27	300319	麦捷科技	592,100	5,707,844.00	0.85
28	300882	万胜智能	229,400	5,588,184.00	0.83
29	688222	成都先导	363,124	5,443,228.76	0.81
30	688468	科美诊断	487,000	5,254,730.00	0.78
31	301201	诚达药业	202,100	5,139,403.00	0.77
32	300272	开能健康	807,100	5,004,020.00	0.75
33	300841	康华生物	63,699	4,939,220.46	0.74
34	002050	三花智控	161,400	4,745,160.00	0.71
35	300308	中际旭创	41,500	4,685,765.00	0.70
36	002662	京威股份	1,285,000	4,510,350.00	0.67
37	300213	佳讯飞鸿	620,500	4,467,600.00	0.67
38	300498	温氏股份	221,370	4,440,682.20	0.66
39	601001	晋控煤业	358,600	4,421,538.00	0.66
40	601699	潞安环能	201,400	4,412,674.00	0.66
41	301149	隆华新材	355,400	4,396,298.00	0.66
42	300369	绿盟科技	466,200	4,396,266.00	0.66

43	601375	中原证券	1,146,500	4,391,095.00	0.66
44	002839	张家港行	1,131,620	4,390,685.60	0.66
45	002019	亿帆医药	296,800	4,386,704.00	0.65
46	603682	锦和商管	763,700	4,383,638.00	0.65
47	601825	沪农商行	763,600	4,383,064.00	0.65
48	600025	华能水电	507,300	4,377,999.00	0.65
49	688567	孚能科技	268,100	4,372,711.00	0.65
50	000039	中集集团	570,100	4,361,265.00	0.65
51	002133	广宇集团	1,247,900	4,355,171.00	0.65
52	601198	东兴证券	528,900	4,352,847.00	0.65
53	001227	兰州银行	1,673,600	4,351,360.00	0.65
54	002372	伟星新材	300,500	4,348,235.00	0.65
55	601633	长城汽车	172,300	4,345,406.00	0.65
56	688235	百济神州	31,244	4,344,165.76	0.65
57	300012	华测检测	305,500	4,338,100.00	0.65
58	300496	中科创达	54,100	4,331,246.00	0.65
59	002993	奥海科技	112,400	4,282,440.00	0.64
60	688159	有方科技	111,946	4,214,766.90	0.63
61	300709	精研科技	134,500	4,195,055.00	0.63
62	300238	冠昊生物	303,500	4,115,460.00	0.61
63	002902	铭普光磁	178,800	4,098,096.00	0.61
64	603396	金辰股份	70,000	3,825,500.00	0.57
65	600153	建发股份	395,500	3,808,665.00	0.57
66	301085	亚康股份	65,300	3,748,873.00	0.56
67	000548	湖南投资	686,300	3,740,335.00	0.56
68	300772	运达股份	350,290	3,727,085.60	0.56
69	300042	朗科科技	106,000	3,710,000.00	0.55
70	603387	基蛋生物	332,156	3,653,716.00	0.55
71	002687	乔治白	681,300	3,631,329.00	0.54
72	603196	日播时尚	267,100	3,608,521.00	0.54
73	002916	深南电路	50,300	3,570,797.00	0.53
74	002444	巨星科技	155,200	3,495,104.00	0.52
75	300394	天孚通信	38,100	3,486,912.00	0.52
76	300551	古鳌科技	197,200	3,431,280.00	0.51
77	300473	德尔股份	185,700	3,394,596.00	0.51
78	300711	广哈通信	250,900	3,349,515.00	0.50
79	688095	福昕软件	46,900	3,275,965.00	0.49
80	300589	江龙船艇	234,400	3,253,472.00	0.49
81	688169	石头科技	11,490	3,251,095.50	0.49
82	300161	华中数控	87,307	3,134,321.30	0.47
83	301080	百普赛斯	52,800	3,112,032.00	0.46
84	002892	科力尔	188,500	3,032,965.00	0.45
85	300432	富临精工	287,400	3,017,700.00	0.45

86	300606	金太阳	84,900	2,900,184.00	0.43
87	688418	震有科技	152,300	2,872,378.00	0.43
88	301103	何氏眼科	94,300	2,827,114.00	0.42
89	300035	中科电气	268,000	2,824,720.00	0.42
90	002870	香山股份	78,100	2,801,447.00	0.42
91	600114	东睦股份	178,300	2,761,867.00	0.41
92	002997	瑞鹄模具	80,700	2,688,924.00	0.40
93	603678	火炬电子	99,500	2,633,765.00	0.39
94	688766	普冉股份	26,494	2,595,882.12	0.39
95	688313	仕佳光子	201,500	2,561,065.00	0.38
96	688292	浩瀚深度	92,257	2,538,912.64	0.38
97	688601	力芯微	47,125	2,468,878.75	0.37
98	002517	恺英网络	219,700	2,454,049.00	0.37
99	603076	乐惠国际	90,100	2,414,680.00	0.36
100	600132	重庆啤酒	35,800	2,378,910.00	0.36
101	000727	冠捷科技	886,100	2,374,748.00	0.35
102	002463	沪电股份	107,200	2,371,264.00	0.35
103	688595	芯海科技	53,900	2,333,870.00	0.35
104	300380	安硕信息	108,000	2,290,680.00	0.34
105	603516	淳中科技	101,100	2,271,717.00	0.34
106	002730	电光科技	237,200	2,248,656.00	0.34
107	688160	步科股份	38,600	2,245,748.00	0.34
108	300045	华力创通	92,000	2,238,360.00	0.33
109	002745	木林森	254,900	2,207,434.00	0.33
110	002795	永和智控	291,000	2,173,770.00	0.32
111	002245	蔚蓝锂芯	253,000	2,155,560.00	0.32
112	002896	中大力德	57,500	2,090,125.00	0.31
113	603496	恒为科技	66,500	2,072,140.00	0.31
114	002559	亚威股份	170,200	1,962,406.00	0.29
115	688138	清溢光电	85,200	1,927,224.00	0.29
116	603855	华荣股份	90,500	1,806,380.00	0.27
117	603788	宁波高发	120,300	1,796,079.00	0.27
118	603486	科沃斯	42,300	1,752,912.00	0.26
119	688569	铁科轨道	61,416	1,695,695.76	0.25
120	300559	佳发教育	107,000	1,658,500.00	0.25
121	300218	安利股份	121,500	1,646,325.00	0.25
122	002947	恒铭达	51,000	1,641,180.00	0.25
123	603767	中马传动	106,100	1,632,879.00	0.24
124	300412	迦南科技	286,600	1,630,754.00	0.24
125	000977	浪潮信息	49,100	1,630,120.00	0.24
126	603220	中贝通信	47,500	1,613,100.00	0.24
127	002557	洽洽食品	46,300	1,612,166.00	0.24
128	002703	浙江世宝	120,000	1,603,200.00	0.24

129	688025	杰普特	16,700	1,545,585.00	0.23
130	000790	华神科技	295,300	1,494,218.00	0.22
131	300542	新晨科技	113,300	1,484,230.00	0.22
132	300446	航天智造	94,400	1,479,248.00	0.22
133	601577	长沙银行	208,900	1,424,698.00	0.21
134	601985	中国核电	187,600	1,407,000.00	0.21
135	603110	东方材料	57,300	1,380,930.00	0.21
136	300322	硕贝德	121,600	1,357,056.00	0.20
137	300286	安科瑞	51,700	1,340,581.00	0.20
138	688165	埃夫特	116,900	1,339,674.00	0.20
139	688208	道通科技	55,323	1,313,921.25	0.20
140	300571	平治信息	36,300	1,282,479.00	0.19
141	688118	普元信息	42,800	1,280,576.00	0.19
142	300620	光库科技	28,100	1,272,930.00	0.19
143	688300	联瑞新材	23,500	1,244,325.00	0.19
144	002724	海洋王	151,000	1,241,220.00	0.19
145	300870	欧陆通	27,839	1,232,432.53	0.18
146	300582	英飞特	100,500	1,207,005.00	0.18
147	300928	华安鑫创	23,600	1,190,384.00	0.18
148	300211	亿通科技	116,300	1,175,793.00	0.18
149	603037	凯众股份	56,400	1,173,684.00	0.18
150	300441	鲍斯股份	164,800	1,135,472.00	0.17
151	002664	信质集团	68,100	1,132,503.00	0.17
152	002134	天津普林	101,700	1,115,649.00	0.17
153	300016	北陆药业	156,400	1,113,568.00	0.17
154	600775	南京熊猫	83,100	1,101,075.00	0.16
155	300451	创业慧康	167,000	1,093,850.00	0.16
156	688262	国芯科技	36,500	1,070,910.00	0.16
157	002196	方正电机	143,900	1,033,202.00	0.15
158	002897	意华股份	27,600	1,025,616.00	0.15
159	002983	芯瑞达	32,000	987,520.00	0.15
160	300628	亿联网络	33,100	978,105.00	0.15
161	300002	神州泰岳	106,800	945,180.00	0.14
162	300533	冰川网络	33,800	936,260.00	0.14
163	600301	华锡有色	73,200	920,856.00	0.14
164	688167	炬光科技	8,000	912,000.00	0.14
165	300011	鼎汉技术	113,800	908,124.00	0.14
166	300493	润欣科技	105,900	901,209.00	0.13
167	688361	中科飞测	12,000	893,160.00	0.13
168	002261	拓维信息	57,839	869,898.56	0.13
169	300884	狄耐克	63,300	827,964.00	0.12
170	688205	德科立	15,500	766,940.00	0.11
171	002773	康弘药业	40,800	752,352.00	0.11

172	688195	腾景科技	20,800	748,592.00	0.11
173	300113	顺网科技	51,000	714,000.00	0.11
174	002682	龙洲股份	81,000	713,610.00	0.11
175	603326	我乐家居	74,700	704,421.00	0.11
176	603236	移远通信	13,000	698,750.00	0.10
177	300327	中颖电子	30,600	697,680.00	0.10
178	300510	金冠股份	115,100	687,147.00	0.10
179	603043	广州酒家	34,900	681,597.00	0.10
180	300660	江苏雷利	22,400	677,824.00	0.10
181	688234	天岳先进	10,200	673,914.00	0.10
182	300414	中光防雷	69,900	673,137.00	0.10
183	600446	金证股份	55,113	637,657.41	0.10
184	603730	岱美股份	43,500	630,315.00	0.09
185	300835	龙磁科技	21,700	629,517.00	0.09
186	300719	安达维尔	46,700	622,511.00	0.09
187	688099	晶晨股份	9,806	614,149.78	0.09
188	300681	英搏尔	31,800	612,786.00	0.09
189	603890	春秋电子	53,400	611,430.00	0.09
190	301333	诺思格	9,440	608,691.20	0.09
191	300043	星辉娱乐	162,500	602,875.00	0.09
192	002671	龙泉股份	100,100	599,599.00	0.09
193	688580	伟思医疗	9,202	588,283.86	0.09
194	002873	新天药业	44,600	555,716.00	0.08
195	002722	物产金轮	35,400	545,514.00	0.08
196	300939	秋田微	14,400	545,472.00	0.08
197	600576	祥源文旅	72,700	540,888.00	0.08
198	603866	桃李面包	66,000	505,560.00	0.08
199	688393	安必平	19,948	498,101.56	0.07
200	301093	华兰股份	15,200	490,960.00	0.07
201	301013	利和兴	30,800	488,180.00	0.07
202	688699	明微电子	12,000	484,200.00	0.07
203	301191	菲菱科思	5,200	479,440.00	0.07
204	605305	中际联合	14,700	474,957.00	0.07
205	300707	威唐工业	25,300	470,327.00	0.07
206	002036	联创电子	43,400	443,114.00	0.07
207	300662	科锐国际	15,600	430,872.00	0.06
208	688362	甬矽电子	16,400	429,516.00	0.06
209	603933	睿能科技	27,400	426,070.00	0.06
210	002609	捷顺科技	36,400	415,688.00	0.06
211	002396	星网锐捷	21,100	381,277.00	0.06
212	300491	通合科技	16,400	365,392.00	0.05
213	603228	景旺电子	15,900	358,704.00	0.05
214	688510	航亚科技	19,100	336,542.00	0.05

215	300552	万集科技	10,600	313,760.00	0.05
216	688260	昀冢科技	10,200	309,060.00	0.05
217	300735	光弘科技	13,000	306,020.00	0.05
218	300609	汇纳科技	10,800	294,840.00	0.04
219	002949	华阳国际	19,600	273,812.00	0.04
220	002988	豪美新材	11,400	272,118.00	0.04
221	300706	阿石创	10,000	258,800.00	0.04
222	603686	福龙马	25,000	255,750.00	0.04
223	300500	启迪设计	16,900	242,177.00	0.04
224	300129	泰胜风能	21,400	230,478.00	0.03
225	603515	欧普照明	13,000	225,940.00	0.03
226	688209	英集芯	11,876	212,105.36	0.03
227	603489	八方股份	3,800	208,810.00	0.03
228	603313	梦百合	17,700	185,850.00	0.03
229	688246	嘉和美康	4,709	157,374.78	0.02
230	600262	北方股份	7,900	152,075.00	0.02
231	600292	远达环保	23,600	143,252.00	0.02
232	000915	华特达因	4,200	121,632.00	0.02
233	300584	海辰药业	4,700	109,416.00	0.02
234	002946	新乳业	8,800	101,024.00	0.02
235	600213	亚星客车	9,500	87,780.00	0.01
236	002823	凯中精密	6,800	86,360.00	0.01
237	688320	禾川科技	1,600	65,600.00	0.01
238	688131	皓元医药	1,125	58,567.50	0.01
239	688499	利元亨	1,525	58,072.00	0.01
240	688105	诺唯赞	1,600	51,232.00	0.01
241	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.01
242	688548	广钢气体	3,221	41,067.75	0.01
243	301487	盟固利	867	35,512.32	0.01
244	688549	中巨芯	4,294	34,738.46	0.01
245	300488	恒锋工具	1,200	29,496.00	0.00
246	301015	百洋医药	800	28,688.00	0.00
247	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
248	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
249	301511	德福科技	982	22,261.94	0.00
250	301559	中集环科	1,217	22,198.08	0.00
251	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
252	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
253	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
254	688591	泰凌微	681	19,081.62	0.00
255	300904	威力传动	304	18,705.12	0.00
256	688627	精智达	196	17,193.12	0.00
257	301172	君逸数码	438	16,714.08	0.00

258	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
259	688612	威迈斯	410	15,567.70	0.00
260	601083	锦江航运	1,263	13,981.41	0.00
261	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
262	688563	航材股份	229	13,852.21	0.00
263	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
264	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
265	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
266	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
267	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
268	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
269	688610	埃科光电	211	10,761.00	0.00
270	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
271	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
272	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
273	301372	科净源	231	10,069.29	0.00
274	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
275	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
276	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
277	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
278	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
279	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
280	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
281	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
282	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
283	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
284	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
285	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
286	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
287	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
288	301456	盘古智能	266	8,083.74	0.00
289	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
290	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
291	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
292	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
293	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
294	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
295	002367	康力电梯	1,000	7,520.00	0.00
296	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00
297	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
298	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
299	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
300	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00

301	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
302	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
303	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
304	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
305	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
306	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
307	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
308	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
309	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
310	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
311	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
312	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
313	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
314	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	002371	北方华创	42,826,266.92	34.43
2	300213	佳讯飞鸿	33,862,532.00	27.22
3	688418	震有科技	29,754,582.72	23.92
4	688158	优刻得	28,677,157.39	23.05
5	688234	天岳先进	28,077,974.25	22.57
6	600519	贵州茅台	26,853,542.00	21.59
7	000568	泸州老窖	26,808,378.74	21.55
8	300634	彩讯股份	26,265,021.00	21.11
9	000021	深科技	25,816,771.64	20.75
10	603396	金辰股份	25,459,628.00	20.47
11	300274	阳光电源	25,343,096.00	20.37
12	300533	冰川网络	24,927,706.00	20.04
13	300724	捷佳伟创	24,869,413.00	19.99
14	603236	移远通信	24,642,460.41	19.81
15	000975	银泰黄金	24,627,026.00	19.80
16	000596	古井贡酒	23,343,874.00	18.77
17	002897	意华股份	22,903,290.03	18.41
18	300785	值得买	22,565,233.00	18.14
19	600418	江淮汽车	22,239,336.00	17.88
20	000801	四川九洲	22,107,527.00	17.77
21	688262	国芯科技	22,103,322.92	17.77
22	000014	沙河股份	21,949,245.08	17.65
23	688590	新致软件	21,909,939.68	17.61
24	688018	乐鑫科技	21,362,561.18	17.17

25	603516	淳中科技	20,590,784.00	16.55
26	300232	洲明科技	20,587,864.18	16.55
27	300136	信维通信	20,351,594.20	16.36
28	688368	晶丰明源	20,054,465.11	16.12
29	601699	潞安环能	19,932,318.00	16.02
30	300560	中富通	19,915,958.00	16.01
31	002970	锐明技术	19,516,727.00	15.69
32	002466	天齐锂业	19,259,614.00	15.48
33	600066	宇通客车	19,234,650.00	15.46
34	601001	晋控煤业	19,185,675.46	15.42
35	300113	顺网科技	19,101,328.00	15.36
36	000729	燕京啤酒	19,062,893.00	15.32
37	002919	名臣健康	19,051,276.90	15.32
38	301039	中集车辆	19,010,578.00	15.28
39	000032	深桑达 A	18,890,750.22	15.19
40	300252	金信诺	18,769,553.00	15.09
41	000821	京山轻机	18,661,860.00	15.00
42	300514	友讯达	18,156,555.00	14.60
43	603533	掌阅科技	17,891,638.00	14.38
44	300589	江龙船艇	17,464,917.35	14.04
45	002292	奥飞娱乐	17,269,696.00	13.88
46	688049	炬芯科技	17,152,851.70	13.79
47	688601	力芯微	17,077,057.06	13.73
48	600346	恒力石化	17,069,664.55	13.72
49	300161	华中数控	16,995,829.15	13.66
50	600489	中金黄金	16,992,482.00	13.66
51	688259	创耀科技	16,881,149.17	13.57
52	300357	我武生物	16,648,060.00	13.38
53	300389	艾比森	16,548,523.00	13.30
54	300493	润欣科技	16,408,093.00	13.19
55	688025	杰普特	16,365,551.00	13.16
56	300520	科大国创	16,364,112.00	13.16
57	300246	宝莱特	16,285,898.50	13.09
58	688019	安集科技	16,265,775.92	13.08
59	600728	佳都科技	16,232,351.00	13.05
60	603028	赛福天	16,184,673.00	13.01
61	300474	景嘉微	16,169,470.00	13.00
62	300751	迈为股份	16,113,769.40	12.95
63	002527	新时达	16,082,500.00	12.93
64	300788	中信出版	16,002,260.00	12.86
65	688499	利元亨	15,862,676.38	12.75
66	300081	恒信东方	15,842,530.00	12.74
67	002559	亚威股份	15,832,581.97	12.73

68	600351	亚宝药业	15,821,377.00	12.72
69	300490	华自科技	15,737,732.00	12.65
70	301085	亚康股份	15,608,444.40	12.55
71	002222	福晶科技	15,602,853.00	12.54
72	000590	启迪药业	15,473,885.00	12.44
73	688365	光云科技	15,372,136.56	12.36
74	688508	芯朋微	15,255,447.06	12.26
75	601186	中国铁建	15,178,624.00	12.20
76	300308	中际旭创	15,089,804.00	12.13
77	300693	盛弘股份	15,038,586.62	12.09
78	002315	焦点科技	15,034,392.00	12.09
79	300708	聚灿光电	14,706,182.00	11.82
80	300378	鼎捷软件	14,678,577.47	11.80
81	688318	财富趋势	14,660,826.76	11.79
82	688589	力合微	14,646,322.25	11.77
83	002795	永和智控	14,451,732.00	11.62
84	600710	苏美达	14,448,453.00	11.62
85	000888	峨眉山 A	14,400,608.00	11.58
86	300316	晶盛机电	14,384,390.38	11.56
87	300674	宇信科技	14,342,242.00	11.53
88	300127	银河磁体	14,312,152.00	11.51
89	000727	冠捷科技	14,300,008.00	11.50
90	300473	德尔股份	14,279,597.00	11.48
91	600667	太极实业	14,263,217.00	11.47
92	688390	固德威	14,219,510.58	11.43
93	002649	博彦科技	14,184,776.00	11.40
94	000906	浙商中拓	14,163,404.93	11.39
95	688095	福昕软件	14,140,880.85	11.37
96	300559	佳发教育	14,138,268.00	11.37
97	300058	蓝色光标	14,126,516.00	11.36
98	300853	申昊科技	14,104,472.00	11.34
99	688772	珠海冠宇	14,034,341.05	11.28
100	300114	中航电测	14,015,792.00	11.27
101	600115	中国东航	14,007,945.00	11.26
102	002870	香山股份	13,997,663.00	11.25
103	688208	道通科技	13,990,872.88	11.25
104	688195	腾景科技	13,986,167.21	11.24
105	300706	阿石创	13,983,460.00	11.24
106	688596	正帆科技	13,861,215.71	11.14
107	002555	三七互娱	13,828,364.00	11.12
108	000528	柳 工	13,825,604.00	11.11
109	301168	通灵股份	13,767,718.00	11.07
110	002568	百润股份	13,750,996.60	11.05

111	688588	凌志软件	13,698,918.84	11.01
112	688366	昊海生科	13,684,277.62	11.00
113	688135	利扬芯片	13,624,531.84	10.95
114	002131	利欧股份	13,605,128.00	10.94
115	600153	建发股份	13,570,383.00	10.91
116	603338	浙江鼎力	13,462,474.00	10.82
117	002594	比亚迪	13,417,270.00	10.79
118	000333	美的集团	13,402,007.00	10.77
119	688036	传音控股	13,396,077.09	10.77
120	300491	通合科技	13,342,042.00	10.73
121	601225	陕西煤业	13,266,202.00	10.66
122	688138	清溢光电	13,255,779.92	10.66
123	300288	朗玛信息	13,253,135.00	10.65
124	688039	当虹科技	13,248,837.54	10.65
125	002803	吉宏股份	13,199,909.00	10.61
126	688170	德龙激光	13,163,982.84	10.58
127	002299	圣农发展	13,093,632.00	10.53
128	002483	润邦股份	13,075,184.00	10.51
129	688126	沪硅产业	13,069,293.68	10.51
130	300327	中颖电子	13,041,682.00	10.48
131	600694	大商股份	13,023,739.64	10.47
132	300238	冠昊生物	13,004,010.00	10.45
133	688787	海天瑞声	12,980,374.70	10.44
134	002912	中新赛克	12,950,323.00	10.41
135	603019	中科曙光	12,934,659.20	10.40
136	601919	中远海控	12,894,701.00	10.37
137	300494	盛天网络	12,894,314.20	10.37
138	300880	迦南智能	12,892,148.00	10.36
139	300835	龙磁科技	12,833,950.00	10.32
140	688118	普元信息	12,830,547.50	10.31
141	300368	汇金股份	12,772,246.00	10.27
142	300570	太辰光	12,747,180.00	10.25
143	601969	海南矿业	12,717,685.00	10.22
144	688235	百济神州	12,700,160.90	10.21
145	600185	格力地产	12,695,676.00	10.21
146	300031	宝通科技	12,686,218.00	10.20
147	600498	烽火通信	12,662,449.60	10.18
148	688002	睿创微纳	12,658,067.59	10.18
149	300595	欧普康视	12,621,876.00	10.15
150	688169	石头科技	12,551,746.83	10.09
151	603501	韦尔股份	12,540,461.30	10.08
152	300458	全志科技	12,527,831.20	10.07
153	300279	和晶科技	12,493,005.00	10.04

154	601633	长城汽车	12,429,067.00	9.99
155	002732	燕塘乳业	12,422,334.00	9.99
156	603885	吉祥航空	12,411,507.36	9.98
157	300709	精研科技	12,363,306.00	9.94
158	002419	天虹股份	12,223,133.00	9.83
159	002126	银轮股份	12,218,699.00	9.82
160	300286	安科瑞	12,195,854.00	9.80
161	300017	网宿科技	12,190,885.00	9.80
162	600737	中粮糖业	12,149,229.00	9.77
163	301052	果麦文化	12,138,796.00	9.76
164	600148	长春一东	12,134,395.00	9.76
165	002032	苏泊尔	12,099,178.24	9.73
166	000063	中兴通讯	12,042,006.00	9.68
167	688599	天合光能	12,024,249.43	9.67
168	600642	申能股份	11,924,265.96	9.59
169	300030	阳普医疗	11,742,186.00	9.44
170	600438	通威股份	11,708,731.76	9.41
171	002826	易明医药	11,673,979.00	9.38
172	601038	一拖股份	11,658,235.47	9.37
173	002876	三利谱	11,599,896.00	9.33
174	600576	祥源文旅	11,548,815.00	9.28
175	002845	同兴达	11,539,200.00	9.28
176	300679	电连技术	11,478,353.00	9.23
177	600482	中国动力	11,433,376.00	9.19
178	002712	思美传媒	11,422,488.00	9.18
179	300498	温氏股份	11,415,208.60	9.18
180	688258	卓易信息	11,390,844.66	9.16
181	688072	拓荆科技	11,390,037.64	9.16
182	601212	白银有色	11,323,366.00	9.10
183	688218	江苏北人	11,321,434.26	9.10
184	300394	天孚通信	11,268,046.00	9.06
185	300846	首都在线	11,248,535.00	9.04
186	688292	浩瀚深度	11,213,690.63	9.01
187	600110	诺德股份	11,157,628.94	8.97
188	000969	安泰科技	11,103,172.00	8.93
189	300675	建科院	11,078,557.00	8.91
190	002878	元隆雅图	11,076,295.00	8.90
191	300314	戴维医疗	10,998,571.00	8.84
192	301041	金百泽	10,983,513.00	8.83
193	688777	中控技术	10,982,737.57	8.83
194	603956	威派格	10,940,078.00	8.79
195	002671	龙泉股份	10,907,109.00	8.77
196	300667	必创科技	10,901,478.00	8.76

197	300620	光库科技	10,901,184.00	8.76
198	688080	映翰通	10,900,068.41	8.76
199	603387	基蛋生物	10,889,835.97	8.75
200	002968	新大正	10,883,583.00	8.75
201	603196	日播时尚	10,867,471.00	8.74
202	601985	中国核电	10,867,424.00	8.74
203	000039	中集集团	10,860,605.00	8.73
204	688369	致远互联	10,850,388.95	8.72
205	300841	康华生物	10,846,824.75	8.72
206	300870	欧陆通	10,840,052.43	8.71
207	002497	雅化集团	10,831,241.00	8.71
208	600446	金证股份	10,809,161.51	8.69
209	300882	万胜智能	10,792,633.00	8.68
210	000790	华神科技	10,792,328.00	8.68
211	603997	继峰股份	10,755,103.00	8.65
212	301013	利和兴	10,712,088.00	8.61
213	688408	中信博	10,705,181.78	8.61
214	300745	欣锐科技	10,694,530.00	8.60
215	603165	荣晟环保	10,635,898.00	8.55
216	002493	荣盛石化	10,629,277.00	8.55
217	000901	航天科技	10,612,160.00	8.53
218	301050	雷电微力	10,548,710.80	8.48
219	300624	万兴科技	10,528,556.00	8.46
220	603348	文灿股份	10,418,116.00	8.38
221	601233	桐昆股份	10,416,511.00	8.37
222	600600	青岛啤酒	10,369,907.60	8.34
223	600779	水井坊	10,342,124.00	8.31
224	300847	中船汉光	10,330,335.00	8.30
225	002196	方正电机	10,288,635.00	8.27
226	600976	健民集团	10,287,760.00	8.27
227	600180	瑞茂通	10,278,691.00	8.26
228	600325	华发股份	10,262,814.00	8.25
229	688099	晶晨股份	10,220,030.67	8.22
230	300276	三丰智能	10,219,987.00	8.22
231	300002	神州泰岳	10,155,265.00	8.16
232	603919	金徽酒	10,036,582.38	8.07
233	300299	富春股份	10,017,958.00	8.05
234	688358	祥生医疗	9,971,032.89	8.02
235	300582	英飞特	9,960,040.00	8.01
236	002533	金杯电工	9,940,192.00	7.99
237	300502	新易盛	9,926,835.40	7.98
238	688128	中国电研	9,876,572.84	7.94
239	300894	火星人	9,850,161.15	7.92

240	300556	丝路视觉	9,846,694.00	7.92
241	002335	科华数据	9,846,576.20	7.92
242	300590	移为通信	9,792,850.00	7.87
243	001696	宗申动力	9,759,166.00	7.85
244	603326	我乐家居	9,715,943.00	7.81
245	300340	科恒股份	9,635,967.00	7.75
246	301152	天力锂能	9,621,080.00	7.73
247	600809	山西汾酒	9,599,973.00	7.72
248	301011	华立科技	9,539,191.05	7.67
249	688662	富信科技	9,535,657.83	7.67
250	300206	理邦仪器	9,531,261.40	7.66
251	300001	特锐德	9,513,755.00	7.65
252	603181	皇马科技	9,466,607.00	7.61
253	300680	隆盛科技	9,459,645.00	7.60
254	002119	康强电子	9,455,654.60	7.60
255	603158	腾龙股份	9,444,826.40	7.59
256	688111	金山办公	9,439,235.89	7.59
257	300344	立方数科	9,431,136.00	7.58
258	000026	飞亚达	9,423,279.00	7.58
259	300747	锐科激光	9,361,855.00	7.53
260	300615	欣天科技	9,325,200.00	7.50
261	688521	芯原股份	9,303,103.80	7.48
262	601169	北京银行	9,297,159.00	7.47
263	000898	鞍钢股份	9,294,042.00	7.47
264	600968	海油发展	9,266,495.00	7.45
265	300812	易天股份	9,256,809.00	7.44
266	002773	康弘药业	9,254,728.00	7.44
267	601077	渝农商行	9,243,881.00	7.43
268	688311	盟升电子	9,215,040.00	7.41
269	300235	方直科技	9,179,235.50	7.38
270	300746	汉嘉设计	9,151,509.00	7.36
271	002609	捷顺科技	9,139,986.00	7.35
272	300625	三雄极光	9,125,066.00	7.34
273	688578	艾力斯	9,089,389.50	7.31
274	300193	佳士科技	9,086,682.00	7.30
275	600456	宝钛股份	9,081,838.00	7.30
276	002835	同为股份	8,925,353.00	7.18
277	600546	山煤国际	8,912,126.97	7.16
278	000581	威孚高科	8,881,509.00	7.14
279	300638	广和通	8,861,719.59	7.12
280	601766	中国中车	8,859,358.00	7.12
281	002345	潮宏基	8,859,102.00	7.12
282	002866	传艺科技	8,841,190.00	7.11

283	600449	宁夏建材	8,831,887.00	7.10
284	000048	京基智农	8,828,306.00	7.10
285	002730	电光科技	8,757,259.00	7.04
286	300012	华测检测	8,726,894.00	7.02
287	301007	德迈仕	8,717,716.00	7.01
288	002395	双象股份	8,655,620.00	6.96
289	002461	珠江啤酒	8,597,423.00	6.91
290	603045	福达合金	8,594,827.00	6.91
291	601595	上海电影	8,592,433.00	6.91
292	601825	沪农商行	8,559,240.00	6.88
293	300719	安达维尔	8,553,866.00	6.88
294	600272	开开实业	8,491,927.00	6.83
295	002841	视源股份	8,433,051.00	6.78
296	000548	湖南投资	8,415,367.00	6.77
297	002169	智光电气	8,346,054.00	6.71
298	600197	伊力特	8,277,517.00	6.65
299	600132	重庆啤酒	8,274,909.00	6.65
300	000800	一汽解放	8,261,148.00	6.64
301	603518	锦泓集团	8,249,514.00	6.63
302	600057	厦门象屿	8,156,314.00	6.56
303	002990	盛视科技	8,081,770.60	6.50
304	300272	开能健康	8,040,624.00	6.46
305	603883	老百姓	8,027,001.00	6.45
306	002980	华盛昌	7,973,907.00	6.41
307	002747	埃斯顿	7,952,621.95	6.39
308	688229	博睿数据	7,930,258.60	6.38
309	605305	中际联合	7,925,052.02	6.37
310	601179	中国西电	7,818,110.00	6.29
311	600572	康恩贝	7,817,229.94	6.28
312	600011	华能国际	7,809,874.00	6.28
313	002713	东易日盛	7,784,759.00	6.26
314	000989	九芝堂	7,691,455.00	6.18
315	002396	星网锐捷	7,674,711.00	6.17
316	002019	亿帆医药	7,658,513.04	6.16
317	688300	联瑞新材	7,632,541.91	6.14
318	688566	吉贝尔	7,597,912.88	6.11
319	300842	帝科股份	7,547,158.71	6.07
320	002917	金奥博	7,536,221.00	6.06
321	688007	光峰科技	7,526,687.53	6.05
322	300534	陇神戎发	7,458,655.00	6.00
323	688569	铁科轨道	7,446,594.73	5.99
324	688222	成都先导	7,423,442.28	5.97
325	688286	敏芯股份	7,423,025.83	5.97

326	300768	迪普科技	7,417,575.50	5.96
327	605333	沪光股份	7,416,859.00	5.96
328	002724	海洋王	7,403,789.00	5.95
329	300129	泰胜风能	7,387,627.00	5.94
330	300380	安硕信息	7,360,046.00	5.92
331	002820	桂发祥	7,353,243.00	5.91
332	001979	招商蛇口	7,300,717.00	5.87
333	688106	金宏气体	7,296,097.46	5.87
334	002913	奥士康	7,277,622.00	5.85
335	688580	伟思医疗	7,252,147.16	5.83
336	688378	奥来德	7,242,617.51	5.82
337	688020	方邦股份	7,242,373.42	5.82
338	603589	口子窖	7,216,881.00	5.80
339	688177	百奥泰	7,197,254.66	5.79
340	300412	迦南科技	7,172,499.00	5.77
341	603508	思维列控	7,164,593.05	5.76
342	300729	乐歌股份	7,156,234.10	5.75
343	601311	骆驼股份	7,122,929.00	5.73
344	002893	京能热力	7,118,866.00	5.72
345	688131	皓元医药	7,114,371.62	5.72
346	000811	冰轮环境	7,062,285.00	5.68
347	002705	新宝股份	7,037,624.00	5.66
348	601098	中南传媒	7,025,303.00	5.65
349	002757	南兴股份	7,016,065.00	5.64
350	300718	长盛轴承	7,015,112.50	5.64
351	688316	青云科技	6,994,232.07	5.62
352	603269	海鸥股份	6,983,770.80	5.61
353	601799	星宇股份	6,956,378.00	5.59
354	600859	王府井	6,938,947.00	5.58
355	688223	晶科能源	6,925,247.07	5.57
356	601717	郑煤机	6,900,494.00	5.55
357	301155	海力风电	6,871,568.55	5.52
358	688076	诺泰生物	6,870,511.85	5.52
359	601021	春秋航空	6,849,502.00	5.51
360	603199	九华旅游	6,825,522.00	5.49
361	603730	岱美股份	6,806,826.00	5.47
362	002234	民和股份	6,802,246.00	5.47
363	603258	电魂网络	6,796,270.00	5.46
364	601360	三六零	6,790,218.00	5.46
365	300659	中孚信息	6,770,293.00	5.44
366	300451	创业慧康	6,752,411.00	5.43
367	002534	西子洁能	6,733,723.67	5.41
368	688409	富创精密	6,708,930.18	5.39

369	300884	狄耐克	6,707,901.80	5.39
370	301080	百普赛斯	6,703,940.00	5.39
371	300432	富临精工	6,678,694.00	5.37
372	301117	佳缘科技	6,648,461.00	5.34
373	002268	电科网安	6,605,854.00	5.31
374	688628	优利德	6,605,303.08	5.31
375	002662	京威股份	6,603,447.00	5.31
376	002651	利君股份	6,564,732.00	5.28
377	688798	艾为电子	6,539,204.66	5.26
378	688595	芯海科技	6,482,471.97	5.21
379	603989	艾华集团	6,468,518.00	5.20
380	688062	迈威生物	6,466,588.81	5.20
381	000990	诚志股份	6,457,439.00	5.19
382	600563	法拉电子	6,456,254.00	5.19
383	002903	宇环数控	6,417,187.00	5.16
384	300592	华凯易佰	6,410,482.00	5.15
385	300551	古鳌科技	6,402,464.00	5.15
386	300465	高伟达	6,397,430.00	5.14
387	300387	富邦股份	6,388,990.00	5.14
388	688016	心脉医疗	6,364,516.19	5.12
389	300253	卫宁健康	6,359,840.68	5.11
390	603929	亚翔集成	6,331,759.00	5.09
391	002159	三特索道	6,320,275.00	5.08
392	601003	柳钢股份	6,312,515.00	5.07
393	603611	诺力股份	6,308,909.00	5.07
394	002388	新亚制程	6,300,895.00	5.07
395	000948	南天信息	6,293,133.11	5.06
396	300093	金刚光伏	6,268,084.00	5.04
397	002860	星帅尔	6,261,428.00	5.03
398	605599	菜百股份	6,246,432.00	5.02
399	600750	江中药业	6,222,221.00	5.00
400	300319	麦捷科技	6,221,027.00	5.00
401	300548	博创科技	6,214,674.00	5.00
402	301221	光庭信息	6,212,458.00	4.99
403	300294	博雅生物	6,192,027.00	4.98
404	300421	力星股份	6,183,988.40	4.97
405	603233	大参林	6,176,490.80	4.97
406	002128	电投能源	6,168,126.00	4.96
407	688206	概伦电子	6,141,206.39	4.94
408	600817	宇通重工	6,138,358.00	4.93
409	603138	海量数据	6,134,106.11	4.93
410	300617	安靠智电	6,118,183.00	4.92
411	688361	中科飞测	6,093,536.32	4.90

412	688139	海尔生物	6,086,484.65	4.89
413	002133	广宇集团	6,081,244.00	4.89
414	300972	万辰集团	6,071,893.00	4.88
415	603977	国泰集团	6,070,344.00	4.88
416	002085	万丰奥威	6,040,024.00	4.86
417	000526	学大教育	6,025,200.00	4.84
418	603305	旭升集团	6,016,295.39	4.84
419	002922	伊戈尔	6,015,854.87	4.84
420	000593	德龙汇能	6,013,944.00	4.83
421	603127	昭衍新药	6,010,501.00	4.83
422	002463	沪电股份	6,010,030.00	4.83
423	603855	华荣股份	6,002,729.00	4.83
424	300280	紫天科技	5,970,836.00	4.80
425	002452	长高电新	5,934,387.00	4.77
426	002448	中原内配	5,924,491.00	4.76
427	600798	宁波海运	5,891,448.00	4.74
428	300402	宝色股份	5,890,752.00	4.74
429	301093	华兰股份	5,887,728.00	4.73
430	300425	中建环能	5,871,567.00	4.72
431	600000	浦发银行	5,867,955.00	4.72
432	688357	建龙微纳	5,866,916.52	4.72
433	603029	天鹅股份	5,865,071.00	4.72
434	003021	兆威机电	5,858,614.00	4.71
435	300211	亿通科技	5,858,214.00	4.71
436	300572	安车检测	5,849,740.00	4.70
437	300845	捷安高科	5,830,930.00	4.69
438	002215	诺普信	5,825,133.00	4.68
439	688261	东微半导	5,818,361.18	4.68
440	300594	朗进科技	5,782,062.00	4.65
441	603917	合力科技	5,769,511.00	4.64
442	300039	上海凯宝	5,753,342.00	4.63
443	002646	天佑德酒	5,748,785.00	4.62
444	300571	平治信息	5,741,578.00	4.62
445	002791	坚朗五金	5,724,221.00	4.60
446	002560	通达股份	5,723,483.00	4.60
447	603208	江山欧派	5,695,719.31	4.58
448	300684	中石科技	5,681,607.00	4.57
449	002957	科瑞技术	5,670,335.00	4.56
450	002880	卫光生物	5,661,228.00	4.55
451	688209	英集芯	5,659,593.16	4.55
452	688676	金盘科技	5,651,478.95	4.54
453	002576	通达动力	5,641,133.00	4.53
454	603043	广州酒家	5,634,106.80	4.53

455	002745	木林森	5,622,284.00	4.52
456	002401	中远海科	5,614,366.00	4.51
457	300691	联合光电	5,607,885.00	4.51
458	688116	天奈科技	5,561,448.34	4.47
459	300825	阿尔特	5,545,690.00	4.46
460	002687	乔治白	5,530,076.00	4.45
461	688567	孚能科技	5,529,938.80	4.45
462	603616	韩建河山	5,522,337.00	4.44
463	688519	南亚新材	5,506,477.06	4.43
464	603109	神驰机电	5,469,011.40	4.40
465	600062	华润双鹤	5,441,459.00	4.37
466	688661	和林微纳	5,410,004.47	4.35
467	688468	科美诊断	5,400,205.59	4.34
468	002302	西部建设	5,394,761.00	4.34
469	002706	良信股份	5,393,715.00	4.34
470	002873	新天药业	5,389,971.00	4.33
471	688165	埃夫特	5,380,547.49	4.33
472	300776	帝尔激光	5,379,974.00	4.33
473	300130	新国都	5,376,710.00	4.32
474	002446	盛路通信	5,370,594.00	4.32
475	300648	星云股份	5,364,439.00	4.31
476	600598	北大荒	5,347,284.00	4.30
477	688617	惠泰医疗	5,345,235.78	4.30
478	603110	东方材料	5,317,365.00	4.27
479	300045	华力创通	5,316,245.00	4.27
480	688207	格灵深瞳	5,308,688.03	4.27
481	603380	易德龙	5,302,240.00	4.26
482	301201	诚达药业	5,292,544.00	4.25
483	688088	虹软科技	5,277,241.56	4.24
484	603179	新泉股份	5,270,242.00	4.24
485	300820	英杰电气	5,266,737.00	4.23
486	600025	华能水电	5,248,963.00	4.22
487	002134	天津普林	5,245,390.00	4.22
488	300643	万通智控	5,233,411.00	4.21
489	603013	亚普股份	5,224,729.00	4.20
490	000951	中国重汽	5,205,742.00	4.18
491	000521	长虹美菱	5,196,120.00	4.18
492	688182	灿勤科技	5,180,371.41	4.16
493	601900	南方传媒	5,176,350.00	4.16
494	600016	民生银行	5,168,898.00	4.16
495	002007	华兰生物	5,163,262.00	4.15
496	301149	隆华新材	5,157,307.00	4.15
497	300566	激智科技	5,154,832.00	4.14

498	002993	奥海科技	5,153,184.00	4.14
499	603682	锦和商管	5,144,386.00	4.14
500	603416	信捷电气	5,074,395.00	4.08
501	002517	恺英网络	5,053,002.00	4.06
502	300285	国瓷材料	5,044,754.00	4.06
503	603983	丸美股份	5,031,431.00	4.04
504	605066	天正电气	5,018,853.00	4.03
505	603187	海容冷链	5,017,325.20	4.03
506	002245	蔚蓝锂芯	5,014,278.00	4.03
507	688255	凯尔达	5,003,741.68	4.02
508	300766	每日互动	5,003,155.00	4.02
509	600905	三峡能源	4,968,341.55	3.99
510	688159	有方科技	4,963,852.65	3.99
511	002546	新联电子	4,958,614.00	3.99
512	603678	火炬电子	4,955,666.00	3.98
513	002723	小崧股份	4,954,927.00	3.98
514	301103	何氏眼科	4,951,191.00	3.98
515	002372	伟星新材	4,935,507.00	3.97
516	688108	赛诺医疗	4,931,438.85	3.96
517	603367	辰欣药业	4,900,845.00	3.94
518	000680	山推股份	4,875,491.00	3.92
519	601997	贵阳银行	4,869,987.00	3.92
520	000757	浩物股份	4,841,780.00	3.89
521	600573	惠泉啤酒	4,830,649.00	3.88
522	300423	昇辉科技	4,821,897.00	3.88
523	000829	天音控股	4,806,787.00	3.86
524	002885	京泉华	4,804,176.20	3.86
525	600266	城建发展	4,795,782.00	3.86
526	300866	安克创新	4,774,537.00	3.84
527	601801	皖新传媒	4,750,287.00	3.82
528	601921	浙版传媒	4,739,795.00	3.81
529	300150	世纪瑞尔	4,739,337.00	3.81
530	688699	明微电子	4,739,051.57	3.81
531	603267	鸿远电子	4,736,035.00	3.81
532	603788	宁波高发	4,728,495.00	3.80
533	002036	联创电子	4,722,119.00	3.80
534	000915	华特达因	4,715,878.00	3.79
535	600391	航发科技	4,712,449.00	3.79
536	002050	三花智控	4,682,041.00	3.76
537	002553	南方精工	4,668,556.00	3.75
538	300298	三诺生物	4,646,579.00	3.74
539	603486	科沃斯	4,642,237.00	3.73
540	300857	协创数据	4,630,212.00	3.72

541	002467	二六三	4,619,363.00	3.71
542	603520	司太立	4,612,269.00	3.71
543	688668	鼎通科技	4,611,785.29	3.71
544	002410	广联达	4,596,585.00	3.70
545	688176	亚虹医药	4,589,278.24	3.69
546	301185	鸥玛软件	4,579,778.00	3.68
547	300510	金冠股份	4,578,998.00	3.68
548	002233	塔牌集团	4,578,848.00	3.68
549	002563	森马服饰	4,578,795.19	3.68
550	000600	建投能源	4,568,317.00	3.67
551	000682	东方电子	4,547,503.00	3.66
552	002317	众生药业	4,546,569.00	3.66
553	601899	紫金矿业	4,531,650.00	3.64
554	603519	立霸股份	4,525,156.00	3.64
555	000777	中核科技	4,523,019.00	3.64
556	603378	亚士创能	4,509,967.00	3.63
557	603757	大元泵业	4,503,245.00	3.62
558	002429	兆驰股份	4,495,884.00	3.61
559	300144	宋城演艺	4,482,229.00	3.60
560	603298	杭叉集团	4,479,395.00	3.60
561	002902	铭普光磁	4,476,138.00	3.60
562	002846	英联股份	4,464,545.00	3.59
563	003026	中晶科技	4,463,477.00	3.59
564	603278	大业股份	4,451,481.00	3.58
565	000960	锡业股份	4,447,817.00	3.58
566	002557	洽洽食品	4,435,592.00	3.57
567	002518	科士达	4,434,352.00	3.56
568	002603	以岭药业	4,433,086.00	3.56
569	603701	德宏股份	4,431,723.00	3.56
570	688658	悦康药业	4,424,676.35	3.56
571	002368	太极股份	4,422,832.00	3.56
572	000559	万向钱潮	4,420,624.00	3.55
573	689009	九号公司	4,406,037.32	3.54
574	300369	绿盟科技	4,402,731.00	3.54
575	688393	安必平	4,400,260.88	3.54
576	002905	金逸影视	4,392,830.00	3.53
577	601375	中原证券	4,386,218.00	3.53
578	002839	张家港行	4,380,646.40	3.52
579	688561	奇安信	4,375,961.43	3.52
580	001227	兰州银行	4,363,927.00	3.51
581	601198	东兴证券	4,356,662.00	3.50
582	688302	海创药业	4,355,732.57	3.50
583	300496	中科创达	4,348,821.00	3.50

584	605499	东鹏饮料	4,337,350.00	3.49
585	603507	振江股份	4,301,868.00	3.46
586	600593	大连圣亚	4,294,572.00	3.45
587	688173	希荻微	4,282,073.98	3.44
588	688233	神工股份	4,267,825.19	3.43
589	688536	思瑞浦	4,264,716.66	3.43
590	688090	瑞松科技	4,258,992.48	3.42
591	600161	天坛生物	4,258,609.00	3.42
592	002587	奥拓电子	4,247,024.00	3.41
593	301089	拓新药业	4,237,024.00	3.41
594	603168	莎普爱思	4,198,635.00	3.38
595	300153	科泰电源	4,192,229.00	3.37
596	600085	同仁堂	4,187,229.00	3.37
597	300558	贝达药业	4,178,085.00	3.36
598	603686	福龙马	4,161,651.00	3.35
599	000759	中百集团	4,160,572.00	3.34
600	000009	中国宝安	4,159,493.00	3.34
601	300096	ST 易联众	4,154,488.00	3.34
602	600098	广州发展	4,151,196.00	3.34
603	603239	浙江仙通	4,149,923.00	3.34
604	603039	泛微网络	4,144,531.00	3.33
605	601666	平煤股份	4,140,439.00	3.33
606	688313	仕佳光子	4,129,516.55	3.32
607	605088	冠盛股份	4,122,091.00	3.31
608	300711	广哈通信	4,121,126.00	3.31
609	600637	东方明珠	4,120,890.00	3.31
610	002149	西部材料	4,120,716.00	3.31
611	300702	天宇股份	4,092,920.00	3.29
612	600535	天士力	4,087,345.00	3.29
613	300304	云意电气	4,085,042.00	3.28
614	300403	汉宇集团	4,080,846.00	3.28
615	603225	新凤鸣	4,072,441.00	3.27
616	300016	北陆药业	4,048,146.00	3.25
617	002017	东信和平	4,047,224.00	3.25
618	688065	凯赛生物	4,043,397.22	3.25
619	603116	红蜻蜓	4,029,777.00	3.24
620	002112	三变科技	4,021,488.00	3.23
621	002261	拓维信息	4,003,570.52	3.22
622	688385	复旦微电	3,988,798.38	3.21
623	600378	昊华科技	3,986,602.00	3.20
624	603156	养元饮品	3,984,453.59	3.20
625	688687	凯因科技	3,970,586.09	3.19
626	300414	中光防雷	3,962,495.00	3.19

627	600248	陕建股份	3,959,213.00	3.18
628	002833	弘亚数控	3,958,273.00	3.18
629	002375	亚厦股份	3,957,709.00	3.18
630	688382	益方生物	3,946,283.40	3.17
631	600590	泰豪科技	3,943,793.00	3.17
632	603197	保隆科技	3,906,500.00	3.14
633	003029	吉大正元	3,903,398.00	3.14
634	000586	汇源通信	3,896,787.00	3.13
635	300200	高盟新材	3,874,926.00	3.12
636	600601	方正科技	3,872,653.00	3.11
637	603527	众源新材	3,867,744.00	3.11
638	603076	乐惠国际	3,863,239.00	3.11
639	003032	传智教育	3,846,122.00	3.09
640	300005	探路者	3,826,975.00	3.08
641	600252	中恒集团	3,820,474.00	3.07
642	000554	泰山石油	3,812,329.00	3.06
643	300043	星辉娱乐	3,811,123.00	3.06
644	688121	卓然股份	3,803,842.08	3.06
645	300011	鼎汉技术	3,800,098.00	3.05
646	002655	共达电声	3,799,405.00	3.05
647	002552	宝鼎科技	3,786,330.54	3.04
648	603313	梦百合	3,774,370.00	3.03
649	603113	金能科技	3,773,466.00	3.03
650	300482	万孚生物	3,765,656.49	3.03
651	300105	龙源技术	3,762,463.00	3.02
652	600571	信雅达	3,749,311.00	3.01
653	300042	朗科科技	3,749,249.00	3.01
654	002707	众信旅游	3,745,528.00	3.01
655	688609	九联科技	3,744,421.18	3.01
656	300035	中科电气	3,744,324.00	3.01
657	002048	宁波华翔	3,744,318.00	3.01
658	300541	先进数通	3,717,382.00	2.99
659	002045	国光电器	3,715,193.00	2.99
660	600765	中航重机	3,708,935.44	2.98
661	603927	中科软	3,686,563.00	2.96
662	600329	达仁堂	3,674,167.00	2.95
663	000810	创维数字	3,670,766.00	2.95
664	002997	瑞鹤模具	3,662,465.00	2.94
665	300772	运达股份	3,661,648.60	2.94
666	002056	横店东磁	3,647,476.00	2.93
667	002916	深南电路	3,641,640.00	2.93
668	002444	巨星科技	3,633,519.00	2.92
669	688205	德科立	3,629,293.51	2.92

670	688058	宝兰德	3,623,965.97	2.91
671	002189	中光学	3,617,060.00	2.91
672	301096	百诚医药	3,612,103.00	2.90
673	002892	科力尔	3,588,918.00	2.89
674	301051	信濠光电	3,576,199.00	2.87
675	603859	能科科技	3,570,249.00	2.87
676	603610	麒盛科技	3,565,145.00	2.87
677	002819	东方中科	3,561,652.00	2.86
678	002531	天顺风能	3,547,649.00	2.85
679	300578	会畅通讯	3,545,209.00	2.85
680	603698	航天工程	3,525,632.00	2.83
681	002100	天康生物	3,510,326.00	2.82
682	603186	华正新材	3,508,786.00	2.82
683	002484	江海股份	3,498,148.00	2.81
684	600301	华锡有色	3,485,831.00	2.80
685	603767	中马传动	3,483,776.00	2.80
686	002853	皮阿诺	3,472,914.00	2.79
687	003005	竞业达	3,464,427.00	2.79
688	688112	鼎阳科技	3,457,965.25	2.78
689	300628	亿联网络	3,447,742.00	2.77
690	002362	汉王科技	3,445,591.00	2.77
691	600999	招商证券	3,441,406.82	2.77
692	600867	通化东宝	3,432,003.00	2.76
693	300678	中科信息	3,425,256.00	2.75
694	000423	东阿阿胶	3,416,393.00	2.75
695	000666	经纬纺机	3,400,626.00	2.73
696	301029	怡合达	3,398,978.00	2.73
697	002402	和而泰	3,386,599.00	2.72
698	300436	广生堂	3,382,013.00	2.72
699	600756	浪潮软件	3,361,175.00	2.70
700	603668	天马科技	3,334,491.60	2.68
701	688103	国力股份	3,330,184.38	2.68
702	688192	迪哲医药	3,329,696.86	2.68
703	600130	波导股份	3,325,956.00	2.67
704	688560	明冠新材	3,324,538.89	2.67
705	601991	大唐发电	3,319,134.00	2.67
706	688425	铁建重工	3,314,625.23	2.66
707	600222	太龙药业	3,314,364.00	2.66
708	300515	三德科技	3,313,259.00	2.66
709	688711	宏微科技	3,295,172.31	2.65
710	605167	利柏特	3,292,789.00	2.65
711	300366	创意信息	3,291,371.00	2.65
712	002373	千方科技	3,290,796.00	2.65

713	600521	华海药业	3,285,498.00	2.64
714	002843	泰嘉股份	3,278,257.00	2.64
715	300542	新晨科技	3,267,804.00	2.63
716	600073	上海梅林	3,258,980.00	2.62
717	300606	金太阳	3,252,269.00	2.61
718	002983	芯瑞达	3,247,988.00	2.61
719	600499	科达制造	3,243,189.00	2.61
720	688667	菱电电控	3,243,179.16	2.61
721	002940	昂利康	3,240,951.00	2.61
722	601916	浙商银行	3,234,845.80	2.60
723	002165	红宝丽	3,218,092.00	2.59
724	002891	中宠股份	3,217,021.00	2.59
725	300194	福安药业	3,214,419.00	2.58
726	688626	翔宇医疗	3,208,606.22	2.58
727	600480	凌云股份	3,204,663.00	2.58
728	002908	德生科技	3,193,186.00	2.57
729	002851	麦格米特	3,189,169.00	2.56
730	300396	迪瑞医疗	3,177,937.00	2.55
731	603033	三维股份	3,176,320.00	2.55
732	000677	恒天海龙	3,172,901.00	2.55
733	002979	雷赛智能	3,170,316.00	2.55
734	601377	兴业证券	3,157,211.00	2.54
735	600664	哈药股份	3,157,163.00	2.54
736	002611	东方精工	3,156,189.00	2.54
737	000751	锌业股份	3,152,043.00	2.53
738	603496	恒为科技	3,133,632.00	2.52
739	688403	汇成股份	3,128,616.58	2.52
740	002367	康力电梯	3,120,933.00	2.51
741	600846	同济科技	3,117,163.00	2.51
742	688032	禾迈股份	3,115,628.75	2.50
743	603037	凯众股份	3,114,893.00	2.50
744	603648	畅联股份	3,113,654.00	2.50
745	688181	八亿时空	3,108,335.81	2.50
746	301188	力诺特玻	3,107,118.00	2.50
747	301101	明月镜片	3,089,859.50	2.48
748	300484	蓝海华腾	3,088,115.00	2.48
749	300584	海辰药业	3,083,380.00	2.48
750	300511	雪榕生物	3,072,823.00	2.47
751	600021	上海电力	3,069,906.00	2.47
752	688621	阳光诺和	3,063,594.95	2.46
753	688246	嘉和美康	3,059,169.33	2.46
754	300990	同飞股份	3,057,479.80	2.46
755	601007	金陵饭店	3,053,624.00	2.45

756	301060	兰卫医学	3,051,472.00	2.45
757	605196	华通线缆	3,049,956.00	2.45
758	300146	汤臣倍健	3,047,195.00	2.45
759	688066	航天宏图	3,041,230.78	2.44
760	300185	通裕重工	3,040,714.00	2.44
761	605117	德业股份	3,036,692.40	2.44
762	603220	中贝通信	3,027,945.00	2.43
763	300219	鸿利智汇	3,024,342.00	2.43
764	601858	中国科传	3,016,921.00	2.43
765	600523	贵航股份	3,006,801.00	2.42
766	603808	歌力思	3,002,423.00	2.41
767	000584	ST 工智	2,991,429.00	2.40
768	000848	承德露露	2,986,053.00	2.40
769	688305	科德数控	2,981,524.23	2.40
770	002971	和远气体	2,980,145.00	2.40
771	688550	瑞联新材	2,979,852.09	2.40
772	688001	华兴源创	2,972,989.97	2.39
773	002976	瑞玛精密	2,963,620.00	2.38
774	603050	科林电气	2,961,929.00	2.38
775	002094	青岛金王	2,959,096.00	2.38
776	300404	博济医药	2,958,217.00	2.38
777	600262	北方股份	2,949,134.00	2.37
778	603711	香飘飘	2,936,263.00	2.36
779	300333	兆日科技	2,920,702.00	2.35
780	300660	江苏雷利	2,914,368.00	2.34
781	002782	可立克	2,907,325.00	2.34
782	300698	万马科技	2,891,234.00	2.32
783	600679	上海凤凰	2,890,823.00	2.32
784	688322	奥比中光	2,888,874.35	2.32
785	002991	甘源食品	2,887,599.00	2.32
786	603896	寿仙谷	2,880,311.00	2.32
787	000797	中国武夷	2,876,718.00	2.31
788	300759	康龙化成	2,875,067.00	2.31
789	002041	登海种业	2,872,477.00	2.31
790	600858	银座股份	2,868,732.00	2.31
791	002043	兔宝宝	2,853,119.00	2.29
792	002084	海鸥住工	2,852,319.00	2.29
793	603121	华培动力	2,850,936.00	2.29
794	600966	博汇纸业	2,841,239.00	2.28
795	603818	曲美家居	2,837,010.00	2.28
796	601126	四方股份	2,835,511.00	2.28
797	603699	纽威股份	2,831,589.00	2.28
798	600213	亚星客车	2,830,644.00	2.28

799	300618	寒锐钴业	2,829,869.00	2.27
800	600738	丽尚国潮	2,820,213.00	2.27
801	300138	晨光生物	2,815,839.00	2.26
802	688386	泛亚微透	2,813,669.45	2.26
803	600639	浦东金桥	2,811,270.90	2.26
804	300192	科德教育	2,808,252.00	2.26
805	603517	绝味食品	2,807,711.00	2.26
806	688639	华恒生物	2,794,094.68	2.25
807	000035	中国天楹	2,766,063.00	2.22
808	002823	凯中精密	2,762,965.00	2.22
809	605133	嵘泰股份	2,761,830.00	2.22
810	002792	通宇通讯	2,759,984.00	2.22
811	002697	红旗连锁	2,751,806.00	2.21
812	002810	山东赫达	2,751,302.00	2.21
813	002683	广东宏大	2,748,771.00	2.21
814	300815	玉禾田	2,747,504.00	2.21
815	603790	雅运股份	2,746,205.00	2.21
816	600114	东睦股份	2,745,178.00	2.21
817	300662	科锐国际	2,733,476.00	2.20
818	002468	申通快递	2,730,083.00	2.19
819	603738	泰晶科技	2,726,189.80	2.19
820	002197	证通电子	2,711,730.00	2.18
821	000635	英力特	2,710,036.00	2.18
822	688520	神州细胞	2,700,004.23	2.17
823	301030	仕净科技	2,697,898.00	2.17
824	603489	八方股份	2,693,144.00	2.17
825	600997	开滦股份	2,689,500.00	2.16
826	688107	安路科技	2,682,896.37	2.16
827	688766	普冉股份	2,682,508.55	2.16
828	300786	国林科技	2,673,503.60	2.15
829	300622	博士眼镜	2,673,037.00	2.15
830	002612	朗姿股份	2,670,740.00	2.15
831	002869	金溢科技	2,659,048.00	2.14
832	603693	江苏新能	2,648,373.00	2.13
833	300613	富瀚微	2,647,853.00	2.13
834	600376	首开股份	2,632,123.00	2.12
835	000776	广发证券	2,629,016.00	2.11
836	300188	国投智能	2,627,880.20	2.11
837	000852	石化机械	2,627,141.00	2.11
838	002690	美亚光电	2,625,998.50	2.11
839	603877	太平鸟	2,623,451.00	2.11
840	002003	伟星股份	2,623,050.80	2.11
841	688123	聚辰股份	2,599,579.72	2.09

842	688678	福立旺	2,597,249.75	2.09
843	300861	美畅股份	2,590,131.00	2.08
844	688517	金冠电气	2,587,230.01	2.08
845	688510	航亚科技	2,584,965.62	2.08
846	603908	牧高笛	2,583,491.00	2.08
847	301165	锐捷网络	2,574,600.00	2.07
848	603283	赛腾股份	2,563,227.00	2.06
849	603118	共进股份	2,556,759.00	2.06
850	300112	万讯自控	2,528,006.00	2.03
851	002896	中大力德	2,517,995.00	2.02
852	301031	中熔电气	2,515,940.00	2.02
853	603339	四方科技	2,514,272.00	2.02
854	002703	浙江世宝	2,505,885.00	2.01
855	688180	君实生物	2,502,213.65	2.01
856	300500	启迪设计	2,499,261.00	2.01
857	300939	秋田微	2,499,092.00	2.01
858	000552	甘肃能化	2,493,459.00	2.00

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	002371	北方华创	41,289,386.74	33.19
2	688418	震有科技	32,698,716.03	26.29
3	300213	佳讯飞鸿	29,532,319.00	23.74
4	688234	天岳先进	28,759,542.01	23.12
5	600519	贵州茅台	27,050,091.00	21.75
6	300634	彩讯股份	26,212,378.00	21.07
7	000021	深科技	25,556,051.83	20.54
8	603236	移远通信	25,526,611.38	20.52
9	000975	银泰黄金	25,476,062.00	20.48
10	000568	泸州老窖	25,370,386.82	20.40
11	300724	捷佳伟创	23,591,708.00	18.97
12	300274	阳光电源	23,453,316.00	18.85
13	300533	冰川网络	23,430,616.00	18.84
14	000596	古井贡酒	23,120,338.52	18.59
15	600418	江淮汽车	23,013,479.00	18.50
16	002897	意华股份	22,399,652.56	18.01
17	603396	金辰股份	22,091,995.00	17.76
18	300785	值得买	21,387,717.79	17.19
19	000014	沙河股份	21,366,390.24	17.18
20	688590	新致软件	20,803,360.59	16.72
21	688262	国芯科技	20,772,610.97	16.70

22	603516	淳中科技	20,572,757.05	16.54
23	300560	中富通	20,512,387.60	16.49
24	002970	锐明技术	20,253,451.00	16.28
25	000821	京山轻机	19,930,715.00	16.02
26	002466	天齐锂业	19,074,592.00	15.33
27	601225	陕西煤业	19,016,869.00	15.29
28	300252	金信诺	18,976,955.00	15.26
29	688158	优刻得	18,810,264.76	15.12
30	000729	燕京啤酒	18,377,580.00	14.77
31	002222	福晶科技	18,266,764.00	14.68
32	600066	宇通客车	18,199,127.00	14.63
33	301039	中集车辆	18,070,036.00	14.53
34	601001	晋控煤业	18,053,505.14	14.51
35	000032	深桑达 A	18,020,502.00	14.49
36	300113	顺网科技	17,944,328.00	14.43
37	002919	名臣健康	17,840,845.50	14.34
38	300232	洲明科技	17,661,998.00	14.20
39	002527	新时达	17,505,907.79	14.07
40	600489	中金黄金	17,386,103.00	13.98
41	000801	四川九洲	17,150,006.00	13.79
42	600346	恒力石化	16,934,811.60	13.61
43	688025	杰普特	16,901,183.78	13.59
44	300389	艾比森	16,809,229.94	13.51
45	002292	奥飞娱乐	16,734,455.00	13.45
46	300493	润欣科技	16,536,813.26	13.29
47	002559	亚威股份	16,324,779.00	13.12
48	300788	中信出版	16,308,685.00	13.11
49	300357	我武生物	16,299,035.00	13.10
50	603533	掌阅科技	16,296,004.00	13.10
51	300081	恒信东方	16,085,644.35	12.93
52	300246	宝莱特	16,059,486.50	12.91
53	300490	华自科技	16,024,704.00	12.88
54	603028	赛福天	16,004,266.60	12.87
55	600728	佳都科技	15,976,210.00	12.84
56	688019	安集科技	15,879,712.28	12.77
57	300751	迈为股份	15,850,677.12	12.74
58	300474	景嘉微	15,654,441.00	12.58
59	600351	亚宝药业	15,626,025.00	12.56
60	601186	中国铁建	15,590,502.00	12.53
61	000590	启迪药业	15,471,931.00	12.44
62	688508	芯朋微	15,424,150.67	12.40
63	300520	科大国创	15,382,112.41	12.37
64	300693	盛弘股份	15,288,144.46	12.29

65	688601	力芯微	15,133,293.45	12.17
66	300708	聚灿光电	15,071,681.00	12.12
67	688589	力合微	15,041,324.53	12.09
68	300114	中航电测	14,952,058.00	12.02
69	300570	太辰光	14,780,549.00	11.88
70	601699	潞安环能	14,599,840.00	11.74
71	688018	乐鑫科技	14,558,452.21	11.70
72	688366	昊海生科	14,520,636.29	11.67
73	300589	江龙船艇	14,437,233.80	11.61
74	688588	凌志软件	14,367,028.46	11.55
75	688390	固德威	14,331,166.61	11.52
76	688365	光云科技	14,262,351.22	11.47
77	000888	峨眉山 A	14,121,751.00	11.35
78	300378	鼎捷软件	14,102,978.07	11.34
79	600148	长春一东	14,012,126.00	11.26
80	000906	浙商中拓	13,999,126.31	11.25
81	301168	通灵股份	13,951,381.36	11.22
82	301085	亚康股份	13,879,815.60	11.16
83	603019	中科曙光	13,840,085.00	11.13
84	300288	朗玛信息	13,830,519.00	11.12
85	688596	正帆科技	13,792,777.58	11.09
86	002878	元隆雅图	13,770,538.00	11.07
87	300161	华中数控	13,712,756.04	11.02
88	688318	财富趋势	13,701,140.85	11.01
89	688135	利扬芯片	13,694,682.29	11.01
90	300706	阿石创	13,685,530.00	11.00
91	002594	比亚迪	13,584,644.00	10.92
92	688499	利元亨	13,559,674.59	10.90
93	600115	中国东航	13,549,003.00	10.89
94	603338	浙江鼎力	13,527,933.00	10.88
95	300559	佳发教育	13,486,400.00	10.84
96	603885	吉祥航空	13,477,541.00	10.83
97	300674	宇信科技	13,460,213.00	10.82
98	688195	腾景科技	13,393,304.11	10.77
99	688368	晶丰明源	13,330,424.85	10.72
100	600667	太极实业	13,323,738.00	10.71
101	002315	焦点科技	13,319,849.00	10.71
102	002131	利欧股份	13,289,402.00	10.68
103	000333	美的集团	13,277,634.00	10.67
104	688036	传音控股	13,270,707.02	10.67
105	000063	中兴通讯	13,262,885.81	10.66
106	688772	珠海冠宇	13,208,530.40	10.62
107	300316	晶盛机电	13,179,788.50	10.60

108	002803	吉宏股份	13,160,984.00	10.58
109	300835	龙磁科技	13,140,297.60	10.56
110	601919	中远海控	13,072,736.00	10.51
111	002649	博彦科技	13,065,917.00	10.50
112	300491	通合科技	12,989,001.40	10.44
113	002568	百润股份	12,978,240.20	10.43
114	688787	海天瑞声	12,967,057.82	10.42
115	600694	大商股份	12,936,356.48	10.40
116	002299	圣农发展	12,836,747.00	10.32
117	688118	普元信息	12,832,399.09	10.32
118	002912	中新赛克	12,640,592.08	10.16
119	002483	润邦股份	12,638,374.00	10.16
120	000528	柳 工	12,633,020.00	10.16
121	300031	宝通科技	12,623,599.27	10.15
122	300017	网宿科技	12,604,679.00	10.13
123	300458	全志科技	12,585,217.56	10.12
124	002845	同兴达	12,559,955.00	10.10
125	300058	蓝色光标	12,543,500.00	10.08
126	688126	沪硅产业	12,468,725.95	10.02
127	601969	海南矿业	12,461,320.00	10.02
128	603501	韦尔股份	12,457,724.80	10.01
129	688002	睿创微纳	12,456,380.98	10.01
130	002732	燕塘乳业	12,449,015.00	10.01
131	688039	当虹科技	12,392,101.79	9.96
132	002876	三利谱	12,302,320.00	9.89
133	300136	信维通信	12,290,227.56	9.88
134	002126	银轮股份	12,213,901.00	9.82
135	600498	烽火通信	12,208,433.00	9.81
136	688138	清溢光电	12,142,660.44	9.76
137	300853	申昊科技	12,138,288.00	9.76
138	002419	天虹股份	12,018,975.00	9.66
139	300494	盛天网络	12,015,885.00	9.66
140	002555	三七互娱	11,956,984.00	9.61
141	600737	中粮糖业	11,898,103.00	9.57
142	002032	苏 泊 尔	11,846,749.60	9.52
143	601038	一拖股份	11,844,936.00	9.52
144	600642	申能股份	11,774,127.15	9.47
145	688258	卓易信息	11,768,315.85	9.46
146	000727	冠捷科技	11,634,411.00	9.35
147	600185	格力地产	11,597,445.00	9.32
148	688208	道通科技	11,540,457.38	9.28
149	600438	通威股份	11,493,535.53	9.24
150	002870	香山股份	11,397,143.00	9.16

151	300679	电连技术	11,332,743.00	9.11
152	300846	首都在线	11,304,471.00	9.09
153	002795	永和智控	11,287,425.00	9.07
154	000969	安泰科技	11,283,222.00	9.07
155	600482	中国动力	11,247,784.00	9.04
156	300314	戴维医疗	11,193,122.00	9.00
157	300667	必创科技	11,101,295.00	8.92
158	601212	白银有色	11,082,624.00	8.91
159	688599	天合光能	11,059,464.18	8.89
160	688777	中控技术	11,053,321.68	8.89
161	002493	荣盛石化	11,029,616.00	8.87
162	688072	拓荆科技	11,019,299.30	8.86
163	300327	中颖电子	10,973,128.51	8.82
164	002712	思美传媒	10,948,146.00	8.80
165	600576	祥源文旅	10,938,184.00	8.79
166	688218	江苏北人	10,892,950.25	8.76
167	300745	欣锐科技	10,866,041.00	8.74
168	002497	雅化集团	10,856,908.00	8.73
169	688408	中信博	10,844,523.98	8.72
170	002671	龙泉股份	10,840,998.00	8.72
171	603348	文灿股份	10,823,980.15	8.70
172	600110	诺德股份	10,804,944.10	8.69
173	300847	中船汉光	10,780,877.00	8.67
174	301041	金百泽	10,768,681.00	8.66
175	300286	安科瑞	10,745,880.00	8.64
176	300514	友讯达	10,739,774.00	8.63
177	603997	继峰股份	10,646,652.00	8.56
178	603956	威派格	10,639,020.42	8.55
179	301013	利和兴	10,630,760.00	8.55
180	301050	雷电微力	10,564,929.40	8.49
181	300812	易天股份	10,523,525.60	8.46
182	688095	福昕软件	10,522,871.44	8.46
183	688311	盟升电子	10,489,779.02	8.43
184	600546	山煤国际	10,477,294.00	8.42
185	688049	炬芯科技	10,440,043.99	8.39
186	000901	航天科技	10,390,675.00	8.35
187	688358	祥生医疗	10,380,102.81	8.34
188	600180	瑞茂通	10,324,369.00	8.30
189	300473	德尔股份	10,311,222.44	8.29
190	300556	丝路视觉	10,269,388.00	8.26
191	002533	金杯电工	10,268,236.00	8.25
192	688662	富信科技	10,172,384.66	8.18
193	300620	光库科技	10,156,339.00	8.16

194	601233	桐昆股份	10,121,663.00	8.14
195	600976	健民集团	10,098,383.13	8.12
196	002119	康强电子	10,095,716.28	8.12
197	300001	特锐德	10,018,484.00	8.05
198	600600	青岛啤酒	10,008,686.40	8.05
199	002335	科华数据	10,008,625.35	8.05
200	688080	映翰通	9,991,785.82	8.03
201	601985	中国核电	9,988,212.00	8.03
202	601088	中国神华	9,966,492.00	8.01
203	300590	移为通信	9,933,275.50	7.99
204	300308	中际旭创	9,916,792.00	7.97
205	603165	荣晟环保	9,899,443.92	7.96
206	300340	科恒股份	9,891,410.00	7.95
207	688369	致远互联	9,875,009.65	7.94
208	300276	三丰智能	9,866,366.00	7.93
209	601077	渝农商行	9,839,062.00	7.91
210	301152	天力锂能	9,822,937.02	7.90
211	000898	鞍钢股份	9,812,310.00	7.89
212	600446	金证股份	9,808,998.00	7.89
213	603919	金徽酒	9,784,610.27	7.87
214	603181	皇马科技	9,735,508.00	7.83
215	300344	立方数科	9,727,591.00	7.82
216	600779	水井坊	9,611,439.00	7.73
217	688111	金山办公	9,520,434.14	7.65
218	600153	建发股份	9,500,599.96	7.64
219	300299	富春股份	9,493,721.00	7.63
220	300624	万兴科技	9,472,628.00	7.62
221	300747	锐科激光	9,425,668.00	7.58
222	300894	火星人	9,420,308.00	7.57
223	600809	山西汾酒	9,398,129.00	7.56
224	600968	海油发展	9,320,609.00	7.49
225	001696	宗申动力	9,300,154.00	7.48
226	688128	中国电研	9,294,060.99	7.47
227	002196	方正电机	9,265,179.00	7.45
228	603326	我乐家居	9,219,826.00	7.41
229	000026	飞亚达	9,192,511.00	7.39
230	688578	艾力斯	9,121,758.21	7.33
231	000790	华神科技	9,099,989.00	7.32
232	300502	新易盛	9,091,469.00	7.31
233	688169	石头科技	9,078,571.62	7.30
234	600456	宝钛股份	9,077,222.00	7.30
235	300615	欣天科技	9,053,352.00	7.28
236	301011	华立科技	9,050,501.20	7.28

237	002345	潮宏基	9,047,392.00	7.27
238	603158	腾龙股份	9,015,459.80	7.25
239	300235	方直科技	9,011,012.00	7.24
240	688177	百奥泰	8,978,566.09	7.22
241	002866	传艺科技	8,972,245.00	7.21
242	002835	同为股份	8,972,236.00	7.21
243	601766	中国中车	8,835,631.00	7.10
244	600325	华发股份	8,824,052.00	7.09
245	603045	福达合金	8,781,113.00	7.06
246	300002	神州泰岳	8,777,977.00	7.06
247	601169	北京银行	8,741,155.00	7.03
248	688292	浩瀚深度	8,726,587.11	7.02
249	000048	京基智农	8,723,202.38	7.01
250	300870	欧陆通	8,693,774.85	6.99
251	300206	理邦仪器	8,692,807.60	6.99
252	000581	威孚高科	8,686,087.00	6.98
253	688259	创耀科技	8,680,898.89	6.98
254	300238	冠昊生物	8,675,638.00	6.97
255	688099	晶晨股份	8,649,227.44	6.95
256	688521	芯原股份	8,631,151.09	6.94
257	002773	康弘药业	8,617,715.00	6.93
258	002609	捷顺科技	8,594,076.00	6.91
259	000776	广发证券	8,532,443.00	6.86
260	300638	广和通	8,509,204.00	6.84
261	601898	中煤能源	8,486,227.00	6.82
262	601595	上海电影	8,470,109.00	6.81
263	600272	开开实业	8,458,642.00	6.80
264	300680	隆盛科技	8,455,416.00	6.80
265	002461	珠江啤酒	8,440,148.00	6.79
266	002395	双象股份	8,357,312.00	6.72
267	600449	宁夏建材	8,345,968.00	6.71
268	600011	华能国际	8,320,417.00	6.69
269	002841	视源股份	8,303,333.00	6.68
270	300709	精研科技	8,298,211.70	6.67
271	002169	智光电气	8,295,612.00	6.67
272	603883	老百姓	8,271,674.00	6.65
273	300582	英飞特	8,192,479.00	6.59
274	002980	华盛昌	8,152,704.00	6.55
275	300534	陇神戎发	8,081,542.00	6.50
276	688170	德龙激光	8,059,885.42	6.48
277	605333	沪光股份	8,050,365.00	6.47
278	300842	帝科股份	8,012,789.00	6.44
279	688235	百济神州	7,970,658.09	6.41

280	300719	安达维尔	7,941,389.00	6.38
281	600057	厦门象屿	7,911,227.96	6.36
282	688286	敏芯股份	7,879,906.44	6.33
283	600197	伊力特	7,822,082.00	6.29
284	002990	盛视科技	7,821,730.60	6.29
285	600859	王府井	7,801,304.00	6.27
286	600572	康恩贝	7,776,913.17	6.25
287	000800	一汽解放	7,745,747.00	6.23
288	688300	联瑞新材	7,696,978.08	6.19
289	605305	中际联合	7,692,635.00	6.18
290	688062	迈威生物	7,614,239.37	6.12
291	000989	九芝堂	7,607,032.00	6.12
292	688106	金宏气体	7,605,344.18	6.11
293	603518	锦泓集团	7,576,406.00	6.09
294	688566	吉贝尔	7,550,688.97	6.07
295	001979	招商蛇口	7,524,557.00	6.05
296	002913	奥士康	7,509,141.00	6.04
297	601098	中南传媒	7,502,293.00	6.03
298	002893	京能热力	7,459,865.00	6.00
299	300729	乐歌股份	7,432,535.40	5.98
300	002820	桂发祥	7,341,745.00	5.90
301	002713	东易日盛	7,335,545.00	5.90
302	300498	温氏股份	7,332,938.00	5.90
303	300394	天孚通信	7,257,145.00	5.83
304	688378	奥来德	7,226,384.05	5.81
305	601179	中国西电	7,153,026.00	5.75
306	688580	伟思医疗	7,140,455.29	5.74
307	002747	埃斯顿	7,091,524.00	5.70
308	688316	青云科技	7,082,430.30	5.69
309	300129	泰胜风能	7,078,635.00	5.69
310	601003	柳钢股份	7,073,403.00	5.69
311	002757	南兴股份	7,071,448.00	5.68
312	601633	长城汽车	7,069,559.00	5.68
313	000526	学大教育	7,051,929.00	5.67
314	002917	金奥博	7,044,271.00	5.66
315	601021	春秋航空	7,036,217.00	5.66
316	603589	口子窖	7,033,329.39	5.65
317	300718	长盛轴承	6,989,547.00	5.62
318	002396	星网锐捷	6,978,870.00	5.61
319	601799	星宇股份	6,974,153.66	5.61
320	688076	诺泰生物	6,936,955.75	5.58
321	603269	海鸥股份	6,891,787.00	5.54
322	002730	电光科技	6,890,777.00	5.54

323	600985	淮北矿业	6,826,517.63	5.49
324	300548	博创科技	6,824,920.00	5.49
325	002576	通达动力	6,804,081.00	5.47
326	600710	苏美达	6,793,558.00	5.46
327	002791	坚朗五金	6,782,380.00	5.45
328	300659	中孚信息	6,742,026.00	5.42
329	600999	招商证券	6,737,013.00	5.42
330	601360	三六零	6,735,311.00	5.41
331	301117	佳缘科技	6,733,594.50	5.41
332	000811	冰轮环境	6,720,362.00	5.40
333	300592	华凯易佰	6,690,781.00	5.38
334	601377	兴业证券	6,660,926.00	5.35
335	600021	上海电力	6,660,673.00	5.35
336	603258	电魂网络	6,644,971.00	5.34
337	300127	银河磁体	6,636,555.00	5.34
338	300280	紫天科技	6,631,781.00	5.33
339	300768	迪普科技	6,593,991.00	5.30
340	688223	晶科能源	6,592,981.00	5.30
341	601717	郑煤机	6,592,820.00	5.30
342	603196	日播时尚	6,590,577.00	5.30
343	002651	利君股份	6,586,226.00	5.29
344	603508	思维列控	6,584,301.00	5.29
345	002903	宇环数控	6,576,372.00	5.29
346	688016	心脉医疗	6,520,667.92	5.24
347	603029	天鹅股份	6,517,127.00	5.24
348	601311	骆驼股份	6,507,012.00	5.23
349	688020	方邦股份	6,498,212.28	5.22
350	603387	基蛋生物	6,498,132.72	5.22
351	603138	海量数据	6,488,625.00	5.22
352	301155	海力风电	6,472,052.00	5.20
353	688628	优利德	6,466,770.25	5.20
354	002534	西子洁能	6,464,480.63	5.20
355	688798	艾为电子	6,461,869.01	5.19
356	603199	九华旅游	6,408,400.00	5.15
357	002705	新宝股份	6,398,378.00	5.14
358	605599	莱百股份	6,370,409.00	5.12
359	000039	中集集团	6,347,458.00	5.10
360	002922	伊戈尔	6,345,655.06	5.10
361	688409	富创精密	6,331,614.47	5.09
362	002860	星帅尔	6,328,162.00	5.09
363	600750	江中药业	6,287,763.00	5.05
364	603611	诺力股份	6,266,852.00	5.04
365	000990	诚志股份	6,260,280.00	5.03

366	300387	富邦股份	6,258,941.00	5.03
367	603989	艾华集团	6,228,928.00	5.01
368	688139	海尔生物	6,219,591.04	5.00
369	000948	南天信息	6,201,306.00	4.99
370	300253	卫宁健康	6,184,764.28	4.97
371	603929	亚翔集成	6,181,471.00	4.97
372	300972	万辰集团	6,177,698.00	4.97
373	688676	金盘科技	6,173,958.01	4.96
374	002268	电科网安	6,137,566.00	4.93
375	301221	光庭信息	6,078,335.56	4.89
376	300425	中建环能	6,074,198.00	4.88
377	300421	力星股份	6,071,314.79	4.88
378	000593	德龙汇能	6,035,505.00	4.85
379	300841	康华生物	5,995,665.82	4.82
380	300684	中石科技	5,994,457.00	4.82
381	002128	电投能源	5,988,894.00	4.81
382	300572	安车检测	5,974,769.00	4.80
383	300882	万胜智能	5,964,703.00	4.80
384	603127	昭衍新药	5,960,377.00	4.79
385	300825	阿尔特	5,957,051.00	4.79
386	002234	民和股份	5,952,064.00	4.78
387	603233	大参林	5,948,711.55	4.78
388	603305	旭升集团	5,934,683.40	4.77
389	002724	海洋王	5,916,641.00	4.76
390	002159	三特索道	5,896,286.00	4.74
391	603917	合力科技	5,883,799.80	4.73
392	600062	华润双鹤	5,873,119.00	4.72
393	300884	狄耐克	5,872,503.00	4.72
394	688206	概伦电子	5,869,019.63	4.72
395	300465	高伟达	5,852,870.00	4.71
396	003021	兆威机电	5,846,953.00	4.70
397	002085	万丰奥威	5,841,105.00	4.70
398	002388	新亚制程	5,830,955.00	4.69
399	301052	果麦文化	5,817,786.00	4.68
400	300039	上海凯宝	5,814,064.00	4.67
401	300594	朗进科技	5,804,147.00	4.67
402	603208	江山欧派	5,784,569.20	4.65
403	002560	通达股份	5,780,837.00	4.65
404	600798	宁波海运	5,753,691.00	4.63
405	688131	皓元医药	5,738,882.57	4.61
406	002880	卫光生物	5,712,265.00	4.59
407	600817	宇通重工	5,692,224.00	4.58
408	002448	中原内配	5,685,882.00	4.57

409	300294	博雅生物	5,678,422.00	4.56
410	603179	新泉股份	5,671,903.00	4.56
411	603730	岱美股份	5,638,377.00	4.53
412	688209	英集芯	5,616,978.60	4.52
413	300691	联合光电	5,616,820.00	4.52
414	002646	天佑德酒	5,603,566.00	4.50
415	688261	东微半导	5,591,552.20	4.50
416	603977	国泰集团	5,587,548.00	4.49
417	002452	长高电新	5,585,863.00	4.49
418	300845	捷安高科	5,576,858.00	4.48
419	688182	灿勤科技	5,556,187.01	4.47
420	600030	中信证券	5,538,437.00	4.45
421	688519	南亚新材	5,536,149.92	4.45
422	688617	惠泰医疗	5,525,772.73	4.44
423	600000	浦发银行	5,505,924.00	4.43
424	603380	易德龙	5,485,916.00	4.41
425	600563	法拉电子	5,471,327.00	4.40
426	300617	安靠智电	5,459,291.00	4.39
427	002401	中远海科	5,442,536.00	4.38
428	688116	天奈科技	5,410,103.71	4.35
429	300412	迦南科技	5,399,780.00	4.34
430	002215	诺普信	5,379,142.00	4.32
431	688661	和林微纳	5,373,381.59	4.32
432	300820	英杰电气	5,359,807.50	4.31
433	688357	建龙微纳	5,347,757.95	4.30
434	002446	盛路通信	5,334,197.00	4.29
435	300566	激智科技	5,326,340.00	4.28
436	300776	帝尔激光	5,300,896.00	4.26
437	603616	韩建河山	5,286,938.00	4.25
438	300402	宝色股份	5,260,406.00	4.23
439	603109	神驰机电	5,223,485.00	4.20
440	002706	良信股份	5,221,831.00	4.20
441	603416	信捷电气	5,221,025.92	4.20
442	600132	重庆啤酒	5,204,639.00	4.18
443	301093	华兰股份	5,179,187.00	4.16
444	600016	民生银行	5,178,907.00	4.16
445	002302	西部建设	5,177,041.00	4.16
446	600905	三峡能源	5,168,954.00	4.16
447	600598	北大荒	5,168,509.00	4.16
448	688207	格灵深瞳	5,166,909.68	4.15
449	300093	金刚光伏	5,122,156.00	4.12
450	300648	星云股份	5,088,678.00	4.09
451	688569	铁科轨道	5,081,253.71	4.08

452	002957	科瑞技术	5,077,473.00	4.08
453	300130	新国都	5,071,998.00	4.08
454	300880	迦南智能	5,071,182.00	4.08
455	603013	亚普股份	5,070,246.00	4.08
456	688108	赛诺医疗	5,065,542.16	4.07
457	002546	新联电子	5,059,146.00	4.07
458	000521	长虹美菱	5,058,693.00	4.07
459	002007	华兰生物	5,054,088.00	4.06
460	688176	亚虹医药	5,046,057.43	4.06
461	300423	昇辉科技	5,022,623.00	4.04
462	300643	万通智控	5,012,192.00	4.03
463	603187	海容冷链	5,010,286.60	4.03
464	688361	中科飞测	5,010,045.17	4.03
465	300211	亿通科技	5,007,078.00	4.03
466	300451	创业慧康	4,981,288.00	4.00
467	603168	莎普爱思	4,964,055.00	3.99
468	688088	虹软科技	4,925,208.21	3.96
469	688668	鼎通科技	4,923,335.44	3.96
470	600266	城建发展	4,915,858.00	3.95
471	002885	京泉华	4,914,079.09	3.95
472	300403	汉宇集团	4,909,116.00	3.95
473	300595	欧普康视	4,895,851.00	3.94
474	300150	世纪瑞尔	4,883,798.00	3.93
475	002233	塔牌集团	4,882,823.00	3.93
476	601997	贵阳银行	4,875,980.00	3.92
477	603043	广州酒家	4,873,192.00	3.92
478	002873	新天药业	4,839,361.00	3.89
479	002317	众生药业	4,833,655.00	3.89
480	002553	南方精工	4,822,259.00	3.88
481	300866	安克创新	4,809,732.00	3.87
482	601899	紫金矿业	4,765,505.00	3.83
483	002723	小崧股份	4,764,524.00	3.83
484	300766	每日互动	4,758,281.00	3.83
485	300368	汇金股份	4,751,316.00	3.82
486	605066	天正电气	4,751,186.00	3.82
487	000951	中国重汽	4,744,988.00	3.81
488	600573	惠泉啤酒	4,741,908.00	3.81
489	000757	浩物股份	4,741,808.00	3.81
490	300298	三诺生物	4,739,591.00	3.81
491	002846	英联股份	4,718,594.00	3.79
492	688255	凯尔达	4,717,099.86	3.79
493	300380	安硕信息	4,714,467.00	3.79
494	300571	平治信息	4,709,012.49	3.79

495	002112	三变科技	4,695,532.70	3.77
496	601921	浙版传媒	4,694,230.00	3.77
497	300285	国瓷材料	4,691,274.00	3.77
498	002410	广联达	4,678,014.00	3.76
499	300857	协创数据	4,677,815.00	3.76
500	601801	皖新传媒	4,673,003.00	3.76
501	603701	德宏股份	4,671,892.00	3.76
502	688233	神工股份	4,669,644.49	3.75
503	600391	航发科技	4,658,344.00	3.74
504	688302	海创药业	4,641,807.68	3.73
505	600593	大连圣亚	4,626,860.00	3.72
506	002467	二六三	4,623,335.00	3.72
507	603983	丸美股份	4,613,315.00	3.71
508	301089	拓新药业	4,580,296.00	3.68
509	603278	大业股份	4,567,261.00	3.67
510	603267	鸿远电子	4,566,595.00	3.67
511	000600	建投能源	4,551,944.00	3.66
512	300558	贝达药业	4,550,126.00	3.66
513	000682	东方电子	4,549,308.00	3.66
514	002603	以岭药业	4,544,279.00	3.65
515	601900	南方传媒	4,531,255.00	3.64
516	003026	中晶科技	4,530,358.00	3.64
517	002563	森马服饰	4,522,892.00	3.64
518	002905	金逸影视	4,510,193.00	3.63
519	002587	奥拓电子	4,500,834.50	3.62
520	002036	联创电子	4,500,589.00	3.62
521	603298	杭叉集团	4,498,634.00	3.62
522	000548	湖南投资	4,486,145.00	3.61
523	300144	宋城演艺	4,478,451.00	3.60
524	603855	华荣股份	4,442,410.00	3.57
525	603520	司太立	4,436,264.60	3.57
526	000829	天音控股	4,435,507.35	3.57
527	689009	九号公司	4,411,389.75	3.55
528	000680	山推股份	4,406,653.00	3.54
529	688536	思瑞浦	4,406,366.01	3.54
530	300012	华测检测	4,400,956.00	3.54
531	688658	悦康药业	4,400,632.20	3.54
532	000777	中核科技	4,378,909.00	3.52
533	603757	大元泵业	4,377,872.00	3.52
534	605088	冠盛股份	4,354,427.00	3.50
535	002134	天津普林	4,350,719.00	3.50
536	000960	锡业股份	4,348,337.00	3.50
537	300096	ST 易联众	4,331,549.00	3.48

538	603367	辰欣药业	4,330,850.00	3.48
539	002429	兆驰股份	4,330,606.00	3.48
540	002518	科士达	4,325,952.00	3.48
541	688595	芯海科技	4,310,626.03	3.47
542	688699	明微电子	4,288,431.12	3.45
543	600161	天坛生物	4,283,848.80	3.44
544	000915	华特达因	4,268,498.00	3.43
545	601825	沪农商行	4,261,614.00	3.43
546	000559	万向钱潮	4,257,772.00	3.42
547	688173	希荻微	4,253,291.78	3.42
548	605499	东鹏饮料	4,238,684.00	3.41
549	300304	云意电气	4,220,752.00	3.39
550	601666	平煤股份	4,216,912.00	3.39
551	301185	鸥玛软件	4,214,760.00	3.39
552	600085	同仁堂	4,213,364.00	3.39
553	003029	吉大正元	4,206,820.00	3.38
554	600601	方正科技	4,200,693.00	3.38
555	603197	保隆科技	4,174,712.00	3.36
556	000586	汇源通信	4,168,791.00	3.35
557	000759	中百集团	4,151,659.00	3.34
558	600637	东方明珠	4,128,698.00	3.32
559	002017	东信和平	4,122,684.30	3.31
560	002261	拓维信息	4,117,229.00	3.31
561	603378	亚士创能	4,115,863.00	3.31
562	300153	科泰电源	4,094,695.00	3.29
563	600098	广州发展	4,087,721.00	3.29
564	300678	中科信息	4,076,527.00	3.28
565	688090	瑞松科技	4,075,679.17	3.28
566	300702	天宇股份	4,044,672.00	3.25
567	600535	天士力	4,034,788.00	3.24
568	603225	新风鸣	4,034,447.00	3.24
569	603116	红蜻蜓	4,017,657.00	3.23
570	688065	凯赛生物	4,013,712.74	3.23
571	688165	埃夫特	4,011,598.32	3.22
572	300510	金冠股份	4,011,331.00	3.22
573	002100	天康生物	4,010,525.00	3.22
574	002045	国光电器	4,009,886.00	3.22
575	002655	共达电声	4,009,272.00	3.22
576	603519	立霸股份	3,986,893.00	3.21
577	688385	复旦微电	3,966,309.43	3.19
578	600378	昊华科技	3,956,264.00	3.18
579	002707	众信旅游	3,955,558.00	3.18
580	688687	凯因科技	3,954,190.24	3.18

581	603507	振江股份	3,941,855.00	3.17
582	300541	先进数通	3,937,224.00	3.17
583	000009	中国宝安	3,935,356.00	3.16
584	600248	陕建股份	3,930,298.00	3.16
585	603156	养元饮品	3,927,234.22	3.16
586	002833	弘亚数控	3,919,549.00	3.15
587	002048	宁波华翔	3,906,871.00	3.14
588	002368	太极股份	3,906,186.00	3.14
589	300482	万孚生物	3,899,449.43	3.13
590	002375	亚厦股份	3,897,224.00	3.13
591	688561	奇安信	3,895,334.98	3.13
592	688393	安必平	3,855,270.08	3.10
593	002552	宝鼎科技	3,853,201.49	3.10
594	002149	西部材料	3,843,081.00	3.09
595	002979	雷赛智能	3,842,491.00	3.09
596	601858	中国科传	3,835,473.00	3.08
597	603239	浙江仙通	3,828,672.00	3.08
598	003032	传智教育	3,827,990.00	3.08
599	300200	高盟新材	3,827,905.00	3.08
600	688382	益方生物	3,817,628.19	3.07
601	301051	信濠光电	3,789,903.00	3.05
602	688192	迪哲医药	3,789,547.15	3.05
603	002189	中光学	3,786,646.00	3.04
604	002463	沪电股份	3,773,241.10	3.03
605	603110	东方材料	3,762,287.00	3.02
606	002819	东方中科	3,756,567.00	3.02
607	603686	福龙马	3,752,755.00	3.02
608	688609	九联科技	3,751,372.46	3.02
609	603527	众源新材	3,734,078.00	3.00
610	603186	华正新材	3,725,671.00	3.00
611	000554	泰山石油	3,719,093.00	2.99
612	600571	信雅达	3,714,182.00	2.99
613	300432	富临精工	3,698,896.00	2.97
614	600252	中恒集团	3,691,337.00	2.97
615	300005	探路者	3,690,050.00	2.97
616	603313	梦百合	3,679,148.00	2.96
617	600590	泰豪科技	3,661,392.00	2.94
618	300045	华力创通	3,654,504.00	2.94
619	688121	卓然股份	3,646,089.33	2.93
620	603927	中科软	3,639,456.00	2.93
621	002056	横店东磁	3,609,688.00	2.90
622	603113	金能科技	3,599,765.00	2.89
623	300030	阳普医疗	3,598,661.00	2.89

624	301096	百诚医药	3,583,142.00	2.88
625	603039	泛微网络	3,573,268.00	2.87
626	600329	达仁堂	3,552,161.00	2.86
627	301029	怡合达	3,548,122.00	2.85
628	300515	三德科技	3,543,074.00	2.85
629	300105	龙源技术	3,542,803.00	2.85
630	300043	星辉娱乐	3,536,231.00	2.84
631	688626	翔宇医疗	3,526,333.24	2.83
632	688103	国力股份	3,519,766.85	2.83
633	600765	中航重机	3,516,744.48	2.83
634	000810	创维数字	3,511,781.00	2.82
635	603610	麒盛科技	3,498,229.00	2.81
636	688058	宝兰德	3,490,144.52	2.81
637	002362	汉王科技	3,467,135.00	2.79
638	000677	恒天海龙	3,465,413.00	2.79
639	300188	国投智能	3,454,510.92	2.78
640	002484	江海股份	3,452,921.00	2.78
641	600523	贵航股份	3,448,795.00	2.77
642	000666	经纬纺机	3,444,074.00	2.77
643	300414	中光防雷	3,439,273.00	2.76
644	600867	通化东宝	3,429,172.00	2.76
645	002531	天顺风能	3,421,611.04	2.75
646	688112	鼎阳科技	3,415,210.03	2.75
647	002843	泰嘉股份	3,399,277.00	2.73
648	600130	波导股份	3,383,092.00	2.72
649	603859	能科科技	3,375,837.00	2.71
650	000423	东阿阿胶	3,373,598.00	2.71
651	600222	太龙药业	3,337,946.74	2.68
652	600756	浪潮软件	3,337,868.00	2.68
653	600664	哈药股份	3,336,135.00	2.68
654	688711	宏微科技	3,336,017.98	2.68
655	688425	铁建重工	3,334,005.98	2.68
656	300192	科德教育	3,330,487.00	2.68
657	300578	会畅通讯	3,327,994.00	2.68
658	002826	易明医药	3,309,165.00	2.66
659	601991	大唐发电	3,305,316.00	2.66
660	300194	福安药业	3,305,101.00	2.66
661	603698	航天工程	3,300,288.00	2.65
662	301080	百普赛斯	3,299,451.50	2.65
663	002402	和而泰	3,299,328.00	2.65
664	002853	皮阿诺	3,293,981.00	2.65
665	688181	八亿时空	3,293,247.73	2.65
666	300404	博济医药	3,284,955.00	2.64

667	601916	浙商银行	3,263,632.40	2.62
668	603668	天马科技	3,260,583.00	2.62
669	000751	锌业股份	3,256,899.00	2.62
670	600073	上海梅林	3,256,586.00	2.62
671	003005	竞业达	3,255,654.00	2.62
672	688550	瑞联新材	3,254,611.00	2.62
673	600499	科达制造	3,251,146.00	2.61
674	002891	中宠股份	3,223,365.00	2.59
675	600480	凌云股份	3,222,114.00	2.59
676	688322	奥比中光	3,214,792.70	2.58
677	002373	千方科技	3,211,482.00	2.58
678	600958	东方证券	3,207,025.00	2.58
679	002851	麦格米特	3,206,898.00	2.58
680	002792	通宇通讯	3,192,020.00	2.57
681	301060	兰卫医学	3,181,484.00	2.56
682	600521	华海药业	3,173,646.00	2.55
683	002019	亿帆医药	3,168,303.44	2.55
684	002940	昂利康	3,162,230.00	2.54
685	301101	明月镜片	3,138,619.25	2.52
686	603033	三维股份	3,134,431.00	2.52
687	300436	广生堂	3,128,813.00	2.52
688	002165	红宝丽	3,127,996.00	2.51
689	605167	利柏特	3,109,827.00	2.50
690	300146	汤臣倍健	3,108,991.00	2.50
691	688560	明冠新材	3,107,292.69	2.50
692	300366	创意信息	3,105,143.00	2.50
693	603648	畅联股份	3,103,382.00	2.49
694	300219	鸿利智汇	3,058,848.00	2.46
695	688001	华兴源创	3,052,820.22	2.45
696	600846	同济科技	3,046,557.00	2.45
697	300990	同飞股份	3,038,152.40	2.44
698	300484	蓝海华腾	3,036,622.00	2.44
699	002094	青岛金王	3,030,506.00	2.44
700	300511	雪榕生物	3,030,368.00	2.44
701	002197	证通电子	3,020,911.00	2.43
702	688621	阳光诺和	3,019,685.85	2.43
703	002745	木林森	3,012,213.00	2.42
704	601007	金陵饭店	3,010,995.00	2.42
705	002611	东方精工	3,005,567.00	2.42
706	300011	鼎汉技术	2,990,556.00	2.40
707	603050	科林电气	2,988,815.60	2.40
708	605133	嵘泰股份	2,983,798.10	2.40
709	000421	南京公用	2,980,746.00	2.40

710	605196	华通线缆	2,976,457.00	2.39
711	688667	菱电电控	2,975,748.48	2.39
712	002367	康力电梯	2,958,861.00	2.38
713	002084	海鸥住工	2,955,657.00	2.38
714	300396	迪瑞医疗	2,938,939.00	2.36
715	300279	和晶科技	2,938,661.00	2.36
716	603738	泰晶科技	2,936,950.46	2.36
717	002041	登海种业	2,934,036.00	2.36
718	688032	禾迈股份	2,930,332.12	2.36
719	300272	开能健康	2,929,817.00	2.36
720	002976	瑞玛精密	2,923,866.00	2.35
721	000848	承德露露	2,922,803.00	2.35
722	688246	嘉和美康	2,922,533.64	2.35
723	300185	通裕重工	2,921,196.00	2.35
724	688107	安路科技	2,907,480.85	2.34
725	603896	寿仙谷	2,907,425.00	2.34
726	688403	汇成股份	2,899,217.00	2.33
727	603121	华培动力	2,894,778.70	2.33
728	603699	纽威股份	2,892,520.00	2.33
729	301188	力诺特玻	2,884,779.00	2.32
730	600262	北方股份	2,882,076.00	2.32
731	300333	兆日科技	2,879,031.00	2.31
732	603711	香飘飘	2,878,952.00	2.31
733	688066	航天宏图	2,872,148.96	2.31
734	300759	康龙化成	2,866,791.00	2.30
735	300618	寒锐钴业	2,857,779.00	2.30
736	601126	四方股份	2,845,815.00	2.29
737	600738	丽尚国潮	2,841,879.00	2.28
738	002991	甘源食品	2,838,633.00	2.28
739	603808	歌力思	2,831,361.00	2.28
740	000797	中国武夷	2,828,082.00	2.27
741	002869	金溢科技	2,816,974.00	2.26
742	002810	山东赫达	2,815,832.00	2.26
743	002697	红旗连锁	2,815,450.00	2.26
744	600679	上海凤凰	2,802,098.00	2.25
745	688305	科德数控	2,794,629.99	2.25
746	600966	博汇纸业	2,782,800.00	2.24
747	002971	和远气体	2,776,127.00	2.23
748	002782	可立克	2,772,309.00	2.23
749	603283	赛腾股份	2,770,610.00	2.23
750	688205	德科立	2,767,565.82	2.22
751	688639	华恒生物	2,761,182.23	2.22
752	600639	浦东金桥	2,758,880.00	2.22

753	603489	八方股份	2,757,706.00	2.22
754	002043	兔宝宝	2,755,072.00	2.21
755	300675	建科院	2,739,331.00	2.20
756	603818	曲美家居	2,734,008.00	2.20
757	600858	银座股份	2,723,429.00	2.19
758	002908	德生科技	2,722,095.00	2.19
759	300138	晨光生物	2,716,895.00	2.18
760	600376	首开股份	2,701,053.00	2.17
761	300112	万讯自控	2,698,993.00	2.17
762	002468	申通快递	2,697,101.00	2.17
763	300861	美畅股份	2,690,181.80	2.16
764	603517	绝味食品	2,664,549.00	2.14
765	688386	泛亚微透	2,658,266.78	2.14
766	688520	神州细胞	2,653,546.43	2.13
767	300698	万马科技	2,644,698.00	2.13
768	300016	北陆药业	2,637,489.00	2.12
769	300815	玉禾田	2,637,470.44	2.12
770	000635	英力特	2,615,396.00	2.10
771	300584	海辰药业	2,604,857.00	2.09
772	600997	开滦股份	2,598,452.00	2.09
773	603908	牧高笛	2,598,433.00	2.09
774	688078	龙软科技	2,591,844.92	2.08
775	300551	古鳌科技	2,590,256.00	2.08
776	300613	富瀚微	2,580,614.00	2.07
777	300622	博士眼镜	2,580,597.00	2.07
778	002612	朗姿股份	2,574,452.00	2.07
779	603788	宁波高发	2,572,086.00	2.07
780	603790	雅运股份	2,567,945.00	2.06
781	002823	凯中精密	2,558,835.00	2.06
782	002245	蔚蓝锂芯	2,555,963.00	2.05
783	002003	伟星股份	2,555,153.20	2.05
784	000852	石化机械	2,554,718.00	2.05
785	603118	共进股份	2,553,346.00	2.05
786	000552	甘肃能化	2,533,122.00	2.04
787	600655	豫园股份	2,533,003.00	2.04
788	002557	洽洽食品	2,525,346.00	2.03
789	002690	美亚光电	2,524,371.50	2.03
790	600213	亚星客车	2,516,116.00	2.02
791	002337	赛象科技	2,515,902.00	2.02
792	603040	新坐标	2,510,997.00	2.02
793	300290	荣科科技	2,508,944.00	2.02
794	300786	国林科技	2,506,730.60	2.02
795	002683	广东宏大	2,503,796.00	2.01

796	603693	江苏新能	2,495,283.70	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	7,442,526,191.30
卖出股票收入（成交）总额	6,858,410,255.38

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，以对冲投资组合的系统性风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

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

本基金将按照法律法规要求，以套期保值为目的参与国债期货投资。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的，在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	500,931.75
2	应收清算款	21,010,355.05
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	77,465.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,588,752.38

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

本基金本报告期末前十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 (%)
万家颐达 A	1,835	327,081.38	580,352,375.65	96.69	19,841,950.80	3.31
万家颐达 C	1,382	14,094.97	15,005,433.14	77.03	4,473,810.33	22.97
合计	3,191	194,194.16	595,357,808.79	96.08	24,315,761.13	3.92

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	万家颐达 A	3,898,257.08	0.6495
	万家颐达 C	15.12	0.0001
	合计	3,898,272.20	0.6291

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	万家颐达 A	>100
	万家颐达 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	万家颐达 A	10~50
	万家颐达 C	0
	合计	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家颐达 A	万家颐达 C
基金合同生效日 (2019年6月11日) 基金份额总额	92,388,896.72	-
本报告期期初基金份额总额	118,668,103.50	-
本报告期基金总申购份额	1,296,745,344.73	67,774,777.58
减：本报告期基金总赎回份额	815,219,121.78	48,295,534.11
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	600,194,326.45	19,479,243.47

§ 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：自 2023 年 4 月 11 日起，陈启女士担任基金托管人资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作，叶文煌先生不再担任基金托管人资产托管部总经理。

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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东海证券	1	2,923,647,306.67	20.46	2,722,802.22	20.54	-
中国国际金融股份有限公司	1	2,006,700,435.10	14.04	1,894,769.37	14.29	-
中泰证券	2	1,609,443,385.49	11.26	1,498,881.67	11.31	-

国泰君安	1	1,453,054,040.41	10.17	1,374,530.02	10.37	-
国金证券	1	1,337,375,638.33	9.36	1,245,507.41	9.40	-
华鑫证券	1	1,051,117,735.30	7.35	930,808.67	7.02	-
东方证券	2	755,521,983.67	5.29	622,568.30	4.70	-
兴业证券	1	744,931,520.85	5.21	704,634.89	5.32	-
中信建投	1	585,010,060.34	4.09	553,362.61	4.17	-
国投证券	1	564,695,174.06	3.95	521,306.14	3.93	-
东北证券	1	483,209,224.27	3.38	457,075.89	3.45	-
国海证券	1	398,982,321.91	2.79	371,575.42	2.80	-
光大证券	1	185,152,833.02	1.30	175,133.72	1.32	-
东吴证券	1	150,356,116.21	1.05	142,225.24	1.07	-
国信证券	1	43,214,111.10	0.30	40,876.52	0.31	-
东兴证券	1	301,597.48	0.00	285.31	0.00	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易席位的选择标准如下：

(1)经营行为稳健规范,内控制度健全,在业内有良好的声誉；

(2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

(1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；

(2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

3、基金专用交易席位的变更情况：

本报告期内，本基金新增国金证券交易单元 1 个、华鑫证券交易单元 1 个、东方证券交易单元 2 个、兴业证券交易单元 1 个、东吴证券交易单元 1 个、东兴证券交易单元 1 个、红塔证券交易单元 1 个、民生证券交易单元 1 个、平安证券交易单元 1 个、上海证券交易单元 1 个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
东海证券	6,080,321.65	100.00	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
兴业证	-	-	-	-	-	-

券						
中信建投	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中国中	-	-	-	-	-	-

金财富						
-----	--	--	--	--	--	--

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	万家基金管理有限公司关于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
2	万家颐达灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	指定媒介	2023 年 1 月 20 日
3	万家颐达灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	指定媒介	2023 年 2 月 24 日
4	万家颐达灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新(2023 年第 1 号)	指定媒介	2023 年 2 月 25 日
5	万家颐达灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要(更新)	指定媒介	2023 年 2 月 25 日
6	关于万家基金管理有限公司旗下部分基金在东海证券开通定投的公告	指定媒介	2023 年 3 月 14 日
7	万家颐达灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告	指定媒介	2023 年 3 月 30 日
8	万家颐达灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	指定媒介	2023 年 4 月 21 日
9	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
10	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在华西证券开通申购、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 30 日
11	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 6 月 1 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 6 月 5 日
13	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在浙商证券开通申购、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 28 日
14	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
15	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 7 月 19 日
16	万家颐达灵活配置混合型证券投资基	指定媒介	2023 年 7 月 20 日

	金 2023 年第 2 季度报告		
17	万家颐达灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	指定媒介	2023 年 7 月 26 日
18	万家颐达灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新(2023 年第 2 号)	指定媒介	2023 年 7 月 27 日
19	万家颐达灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要(更新)	指定媒介	2023 年 7 月 27 日
20	万家颐达灵活配置混合型证券投资基金托管协议(更新)	指定媒介	2023 年 8 月 15 日
21	万家基金管理有限公司关于万家颐达灵活配置混合型证券投资基金新增 C 类基金份额并修改基金合同与托管协议的公告	指定媒介	2023 年 8 月 15 日
22	万家颐达灵活配置混合型证券投资基金基金合同(更新)	指定媒介	2023 年 8 月 15 日
23	万家颐达灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要(更新)	指定媒介	2023 年 8 月 17 日
24	万家颐达灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新(2023 年第 3 号)	指定媒介	2023 年 8 月 17 日
25	万家颐达灵活配置混合型证券投资基金基金合同(更新)	指定媒介	2023 年 8 月 19 日
26	万家颐达灵活配置混合型证券投资基金托管协议(更新)	指定媒介	2023 年 8 月 19 日
27	万家颐达灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新(2023 年第 4 号)	指定媒介	2023 年 8 月 21 日
28	万家颐达灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要(更新)	指定媒介	2023 年 8 月 21 日
29	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在华安证券开通申购、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 28 日
30	万家颐达灵活配置混合型证券投资基金 2023 年中期报告	指定媒介	2023 年 8 月 30 日
31	万家基金管理有限公司关于旗下基金在湘财证券等机构开通申购、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 9 月 11 日
32	万家基金管理有限公司关于旗下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 9 月 11 日
33	万家基金管理有限公司关于旗下基金在长江证券等机构开通申购、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 9 月 12 日
34	万家基金管理有限公司关于旗下部分	指定媒介	2023 年 9 月 12 日

	基金在长城证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告		
35	万家颐达灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	指定媒介	2023 年 10 月 24 日
36	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在长江证券开通申购、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 9 日
37	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 11 月 10 日
38	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宁波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 11 月 13 日
39	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 11 月 15 日
40	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在财通证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 11 月 22 日
41	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 11 月 24 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	20230101-20230302	89,373,658.47	20,280,745.92	97,893,158.66	11,761,245.73	1.90
	2	20230307-20230309	-	18,245,598.03	18,245,598.03	-	-
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、《万家颐达灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家颐达灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。
- 4、万家颐达灵活配置混合型证券投资基金 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