

万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资 基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2022 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料已经审计,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 2021 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.....	6
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	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	13
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	20
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.....	20
§5 托管人报告	21
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	21
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.....	21
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.....	21
§6 审计报告	22
6.1 审计报告基本信息.....	22
6.2 审计报告的基本内容.....	22
§7 年度财务报表	25
7.1 资产负债表.....	25
7.2 利润表.....	26
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	28
7.4 报表附注.....	30
§8 投资组合报告	69
8.1 期末基金资产组合情况.....	69
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	69
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.....	71
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	85
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	157
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.....	157
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.....	157

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	157
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	158
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	158
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	158
8.12	投资组合报告附注	158
§9	基金份额持有人信息	160
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	160
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	160
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的情况	161
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况	161
§10	开放式基金份额变动	162
§11	重大事件揭示	163
11.1	基金份额持有人大会决议	163
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	163
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	163
11.4	基金投资策略的改变	163
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	163
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	163
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	163
§12	影响投资者决策的其他重要信息	165
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	165
§13	备查文件目录	166
13.1	备查文件目录	166
13.2	存放地点	166
13.3	查阅方式	166

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	万家中证 1000 指数增强	
基金主代码	005313	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 12 月 3 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	508,887,576.10 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	万家中证 1000 指数增强 A	万家中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码:	005313	005314
报告期末下属分级基金的份额总额	230,974,168.43 份	277,913,407.67 份

2.2 基金产品说明

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

	金及货币市场基金。
--	-----------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		万家基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	张燕
	联系电话	021-38909626	0755-83199084
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4008880800	95555
传真		021-38909627	0755-83195201
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		200122	518040
法定代表人		方一天	缪建民

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市南京东路 61 号 4 楼新黄浦金融大厦

注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
--------	----------------	------------------

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1. 1 期 间数 据和 指标	2021 年		2020 年		2019 年	
	万家中证 1000 指数增 强 A	万家中证 1000 指数增 强 C	万家中证 1000 指数增 强 A	万家中证 1000 指数增 强 C	万家中证 1000 指数增 强 A	万家中证 1000 指数增 强 C
本期 已实 现收 益	30,954,962. 41	37,745,976. 49	4,294,744.5 5	3,263,838. 47	4,449,479.5 5	22,351,174. 93
本期 利润	32,942,128. 46	35,834,064. 42	3,933,740.4 7	3,263,635. 62	3,803,682.4 1	24,871,518. 86
加权 平均 基金 份额 本期 利润	0.2880	0.2525	0.3410	0.3462	0.3496	0.5092
本期 加权 平均 净值 利润 率	23.89%	20.62%	26.99%	28.40%	29.79%	42.45%
本期	29.98%	29.47%	33.58%	33.01%	40.77%	40.57%

基金 份额 净值 增长 率						
3.1. 2 期 末数 据和 指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
期末 可供 分配 利润	79,562,180. 78	95,402,086. 94	4,146,667.1 3	781,361.27	645,250.58	645,014.53
期末 可供 分配 基金 份额 利润	0.3445	0.3433	0.3729	0.3658	0.0576	0.0562
期末 基金 资产 净值	310,536,349 .21	373,315,494 .61	15,267,628. 92	2,917,676. 64	11,844,421. 18	12,130,844. 35
期末 基金 份额 净值	1.3445	1.3433	1.3729	1.3658	1.0576	1.0562
3.1. 3	2021 年末		2020 年末		2019 年末	

累计 期末 指标						
基金 份额 累计 净值 增长 率	128.91%	126.66%	76.11%	75.06%	31.84%	31.61%

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家中证 1000 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.92%	1.05%	7.78%	1.00%	-1.86%	0.05%
过去六个月	16.87%	1.23%	12.48%	1.19%	4.39%	0.04%
过去一年	29.98%	1.16%	19.59%	1.15%	10.39%	0.01%
过去三年	144.42%	1.42%	76.65%	1.44%	67.77%	-0.02%
自基金合同生效起至今	128.91%	1.41%	68.79%	1.43%	60.12%	-0.02%

万家中证 1000 指数增强 C

阶段	份额净值增	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-------	------	------	--------	-----	-----

	长率①	增长率标准差②	基准收益率③	收益率标准差④		
过去三个月	5.80%	1.05%	7.78%	1.00%	-1.98%	0.05%
过去六个月	16.64%	1.23%	12.48%	1.19%	4.16%	0.04%
过去一年	29.47%	1.16%	19.59%	1.15%	9.88%	0.01%
过去三年	142.07%	1.42%	76.65%	1.44%	65.42%	-0.02%
自基金合同生效起至今	126.66%	1.41%	68.79%	1.43%	57.87%	-0.02%

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

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

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



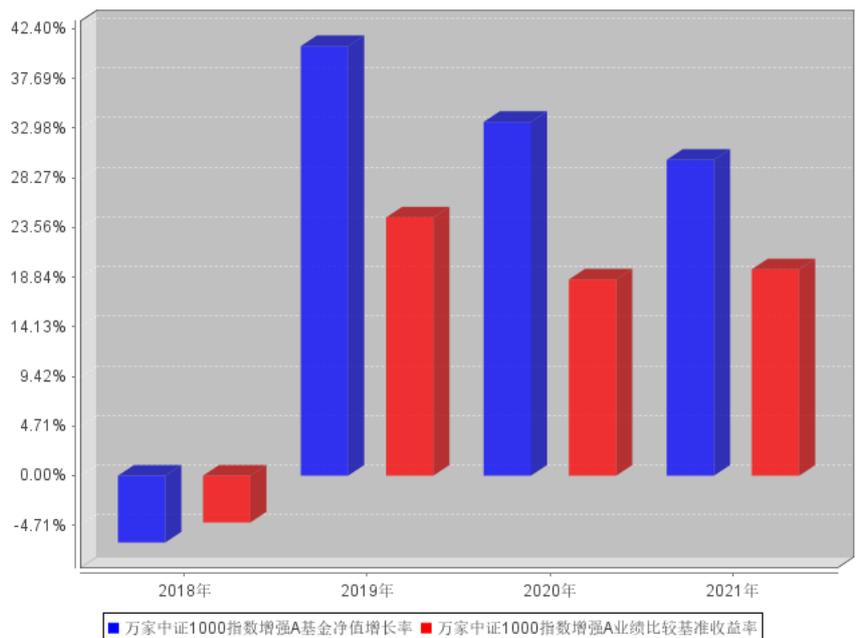
万家中证1000指数增强C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



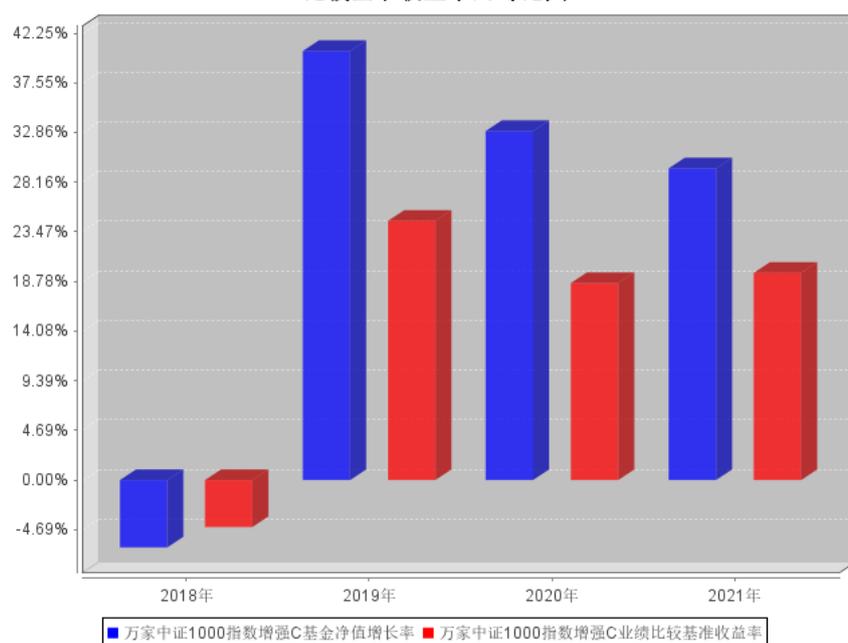
注：本基金合同生效日期为 2018 年 12 月 03 日，基金建仓期为基金合同生效后六个月，基金合同生效后各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

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

万家中证1000指数增强A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对比图



万家中证1000指数增强C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对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

万家中证 1000 指数增强 A					
年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021	3.3000	3,568,145.64	116,516.50	3,684,662.14	
2020	0.3920	426,301.86	11,913.86	438,215.72	
2019	2.6670	2,819,285.16	126,287.24	2,945,572.40	
合计	6.3590	6,813,732.66	254,717.60	7,068,450.26	

单位：人民币元

万家中证 1000 指数增强 C					
年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021	3.2000	567,997.74	140,136.25	708,133.99	
2020	0.3840	66,295.69	17,540.85	83,836.54	
2019	2.5130	382,394.80	30,329,130.54	30,711,525.34	
合计	6.0970	1,016,688.23	30,486,807.64	31,503,495.87	

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44号文批准设立。公司现股东为中泰证券股份有限公司、新疆国际实业股份有限公司和齐河众鑫投资有限公司,住所:中国(上海)自由贸易试验区浦电路360号8楼(名义楼层9层),办公地点:上海市浦东新区浦电路360号9楼,注册资本3亿元人民币。目前管理一百只开放式基金,分别为万家180指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选混合型证券投资基金(LOF)、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金(LOF)、万家添利债券型证券投资基金(LOF)、万家新机遇价值驱动灵活配置混合型证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家上证50交易型开放式指数证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞和灵活配置混合型证券投资基金、万家颐达灵活配置混合型证券投资基金、万家颐和灵活配置混合型证券投资基金、万家恒瑞18个月定期开放债券型证券投资基金、万家3-5年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家鑫安纯债债券型证券投资基金、万家鑫璟纯债债券型证券投资基金、万家沪深300指数增强型证券投资基金、万家家享中短债债券型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家1-3年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家瑞隆混合型证券投资基金、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家现金增利货币市场基金、万家消费成长股票型证券投资基金、万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家玖盛纯债9个月定期开放债券型证券投资基金、万家天添宝货币市场基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、万家家瑞债券型证券投资基金、万家臻选混合型证券投资基金、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金、万家中证1000指数增强型发起式证券投资基金、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、万家鑫悦纯债债券型证券投资基金、万家智造优势混合型证券投资基金、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 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、万家民安增利 12 个月定期开放债券型证券投资基金、万家鑫盛纯债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、万家鑫动力月月购一年滚动持有混合型证券投资基金、万家养老目标日期 2035 三年持有期混合发起式基金中基金（FOF）、万家科创板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家创业板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家周期优势企业混合型证券投资基金、万家健康产业混合型证券投资基金、万家互联互通中国优势量化策略混合型证券投资基金、万家战略发展产业混合型证券投资基金、万家创业板指数增强型证券投资基金、万家陆家嘴金融城金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家内需增长一年持有期混合型证券投资基金、万家互联互通核心资产量化策略混合型证券投资基金、万家民瑞祥明 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家瑞泽回报一年持有期混合型证券投资基金、万家惠裕回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家悦兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金、万家稳鑫 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、万家全球成长一年持有期混合型证券投资基金（QDII）、万家瑞泰混合型证券投资基金、万家沪港深蓝筹混合型证券投资基金、万家北交所慧选两年定期开放混合型证券投资基金、万家鼎鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家新机遇成长一年持有期混合型发起式证券投资基金。

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)		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
乔亮	万家量化睿选 灵活配置混合	2019 年 8 月 21 日	-	14 年	曾任美国巴克莱国际投资管理公司基

	型基金、万家中证 1000 指数增强型发起式基金、万家沪深 300 指数增强型基金、万家互联互通核心资产量化策略混合型证券投资基金、万家创业板指数增强型证券投资基金、万家中证 500 指数增强型基金的基金经理				金经理,加拿大退休基金国际投资管理公司基金经理,南方基金管理有限公司量化投资部基金经理,通联数据股份公司联合创始人、首席投资官,上海寻乾资产管理有限公司投资总监、总经理,巨杉(上海)资产管理有限公司量化投资部投资总监。2019 年 7 月加入万家基金管理有限公司,担任公司总经理助理。
--	--	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

不同投资组合。

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

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 1 次，为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金为指数增强型股票基金，采取量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，在力求

有效跟踪标的指数基础上，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

本基金采用量化多因子选股策略，控制行业权重偏离度、个股集中度，通过量化多因子选股的方式选取一篮子股票组合。在行业和风格配置相对于业绩基准指数相对均衡，无重仓行业或具体风格，在量化选股方面精选行业内质优个股组合，持股较为分散。采用量化风险模型合理控制组合风险，保证较小的跟踪误差，投资目标是获取在既定跟踪误差下的超额收益最大化。本基金股票组合中 80%以上权重为中证 1000 成分股，保持了跟标的指数的风格基本一致。

后续投资运作继续坚持以量化多因子选股为策略基础，积极参与科创、创业板打新等事件性机会，追求长期稳健的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家中证 1000 指数增强 A 基金份额净值为 1.3445 元，本报告期基金份额净值增长率为 29.98%；截至本报告期末万家中证 1000 指数增强 C 基金份额净值为 1.3433 元，本报告期基金份额净值增长率为 29.47%；同期业绩比较基准收益率为 19.59%。基金报告期末 A 份额、C 份额日均跟踪偏离度分别为 0.2208%、0.2206%，年跟踪误差分别为 2.9391%、2.9385%，符合基金合同中日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%的规定。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年，从宏观经济角度来看，国内由于地产投资增速可能出现的快速下行风险，带来经济下行压力较大，经济发展面临需求收缩、供给冲击、预期转弱的三重冲击。在此背景下，中央经济工作会议定调经济“稳字当头”，重提“以经济建设为中心”，同时对过去的政策进行适当纠偏，后续“稳增长”是经济的核心要点。

当前国内货币政策处于宽松窗口，央行连续降准降息、积极释放流动性，政策底已经出现。随着三月份全国两会的开幕，稳增长政策有望加速推进，另外相关行业政策规划也同样值得期待。与此同时，海外通胀推动的利率上行正在影响全球资产定价，美联储 3 月份加息的概率和预期正在加速提升，海外流动性拐点可能反复冲击今年的市场风险偏好，对一些高估值成长型行业形成压制。有鉴于此，“稳增长”是今年上半年最为清晰的投资路线。全年来看，今年 A 股主要的投资主线是市场风格和政策催化，特别是稳增长政策以及之前预期较低的板块带来的投资机会。具体来看：一、低预期下的反转行业：一方面，2022 年最重要的政策方针是稳增长政策，在此预期

下，房地产、地产链和基建链、大消费具备政策边际利好的预期。另一方面，虽然疫情不确定性对餐饮旅游、交通运输等为主的行业复苏节奏或仍有扰动，但随着海外疫情管控的放开以及全球疫情防治的进一步科学化，“后疫情”行业有望逐步实现预期修复甚至反转。二、新的主题投资依然在积极涌现，例如受益于十四五“数字经济发展规划”的数字经济、新能源渗透率提升下的汽车智能化、有资产注入预期的国企改革等等。三、长期政策确定性强、行业空间大、国产替代加速的科技板块，以及军工，新能源车等板块虽然短期调整幅度较大，但中长期来看仍然是市场的重要配置方向。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

（一）加强风控文化建设

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

（二）制度流程建设

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

（三）定期和临时稽核工作

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

（四）绩效评估和风险管理工作

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

（五）员工行为管理与防控内幕交易

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了估值委员会, 定期评价现行估值政策和程序, 在发生了影响估值政策和程序有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。估值委员会由负责估值业务的分管领导、合规稽核部负责人、基金运营部负责人、相关估值业务岗位人员、相关风控人员等组成。估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关从业资格, 精通各自领域的理论知识, 熟悉政策法规, 并具有丰富的实践经验。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论, 但不介入基金日常估值业务。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中债金融估值中心有限公司签署了《中债信息产品服务协议》, 本基金管理人与中证指数有限公司签署了《中证债券估值数据服务协议》、《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同规定: “在符合有关基金分红条件的前提下, 本基金每年收益分配次数最少为 1 次, 每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%”。2021 年 1 月 13 日, 本基金进行了利润分配, A 类每 10 份基金份额分红 3.30 元, 共计分配利润 3,684,662.14 元; C 类每 10 份基金份额分红 3.20 元, 共计分配利润 708,133.99 元。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

托管人声明：

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

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

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

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	信会师报字[2022]第 ZA30194 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“万家中证 1000 指数增强”）财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）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监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了万家中证 1000 指数增强 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</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，我们独立于万家中证 1000 指数增强，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>万家中证 1000 指数增强的基金管理人万家基金管理有限公司管理层（以下简称管理层）负责按照企业会计准则和中国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</p>

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

	<p>日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致万家中证 1000 指数增强不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与管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	王 斌 徐 冬
会计师事务所的地址	中国 上海
审计报告日期	2022 年 3 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	17,729,574.45	1,092,654.49
结算备付金		25,899,350.66	48,374.56
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	641,995,114.15	17,155,937.38
其中：股票投资		641,995,114.15	17,155,937.38
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	4,503.15	144.83
应收股利		-	-
应收申购款		4,297,967.09	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		689,926,509.50	18,297,111.26
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		5,022,354.83	29,180.87
应付管理人报酬		587,407.88	15,642.35
应付托管费		117,481.56	3,128.47
应付销售服务费		130,286.67	1,028.83
应付交易费用	7.4.7.7	-	21,592.30
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	217,134.74	41,232.88
负债合计		6,074,665.68	111,805.70
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	508,887,576.10	13,257,277.16
未分配利润	7.4.7.10	174,964,267.72	4,928,028.40
所有者权益合计		683,851,843.82	18,185,305.56
负债和所有者权益总计		689,926,509.50	18,297,111.26

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，万家中证 1000 指数增强 A 基金份额净值 1.3445 元，基金份额总额 230,974,168.43 份；万家中证 1000 指数增强 C 基金份额净值 1.3433 元，基金份额总额 277,913,407.67 份。万家中证 1000 指数增强份额总额合计为 508,887,576.10 份。

7.2 利润表

会计主体：万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		80,627,652.43	7,885,142.16
1.利息收入		71,924.36	11,145.88
其中：存款利息收入	7.4.7.11	71,924.36	11,145.88
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		78,350,350.85	8,171,369.48
其中：股票投资收益	7.4.7.12	77,148,934.63	7,980,488.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-	-
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	1,201,416.22	190,881.10
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	75,253.98	-361,206.93
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	2,130,123.24	63,833.73
减：二、费用		11,851,459.55	687,766.07
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,095,610.05	262,362.18
2. 托管费	7.4.10.2.2	619,121.92	52,472.46
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	691,987.11	46,967.88

4. 交易费用	7.4.7.19	7, 214, 532. 12	262, 390. 38
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	230, 208. 35	63, 573. 17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		68, 776, 192. 88	7, 197, 376. 09
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		68, 776, 192. 88	7, 197, 376. 09

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	13, 257, 277. 16	4, 928, 028. 40	18, 185, 305. 56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	68, 776, 192. 88	68, 776, 192. 88
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	495, 630, 298. 94	105, 652, 842. 57	601, 283, 141. 51
其中：1. 基金申购款	1, 135, 985, 474. 64	232, 561, 923. 39	1, 368, 547, 398. 03

2. 基金赎回款	-640,355,175.70	-126,909,080.82	-767,264,256.52
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-4,392,796.13	-4,392,796.13
五、期末所有者权益（基金净值）	508,887,576.10	174,964,267.72	683,851,843.82
项目	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	22,685,000.42	1,290,265.11	23,975,265.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,197,376.09	7,197,376.09
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-9,427,723.26	-3,037,560.54	-12,465,283.80
其中：1. 基金申购款	24,734,374.66	4,210,472.48	28,944,847.14
2. 基金赎回款	-34,162,097.92	-7,248,033.02	-41,410,130.94
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-522,052.26	-522,052.26
五、期末所有者权益（基金净值）	13,257,277.16	4,928,028.40	18,185,305.56

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）、其他股票（包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中小企业私募债券、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、债券回购、银行存款、同业存单、资产支持证券、金融衍生品（包括权证、股指期货、国债期货、股票期权等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可参与融资业务和转融通证券出借交易。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金在履行适当程序后可将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率*95%+一年期人民币定期存款利率（税后）*5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法（2020 年修订）》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板

第 3 号《年度报告和中期报告》及其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 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根据下列依照企业会计准则、《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

1、金融资产的分类

本基金的金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

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

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债的分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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，应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，应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。

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账

面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00%的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率逐日计提；

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

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

- 1、若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- 3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- 4、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最少为 1 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%。
- 5、本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；
- 6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本

基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

(一) 印花税

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

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

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

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

(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、地方政府债券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。

(三) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定, 自 2004 年 1 月 1 日起, 对证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金) 管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入, 继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定, 股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入, 暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定, 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

(四) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定, 股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入, 暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》的规定，对基金通过深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	17,729,574.45	1,092,654.49
定期存款	-	-
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	-	-
合计：	17,729,574.45	1,092,654.49

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	641,040,105.11	641,995,114.15	955,009.04
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	641,040,105.11	641,995,114.15	955,009.04
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	16,276,182.32	17,155,937.38	879,755.06
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	16,276,182.32	17,155,937.38	879,755.06

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有各项买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,155.68	123.40
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	15.51
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.55	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	3,346.92	5.92
合计	4,503.15	144.83

注：其他本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金所产生的应收利息。

7.4.7.6 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。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	21,592.30
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	-	21,592.30

注：本基金本报告期末无应付交易费用。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	3,987.18	8.81
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	165,000.00	41,224.07
应付指数使用费	48,147.56	-
合计	217,134.74	41,232.88

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

万家中证 1000 指数增强 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	11,120,961.79	11,120,961.79
本期申购	443,480,824.01	443,480,824.01
本期赎回（以“-”号填列）	-223,627,617.37	-223,627,617.37
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	230,974,168.43	230,974,168.43

金额单位：人民币元

万家中证 1000 指数增强 C		
项目	本期	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,136,315.37	2,136,315.37
本期申购	692,504,650.63	692,504,650.63
本期赎回（以“-”号填列）	-416,727,558.33	-416,727,558.33
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	277,913,407.67	277,913,407.67

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

万家中证 1000 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,320,052.93	-1,173,385.80	4,146,667.13
本期利润	30,954,962.41	1,987,166.05	32,942,128.46

本期基金份额交易产生的变动数	69,842,772.61	-23,684,725.28	46,158,047.33
其中：基金申购款	139,449,219.15	-50,168,685.58	89,280,533.57
基金赎回款	-69,606,446.54	26,483,960.30	-43,122,486.24
本期已分配利润	-3,684,662.14	-	-3,684,662.14
本期末	102,433,125.81	-22,870,945.03	79,562,180.78

单位：人民币元

万家中证 1000 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,007,435.85	-226,074.58	781,361.27
本期利润	37,745,976.49	-1,911,912.07	35,834,064.42
本期基金份额交易产生的变动数	84,846,848.16	-25,352,052.92	59,494,795.24
其中：基金申购款	218,538,962.12	-75,257,572.30	143,281,389.82
基金赎回款	-133,692,113.96	49,905,519.38	-83,786,594.58
本期已分配利润	-708,133.99	-	-708,133.99
本期末	122,892,126.51	-27,490,039.57	95,402,086.94

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	43,675.10	9,247.56
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	5.59	1,293.56
其他	28,243.67	604.76
合计	71,924.36	11,145.88

注：本期其他包含存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,834,483,178.06	92,120,654.39
减：卖出股票成本总额	2,757,334,243.43	84,140,166.01
买卖股票差价收入	77,148,934.63	7,980,488.38

7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.13.1 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	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	1,201,416.22	190,881.10
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	1,201,416.22	190,881.10

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	75,253.98	-361,206.93
——股票投资	75,253.98	-361,206.93
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——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	75,253.98	-361,206.93

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	2,106,186.28	63,122.85
转换费收入	23,936.96	710.88

合计	2,130,123.24	63,833.73
----	--------------	-----------

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	7,214,532.12	262,390.38
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	7,214,532.12	262,390.38

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	45,000.00	20,000.00
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
指数费用	58,147.56	40,000.00
银行费用	7,060.79	3,573.17
合计	230,208.35	63,573.17

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，本基金本报告期末无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》(财会〔2017〕7 号)、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》(财会〔2017〕8 号)、《企业会计准则第 24 号——套期会计》(财会〔2017〕9 号)、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(财会〔2017〕14 号)(以下简称新金融工具相关会计准则)和《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》(财会〔2020〕22 号),自 2022 年 1 月 1 日起,本基金开始执行新金融工具相关会计准则。

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	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
新疆国际实业股份有限公司	基金管理人的股东
齐河众鑫投资有限公司	基金管理人的股东
万家共赢资产管理有限公司	基金管理人的子公司
万家财富基金销售(天津)有限公司	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	基金管理人控制的公司

注: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		上年度可比期间	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		2020 年 1 月 1 日至 2020 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

中泰证券股份有 限公司	-	-	17,228,572.83	10.08%
----------------	---	---	---------------	--------

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
中泰证券股份有 限公司	16,044.60	10.34%	-	-

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日

	月 31 日	日
当期发生的基金应支付的管理费	3,095,610.05	262,362.18
其中：支付销售机构的客户维护费	1,258,610.39	32,107.95

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	619,121.92	52,472.46

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家中证 1000 指数增强 A	万家中证 1000 指数增强 C	合计
万家基金管理有限公司	-	82,542.39	82,542.39
中泰证券股份有限公司	-	343.00	343.00
招商银行股份有限公司	-	11,933.79	11,933.79
合计	-	94,819.18	94,819.18
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家中证 1000 指数增强 A	万家中证 1000 指数增强 C	合计
万家基金管理有限公司	-	26,037.60	26,037.60
中泰证券股份有限公司	-	194.90	194.90
招商银行股份有限公司	-	600.66	600.66
合计	-	26,833.16	26,833.16

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

计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	万家中证 1000 指数增强 A	万家中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日（2018 年 12 月 3 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	9,887,305.69	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-

报告期末持有的基金份额	9,887,305.69	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	1.9429%	-

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	万家中证 1000 指数增强 A	万家中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日（2018 年 12 月 3 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	9,887,305.69	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	9,887,305.69	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	74.5802%	-

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

招商银行股份有限公司	17,729,574.45	43,675.10	1,092,654.49	9,247.56
------------	---------------	-----------	--------------	----------

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方所承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间没有需作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

万家中证1000指数增强A

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2021年1 月13日		-2021年1 月13日	3.3000	3,568,145.64	116,516.50	3,684,662.14	
合 计	-		-	3.3000	3,568,145.64	116,516.50	3,684,662.14	

万家中证 1000 指数增强 C

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分 配 合计	备注
		场内	场外					
1	2021年1 月13日		-2021年1 月13日	3.2000	567,997.74	140,136.25	708,133.99	
合 计	-		-	3.2000	567,997.74	140,136.25	708,133.99	

7.4.12 期末（2021 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	可流通日	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
688262	国芯科技	2021 年 12 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股未上市	41.98	41.98	5,927	248,815.46	248,815.46	-
301136	招标股份	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 11 日	新股未上市	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
001234	泰慕士	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 11 日	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
688107	安路科技	2021 年 11 月 5 日	2022 年 5 月 12 日	新股流通受限	26.00	56.09	5,107	132,782.00	286,451.63	-
688248	南网科技	2021 年 12 月 14 日	2022 年 6 月 22 日	新股流通受限	12.24	18.90	11,763	143,979.12	222,320.70	-
688622	禾信仪器	2021 年 9 月 3 日	2022 年 3 月 14 日	新股流通受限	17.70	56.93	1,204	21,310.80	68,543.72	-
301050	雷电微力	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	新股流通受限	60.64	234.74	170	10,308.80	39,905.80	-
301211	亨迪	2021 年	2022	新股流	25.80	33.65	967	24,948.60	32,539.55	-

	药业	12月14日	2021年6月22日	通受限							
301177	迪阿股份	2021年12月8日	2022年6月15日	新股流通受限	116.88	116.08	258	30,155.04	29,948.64	-	
301127	天源环保	2021年12月23日	2022年6月30日	新股流通受限	12.03	17.12	1,685	20,270.55	28,847.20	-	
301099	雅创电子	2021年11月10日	2022年5月23日	新股流通受限	21.99	71.36	351	7,718.49	25,047.36	-	
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年6月22日	新股流通受限	69.89	88.72	280	19,569.20	24,841.60	-	
301069	凯盛新材	2021年9月16日	2022年3月28日	新股流通受限	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-	
301029	怡合达	2021年7月14日	2022年1月24日	新股流通受限	14.14	89.87	260	3,676.40	23,366.20	-	
301189	奥尼电子	2021年12月21日	2022年6月28日	新股流通受限	66.18	56.62	411	27,199.98	23,270.82	-	
301090	华润材料	2021年10月19日	2022年4月26日	新股流通受限	10.45	11.22	1,815	18,966.75	20,364.30	-	
301149	隆华新材	2021年11月3日	2022年5月10日	新股流通受限	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-	

301087	可孚 医疗	2021 年 10 月 15 日	2022 年 4 月 25 日	新股流 通受限	93.09	75.34	268	24,948.12	20,191.12	-
300994	久祺 股份	2021 年 8 月 2 日	2022 年 2 月 14 日	新股流 通受限	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301100	风光 股份	2021 年 12 月 10 日	2022 年 6 月 17 日	新股流 通受限	27.81	31.14	599	16,658.19	18,652.86	-
301060	兰卫 医学	2021 年 9 月 6 日	2022 年 3 月 14 日	新股流 通受限	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301168	通灵 股份	2021 年 12 月 2 日	2022 年 6 月 10 日	新股流 通受限	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-
301091	深城 交	2021 年 10 月 20 日	2022 年 4 月 29 日	新股流 通受限	36.50	31.31	524	19,126.00	16,406.44	-
301101	明月 镜片	2021 年 12 月 9 日	2022 年 6 月 16 日	新股流 通受限	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-
301190	善水 科技	2021 年 12 月 17 日	2022 年 6 月 24 日	新股流 通受限	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301118	恒光 股份	2021 年 11 月 9 日	2022 年 5 月 18 日	新股流 通受限	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301089	拓新 药业	2021 年 10 月 20 日	2022 年 4 月	新股流 通受限	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-

		日	27 日							
301096	百诚医药	2021 年 12 月 13 日	2022 年 6 月 20 日	新股流 通受限	79.60	78.53	190	15,124.00	14,920.70	-
301180	万祥科技	2021 年 11 月 9 日	2022 年 5 月 16 日	新股流 通受限	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-
301093	华兰股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 5 月 5 日	新股流 通受限	58.08	49.85	287	16,668.96	14,306.95	-
301046	能辉科技	2021 年 8 月 10 日	2022 年 2 月 17 日	新股流 通受限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301111	粤万年青	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	新股流 通受限	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301179	泽宇智能	2021 年 12 月 1 日	2022 年 6 月 8 日	新股流 通受限	43.99	50.77	268	11,789.32	13,606.36	-
301138	华研精机	2021 年 12 月 8 日	2022 年 6 月 15 日	新股流 通受限	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301126	达嘉维康	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	新股流 通受限	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-
301108	洁雅股份	2021 年 11 月 25 日	2022 年 6 月 6 日	新股流 通受限	57.27	53.71	227	13,000.29	12,192.17	-
301092	争光	2021 年	2022	新股流	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-

	股份	10月21日	2021年5月5日	通受限							
301088	戎美股份	2021年10月19日	2022年4月28日	新股流通受限	33.16	24.67	462	15,319.92	11,397.54	-	
301048	金鹰重工	2021年8月11日	2022年2月28日	新股流通受限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-	
301035	润丰股份	2021年7月21日	2022年1月28日	新股流通受限	22.04	56.28	173	3,812.92	9,736.44	-	
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股流通受限	9.46	41.43	229	2,166.34	9,487.47	-	
300774	倍杰特	2021年7月26日	2022年2月16日	新股流通受限	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-	
301040	中环海陆	2021年7月26日	2022年2月7日	新股流通受限	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-	
301078	孩子王	2021年9月30日	2022年4月14日	新股流通受限	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-	
301182	凯旺科技	2021年12月16日	2022年6月23日	新股流通受限	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-	
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	新股流通受限	10.64	30.44	295	3,138.80	8,979.80	-	

301062	上海艾录	2021 年 9 月 7 日	2022 年 3 月 14 日	新股流通受限	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301193	家联科技	2021 年 12 月 2 日	2022 年 6 月 9 日	新股流通受限	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
301026	浩通科技	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 17 日	新股流通受限	18.03	62.73	137	2,470.11	8,594.01	-
301052	果麦文化	2021 年 8 月 23 日	2022 年 2 月 28 日	新股流通受限	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	-
301025	读客文化	2021 年 7 月 6 日	2022 年 1 月 24 日	新股流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301066	万事利	2021 年 9 月 13 日	2022 年 3 月 22 日	新股流通受限	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
300814	中富电路	2021 年 8 月 4 日	2022 年 2 月 14 日	新股流通受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
301055	张小泉	2021 年 8 月 26 日	2022 年 3 月 7 日	新股流通受限	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301133	金钟股份	2021 年 11 月 19 日	2022 年 5 月 26 日	新股流通受限	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301198	喜悦智行	2021 年 11 月 25 日	2022 年 6 月	新股流通受限	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-

		日	2 日							
301030	仕净科技	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	新股流 通受限	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301081	严牌股份	2021 年 10 月 13 日	2022 年 4 月 20 日	新股流 通受限	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301098	金埔园林	2021 年 11 月 4 日	2022 年 5 月 12 日	新股流 通受限	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301039	中集车辆	2021 年 7 月 1 日	2022 年 1 月 10 日	新股流 通受限	6.96	12.51	527	3,667.92	6,592.77	-
301033	迈普医学	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 26 日	新股流 通受限	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301049	超越科技	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	新股流 通受限	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301032	新柴股份	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	新股流 通受限	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301056	森赫股份	2021 年 8 月 27 日	2022 年 3 月 7 日	新股流 通受限	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301041	金百泽	2021 年 8 月 2 日	2022 年 2 月 11 日	新股流 通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301072	中捷	2021 年	2022	新股流	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-

	精工	9月22日	2021年3月29日	通受限							
301083	百胜智能	2021年10月13日	2022年4月21日	新股流通受限	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-	
301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	新股流通受限	5.31	13.50	417	2,214.27	5,629.50	-	
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月16日	新股流通受限	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-	
301063	海锅股份	2021年9月9日	2022年3月24日	新股流通受限	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-	
301038	深水规院	2021年7月22日	2022年2月7日	新股流通受限	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-	
301059	金三江	2021年9月3日	2022年3月14日	新股流通受限	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-	
301037	保立佳	2021年7月21日	2022年2月7日	新股流通受限	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-	
301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	新股流通受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-	
301053	远信工业	2021年8月25日	2022年3月1日	新股流通受限	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-	

301057	汇隆 新材	2021 年 8 月 31 日	2022 年 3 月 9 日	新股流 通受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301068	大地 海洋	2021 年 9 月 16 日	2022 年 3 月 28 日	新股流 通受限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301036	双乐 股份	2021 年 7 月 21 日	2022 年 2 月 16 日	新股流 通受限	23.38	29.93	133	3,109.54	3,980.69	-
301079	邵阳 液压	2021 年 10 月 11 日	2022 年 4 月 19 日	新股流 通受限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301027	华蓝 集团	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 19 日	新股流 通受限	11.45	16.65	205	2,347.25	3,413.25	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 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 2021 年 12 月 31 日止, 本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理融入各业务层面，建立了三道防线：以各岗位目标责任制为基础，形成第一道防线；通过相关部门、相关岗位之间相互监督制衡，形成第二道防线；由监察稽核部门、督察长对各岗位、各部门、各机构、各项业务实施监督反馈，形成第三道防线。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险，本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资（2020 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.3 流动性风险

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

本基金所持证券全部在证券交易所上市，因此除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂

时受限制不能自由转让的情况外，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投资的公允价值。

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（2021 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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	17,729,574.45	-	-	-	-	-	17,729,574.45
结算备付金	25,899,350.66	-	-	-	-	-	25,899,350.66
交易性金融资产	-	-	-	-	-	641,995,114.15	641,995,114.15
应收利息	-	-	-	-	-	4,503.15	4,503.15
应收申购款	3,149.00	-	-	-	-	4,294,818.09	4,297,967.09
资产总计	43,632,074.11	-	-	-	-	646,294,435.39	689,926,509.50
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,022,354.83	5,022,354.83
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	587,407.88	587,407.88
应付托管费	-	-	-	-	-	117,481.56	117,481.56
应付销售服务费	-	-	-	-	-	130,286.67	130,286.67
其他负债	-	-	-	-	-	217,134.74	217,134.74
负债总计	-	-	-	-	-	6,074,665.68	6,074,665.68
利率敏感度缺口	43,632,074.11	-	-	-	-	640,219,769.71	683,851,843.82
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,092,654.49	-	-	-	-	-	1,092,654.49
结算备付金	48,374.56	-	-	-	-	-	48,374.56
交易性金融资产	-	-	-	-	-	17,155,937.38	17,155,937.38
应收利息	-	-	-	-	-	144.83	144.83
资产总计	1,141,029.05	-	-	-	-	17,156,082.21	18,297,111.26
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	29,180.87	29,180.87
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	15,642.35	15,642.35
应付托管费	-	-	-	-	-	3,128.47	3,128.47
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,028.83	1,028.83
应付交易费用	-	-	-	-	-	21,592.30	21,592.30
其他负债	-	-	-	-	-	41,232.88	41,232.88
负债总计	-	-	-	-	-	111,805.70	111,805.70
利率敏感度缺口	1,141,029.05	-	-	-	-	17,044,276.51	18,185,305.56

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2020 年 12 月 31 日：同），银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2020 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 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	641,995,114.15	93.88	17,155,937.38	94.34
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	641,995,114.15	93.88	17,155,937.38	94.34

注：本基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；权证投资占基金资产净值的 0-3%。每个交易日日终，在扣除股票期权、股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 若股票基准指数发生变动而其他市场变量保持不变		
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（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1. 股票基准指数下降 100 个 基点	-6,811,216.66	-171,454.22
	2. 股票基准指数上升 100 个 基点	6,811,216.66	171,454.22

注：本基金管理人运用资本-资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。表中为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

（一）公允价值

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。

2、持续的以公允价值计量的金融工具

(1) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为 640,187,977.61 元，属于第二层次的余额为 1,807,136.54 元，无属于第三层次的余额。（2020 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为 17,155,937.38 元，无属于第二层次和第三层次的余额。）

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次均未发生重大变动。

(3) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具本期末及上年度末均未以第三层次公允价值计量。

3、非持续的以公允价值计量的金融工具

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。

4、不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息以及其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(二)除公允价值外，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	641,995,114.15	93.05
	其中：股票	641,995,114.15	93.05
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	43,628,925.11	6.32
8	其他各项资产	4,302,470.24	0.62
9	合计	689,926,509.50	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	10,781,343.00	1.58
B	采矿业	10,212,921.00	1.49
C	制造业	390,265,303.89	57.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,944,175.00	1.60
E	建筑业	9,116,390.00	1.33
F	批发和零售业	195,312.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	6,332,778.76	0.93
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务	60,484,258.13	8.84

	业		
J	金融业	2,374,295.00	0.35
K	房地产业	7,126,782.00	1.04
L	租赁和商务服务业	1,431,262.57	0.21
M	科学研究和技术服务业	12,436,118.24	1.82
N	水利、环境和公共设施管理业	5,393,471.80	0.79
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	673,524.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	243,423.00	0.04
S	综合	-	-
	合计	528,011,358.39	77.21

8.2.2 期末积极投资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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	4,437,504.00	0.65
B	采矿业	11,360,656.50	1.66
C	制造业	68,325,856.95	9.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,615,183.00	0.53
E	建筑业	5,983,730.07	0.88
F	批发和零售业	88,301.64	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	4,718,379.00	0.69
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,586,972.50	0.82
J	金融业	3,347,963.68	0.49

K	房地产业		-
L	租赁和商务服务业		-
M	科学研究和技术服务业	4,867,803.81	0.71
N	水利、环境和公共设施管理业	1,423,486.91	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业		-
P	教育		-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	16,891.92	0.00
S	综合	188,256.00	0.03
	合计	113,983,755.76	16.67

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资组合。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600360	华微电子	1,510,600	13,716,248.00	2.01
2	002204	大连重工	2,634,500	11,460,075.00	1.68
3	688050	爱博医疗	46,000	9,670,580.00	1.41
4	600108	亚盛集团	2,739,300	9,669,729.00	1.41
5	300735	光弘科技	600,200	9,045,014.00	1.32
6	002326	永太科技	175,204	8,972,196.84	1.31
7	002407	多氟多	197,400	8,881,026.00	1.30
8	603383	顶点软件	237,140	8,513,326.00	1.24
9	688200	华峰测控	16,273	8,330,148.70	1.22
10	002376	新北洋	880,500	8,303,115.00	1.21

11	600559	老白干酒	269,752	7,536,870.88	1.10
12	688116	天奈科技	47,716	7,123,521.64	1.04
13	688598	金博股份	19,801	7,030,147.04	1.03
14	601666	平煤股份	834,000	6,980,580.00	1.02
15	688388	嘉元科技	54,854	6,886,919.70	1.01
16	002449	国星光电	614,900	6,628,622.00	0.97
17	688508	芯朋微	57,070	6,612,130.20	0.97
18	688122	西部超导	67,663	6,559,251.22	0.96
19	300035	中科电气	215,100	6,506,775.00	0.95
20	300233	金城医药	213,300	6,204,897.00	0.91
21	300054	鼎龙股份	248,600	6,050,924.00	0.88
22	300294	博雅生物	157,100	6,024,785.00	0.88
23	300232	洲明科技	659,600	5,896,824.00	0.86
24	300390	天华超净	71,700	5,807,700.00	0.85
25	688202	美迪西	11,705	5,683,830.95	0.83
26	601011	宝泰隆	1,062,000	5,617,980.00	0.82
27	600110	诺德股份	340,000	5,423,000.00	0.79
28	300775	三角防务	110,900	5,421,901.00	0.79
29	688390	固德威	11,700	5,377,086.00	0.79
30	688366	昊海生科	42,235	5,316,964.15	0.78
31	688085	三友医疗	169,310	5,226,599.70	0.76
32	600662	外服控股	705,611	5,052,174.76	0.74
33	000676	智度股份	633,500	4,922,295.00	0.72
34	300567	精测电子	67,000	4,852,810.00	0.71
35	300352	北信源	786,300	4,796,430.00	0.70
36	300204	舒泰神	272,800	4,787,640.00	0.70
37	603881	数据港	126,220	4,660,042.40	0.68
38	688106	金宏气体	164,368	4,571,074.08	0.67

39	300311	任子行	539,300	4,406,081.00	0.64
40	000823	超声电子	322,300	4,389,726.00	0.64
41	000657	中钨高新	271,500	4,365,720.00	0.64
42	002597	金禾实业	84,700	4,349,345.00	0.64
43	300590	移为通信	149,500	4,313,075.00	0.63
44	300328	宜安科技	549,200	4,311,220.00	0.63
45	300346	南大光电	92,004	4,272,665.76	0.62
46	000966	长源电力	580,100	4,252,133.00	0.62
47	300748	金力永磁	92,039	4,131,630.71	0.60
48	688030	山石网科	136,018	4,034,293.88	0.59
49	300568	星源材质	109,300	4,014,589.00	0.59
50	600685	中船防务	172,000	4,012,760.00	0.59
51	300470	中密控股	89,200	3,984,564.00	0.58
52	000913	钱江摩托	274,900	3,900,831.00	0.57
53	603599	广信股份	98,600	3,845,400.00	0.56
54	002158	汉钟精机	138,700	3,693,581.00	0.54
55	688023	安恒信息	14,594	3,659,299.56	0.54
56	000917	电广传媒	536,900	3,629,444.00	0.53
57	600456	宝钛股份	49,000	3,517,220.00	0.51
58	688520	神州细胞	59,029	3,450,245.05	0.50
59	600223	鲁商发展	260,000	3,445,000.00	0.50
60	603508	思维列控	149,640	3,438,727.20	0.50
61	002276	万马股份	375,900	3,386,859.00	0.50
62	603299	苏盐井神	343,800	3,286,728.00	0.48
63	000498	山东路桥	527,500	3,259,950.00	0.48
64	002941	新疆交建	265,700	3,212,313.00	0.47
65	600123	兰花科创	340,800	3,193,296.00	0.47
66	300633	开立医疗	99,944	3,191,211.92	0.47

67	688033	天宜上佳	94,960	3,138,428.00	0.46
68	002738	中矿资源	44,600	3,138,056.00	0.46
69	300252	金信诺	332,500	2,965,900.00	0.43
70	300073	当升科技	34,100	2,962,267.00	0.43
71	603043	广州酒家	118,713	2,856,234.78	0.42
72	300613	富瀚微	17,400	2,837,070.00	0.41
73	600007	中国国贸	192,400	2,770,560.00	0.41
74	300973	立高食品	20,793	2,746,339.44	0.40
75	601952	苏垦农发	229,900	2,738,109.00	0.40
76	300215	电科院	272,000	2,728,160.00	0.40
77	002573	清新环境	361,900	2,634,632.00	0.39
78	300768	迪普科技	63,300	2,611,125.00	0.38
79	300821	东岳硅材	135,600	2,478,768.00	0.36
80	603588	高能环境	139,640	2,453,474.80	0.36
81	000423	东阿阿胶	49,000	2,388,750.00	0.35
82	002436	兴森科技	169,500	2,373,000.00	0.35
83	603008	喜临门	60,600	2,365,218.00	0.35
84	688568	中科星图	28,730	2,269,095.40	0.33
85	600496	精工钢构	521,200	2,220,312.00	0.32
86	002639	雪人股份	148,200	2,203,734.00	0.32
87	603610	麒盛科技	83,405	2,156,853.30	0.32
88	688586	江航装备	61,704	2,091,765.60	0.31
89	601158	重庆水务	312,400	2,002,484.00	0.29
90	688037	芯源微	11,425	1,928,540.00	0.28
91	688158	优刻得	71,506	1,896,339.12	0.28
92	002850	科达利	11,800	1,892,012.00	0.28
93	300769	德方纳米	3,800	1,866,408.00	0.27
94	603976	正川股份	53,900	1,839,068.00	0.27

95	000403	派林生物	64,800	1,816,344.00	0.27
96	688368	晶丰明源	5,412	1,732,381.20	0.25
97	000710	贝瑞基因	88,900	1,724,660.00	0.25
98	002635	安洁科技	99,900	1,701,297.00	0.25
99	002135	东南网架	146,500	1,693,540.00	0.25
100	600882	妙可蓝多	30,100	1,685,600.00	0.25
101	002254	泰和新材	85,500	1,676,655.00	0.25
102	688389	普门科技	71,377	1,641,671.00	0.24
103	600621	华鑫股份	115,700	1,601,288.00	0.23
104	300723	一品红	44,200	1,586,780.00	0.23
105	002042	华孚时尚	346,700	1,584,419.00	0.23
106	688019	安集科技	5,704	1,558,332.80	0.23
107	300055	万邦达	118,600	1,544,172.00	0.23
108	601126	四方股份	73,600	1,538,240.00	0.22
109	603027	千禾味业	62,300	1,500,184.00	0.22
110	600285	羚锐制药	94,400	1,491,520.00	0.22
111	688278	特宝生物	50,030	1,464,878.40	0.21
112	603105	芯能科技	87,900	1,460,898.00	0.21
113	300861	美畅股份	18,576	1,444,655.52	0.21
114	300130	新国都	98,300	1,443,044.00	0.21
115	601619	嘉泽新能	275,600	1,422,096.00	0.21
116	600057	厦门象屿	166,793	1,416,072.57	0.21
117	688177	百奥泰	54,615	1,410,705.45	0.21
118	688017	绿的谐波	8,081	1,410,619.36	0.21
119	688100	威胜信息	40,097	1,380,539.71	0.20
120	601609	金田铜业	158,400	1,370,160.00	0.20
121	002498	汉缆股份	261,400	1,351,438.00	0.20
122	300101	振芯科技	59,800	1,326,364.00	0.19

123	603236	移远通信	6,230	1,270,297.00	0.19
124	000933	神火股份	138,800	1,261,692.00	0.18
125	002545	东方铁塔	133,900	1,221,168.00	0.18
126	002911	佛燃能源	108,000	1,209,600.00	0.18
127	600874	创业环保	166,000	1,173,620.00	0.17
128	300738	奥飞数据	51,600	1,171,320.00	0.17
129	002895	川恒股份	46,000	1,135,740.00	0.17
130	300149	睿智医药	80,500	1,111,705.00	0.16
131	300761	立华股份	29,400	1,111,614.00	0.16
132	603713	密尔克卫	7,800	1,051,284.00	0.15
133	300292	吴通控股	260,800	1,040,592.00	0.15
134	300034	钢研高纳	17,711	1,020,153.60	0.15
135	300777	中简科技	15,600	965,328.00	0.14
136	603595	东尼电子	25,900	956,487.00	0.14
137	688198	佰仁医疗	3,712	943,961.60	0.14
138	300083	创世纪	64,627	922,873.56	0.13
139	300709	精研科技	15,300	917,235.00	0.13
140	300829	金丹科技	19,300	882,010.00	0.13
141	300432	富临精工	29,200	858,480.00	0.13
142	601965	中国汽研	46,000	856,060.00	0.13
143	603118	共进股份	88,100	842,236.00	0.12
144	002145	中核钛白	65,200	820,868.00	0.12
145	300855	图南股份	11,300	796,537.00	0.12
146	000881	中广核技	82,600	795,438.00	0.12
147	600596	新安股份	31,463	786,260.37	0.11
148	600502	安徽建工	185,300	768,995.00	0.11
149	002539	云图控股	56,900	755,063.00	0.11
150	300900	广联航空	20,900	717,915.00	0.10

151	600929	雪天盐业	95,400	711,684.00	0.10
152	300477	合纵科技	88,400	711,620.00	0.10
153	300638	广和通	12,800	697,600.00	0.10
154	300045	华力创通	59,800	695,474.00	0.10
155	002759	天际股份	23,000	673,900.00	0.10
156	300143	盈康生命	47,700	673,524.00	0.10
157	300118	东方日升	19,300	626,671.00	0.09
158	000918	嘉凯城	244,600	609,054.00	0.09
159	000567	海德股份	33,900	605,115.00	0.09
160	688408	中信博	3,400	600,134.00	0.09
161	688277	天智航	21,660	568,575.00	0.08
162	688066	航天宏图	7,601	552,592.70	0.08
163	300409	道氏技术	22,700	550,475.00	0.08
164	002768	国恩股份	21,100	545,646.00	0.08
165	688007	光峰科技	15,868	545,065.80	0.08
166	300510	金冠股份	81,000	532,170.00	0.08
167	300428	立中集团	18,800	494,440.00	0.07
168	002643	万润股份	20,800	491,712.00	0.07
169	002550	千红制药	101,400	489,762.00	0.07
170	600389	江山股份	11,800	485,216.00	0.07
171	600877	声光电科	29,600	463,536.00	0.07
172	600116	三峡水利	38,400	447,744.00	0.07
173	002611	东方精工	79,300	442,494.00	0.06
174	603612	索通发展	21,516	441,508.32	0.06
175	300287	飞利信	67,703	415,019.39	0.06
176	300298	三诺生物	12,600	376,866.00	0.06
177	603693	江苏新能	13,100	372,826.00	0.05
178	300657	弘信电子	22,200	366,522.00	0.05

179	688222	成都先导	14,121	331,702.29	0.05
180	603959	百利科技	21,000	330,960.00	0.05
181	603429	集友股份	12,300	321,030.00	0.05
182	688166	博瑞医药	8,500	312,035.00	0.05
183	300388	节能国祯	38,900	305,365.00	0.04
184	600990	四创电子	5,400	303,318.00	0.04
185	603666	亿嘉和	4,000	300,480.00	0.04
186	300366	创意信息	23,300	282,396.00	0.04
187	300672	国科微	1,500	278,250.00	0.04
188	300145	中金环境	84,400	275,144.00	0.04
189	600105	永鼎股份	47,200	253,464.00	0.04
190	601606	长城军工	18,900	245,511.00	0.04
191	600715	文投控股	73,100	243,423.00	0.04
192	603876	鼎胜新材	6,388	240,508.20	0.04
193	600428	中远海特	45,500	229,320.00	0.03
194	688365	光云科技	15,448	214,109.28	0.03
195	603439	贵州三力	13,200	208,296.00	0.03
196	000615	奥园美谷	18,800	202,664.00	0.03
197	300755	华致酒行	3,900	195,312.00	0.03
198	601929	吉视传媒	81,600	183,600.00	0.03
199	003009	中天火箭	2,900	179,133.00	0.03
200	600449	宁夏建材	13,100	157,593.00	0.02
201	002773	康弘药业	7,300	148,555.00	0.02
202	300208	青岛中程	13,300	144,172.00	0.02
203	603520	司太立	1,800	117,000.00	0.02
204	300831	派瑞股份	5,400	106,650.00	0.02
205	600185	格力地产	14,400	99,504.00	0.01
206	600864	哈投股份	15,600	95,316.00	0.01

207	300219	鸿利智汇	5,200	82,212.00	0.01
208	002839	张家港行	12,600	72,576.00	0.01
209	000155	川能动力	2,400	63,672.00	0.01
210	600746	江苏索普	3,900	53,820.00	0.01
211	688516	奥特维	214	52,584.08	0.01
212	603169	兰石重装	5,600	51,016.00	0.01
213	002970	锐明技术	1,100	45,276.00	0.01
214	002192	融捷股份	300	39,045.00	0.01
215	300458	全志科技	500	31,640.00	0.00
216	301029	怡合达	260	23,366.20	0.00
217	002344	海宁皮城	3,100	15,190.00	0.00
218	301035	润丰股份	173	9,736.44	0.00
219	002664	长鹰信质	400	7,940.00	0.00
220	301039	中集车辆	527	6,592.77	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601958	金钼股份	1,658,490	11,360,656.50	1.66
2	300162	雷曼光电	635,900	6,880,438.00	1.01
3	603929	亚翔集成	480,763	5,846,078.08	0.85
4	000938	紫光股份	211,667	4,836,590.95	0.71
5	300827	上能电气	52,000	4,726,800.00	0.69
6	000768	中航西飞	126,800	4,628,200.00	0.68
7	601111	中国国航	498,300	4,549,479.00	0.67
8	300404	博济医药	325,300	4,498,899.00	0.66
9	688567	孚能科技	133,100	4,478,815.00	0.65

10	600487	亨通光电	296,153	4,477,833.36	0.65
11	300010	豆神教育	1,060,548	4,443,696.12	0.65
12	300498	温氏股份	230,400	4,437,504.00	0.65
13	688005	容百科技	36,006	4,161,573.48	0.61
14	600885	宏发股份	52,220	3,897,700.80	0.57
15	600283	钱江水利	284,100	3,593,865.00	0.53
16	300757	罗博特科	54,800	3,397,600.00	0.50
17	600779	水井坊	27,500	3,299,725.00	0.48
18	600919	江苏银行	496,800	2,896,344.00	0.42
19	300363	博腾股份	30,000	2,683,500.00	0.39
20	000877	天山股份	151,100	2,313,341.00	0.34
21	300450	先导智能	28,600	2,126,982.00	0.31
22	000709	河钢股份	749,500	1,843,770.00	0.27
23	603099	长白山	125,300	1,373,288.00	0.20
24	688578	艾力斯	45,118	1,362,563.60	0.20
25	688313	仕佳光子	86,373	1,113,347.97	0.16
26	688185	康希诺	3,348	1,002,893.40	0.15
27	688550	瑞联新材	8,312	824,301.04	0.12
28	300820	英杰电气	7,900	710,210.00	0.10
29	002579	中京电子	66,560	685,568.00	0.10
30	688596	正帆科技	25,400	656,590.00	0.10
31	600623	华谊集团	69,500	632,450.00	0.09
32	002805	丰元股份	19,800	624,690.00	0.09
33	000949	新乡化纤	98,400	552,024.00	0.08
34	603938	三孚股份	14,900	548,171.00	0.08
35	002202	金风科技	28,900	475,983.00	0.07
36	688536	思瑞浦	556	427,008.00	0.06
37	688006	杭可科技	3,881	417,517.98	0.06

38	688521	芯原股份	5,336	412,792.96	0.06
39	300514	友讯达	28,600	362,076.00	0.05
40	002821	凯莱英	800	348,000.00	0.05
41	688378	奥来德	4,163	333,456.30	0.05
42	601658	邮储银行	61,400	313,140.00	0.05
43	002881	美格智能	6,800	291,584.00	0.04
44	600841	上柴股份	24,400	288,652.00	0.04
45	688107	安路科技	5,107	286,451.63	0.04
46	688262	国芯科技	5,927	248,815.46	0.04
47	002180	纳思达	5,200	248,352.00	0.04
48	300575	中旗股份	10,200	228,990.00	0.03
49	688248	南网科技	11,763	222,320.70	0.03
50	688556	高测股份	3,020	203,819.80	0.03
51	002510	天汽模	43,100	195,674.00	0.03
52	600673	东阳光	21,200	188,256.00	0.03
53	688558	国盛智科	3,800	171,760.00	0.03
54	601872	招商轮船	38,800	159,080.00	0.02
55	300472	新元科技	7,900	126,874.00	0.02
56	300712	永福股份	2,300	126,132.00	0.02
57	300505	川金诺	3,700	113,368.00	0.02
58	002223	鱼跃医疗	2,800	105,840.00	0.02
59	300833	浩洋股份	1,300	105,339.00	0.02
60	300082	奥克股份	6,800	105,060.00	0.02
61	300890	翔丰华	1,600	98,928.00	0.01
62	688519	南亚新材	1,900	95,779.00	0.01
63	600160	巨化股份	6,300	81,333.00	0.01
64	300153	科泰电源	7,700	78,078.00	0.01
65	600438	通威股份	1,700	76,432.00	0.01

66	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.01
67	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.01
68	000987	越秀金控	7,900	68,730.00	0.01
69	688622	禾信仪器	1,204	68,543.72	0.01
70	600516	方大炭素	6,200	67,084.00	0.01
71	603185	上机数控	400	66,792.00	0.01
72	605358	立昂微	500	60,005.00	0.01
73	688357	建龙微纳	300	57,582.00	0.01
74	301050	雷电微力	170	39,905.80	0.01
75	603351	威尔药业	900	35,253.00	0.01
76	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.00
77	300024	机器人	2,700	30,159.00	0.00
78	301177	迪阿股份	258	29,948.64	0.00
79	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.00
80	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.00
81	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
82	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
83	301189	奥尼电子	411	23,270.82	0.00
84	600011	华能国际	2,200	21,318.00	0.00
85	301090	华润材料	1,815	20,364.30	0.00
86	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
87	301087	可孚医疗	268	20,191.12	0.00
88	688022	瀚川智能	300	19,524.00	0.00
89	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
90	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
91	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
92	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
93	300825	阿尔特	600	16,806.00	0.00

94	301091	深城交	524	16,406.44	0.00
95	002555	三七互娱	600	16,212.00	0.00
96	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
97	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
98	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
99	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
100	301096	百诚医药	190	14,920.70	0.00
101	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
102	301093	华兰股份	287	14,306.95	0.00
103	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
104	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
105	301179	泽宇智能	268	13,606.36	0.00
106	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
107	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
108	301108	洁雅股份	227	12,192.17	0.00
109	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
110	301088	戎美股份	462	11,397.54	0.00
111	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
112	300873	海晨股份	200	9,820.00	0.00
113	001288	运机集团	537	9,563.97	0.00
114	301021	英诺激光	229	9,487.47	0.00
115	600425	青松建化	2,500	9,475.00	0.00
116	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
117	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
118	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
119	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
120	301020	密封科技	295	8,979.80	0.00
121	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00

122	605138	盛泰集团	723	8,733.84	0.00
123	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
124	301026	浩通科技	137	8,594.01	0.00
125	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
126	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
127	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
128	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
129	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
130	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
131	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
132	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
133	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
134	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
135	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
136	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
137	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
138	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
139	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
140	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
141	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
142	301028	东亚机械	417	5,629.50	0.00
143	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
144	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
145	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
146	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
147	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
148	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
149	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00

150	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
151	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
152	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
153	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
154	301036	双乐股份	133	3,980.69	0.00
155	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00
156	301027	华蓝集团	205	3,413.25	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	601958	金钼股份	21,413,164.30	117.75
2	600108	亚盛集团	18,086,969.72	99.46
3	688116	天奈科技	17,960,329.16	98.76
4	688200	华峰测控	17,904,597.14	98.46
5	002204	大连重工	17,429,104.66	95.84
6	300363	博腾股份	17,252,458.00	94.87
7	600360	华微电子	17,119,904.00	94.14
8	300390	天华超净	16,713,343.18	91.91
9	000733	振华科技	16,446,442.00	90.44
10	300073	当升科技	16,238,770.62	89.30
11	002326	永太科技	15,533,990.84	85.42
12	300725	药石科技	15,338,009.26	84.34
13	002407	多氟多	15,194,069.00	83.55
14	002254	泰和新材	14,594,955.00	80.26
15	603267	鸿远电子	14,560,413.65	80.07

16	600123	兰花科创	14,157,849.00	77.85
17	000933	神火股份	13,990,463.00	76.93
18	688388	嘉元科技	13,567,072.89	74.60
19	002850	科达利	13,468,372.00	74.06
20	603678	火炬电子	13,443,417.02	73.92
21	002497	雅化集团	13,402,355.00	73.70
22	300775	三角防务	13,228,965.00	72.75
23	603345	安井食品	13,110,659.46	72.09
24	300724	捷佳伟创	13,083,763.69	71.95
25	688202	美迪西	12,920,655.74	71.05
26	688366	昊海生科	12,851,352.90	70.67
27	603026	石大胜华	12,741,522.00	70.06
28	603383	顶点软件	12,700,908.20	69.84
29	002276	万马股份	12,664,152.00	69.64
30	688005	容百科技	12,551,134.18	69.02
31	603456	九洲药业	12,407,539.00	68.23
32	601666	平煤股份	12,206,295.00	67.12
33	300568	星源材质	11,944,997.90	65.68
34	600559	老白干酒	11,944,308.08	65.68
35	300054	鼎龙股份	11,712,109.00	64.40
36	300012	华测检测	11,438,971.00	62.90
37	002568	百润股份	11,376,889.10	62.56
38	603337	杰克股份	11,280,420.84	62.03
39	300294	博雅生物	11,084,621.54	60.95
40	300751	迈为股份	11,079,269.04	60.92
41	688050	爱博医疗	11,049,474.18	60.76
42	002313	日海智能	10,937,142.38	60.14
43	002376	新北洋	10,917,552.00	60.04

44	002573	清新环境	10,738,732.00	59.05
45	688368	晶丰明源	10,726,411.74	58.98
46	600596	新安股份	10,653,008.03	58.58
47	688122	西部超导	10,567,814.28	58.11
48	002011	盾安环境	10,452,651.00	57.48
49	300034	钢研高纳	10,405,932.56	57.22
50	300232	洲明科技	10,253,012.00	56.38
51	603305	旭升股份	10,154,714.30	55.84
52	603929	亚翔集成	10,149,008.44	55.81
53	300496	中科创达	10,106,680.85	55.58
54	603508	思维列控	10,064,846.63	55.35
55	688188	柏楚电子	10,002,379.90	55.00
56	002449	国星光电	9,925,824.00	54.58
57	600110	诺德股份	9,871,279.00	54.28
58	688016	心脉医疗	9,835,405.87	54.08
59	603588	高能环境	9,689,983.93	53.28
60	300233	金城医药	9,624,681.00	52.93
61	300769	德方纳米	9,584,756.00	52.71
62	600323	瀚蓝环境	9,583,735.00	52.70
63	300162	雷曼光电	9,572,624.00	52.64
64	300748	金力永磁	9,548,691.60	52.51
65	601678	滨化股份	9,399,968.61	51.69
66	300215	电科院	9,382,109.00	51.59
67	300406	九强生物	9,295,240.00	51.11
68	300735	光弘科技	9,240,816.79	50.81
69	300458	全志科技	9,226,231.32	50.73
70	300633	开立医疗	9,165,041.88	50.40
71	603236	移远通信	9,113,314.00	50.11

72	300395	菲利华	9,102,854.00	50.06
73	002041	登海种业	9,033,287.00	49.67
74	002042	华孚时尚	8,964,259.00	49.29
75	688598	金博股份	8,885,650.92	48.86
76	600882	妙可蓝多	8,869,722.00	48.77
77	300477	合纵科技	8,790,206.00	48.34
78	600057	厦门象屿	8,782,189.07	48.29
79	002920	德赛西威	8,774,352.32	48.25
80	002129	中环股份	8,773,514.00	48.25
81	300470	中密控股	8,769,919.40	48.23
82	603599	广信股份	8,660,358.27	47.62
83	600869	远东股份	8,605,629.00	47.32
84	002545	东方铁塔	8,589,896.00	47.24
85	688018	乐鑫科技	8,536,210.29	46.94
86	300639	凯普生物	8,475,045.42	46.60
87	002918	蒙娜丽莎	8,397,417.60	46.18
88	300145	中金环境	8,397,314.00	46.18
89	002135	东南网架	8,365,155.00	46.00
90	688389	普门科技	8,315,912.79	45.73
91	603612	索通发展	8,308,937.76	45.69
92	300352	北信源	8,297,677.00	45.63
93	300130	新国都	8,252,213.47	45.38
94	300763	锦浪科技	8,226,558.48	45.24
95	300171	东富龙	8,180,517.00	44.98
96	002597	金禾实业	8,178,237.00	44.97
97	601330	绿色动力	8,119,367.50	44.65
98	002402	和而泰	8,062,803.80	44.34
99	000498	山东路桥	8,044,387.00	44.24

100	300638	广和通	8,003,236.93	44.01
101	300567	精测电子	7,965,694.00	43.80
102	002756	永兴材料	7,938,514.00	43.65
103	300894	火星人	7,907,108.87	43.48
104	000035	中国天楹	7,858,369.00	43.21
105	300035	中科电气	7,825,269.00	43.03
106	002025	航天电器	7,814,498.00	42.97
107	002430	杭氧股份	7,787,835.00	42.82
108	000516	国际医学	7,784,744.15	42.81
109	300747	锐科激光	7,695,492.00	42.32
110	688177	百奥泰	7,608,109.89	41.84
111	603299	苏盐井神	7,504,532.00	41.27
112	688508	芯朋微	7,462,342.86	41.04
113	600129	太极集团	7,433,806.50	40.88
114	603043	广州酒家	7,424,068.15	40.82
115	002215	诺普信	7,383,781.39	40.60
116	603881	数据港	7,382,225.20	40.59
117	688085	三友医疗	7,330,381.56	40.31
118	000676	智度股份	7,305,159.78	40.17
119	300441	鲍斯股份	7,288,518.37	40.08
120	300204	舒泰神	7,207,035.00	39.63
121	603613	国联股份	7,195,505.00	39.57
122	601600	中国铝业	7,156,654.00	39.35
123	000799	酒鬼酒	7,134,865.00	39.23
124	000918	嘉凯城	7,131,772.00	39.22
125	300696	爱乐达	7,095,172.20	39.02
126	002833	弘亚数控	7,087,877.00	38.98
127	300691	联合光电	7,082,691.40	38.95

128	000902	新洋丰	7,079,707.00	38.93
129	000917	电广传媒	7,078,922.00	38.93
130	688100	威胜信息	7,059,408.53	38.82
131	600096	云天化	7,047,290.00	38.75
132	688037	芯源微	6,973,243.69	38.35
133	300677	英科医疗	6,936,754.00	38.14
134	688007	光峰科技	6,927,888.17	38.10
135	600030	中信证券	6,908,450.00	37.99
136	300590	移为通信	6,873,047.31	37.79
137	603129	春风动力	6,869,725.32	37.78
138	300373	扬杰科技	6,787,604.00	37.32
139	601985	中国核电	6,783,740.00	37.30
140	000938	紫光股份	6,767,196.96	37.21
141	000025	特力 A	6,697,592.90	36.83
142	601898	中煤能源	6,616,570.00	36.38
143	300623	捷捷微电	6,602,963.50	36.31
144	300224	正海磁材	6,600,403.00	36.30
145	600308	华泰股份	6,530,306.00	35.91
146	300101	振芯科技	6,517,391.00	35.84
147	601677	明泰铝业	6,460,282.57	35.52
148	000923	河钢资源	6,459,295.00	35.52
149	300613	富瀚微	6,456,914.53	35.51
150	300349	金卡智能	6,413,377.68	35.27
151	002245	蔚蓝锂芯	6,400,176.00	35.19
152	300311	任子行	6,385,855.00	35.12
153	300662	科锐国际	6,342,861.00	34.88
154	000913	钱江摩托	6,324,254.00	34.78
155	600919	江苏银行	6,320,629.00	34.76

156	000875	吉电股份	6,312,684.55	34.71
157	600986	浙文互联	6,293,812.00	34.61
158	300346	南大光电	6,256,382.84	34.40
159	601058	赛轮轮胎	6,251,134.19	34.37
160	002859	洁美科技	6,209,054.00	34.14
161	600850	电科数字	6,116,491.60	33.63
162	000403	派林生物	6,094,827.00	33.52
163	300319	麦捷科技	6,080,201.80	33.43
164	300276	三丰智能	6,004,716.00	33.02
165	300055	万邦达	5,975,377.00	32.86
166	300755	华致酒行	5,959,080.00	32.77
167	688033	天宜上佳	5,951,380.12	32.73
168	002541	鸿路钢构	5,942,616.00	32.68
169	688006	杭可科技	5,935,793.49	32.64
170	600184	光电股份	5,915,086.72	32.53
171	688520	神州细胞	5,908,422.38	32.49
172	002929	润建股份	5,881,230.00	32.34
173	300726	宏达电子	5,879,440.00	32.33
174	300740	水羊股份	5,868,016.00	32.27
175	600810	神马股份	5,864,877.00	32.25
176	601619	嘉泽新能	5,861,866.00	32.23
177	000901	航天科技	5,856,483.49	32.20
178	601515	东风股份	5,851,882.40	32.18
179	002258	利尔化学	5,832,481.00	32.07
180	600499	科达制造	5,705,141.00	31.37
181	601001	晋控煤业	5,659,945.58	31.12
182	002852	道道全	5,658,818.36	31.12
183	002240	盛新锂能	5,648,943.00	31.06

184	000666	经纬纺机	5,639,501.00	31.01
185	300604	长川科技	5,604,770.00	30.82
186	002206	海利得	5,576,057.00	30.66
187	300287	飞利信	5,571,471.00	30.64
188	000709	河钢股份	5,525,557.00	30.38
189	300184	力源信息	5,524,771.80	30.38
190	300037	新宙邦	5,516,935.00	30.34
191	002158	汉钟精机	5,498,467.00	30.24
192	601595	上海电影	5,476,158.40	30.11
193	000801	四川九洲	5,411,712.00	29.76
194	002648	卫星化学	5,381,027.20	29.59
195	688139	海尔生物	5,375,774.11	29.56
196	601011	宝泰隆	5,375,323.00	29.56
197	300861	美畅股份	5,370,243.12	29.53
198	300114	中航电测	5,302,216.00	29.16
199	688066	航天宏图	5,300,130.61	29.15
200	688106	金宏气体	5,275,546.65	29.01
201	300252	金信诺	5,256,678.80	28.91
202	600662	外服控股	5,245,166.31	28.84
203	603876	鼎胜新材	5,223,424.64	28.72
204	603489	八方股份	5,170,735.00	28.43
205	688030	山石网科	5,139,778.15	28.26
206	600456	宝钛股份	5,133,729.00	28.23
207	603185	上机数控	5,123,570.00	28.17
208	300409	道氏技术	5,116,166.20	28.13
209	000650	仁和药业	5,075,721.00	27.91
210	688023	安恒信息	5,066,071.35	27.86
211	300603	立昂技术	5,035,554.00	27.69

212	000877	天山股份	5,021,316.00	27.61
213	300661	圣邦股份	5,020,526.00	27.61
214	300010	豆神教育	5,017,658.29	27.59
215	000823	超声电子	4,942,381.00	27.18
216	002579	中京电子	4,942,057.60	27.18
217	002636	金安国纪	4,941,239.00	27.17
218	601126	四方股份	4,941,235.74	27.17
219	603906	龙蟠科技	4,914,489.00	27.02
220	002727	一心堂	4,909,670.56	27.00
221	603777	来伊份	4,865,685.00	26.76
222	002706	良信股份	4,865,421.00	26.75
223	600115	中国东航	4,856,075.00	26.70
224	300377	赢时胜	4,838,214.00	26.61
225	600223	鲁商发展	4,838,001.00	26.60
226	300476	胜宏科技	4,828,216.00	26.55
227	002178	延华智能	4,826,174.00	26.54
228	603039	泛微网络	4,813,841.40	26.47
229	000768	中航西飞	4,789,888.00	26.34
230	603713	密尔克卫	4,786,416.00	26.32
231	002043	兔宝宝	4,748,545.52	26.11
232	600618	氯碱化工	4,737,957.00	26.05
233	600694	大商股份	4,735,544.00	26.04
234	002556	辉隆股份	4,730,950.00	26.02
235	600459	贵研铂业	4,711,627.90	25.91
236	601588	北辰实业	4,699,754.00	25.84
237	300498	温氏股份	4,692,012.00	25.80
238	688390	固德威	4,688,002.66	25.78
239	300502	新易盛	4,668,678.00	25.67

240	002614	奥佳华	4,656,933.00	25.61
241	300750	宁德时代	4,646,159.00	25.55
242	000657	中钨高新	4,640,765.00	25.52
243	600873	梅花生物	4,614,922.00	25.38
244	601111	中国国航	4,599,166.00	25.29
245	603359	东珠生态	4,576,890.00	25.17
246	600116	三峡水利	4,572,313.00	25.14
247	603169	兰石重装	4,565,835.00	25.11
248	002631	德尔未来	4,538,109.00	24.95
249	300328	宜安科技	4,532,739.00	24.93
250	603225	新凤鸣	4,529,801.18	24.91
251	300083	创世纪	4,524,077.28	24.88
252	300827	上能电气	4,502,987.00	24.76
253	300298	三诺生物	4,474,979.00	24.61
254	603103	横店影视	4,472,385.00	24.59
255	600929	雪天盐业	4,451,680.00	24.48
256	688567	孚能科技	4,450,215.08	24.47
257	300672	国科微	4,438,103.00	24.40
258	000423	东阿阿胶	4,402,526.00	24.21
259	600500	中化国际	4,389,807.00	24.14
260	000966	长源电力	4,374,466.00	24.05
261	300119	瑞普生物	4,351,804.81	23.93
262	603308	应流股份	4,348,914.00	23.91
263	600884	杉杉股份	4,338,156.09	23.86
264	300723	一品红	4,336,348.40	23.85
265	000951	中国重汽	4,325,627.80	23.79
266	002539	云图控股	4,324,147.00	23.78
267	300404	博济医药	4,320,522.55	23.76

268	300666	江丰电子	4,289,550.00	23.59
269	600487	亨通光电	4,289,495.17	23.59
270	600378	昊华科技	4,286,564.60	23.57
271	000818	航锦科技	4,250,623.00	23.37
272	002911	佛燃能源	4,225,736.17	23.24
273	688568	中科星图	4,217,807.67	23.19
274	600552	凯盛科技	4,214,605.00	23.18
275	002145	中核钛白	4,209,661.94	23.15
276	603351	威尔药业	4,208,661.00	23.14
277	688518	联赢激光	4,207,406.73	23.14
278	300110	华仁药业	4,202,399.40	23.11
279	603128	华贸物流	4,185,978.40	23.02
280	002032	苏泊尔	4,180,657.50	22.99
281	601827	三峰环境	4,149,763.00	22.82
282	603986	兆易创新	4,105,860.00	22.58
283	603877	太平鸟	4,104,089.00	22.57
284	300327	中颖电子	4,099,449.11	22.54
285	603688	石英股份	4,090,212.50	22.49
286	603466	风语筑	4,081,057.10	22.44
287	002335	科华数据	4,072,480.00	22.39
288	002643	万润股份	4,070,083.00	22.38
289	002436	兴森科技	4,066,855.00	22.36
290	600389	江山股份	4,062,647.00	22.34
291	000710	贝瑞基因	4,048,021.00	22.26
292	300757	罗博特科	4,044,492.80	22.24
293	603179	新泉股份	4,018,634.58	22.10
294	600966	博汇纸业	4,005,267.00	22.02
295	600512	腾达建设	3,993,070.00	21.96

296	300829	金丹科技	3,990,098.00	21.94
297	300366	创意信息	3,983,251.07	21.90
298	600187	国中水务	3,974,509.50	21.86
299	688019	安集科技	3,972,717.09	21.85
300	002941	新疆交建	3,970,624.00	21.83
301	688278	特宝生物	3,969,579.00	21.83
302	300118	东方日升	3,953,440.00	21.74
303	600569	安阳钢铁	3,948,280.00	21.71
304	603348	文灿股份	3,940,739.00	21.67
305	603127	昭衍新药	3,933,757.80	21.63
306	002274	华昌化工	3,932,022.50	21.62
307	600685	中船防务	3,900,119.00	21.45
308	600458	时代新材	3,894,995.00	21.42
309	600577	精达股份	3,887,137.00	21.38
310	688166	博瑞医药	3,882,702.16	21.35
311	688180	君实生物	3,866,440.49	21.26
312	600581	八一钢铁	3,861,890.00	21.24
313	002675	东诚药业	3,839,840.00	21.12
314	300761	立华股份	3,815,819.00	20.98
315	600063	皖维高新	3,804,480.00	20.92
316	600885	宏发股份	3,801,641.20	20.91
317	600756	浪潮软件	3,781,047.00	20.79
318	300292	吴通控股	3,778,065.00	20.78
319	002078	太阳纸业	3,762,480.00	20.69
320	600779	水井坊	3,739,379.00	20.56
321	600169	太原重工	3,696,335.00	20.33
322	600575	淮河能源	3,686,852.50	20.27
323	300379	东方通	3,684,574.60	20.26

324	300465	高伟达	3,668,960.00	20.18
325	300653	正海生物	3,664,145.00	20.15
326	688198	佰仁医疗	3,662,395.45	20.14
327	002639	雪人股份	3,660,694.00	20.13
328	002180	纳思达	3,623,988.00	19.93
329	600426	华鲁恒升	3,612,566.00	19.87
330	002615	哈尔斯	3,602,275.50	19.81
331	300378	鼎捷软件	3,585,804.18	19.72
332	300081	恒信东方	3,566,593.00	19.61
333	300685	艾德生物	3,557,500.28	19.56
334	603619	中曼石油	3,525,210.00	19.38
335	002961	瑞达期货	3,477,804.00	19.12
336	300821	东岳硅材	3,476,985.00	19.12
337	300679	电连技术	3,458,133.75	19.02
338	600990	四创电子	3,455,396.00	19.00
339	600711	盛屯矿业	3,426,421.00	18.84
340	002777	久远银海	3,419,535.00	18.80
341	688298	东方生物	3,416,194.01	18.79
342	300223	北京君正	3,409,190.00	18.75
343	603801	志邦家居	3,405,185.36	18.72
344	300783	三只松鼠	3,404,156.00	18.72
345	002913	奥士康	3,403,393.00	18.72
346	601860	紫金银行	3,397,964.00	18.69
347	300798	锦鸡股份	3,397,412.00	18.68
348	600283	钱江水利	3,387,017.00	18.63
349	002337	赛象科技	3,377,068.57	18.57
350	300571	平治信息	3,358,423.00	18.47
351	600103	青山纸业	3,357,797.00	18.46

352	002514	宝馨科技	3,350,587.00	18.42
353	603566	普莱柯	3,301,372.00	18.15
354	605111	新洁能	3,299,178.00	18.14
355	688222	成都先导	3,278,652.03	18.03
356	000567	海德股份	3,276,367.00	18.02
357	300388	节能国祯	3,221,523.00	17.71
358	000573	粤宏远 A	3,218,669.00	17.70
359	601952	苏垦农发	3,218,575.00	17.70
360	603186	华正新材	3,217,562.64	17.69
361	600674	川投能源	3,211,678.00	17.66
362	600688	上海石化	3,207,524.00	17.64
363	688185	康希诺	3,206,392.13	17.63
364	603108	润达医疗	3,188,623.00	17.53
365	000856	冀东装备	3,165,700.00	17.41
366	600977	中国电影	3,141,329.00	17.27
367	002115	三维通信	3,106,888.00	17.08
368	002738	中矿资源	3,105,507.00	17.08
369	300188	美亚柏科	3,096,364.62	17.03
370	002891	中宠股份	3,096,310.35	17.03
371	603915	国茂股份	3,072,700.00	16.90
372	300973	立高食品	3,068,222.74	16.87
373	002657	中科金财	3,058,109.99	16.82
374	300850	新强联	3,055,518.00	16.80
375	300451	创业慧康	3,053,696.00	16.79
376	688158	优刻得	3,041,580.70	16.73
377	688268	华特气体	3,031,931.46	16.67
378	300583	赛托生物	3,031,648.00	16.67
379	600602	云赛智联	3,026,982.00	16.65

380	603997	继峰股份	2,995,433.00	16.47
381	002482	广田集团	2,994,097.00	16.46
382	002312	川发龙蟒	2,993,499.00	16.46
383	600808	马钢股份	2,992,039.00	16.45
384	002851	麦格米特	2,961,630.00	16.29
385	603733	仙鹤股份	2,959,451.00	16.27
386	002565	顺灏股份	2,944,682.00	16.19
387	605338	巴比食品	2,943,184.00	16.18
388	600621	华鑫股份	2,940,302.60	16.17
389	600497	驰宏锌锗	2,926,320.00	16.09
390	300149	睿智医药	2,924,953.00	16.08
391	002421	达实智能	2,915,880.00	16.03
392	688159	有方科技	2,902,233.97	15.96
393	601965	中国汽研	2,901,026.00	15.95
394	603659	璞泰来	2,897,905.00	15.94
395	300768	迪普科技	2,882,791.96	15.85
396	300428	立中集团	2,875,646.50	15.81
397	002017	东信和平	2,849,734.76	15.67
398	002747	埃斯顿	2,840,844.00	15.62
399	688586	江航装备	2,828,548.30	15.55
400	600612	老凤祥	2,814,080.80	15.47
401	000738	航发控制	2,811,357.00	15.46
402	603610	麒盛科技	2,804,279.55	15.42
403	002367	康力电梯	2,779,369.00	15.28
404	002182	云海金属	2,768,835.00	15.23
405	600330	天通股份	2,753,523.80	15.14
406	600708	光明地产	2,746,408.00	15.10
407	600007	中国国贸	2,727,810.00	15.00

408	300855	图南股份	2,700,960.00	14.85
409	603008	喜临门	2,699,609.00	14.85
410	002895	川恒股份	2,682,801.00	14.75
411	002266	浙富控股	2,676,680.00	14.72
412	002563	森马服饰	2,658,639.00	14.62
413	002139	拓邦股份	2,656,792.00	14.61
414	000912	泸天化	2,635,977.00	14.50
415	600740	山西焦化	2,625,102.00	14.44
416	002332	仙琚制药	2,621,876.00	14.42
417	300737	科顺股份	2,617,999.20	14.40
418	603676	卫信康	2,612,278.00	14.36
419	002409	雅克科技	2,599,779.00	14.30
420	600661	昂立教育	2,593,830.67	14.26
421	600797	浙大网新	2,587,568.00	14.23
422	601598	中国外运	2,580,964.00	14.19
423	300087	荃银高科	2,577,750.00	14.17
424	603298	杭叉集团	2,555,772.00	14.05
425	600642	申能股份	2,549,347.00	14.02
426	600619	海立股份	2,541,647.00	13.98
427	601369	陕鼓动力	2,531,112.00	13.92
428	002635	安洁科技	2,517,718.00	13.84
429	002262	恩华药业	2,515,286.17	13.83
430	000750	国海证券	2,511,224.00	13.81
431	603658	安图生物	2,510,774.90	13.81
432	000507	珠海港	2,509,286.00	13.80
433	603816	顾家家居	2,494,605.96	13.72
434	601636	旗滨集团	2,475,085.18	13.61
435	603313	梦百合	2,472,114.00	13.59

436	601918	新集能源	2,461,659.20	13.54
437	300250	初灵信息	2,436,275.00	13.40
438	601609	金田铜业	2,433,298.00	13.38
439	300559	佳发教育	2,431,482.00	13.37
440	603168	莎普爱思	2,430,019.00	13.36
441	002022	科华生物	2,424,782.00	13.33
442	688001	华兴源创	2,421,840.68	13.32
443	002585	双星新材	2,404,057.00	13.22
444	600590	泰豪科技	2,394,110.00	13.17
445	300434	金石亚药	2,383,565.00	13.11
446	603323	苏农银行	2,378,801.00	13.08
447	300438	鹏辉能源	2,361,945.00	12.99
448	603283	赛腾股份	2,353,604.00	12.94
449	600490	鹏欣资源	2,343,713.00	12.89
450	688556	高测股份	2,341,724.77	12.88
451	300068	南都电源	2,334,339.60	12.84
452	300791	仙乐健康	2,325,524.00	12.79
453	603077	和邦生物	2,307,737.00	12.69
454	300450	先导智能	2,304,498.00	12.67
455	000155	川能动力	2,303,194.00	12.67
456	300158	振东制药	2,299,804.00	12.65
457	300520	科大国创	2,291,323.00	12.60
458	002171	楚江新材	2,290,392.00	12.59
459	000544	中原环保	2,288,658.00	12.59
460	002396	星网锐捷	2,270,130.00	12.48
461	600502	安徽建工	2,265,964.00	12.46
462	002705	新宝股份	2,256,218.31	12.41
463	000550	江铃汽车	2,255,430.00	12.40

464	600742	一汽富维	2,247,563.46	12.36
465	601567	三星医疗	2,246,503.00	12.35
466	688578	艾力斯	2,243,538.47	12.34
467	603976	正川股份	2,232,294.00	12.28
468	688519	南亚新材	2,226,435.73	12.24
469	300674	宇信科技	2,216,863.82	12.19
470	603626	科森科技	2,199,919.00	12.10
471	002097	山河智能	2,196,392.00	12.08
472	600211	西藏药业	2,196,086.00	12.08
473	600391	航发科技	2,185,228.00	12.02
474	000950	重药控股	2,177,384.00	11.97
475	600496	精工钢构	2,176,069.00	11.97
476	300487	蓝晓科技	2,156,998.00	11.86
477	002946	新乳业	2,150,963.00	11.83
478	002192	融捷股份	2,148,242.00	11.81
479	603218	日月股份	2,145,537.00	11.80
480	601009	南京银行	2,128,020.00	11.70
481	300344	立方数科	2,126,899.00	11.70
482	600054	黄山旅游	2,121,395.00	11.67
483	600760	中航沈飞	2,112,389.00	11.62
484	000761	本钢板材	2,110,822.00	11.61
485	300485	赛升药业	2,102,609.15	11.56
486	603515	欧普照明	2,101,405.00	11.56
487	002537	海联金汇	2,096,770.00	11.53
488	002726	龙大美食	2,094,729.00	11.52
489	601158	重庆水务	2,078,907.00	11.43
490	601233	桐昆股份	2,078,160.00	11.43
491	002832	比音勒芬	2,069,602.00	11.38

492	002114	罗平锌电	2,061,495.00	11.34
493	603660	苏州科达	2,055,321.00	11.30
494	601231	环旭电子	2,043,162.00	11.24
495	002462	嘉事堂	2,026,550.07	11.14
496	002739	万达电影	2,026,112.00	11.14
497	002774	快意电梯	2,025,162.00	11.14
498	600325	华发股份	2,016,777.00	11.09
499	002591	恒大高新	2,005,541.00	11.03
500	002550	千红制药	2,001,692.00	11.01
501	002036	联创电子	1,990,865.00	10.95
502	603956	威派格	1,987,049.00	10.93
503	000848	承德露露	1,975,786.00	10.86
504	603596	伯特利	1,972,314.00	10.85
505	002498	汉缆股份	1,948,317.00	10.71
506	603113	金能科技	1,938,916.00	10.66
507	002651	利君股份	1,936,041.00	10.65
508	000910	大亚圣象	1,930,430.00	10.62
509	300168	万达信息	1,924,600.00	10.58
510	300699	光威复材	1,911,849.88	10.51
511	601900	南方传媒	1,892,476.69	10.41
512	002792	通宇通讯	1,890,795.00	10.40
513	002216	三全食品	1,890,527.00	10.40
514	000898	鞍钢股份	1,887,736.00	10.38
515	002476	宝莫股份	1,878,024.00	10.33
516	300803	指南针	1,864,650.00	10.25
517	603009	北特科技	1,857,874.00	10.22
518	002347	泰尔股份	1,855,531.00	10.20
519	000795	英洛华	1,849,473.00	10.17

520	300705	九典制药	1,845,578.00	10.15
521	603180	金牌厨柜	1,832,429.30	10.08
522	601311	骆驼股份	1,831,084.00	10.07
523	600963	岳阳林纸	1,827,174.00	10.05
524	603208	江山欧派	1,798,467.00	9.89
525	601818	光大银行	1,795,999.00	9.88
526	002876	三利谱	1,792,626.00	9.86
527	600428	中远海特	1,791,616.00	9.85
528	300777	中简科技	1,782,759.00	9.80
529	000789	万年青	1,768,195.00	9.72
530	003009	中天火箭	1,766,155.00	9.71
531	000677	恒天海龙	1,762,163.25	9.69
532	601519	大智慧	1,761,857.00	9.69
533	603959	百利科技	1,761,410.00	9.69
534	600664	哈药股份	1,759,710.00	9.68
535	600692	亚通股份	1,755,256.00	9.65
536	000598	兴蓉环境	1,753,791.00	9.64
537	002810	山东赫达	1,750,432.90	9.63
538	600715	文投控股	1,746,015.00	9.60
539	601101	昊华能源	1,744,490.40	9.59
540	300365	恒华科技	1,744,044.00	9.59
541	300007	汉威科技	1,742,513.00	9.58
542	300448	浩云科技	1,722,609.00	9.47
543	300240	飞力达	1,719,890.00	9.46
544	600622	光大嘉宝	1,717,043.00	9.44
545	002773	康弘药业	1,716,203.00	9.44
546	300288	朗玛信息	1,714,569.00	9.43
547	002840	华统股份	1,711,920.80	9.41

548	603595	东尼电子	1,709,096.00	9.40
549	688277	天智航	1,698,105.64	9.34
550	600635	大众公用	1,697,625.00	9.34
551	600105	永鼎股份	1,694,607.00	9.32
552	300785	值得买	1,691,413.64	9.30
553	601882	海天精工	1,682,188.00	9.25
554	600285	羚锐制药	1,674,307.00	9.21
555	603520	司太立	1,670,875.00	9.19
556	300527	中船应急	1,666,150.00	9.16
557	000921	海信家电	1,655,358.00	9.10
558	300170	汉得信息	1,652,640.00	9.09
559	600676	交运股份	1,649,758.00	9.07
560	300900	广联航空	1,643,718.00	9.04
561	600185	格力地产	1,633,584.00	8.98
562	603027	千禾味业	1,629,580.00	8.96
563	603606	东方电缆	1,627,892.00	8.95
564	002293	罗莱生活	1,579,687.10	8.69
565	002611	东方精工	1,573,734.00	8.65
566	002378	章源钨业	1,567,698.00	8.62
567	002034	旺能环境	1,561,097.00	8.58
568	002722	金轮股份	1,554,560.00	8.55
569	300394	天孚通信	1,554,150.00	8.55
570	603363	傲农生物	1,550,560.00	8.53
571	002812	恩捷股份	1,550,442.00	8.53
572	603565	中谷物流	1,541,223.00	8.48
573	600710	苏美达	1,540,595.00	8.47
574	000830	鲁西化工	1,537,906.00	8.46
575	300122	智飞生物	1,536,582.00	8.45

576	603889	新澳股份	1,536,098.00	8.45
577	000851	高鸿股份	1,534,960.50	8.44
578	300266	兴源环境	1,534,369.00	8.44
579	002531	天顺风能	1,531,660.00	8.42
580	002314	南山控股	1,527,851.00	8.40
581	688017	绿的谐波	1,526,986.68	8.40
582	300398	飞凯材料	1,526,444.24	8.39
583	000011	深物业 A	1,525,885.00	8.39
584	600812	华北制药	1,523,178.00	8.38
585	300657	弘信电子	1,519,466.00	8.36
586	300655	晶瑞电材	1,479,142.00	8.13
587	000881	中广核技	1,472,189.14	8.10
588	300230	永利股份	1,470,323.00	8.09
589	600549	厦门钨业	1,469,554.00	8.08
590	002003	伟星股份	1,466,296.00	8.06
591	603897	长城科技	1,462,154.46	8.04
592	603105	芯能科技	1,454,298.00	8.00
593	300369	绿盟科技	1,451,594.00	7.98
594	603738	泰晶科技	1,446,258.08	7.95
595	300429	强力新材	1,441,130.00	7.92
596	600372	中航电子	1,438,454.00	7.91
597	002361	神剑股份	1,438,214.00	7.91
598	002344	海宁皮城	1,431,241.00	7.87
599	603912	佳力图	1,429,722.00	7.86
600	600162	香江控股	1,415,612.00	7.78
601	600338	西藏珠峰	1,415,294.00	7.78
602	002410	广联达	1,410,774.00	7.76
603	300091	金通灵	1,401,249.26	7.71

604	603919	金徽酒	1,397,791.00	7.69
605	300097	智云股份	1,393,415.00	7.66
606	300102	乾照光电	1,385,974.00	7.62
607	603603	博天环境	1,385,941.00	7.62
608	300002	神州泰岳	1,382,319.00	7.60
609	002161	远望谷	1,376,873.00	7.57
610	603598	引力传媒	1,373,123.00	7.55
611	600548	深高速	1,373,099.00	7.55
612	603099	长白山	1,370,622.00	7.54
613	000863	三湘印象	1,359,678.00	7.48
614	600480	凌云股份	1,346,050.96	7.40
615	002151	北斗星通	1,345,068.00	7.40
616	603429	集友股份	1,341,577.00	7.38
617	300810	中科海讯	1,333,115.00	7.33
618	002037	保利联合	1,332,675.00	7.33
619	603060	国检集团	1,328,370.80	7.30
620	300525	博思软件	1,326,116.00	7.29
621	000034	神州数码	1,323,966.00	7.28
622	603602	纵横通信	1,317,732.42	7.25
623	000887	中鼎股份	1,312,747.00	7.22
624	002601	龙佰集团	1,305,460.00	7.18
625	600420	国药现代	1,299,580.00	7.15
626	603686	龙马环卫	1,297,253.00	7.13
627	300738	奥飞数据	1,297,113.00	7.13
628	600114	东睦股份	1,288,806.00	7.09
629	300888	稳健医疗	1,283,247.00	7.06
630	603773	沃格光电	1,282,565.00	7.05
631	002641	永高股份	1,279,356.00	7.04

632	601375	中原证券	1,255,428.00	6.90
633	603118	共进股份	1,254,841.00	6.90
634	601699	潞安环能	1,253,012.00	6.89
635	600012	皖通高速	1,246,913.00	6.86
636	603587	地素时尚	1,239,069.20	6.81
637	002458	益生股份	1,238,290.00	6.81
638	300124	汇川技术	1,228,781.00	6.76
639	601789	宁波建工	1,220,369.00	6.71
640	300208	青岛中程	1,200,242.00	6.60
641	002494	华斯股份	1,199,258.00	6.59
642	688313	仕佳光子	1,196,744.72	6.58
643	000039	中集集团	1,196,497.00	6.58
644	600696	岩石股份	1,195,565.00	6.57
645	600132	重庆啤酒	1,194,969.00	6.57
646	300166	东方国信	1,190,476.00	6.55
647	603693	江苏新能	1,188,847.00	6.54
648	300385	雪浪环境	1,188,346.00	6.53
649	300474	景嘉微	1,183,425.00	6.51
650	600761	安徽合力	1,183,016.00	6.51
651	600874	创业环保	1,182,817.00	6.50
652	300767	震安科技	1,182,118.40	6.50
653	002231	奥维通信	1,181,886.00	6.50
654	600641	万业企业	1,181,875.00	6.50
655	300322	硕贝德	1,180,961.00	6.49
656	002843	泰嘉股份	1,176,635.00	6.47
657	600277	亿利洁能	1,175,916.30	6.47
658	300773	拉卡拉	1,172,550.00	6.45
659	688099	晶晨股份	1,164,478.01	6.40

660	000553	安道麦 A	1,155,282.00	6.35
661	002126	银轮股份	1,151,645.00	6.33
662	688077	大地熊	1,149,149.62	6.32
663	300910	瑞丰新材	1,147,060.00	6.31
664	600507	方大特钢	1,142,397.00	6.28
665	000949	新乡化纤	1,138,255.00	6.26
666	000059	华锦股份	1,135,155.00	6.24
667	688526	科前生物	1,134,372.23	6.24
668	300332	天壕环境	1,123,219.00	6.18
669	002285	世联行	1,123,073.00	6.18
670	600151	航天机电	1,122,798.00	6.17
671	000852	石化机械	1,118,764.40	6.15
672	603728	鸣志电器	1,116,966.46	6.14
673	600855	航天长峰	1,115,364.00	6.13
674	002277	友阿股份	1,113,447.00	6.12
675	002049	紫光国微	1,110,876.00	6.11
676	688235	百济神州	1,110,339.00	6.11
677	002461	珠江啤酒	1,109,578.00	6.10
678	600035	楚天高速	1,088,927.00	5.99
679	300709	精研科技	1,088,831.00	5.99
680	000555	神州信息	1,088,508.00	5.99
681	300506	名家汇	1,087,128.30	5.98
682	300132	青松股份	1,083,318.00	5.96
683	002183	怡亚通	1,083,058.00	5.96
684	603013	亚普股份	1,080,793.00	5.94
685	603551	奥普家居	1,072,869.26	5.90
686	002664	长鹰信质	1,063,820.00	5.85
687	300627	华测导航	1,062,118.00	5.84

688	002026	山东威达	1,059,019.28	5.82
689	600933	爱柯迪	1,053,260.00	5.79
690	000717	韶钢松山	1,052,581.00	5.79
691	300009	安科生物	1,048,948.00	5.77
692	002691	冀凯股份	1,046,709.00	5.76
693	002609	捷顺科技	1,045,375.00	5.75
694	002906	华阳集团	1,045,158.00	5.75
695	002737	葵花药业	1,041,009.00	5.72
696	002905	金逸影视	1,037,268.00	5.70
697	300263	隆华科技	1,033,472.00	5.68
698	002141	贤丰控股	1,032,034.00	5.68
699	002768	国恩股份	1,025,641.00	5.64
700	000990	诚志股份	1,020,647.00	5.61
701	603328	依顿电子	1,017,327.00	5.59
702	300732	设研院	1,016,333.80	5.59
703	300348	长亮科技	1,013,642.00	5.57
704	000811	冰轮环境	1,010,866.00	5.56
705	600843	上工申贝	1,010,399.00	5.56
706	002234	民和股份	1,006,809.00	5.54
707	600997	开滦股份	1,002,943.00	5.52
708	300616	尚品宅配	997,575.68	5.49
709	002847	盐津铺子	996,937.00	5.48
710	002191	劲嘉股份	996,196.00	5.48
711	300432	富临精工	995,921.00	5.48
712	600587	新华医疗	993,063.00	5.46
713	300579	数字认证	992,943.00	5.46
714	002382	蓝帆医疗	991,146.00	5.45
715	300820	英杰电气	990,780.00	5.45

716	002713	东易日盛	985,327.20	5.42
717	002662	京威股份	978,250.00	5.38
718	300047	天源迪科	977,995.00	5.38
719	603256	宏和科技	972,244.00	5.35
720	600728	佳都科技	970,494.00	5.34
721	300353	东土科技	968,896.00	5.33
722	002218	拓日新能	967,739.00	5.32
723	300456	赛微电子	967,719.00	5.32
724	300702	天宇股份	952,847.00	5.24
725	300121	阳谷华泰	952,734.00	5.24
726	601872	招商轮船	952,720.00	5.24
727	002544	杰赛科技	952,566.00	5.24
728	300721	怡达股份	944,925.00	5.20
729	603833	欧派家居	944,682.00	5.19
730	300196	长海股份	941,540.60	5.18
731	002821	凯莱英	940,333.00	5.17
732	002870	香山股份	939,692.00	5.17
733	688408	中信博	934,870.93	5.14
734	600248	陕西建工	930,649.00	5.12
735	603938	三孚股份	927,061.00	5.10
736	600111	北方稀土	926,825.00	5.10
737	601689	拓普集团	919,292.00	5.06
738	688301	奕瑞科技	918,020.57	5.05
739	600252	中恒集团	916,241.00	5.04
740	002330	得利斯	915,296.00	5.03
741	000049	德赛电池	912,263.00	5.02
742	603053	成都燃气	909,023.00	5.00
743	600775	南京熊猫	905,931.00	4.98

744	603421	鼎信通讯	905,566.97	4.98
745	603018	华设集团	904,233.00	4.97
746	300143	盈康生命	901,860.00	4.96
747	002318	久立特材	901,269.00	4.96
748	300872	天阳科技	900,060.98	4.95
749	002320	海峡股份	898,575.00	4.94
750	002881	美格智能	896,088.00	4.93
751	300401	花园生物	896,064.00	4.93
752	603730	岱美股份	893,687.36	4.91
753	300472	新元科技	892,738.00	4.91
754	000900	现代投资	891,345.00	4.90
755	603220	中贝通信	889,630.00	4.89
756	601908	京运通	882,991.00	4.86
757	601886	江河集团	877,483.00	4.83
758	002543	万和电气	875,007.08	4.81
759	600230	沧州大化	872,835.00	4.80
760	002805	丰元股份	868,591.00	4.78
761	603187	海容冷链	868,375.00	4.78
762	002405	四维图新	860,973.00	4.73
763	600258	首旅酒店	859,402.00	4.73
764	300650	太龙股份	854,682.00	4.70
765	688521	芯原股份	852,350.07	4.69
766	002061	浙江交科	849,035.00	4.67
767	002765	蓝黛科技	848,566.00	4.67
768	000615	奥园美谷	848,000.00	4.66
769	300222	科大智能	838,836.00	4.61
770	603638	艾迪精密	837,297.80	4.60
771	300439	美康生物	835,971.00	4.60

772	000723	美锦能源	835,581.00	4.59
773	603081	大丰实业	832,082.00	4.58
774	603025	大豪科技	831,042.00	4.57
775	603667	五洲新春	829,394.00	4.56
776	300670	大烨智能	829,167.00	4.56
777	300181	佐力药业	824,090.00	4.53
778	300788	中信出版	823,758.00	4.53
779	002371	北方华创	823,605.00	4.53
780	603360	百傲化学	823,561.61	4.53
781	601163	三角轮胎	823,036.58	4.53
782	600971	恒源煤电	821,516.00	4.52
783	300045	华力创通	819,147.00	4.50
784	002013	中航机电	817,444.00	4.50
785	600531	豫光金铅	814,048.00	4.48
786	603301	振德医疗	813,664.00	4.47
787	002733	雄韬股份	813,231.00	4.47
788	688550	瑞联新材	811,509.97	4.46
789	002267	陕天然气	804,656.00	4.42
790	002055	得润电子	803,435.00	4.42
791	300326	凯利泰	802,601.00	4.41
792	600075	新疆天业	801,907.00	4.41
793	300687	赛意信息	801,649.00	4.41
794	002239	奥特佳	801,348.00	4.41
795	002930	宏川智慧	800,759.98	4.40
796	300523	辰安科技	800,324.00	4.40
797	002759	天际股份	791,066.00	4.35
798	000783	长江证券	785,603.00	4.32
799	600150	中国船舶	785,007.00	4.32

800	002137	实益达	784,603.00	4.31
801	605117	德业股份	777,518.98	4.28
802	000976	华铁股份	769,766.00	4.23
803	600180	瑞茂通	769,161.00	4.23
804	600746	江苏索普	768,706.00	4.23
805	002522	浙江众成	764,823.00	4.21
806	002368	太极股份	760,982.00	4.18
807	603868	飞科电器	759,471.00	4.18
808	300473	德尔股份	754,052.00	4.15
809	002251	步步高	753,674.00	4.14
810	300618	寒锐钴业	752,602.00	4.14
811	600967	内蒙一机	751,432.00	4.13
812	002416	爱施德	745,886.00	4.10
813	000546	金圆股份	742,119.00	4.08
814	002745	木林森	740,749.00	4.07
815	688536	思瑞浦	738,566.10	4.06
816	603486	科沃斯	733,448.40	4.03
817	002298	中电兴发	732,420.00	4.03
818	002284	亚太股份	728,533.00	4.01
819	300510	金冠股份	712,017.28	3.92
820	000796	凯撒旅业	711,785.00	3.91
821	688300	联瑞新材	711,116.35	3.91
822	600876	洛阳玻璃	706,609.00	3.89
823	002955	鸿合科技	704,852.60	3.88
824	300759	康龙化成	703,013.00	3.87
825	600133	东湖高新	698,818.00	3.84
826	300562	乐心医疗	697,814.00	3.84
827	000968	蓝焰控股	696,277.00	3.83

828	300151	昌红科技	692,069.00	3.81
829	600197	伊力特	691,885.00	3.80
830	600172	黄河旋风	688,011.00	3.78
831	300833	浩洋股份	686,328.00	3.77
832	002106	莱宝高科	685,867.00	3.77
833	600623	华谊集团	685,548.00	3.77
834	002603	以岭药业	682,755.00	3.75
835	000603	盛达资源	680,842.00	3.74
836	601222	林洋能源	679,309.00	3.74
837	600439	瑞贝卡	678,889.00	3.73
838	300776	帝尔激光	677,479.00	3.73
839	000680	山推股份	677,422.00	3.73
840	603501	韦尔股份	673,962.00	3.71
841	000989	九芝堂	669,235.37	3.68
842	300307	慈星股份	666,780.00	3.67
843	300621	维业股份	663,325.00	3.65
844	600988	赤峰黄金	660,094.00	3.63
845	603477	巨星农牧	659,435.00	3.63
846	688288	鸿泉物联	658,166.35	3.62
847	000683	远兴能源	655,520.00	3.60
848	300131	英唐智控	652,468.00	3.59
849	600645	中源协和	651,658.00	3.58
850	300673	佩蒂股份	651,602.00	3.58
851	601015	陕西黑猫	650,571.00	3.58
852	000959	首钢股份	649,865.00	3.57
853	002960	青鸟消防	648,544.00	3.57
854	600970	中材国际	648,419.00	3.57
855	000685	中山公用	648,385.00	3.57

856	603416	信捷电气	645,667.00	3.55
857	603600	永艺股份	645,649.00	3.55
858	300177	中海达	644,913.00	3.55
859	603156	养元饮品	642,699.00	3.53
860	000560	我爱我家	640,805.00	3.52
861	688516	奥特维	638,821.50	3.51
862	300180	华峰超纤	638,493.00	3.51
863	002108	沧州明珠	634,619.40	3.49
864	300548	博创科技	633,939.00	3.49
865	300017	网宿科技	628,230.00	3.45
866	002261	拓维信息	626,965.00	3.45
867	002940	昂利康	623,927.00	3.43
868	600018	上港集团	623,633.00	3.43
869	002056	横店东磁	622,725.00	3.42
870	688168	安博通	621,530.47	3.42
871	600072	中船科技	620,120.00	3.41
872	688596	正帆科技	619,797.00	3.41
873	300339	润和软件	619,340.00	3.41
874	002283	天润工业	617,369.00	3.39
875	603896	寿仙谷	612,179.91	3.37
876	002860	星帅尔	608,781.00	3.35
877	002484	江海股份	604,162.00	3.32
878	300358	楚天科技	602,941.00	3.32
879	601881	中国银河	602,569.00	3.31
880	002024	苏宁易购	598,880.00	3.29
881	688617	惠泰医疗	598,769.52	3.29
882	002977	火箭科技	597,495.00	3.29
883	300852	四会富仕	594,496.00	3.27

884	600741	华域汽车	593,249.00	3.26
885	600067	冠城大通	590,958.00	3.25
886	002104	恒宝股份	590,235.46	3.25
887	002419	天虹股份	587,698.00	3.23
888	002967	广电计量	583,248.00	3.21
889	600586	金晶科技	583,064.00	3.21
890	002978	安宁股份	576,998.00	3.17
891	300602	飞荣达	574,606.00	3.16
892	002528	英飞拓	569,433.00	3.13
893	300857	协创数据	568,054.00	3.12
894	300531	优博讯	565,627.00	3.11
895	600481	双良节能	565,023.00	3.11
896	601127	小康股份	559,231.00	3.08
897	300596	利安隆	559,091.00	3.07
898	000692	惠天热电	546,828.00	3.01
899	603068	博通集成	545,847.00	3.00
900	000937	冀中能源	544,506.00	2.99
901	002649	博彦科技	544,004.00	2.99
902	603799	华友钴业	542,560.00	2.98
903	000623	吉林敖东	542,456.00	2.98
904	603825	华扬联众	540,064.00	2.97
905	000045	深纺织 A	538,248.00	2.96
906	300415	伊之密	535,999.00	2.95
907	002559	亚威股份	535,438.00	2.94
908	688561	奇安信	534,770.69	2.94
909	600877	声光电科	532,089.00	2.93
910	603238	诺邦股份	528,951.00	2.91
911	600851	海欣股份	526,670.00	2.90

912	002677	浙江美大	525,310.00	2.89
913	603787	新日股份	525,012.67	2.89
914	002638	勤上股份	524,556.00	2.88
915	300842	帝科股份	522,457.00	2.87
916	300871	回盛生物	521,541.00	2.87
917	300499	高澜股份	520,900.00	2.86
918	002315	焦点科技	520,357.00	2.86
919	002068	黑猫股份	518,849.00	2.85
920	601866	中远海发	518,576.00	2.85
921	000019	深粮控股	516,756.00	2.84
922	300061	旗天科技	516,736.00	2.84
923	300493	润欣科技	512,236.00	2.82
924	603217	元利科技	510,925.80	2.81
925	600478	科力远	508,926.00	2.80
926	600546	山煤国际	508,284.00	2.80
927	300117	嘉寓股份	503,243.00	2.77
928	600381	青海春天	502,825.00	2.77
929	300020	银江技术	502,449.00	2.76
930	300219	鸿利智汇	501,195.00	2.76
931	600545	卓郎智能	501,158.00	2.76
932	300424	航新科技	500,117.00	2.75
933	600678	四川金顶	498,997.00	2.74
934	002962	五方光电	492,296.00	2.71
935	002441	众业达	482,248.00	2.65
936	000606	ST 顺利	480,711.00	2.64
937	002903	宇环数控	477,262.00	2.62
938	603517	绝味食品	476,652.00	2.62
939	002560	通达股份	475,268.00	2.61

940	000859	国风塑业	474,539.00	2.61
941	300572	安车检测	472,630.00	2.60
942	605222	起帆电缆	472,163.00	2.60
943	000510	新金路	471,819.00	2.59
944	688399	硕世生物	470,394.20	2.59
945	002637	赞宇科技	469,680.00	2.58
946	002837	英维克	468,390.00	2.58
947	002202	金风科技	467,340.00	2.57
948	300846	首都在线	465,885.00	2.56
949	002051	中工国际	463,969.00	2.55
950	601005	重庆钢铁	463,246.00	2.55
951	002761	浙江建投	459,527.00	2.53
952	300217	东方电热	459,459.00	2.53
953	000731	四川美丰	459,186.00	2.53
954	002351	漫步者	458,672.00	2.52
955	600903	贵州燃气	457,778.00	2.52
956	300078	思创医惠	457,458.00	2.52
957	688357	建龙微纳	457,418.44	2.52
958	000012	南玻 A	456,981.00	2.51
959	002743	富煌钢构	456,363.00	2.51
960	688339	亿华通	455,283.83	2.50
961	002117	东港股份	454,306.00	2.50
962	688111	金山办公	452,817.36	2.49
963	300316	晶盛机电	451,449.00	2.48
964	300529	健帆生物	451,396.00	2.48
965	000969	安泰科技	447,172.00	2.46
966	002287	奇正藏药	446,370.00	2.45
967	002176	江特电机	446,040.00	2.45

968	688026	洁特生物	444,904.44	2.45
969	002682	龙洲股份	443,539.00	2.44
970	300318	博晖创新	440,186.00	2.42
971	603329	上海雅仕	437,449.00	2.41
972	300727	润禾材料	433,735.00	2.39
973	603229	奥翔药业	433,668.00	2.38
974	300079	数码视讯	433,464.00	2.38
975	603533	掌阅科技	430,453.00	2.37
976	300299	富春股份	427,531.00	2.35
977	600841	上柴股份	424,977.00	2.34
978	000762	西藏矿业	422,866.00	2.33
979	603228	景旺电子	418,152.00	2.30
980	000030	富奥股份	417,138.00	2.29
981	000519	中兵红箭	416,041.00	2.29
982	300024	机器人	413,290.00	2.27
983	002621	美吉姆	412,689.25	2.27
984	600550	保变电气	410,739.00	2.26
985	000068	华控赛格	410,074.00	2.25
986	688155	先惠技术	407,592.76	2.24
987	002035	华帝股份	407,169.00	2.24
988	603083	剑桥科技	406,912.00	2.24
989	300617	安靠智电	403,790.00	2.22
990	600282	南钢股份	402,167.00	2.21
991	002425	凯撒文化	402,080.00	2.21
992	000026	飞亚达	401,558.00	2.21
993	000659	珠海中富	397,384.00	2.19
994	300718	长盛轴承	397,202.00	2.18
995	603708	家家悦	392,906.00	2.16

996	603690	至纯科技	392,035.00	2.16
997	603990	麦迪科技	390,851.00	2.15
998	603258	电魂网络	390,445.00	2.15
999	002023	海特高新	388,187.00	2.13
1,000	002907	华森制药	387,490.00	2.13
1,001	300207	欣旺达	386,972.00	2.13
1,002	603855	华荣股份	386,005.00	2.12
1,003	603355	莱克电气	385,720.00	2.12
1,004	002125	湘潭电化	384,032.00	2.11
1,005	000833	粤桂股份	379,892.00	2.09
1,006	688068	热景生物	378,035.05	2.08
1,007	000920	沃顿科技	377,344.00	2.07
1,008	300280	紫天科技	377,021.00	2.07
1,009	300825	阿尔特	376,675.00	2.07
1,010	300663	科蓝软件	376,266.00	2.07
1,011	603197	保隆科技	375,158.00	2.06
1,012	002645	华宏科技	373,373.00	2.05
1,013	003006	百亚股份	371,800.00	2.04
1,014	603010	万盛股份	370,736.00	2.04
1,015	300495	*ST 美尚	369,278.00	2.03
1,016	600256	广汇能源	367,593.00	2.02
1,017	300514	友讯达	365,853.00	2.01
1,018	300841	康华生物	365,454.00	2.01
1,019	600831	广电网络	364,386.00	2.00

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

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000733	振华科技	17,255,410.04	94.89
2	300725	药石科技	15,492,839.60	85.19
3	603267	鸿远电子	15,357,919.54	84.45
4	300363	博腾股份	14,872,838.06	81.78
5	603345	安井食品	14,495,622.73	79.71
6	300073	当升科技	14,229,875.00	78.25
7	603456	九洲药业	13,651,212.81	75.07
8	300724	捷佳伟创	13,551,808.00	74.52
9	002850	科达利	13,385,063.50	73.60
10	603026	石大胜华	13,355,755.00	73.44
11	002011	盾安环境	13,203,904.00	72.61
12	002497	雅化集团	13,099,514.00	72.03
13	000933	神火股份	12,897,589.00	70.92
14	603678	火炬电子	12,769,360.40	70.22
15	002254	泰和新材	12,037,028.54	66.19
16	603305	旭升股份	11,624,863.00	63.92
17	002568	百润股份	11,608,360.00	63.83
18	603337	杰克股份	11,498,734.60	63.23
19	002313	日海智能	11,329,854.12	62.30
20	300012	华测检测	11,178,909.78	61.47
21	300751	迈为股份	11,072,195.00	60.89
22	688116	天奈科技	10,952,936.93	60.23
23	601678	滨化股份	10,690,892.76	58.79
24	600123	兰花科创	10,556,167.00	58.05

25	300496	中科创达	10,342,545.09	56.87
26	300390	天华超净	10,014,029.00	55.07
27	600869	远东股份	10,011,304.00	55.05
28	600323	瀚蓝环境	9,895,736.00	54.42
29	601958	金钼股份	9,813,543.00	53.96
30	002041	登海种业	9,763,947.00	53.69
31	002920	德赛西威	9,749,398.58	53.61
32	600596	新安股份	9,563,788.56	52.59
33	002276	万马股份	9,521,794.00	52.36
34	603612	索通发展	9,517,232.00	52.33
35	002573	清新环境	9,470,801.00	52.08
36	300034	钢研高纳	9,352,015.00	51.43
37	688188	柏楚电子	9,350,673.09	51.42
38	601600	中国铝业	8,998,953.00	49.48
39	300458	全志科技	8,990,479.00	49.44
40	300395	菲利华	8,895,369.00	48.92
41	688200	华峰测控	8,746,548.08	48.10
42	601330	绿色动力	8,640,533.00	47.51
43	600108	亚盛集团	8,633,188.00	47.47
44	300769	德方纳米	8,627,646.00	47.44
45	300406	九强生物	8,582,788.00	47.20
46	002756	永兴材料	8,570,324.00	47.13
47	688016	心脉医疗	8,518,214.49	46.84
48	000035	中国天楹	8,491,461.60	46.69
49	300477	合纵科技	8,465,414.00	46.55
50	002129	中环股份	8,354,553.00	45.94
51	300130	新国都	8,236,549.52	45.29
52	300639	凯普生物	8,225,928.36	45.23

53	603236	移远通信	8,179,558.10	44.98
54	688368	晶丰明源	8,136,941.77	44.74
55	600096	云天化	8,125,242.00	44.68
56	300763	锦浪科技	8,056,086.42	44.30
57	002326	永太科技	8,041,224.00	44.22
58	688018	乐鑫科技	7,925,891.64	43.58
59	300638	广和通	7,867,473.38	43.26
60	300775	三角防务	7,852,269.39	43.18
61	688388	嘉元科技	7,839,960.79	43.11
62	688005	容百科技	7,817,074.57	42.99
63	300894	火星人	7,783,811.91	42.80
64	300145	中金环境	7,737,445.00	42.55
65	002402	和而泰	7,733,206.00	42.52
66	002215	诺普信	7,719,707.12	42.45
67	002025	航天电器	7,713,291.00	42.41
68	300171	东富龙	7,678,443.45	42.22
69	603588	高能环境	7,675,182.75	42.21
70	000516	国际医学	7,659,549.50	42.12
71	002430	杭氧股份	7,642,409.00	42.03
72	300691	联合光电	7,621,819.00	41.91
73	002918	蒙娜丽莎	7,614,370.72	41.87
74	000799	酒鬼酒	7,572,756.82	41.64
75	002042	华孚时尚	7,549,202.00	41.51
76	600129	太极集团	7,530,793.00	41.41
77	600057	厦门象屿	7,524,997.48	41.38
78	600882	妙可蓝多	7,521,705.56	41.36
79	000918	嘉凯城	7,478,822.00	41.13
80	300215	电科院	7,397,404.77	40.68

81	002833	弘亚数控	7,395,285.84	40.67
82	300373	扬杰科技	7,329,585.20	40.30
83	688366	昊海生科	7,256,745.57	39.90
84	603613	国联股份	7,186,676.71	39.52
85	601985	中国核电	7,156,795.00	39.35
86	600030	中信证券	7,147,659.50	39.30
87	002245	蔚蓝锂芯	7,105,096.00	39.07
88	300747	锐科激光	7,080,705.00	38.94
89	002178	延华智能	7,049,818.00	38.77
90	688389	普门科技	7,038,810.03	38.71
91	002545	东方铁塔	7,033,524.00	38.68
92	002135	东南网架	7,016,570.00	38.58
93	000902	新洋丰	6,925,279.45	38.08
94	603169	兰石重装	6,900,453.36	37.95
95	300441	鲍斯股份	6,893,469.35	37.91
96	601677	明泰铝业	6,885,072.81	37.86
97	300276	三丰智能	6,849,550.00	37.67
98	002204	大连重工	6,839,409.00	37.61
99	300319	麦捷科技	6,761,004.20	37.18
100	603508	思维列控	6,754,566.92	37.14
101	000025	特力 A	6,752,060.65	37.13
102	603129	春风动力	6,708,495.80	36.89
103	300696	爱乐达	6,688,294.90	36.78
104	002929	润建股份	6,643,755.00	36.53
105	300633	开立医疗	6,634,546.00	36.48
106	601058	赛轮轮胎	6,572,007.29	36.14
107	300623	捷捷微电	6,570,929.50	36.13
108	600850	电科数字	6,567,802.00	36.12

109	300748	金力永磁	6,565,959.96	36.11
110	002407	多氟多	6,530,108.00	35.91
111	000875	吉电股份	6,513,755.90	35.82
112	600499	科达制造	6,484,198.00	35.66
113	300054	鼎龙股份	6,441,818.00	35.42
114	000901	航天科技	6,374,899.22	35.06
115	002859	洁美科技	6,362,670.00	34.99
116	600184	光电股份	6,356,501.12	34.95
117	601898	中煤能源	6,327,732.00	34.80
118	000923	河钢资源	6,316,423.00	34.73
119	688177	百奥泰	6,290,495.31	34.59
120	688007	光峰科技	6,282,855.00	34.55
121	002240	盛新锂能	6,250,260.00	34.37
122	600618	氯碱化工	6,244,147.36	34.34
123	300662	科锐国际	6,178,032.00	33.97
124	300349	金卡智能	6,154,108.44	33.84
125	600986	浙文互联	6,127,499.00	33.69
126	300726	宏达电子	6,116,375.50	33.63
127	600308	华泰股份	6,109,223.00	33.59
128	300184	力源信息	6,032,529.80	33.17
129	688202	美迪西	6,026,850.87	33.14
130	002541	鸿路钢构	6,021,869.03	33.11
131	002206	海利得	5,991,101.50	32.94
132	688006	杭可科技	5,901,045.75	32.45
133	300287	飞利信	5,887,449.00	32.37
134	300101	振芯科技	5,882,483.00	32.35
135	300740	水羊股份	5,854,463.65	32.19
136	300604	长川科技	5,817,800.00	31.99

137	300224	正海磁材	5,814,613.00	31.97
138	300755	华致酒行	5,809,700.69	31.95
139	601515	东风股份	5,803,142.60	31.91
140	300568	星源材质	5,701,312.60	31.35
141	000666	经纬纺机	5,681,839.00	31.24
142	688100	威胜信息	5,587,339.87	30.72
143	300294	博雅生物	5,554,338.00	30.54
144	300114	中航电测	5,549,354.00	30.52
145	600810	神马股份	5,531,586.00	30.42
146	002648	卫星化学	5,502,019.00	30.26
147	002852	道道全	5,498,195.48	30.23
148	002727	一心堂	5,473,692.66	30.10
149	300037	新宙邦	5,407,539.00	29.74
150	603876	鼎胜新材	5,354,275.00	29.44
151	601595	上海电影	5,309,216.40	29.20
152	300081	恒信东方	5,302,765.00	29.16
153	603489	八方股份	5,264,044.00	28.95
154	300677	英科医疗	5,229,357.12	28.76
155	600559	老白干酒	5,214,593.00	28.67
156	300476	胜宏科技	5,175,933.00	28.46
157	300377	赢时胜	5,172,048.00	28.44
158	300470	中密控股	5,111,353.00	28.11
159	601001	晋控煤业	5,108,258.32	28.09
160	000650	仁和药业	5,098,019.00	28.03
161	600115	中国东航	5,092,345.00	28.00
162	300603	立昂技术	5,069,167.49	27.88
163	600569	安阳钢铁	5,044,827.64	27.74
164	000498	山东路桥	5,038,755.20	27.71

165	002258	利尔化学	5,026,661.83	27.64
166	603599	广信股份	5,024,392.00	27.63
167	002636	金安国纪	5,019,369.00	27.60
168	300750	宁德时代	4,966,459.00	27.31
169	601666	平煤股份	4,939,978.38	27.16
170	000801	四川九洲	4,935,039.00	27.14
171	603359	东珠生态	4,905,931.40	26.98
172	603299	苏盐井神	4,898,423.00	26.94
173	300661	圣邦股份	4,872,882.51	26.80
174	002614	奥佳华	4,849,478.00	26.67
175	603777	来伊份	4,830,014.60	26.56
176	603039	泛微网络	4,781,403.60	26.29
177	603348	文灿股份	4,747,138.00	26.10
178	002556	辉隆股份	4,744,356.00	26.09
179	600378	昊华科技	4,735,038.65	26.04
180	688518	联赢激光	4,732,038.43	26.02
181	688139	海尔生物	4,723,184.34	25.97
182	688122	西部超导	4,698,634.86	25.84
183	600884	杉杉股份	4,697,050.18	25.83
184	002043	兔宝宝	4,677,898.40	25.72
185	002706	良信股份	4,674,595.60	25.71
186	002579	中京电子	4,646,994.00	25.55
187	300055	万邦达	4,642,931.00	25.53
188	600873	梅花生物	4,640,091.00	25.52
189	601619	嘉泽新能	4,638,773.45	25.51
190	600694	大商股份	4,621,754.15	25.41
191	000818	航锦科技	4,620,264.00	25.41
192	000403	派林生物	4,606,932.99	25.33

193	688066	航天宏图	4,596,423.95	25.28
194	603466	风语筑	4,579,601.30	25.18
195	603351	威尔药业	4,571,727.00	25.14
196	601588	北辰实业	4,567,667.38	25.12
197	603128	华贸物流	4,553,201.50	25.04
198	600459	贵研铂业	4,546,779.88	25.00
199	603929	亚翔集成	4,522,822.00	24.87
200	300119	瑞普生物	4,521,251.24	24.86
201	603688	石英股份	4,514,790.50	24.83
202	600552	凯盛科技	4,500,953.00	24.75
203	300409	道氏技术	4,499,355.00	24.74
204	603043	广州酒家	4,492,446.29	24.70
205	300666	江丰电子	4,482,130.00	24.65
206	603383	顶点软件	4,479,513.60	24.63
207	000951	中国重汽	4,451,657.60	24.48
208	603986	兆易创新	4,408,239.00	24.24
209	603308	应流股份	4,379,581.60	24.08
210	603906	龙蟠科技	4,374,203.44	24.05
211	300502	新易盛	4,368,174.00	24.02
212	300672	国科微	4,337,380.00	23.85
213	300679	电连技术	4,325,034.26	23.78
214	600116	三峡水利	4,321,934.00	23.77
215	002597	金禾实业	4,317,941.00	23.74
216	300232	洲明科技	4,297,086.00	23.63
217	600512	腾达建设	4,295,974.00	23.62
218	600577	精达股份	4,288,916.00	23.58
219	600110	诺德股份	4,285,808.00	23.57
220	603801	志邦家居	4,281,708.40	23.54

221	688037	芯源微	4,277,473.07	23.52
222	300366	创意信息	4,275,746.20	23.51
223	300110	华仁药业	4,241,031.00	23.32
224	600581	八一钢铁	4,233,144.00	23.28
225	600711	盛屯矿业	4,226,446.00	23.24
226	002913	奥士康	4,214,925.00	23.18
227	603103	横店影视	4,176,811.00	22.97
228	002274	华昌化工	4,167,355.01	22.92
229	002961	瑞达期货	4,147,626.00	22.81
230	601827	三峰环境	4,130,411.00	22.71
231	002449	国星光电	4,119,863.00	22.65
232	300298	三诺生物	4,114,795.00	22.63
233	300233	金城医药	4,103,538.00	22.57
234	002335	科华数据	4,075,269.59	22.41
235	300327	中颖电子	4,074,994.20	22.41
236	002643	万润股份	4,041,560.00	22.22
237	002032	苏泊尔	4,035,598.00	22.19
238	603179	新泉股份	4,029,716.92	22.16
239	300861	美畅股份	4,026,636.00	22.14
240	600458	时代新材	4,003,235.00	22.01
241	603713	密尔克卫	3,974,608.00	21.86
242	002675	东诚药业	3,970,495.70	21.83
243	603225	新凤鸣	3,938,918.75	21.66
244	002078	太阳纸业	3,900,665.00	21.45
245	600187	国中水务	3,885,071.00	21.36
246	600756	浪潮软件	3,869,093.00	21.28
247	600966	博汇纸业	3,846,990.61	21.15
248	600575	淮河能源	3,844,443.00	21.14

249	002615	哈尔斯	3,837,492.25	21.10
250	601126	四方股份	3,831,829.20	21.07
251	002631	德尔未来	3,828,120.00	21.05
252	603127	昭衍新药	3,794,904.00	20.87
253	600929	雪天盐业	3,779,439.11	20.78
254	688033	天宜上佳	3,741,726.24	20.58
255	300118	东方日升	3,735,831.00	20.54
256	300083	创世纪	3,725,462.00	20.49
257	600426	华鲁恒升	3,698,528.20	20.34
258	603877	太平鸟	3,695,079.00	20.32
259	000917	电广传媒	3,682,078.00	20.25
260	300571	平治信息	3,660,203.74	20.13
261	300465	高伟达	3,654,222.00	20.09
262	603185	上机数控	3,649,841.00	20.07
263	688166	博瑞医药	3,619,119.31	19.90
264	300379	东方通	3,609,115.80	19.85
265	600990	四创电子	3,607,628.00	19.84
266	603619	中曼石油	3,602,448.00	19.81
267	300567	精测电子	3,552,037.53	19.53
268	002312	川发龙蟒	3,551,388.00	19.53
269	600500	中化国际	3,544,788.00	19.49
270	688180	君实生物	3,532,169.52	19.42
271	000912	泸天化	3,525,729.00	19.39
272	300653	正海生物	3,498,375.00	19.24
273	600103	青山纸业	3,487,205.00	19.18
274	300378	鼎捷软件	3,452,492.77	18.99
275	300613	富瀚微	3,442,452.62	18.93
276	002180	纳思达	3,441,519.00	18.92

277	002777	久远银海	3,432,670.40	18.88
278	002337	赛象科技	3,418,597.86	18.80
279	000709	河钢股份	3,415,476.00	18.78
280	601860	紫金银行	3,395,983.00	18.67
281	605111	新洁能	3,391,050.20	18.65
282	600063	皖维高新	3,385,423.00	18.62
283	000567	海德股份	3,382,974.00	18.60
284	600169	太原重工	3,324,614.00	18.28
285	002376	新北洋	3,317,560.57	18.24
286	002139	拓邦股份	3,315,527.00	18.23
287	002911	佛燃能源	3,302,936.65	18.16
288	300352	北信源	3,302,521.00	18.16
289	300223	北京君正	3,299,714.00	18.14
290	300783	三只松鼠	3,291,892.00	18.10
291	300798	锦鸡股份	3,280,248.00	18.04
292	688298	东方生物	3,242,795.50	17.83
293	002539	云图控股	3,242,770.00	17.83
294	000856	冀东装备	3,242,276.00	17.83
295	002421	达实智能	3,240,115.00	17.82
296	603186	华正新材	3,224,737.44	17.73
297	300685	艾德生物	3,222,977.92	17.72
298	603566	普莱柯	3,215,967.00	17.68
299	300737	科顺股份	3,215,505.00	17.68
300	600360	华微电子	3,206,685.00	17.63
301	603108	润达医疗	3,170,411.00	17.43
302	603997	继峰股份	3,153,605.00	17.34
303	000738	航发控制	3,152,895.00	17.34
304	600919	江苏银行	3,148,069.00	17.31

305	002115	三维通信	3,147,029.46	17.31
306	002891	中宠股份	3,140,975.55	17.27
307	300829	金丹科技	3,139,391.20	17.26
308	002482	广田集团	3,129,246.00	17.21
309	000573	粤宏远 A	3,127,102.00	17.20
310	600674	川投能源	3,115,947.00	17.13
311	600389	江山股份	3,090,200.71	16.99
312	002332	仙琚制药	3,088,436.00	16.98
313	002851	麦格米特	3,085,209.00	16.97
314	300723	一品红	3,059,843.71	16.83
315	600612	老凤祥	3,055,028.18	16.80
316	300162	雷曼光电	3,051,747.00	16.78
317	605338	巴比食品	3,047,527.00	16.76
318	002514	宝馨科技	3,047,070.00	16.76
319	002657	中科金财	3,019,813.00	16.61
320	002145	中核钛白	3,017,533.96	16.59
321	300188	美亚柏科	3,016,033.02	16.59
322	603733	仙鹤股份	2,993,004.00	16.46
323	603915	国茂股份	2,984,092.00	16.41
324	002565	顺灏股份	2,978,391.00	16.38
325	300428	立中集团	2,977,577.38	16.37
326	600602	云赛智联	2,964,835.00	16.30
327	600708	光明地产	2,962,742.60	16.29
328	600808	马钢股份	2,961,648.00	16.29
329	300451	创业慧康	2,953,178.00	16.24
330	300590	移为通信	2,926,636.00	16.09
331	002585	双星新材	2,916,502.00	16.04
332	600977	中国电影	2,915,591.94	16.03

333	688159	有方科技	2,913,991.33	16.02
334	601636	旗滨集团	2,906,242.44	15.98
335	300850	新强联	2,892,729.00	15.91
336	600688	上海石化	2,853,403.00	15.69
337	603881	数据港	2,843,385.80	15.64
338	000507	珠海港	2,840,946.00	15.62
339	688222	成都先导	2,834,400.12	15.59
340	300252	金信诺	2,830,177.00	15.56
341	600642	申能股份	2,826,124.00	15.54
342	688520	神州细胞	2,799,039.35	15.39
343	000877	天山股份	2,798,704.58	15.39
344	600497	驰宏锌锗	2,786,545.00	15.32
345	002017	东信和平	2,786,210.84	15.32
346	688268	华特气体	2,751,683.63	15.13
347	688198	佰仁医疗	2,751,113.10	15.13
348	600330	天通股份	2,751,011.00	15.13
349	002367	康力电梯	2,739,096.00	15.06
350	603659	璞泰来	2,738,432.00	15.06
351	002182	云海金属	2,729,453.63	15.01
352	300583	赛托生物	2,728,577.00	15.00
353	300438	鹏辉能源	2,727,383.00	15.00
354	603816	顾家家居	2,726,863.88	14.99
355	300388	节能国祯	2,721,158.00	14.96
356	300292	吴通控股	2,714,706.00	14.93
357	002639	雪人股份	2,691,164.10	14.80
358	603658	安图生物	2,680,284.75	14.74
359	601369	陕鼓动力	2,669,982.00	14.68
360	002266	浙富控股	2,640,366.00	14.52

361	601918	新集能源	2,639,859.00	14.52
362	002022	科华生物	2,633,358.00	14.48
363	002378	章源钨业	2,624,070.00	14.43
364	300087	荃银高科	2,616,889.00	14.39
365	002774	快意电梯	2,610,012.00	14.35
366	603298	杭叉集团	2,609,858.00	14.35
367	601598	中国外运	2,604,615.00	14.32
368	000750	国海证券	2,600,195.00	14.30
369	300204	舒泰神	2,590,455.00	14.24
370	600661	昂立教育	2,588,071.00	14.23
371	300761	立华股份	2,569,058.00	14.13
372	600740	山西焦化	2,563,517.41	14.10
373	002563	森马服饰	2,552,578.00	14.04
374	600742	一汽富维	2,549,106.22	14.02
375	300250	初灵信息	2,544,600.00	13.99
376	300520	科大国创	2,536,710.00	13.95
377	600797	浙大网新	2,503,611.00	13.77
378	603283	赛腾股份	2,500,018.00	13.75
379	603676	卫信康	2,496,124.00	13.73
380	688519	南亚新材	2,493,825.66	13.71
381	300559	佳发教育	2,478,321.00	13.63
382	688278	特宝生物	2,459,514.80	13.52
383	002171	楚江新材	2,448,876.00	13.47
384	603077	和邦生物	2,442,100.00	13.43
385	300791	仙乐健康	2,437,115.00	13.40
386	002262	恩华药业	2,428,056.00	13.35
387	600619	海立股份	2,414,799.00	13.28
388	002409	雅克科技	2,411,232.00	13.26

389	600490	鹏欣资源	2,399,310.00	13.19
390	000950	重药控股	2,388,595.00	13.13
391	600590	泰豪科技	2,386,528.00	13.12
392	000423	东阿阿胶	2,379,116.00	13.08
393	603323	苏农银行	2,362,465.00	12.99
394	601567	三星医疗	2,346,478.00	12.90
395	688085	三友医疗	2,341,829.30	12.88
396	002705	新宝股份	2,340,599.00	12.87
397	300434	金石亚药	2,339,286.00	12.86
398	688556	高测股份	2,302,902.14	12.66
399	000550	江铃汽车	2,299,958.00	12.65
400	002747	埃斯顿	2,294,536.00	12.62
401	300487	蓝晓科技	2,291,829.50	12.60
402	000913	钱江摩托	2,288,894.00	12.59
403	002832	比音勒芬	2,285,559.00	12.57
404	000710	贝瑞基因	2,283,386.00	12.56
405	000544	中原环保	2,272,573.00	12.50
406	002946	新乳业	2,264,529.00	12.45
407	688001	华兴源创	2,263,569.00	12.45
408	300674	宇信科技	2,263,059.20	12.44
409	000676	智度股份	2,259,754.10	12.43
410	300068	南都电源	2,256,028.00	12.41
411	601009	南京银行	2,245,318.00	12.35
412	002537	海联金汇	2,222,000.28	12.22
413	688019	安集科技	2,218,835.51	12.20
414	000910	大亚圣象	2,209,533.00	12.15
415	300485	赛升药业	2,202,975.45	12.11
416	600211	西藏药业	2,199,569.00	12.10

417	000155	川能动力	2,198,729.00	12.09
418	002097	山河智能	2,194,779.50	12.07
419	000898	鞍钢股份	2,190,276.00	12.04
420	002036	联创电子	2,187,606.00	12.03
421	002591	恒大高新	2,173,355.00	11.95
422	300344	立方数科	2,169,563.27	11.93
423	600054	黄山旅游	2,145,116.00	11.80
424	002462	嘉事堂	2,144,395.36	11.79
425	300311	任子行	2,134,430.00	11.74
426	002216	三全食品	2,133,582.00	11.73
427	688568	中科星图	2,123,115.78	11.67
428	002476	宝莫股份	2,122,927.18	11.67
429	002114	罗平锌电	2,121,713.00	11.67
430	603218	日月股份	2,119,622.00	11.66
431	000761	本钢板材	2,101,906.00	11.56
432	600760	中航沈飞	2,094,095.00	11.52
433	603956	威派格	2,090,409.00	11.50
434	002726	龙大美食	2,063,861.00	11.35
435	603168	莎普爱思	2,055,556.00	11.30
436	002192	融捷股份	2,048,029.00	11.26
437	603626	科森科技	2,024,663.00	11.13
438	601311	骆驼股份	2,024,072.00	11.13
439	300699	光威复材	2,011,478.00	11.06
440	002436	兴森科技	2,011,461.00	11.06
441	600391	航发科技	2,009,722.00	11.05
442	601965	中国汽研	2,005,019.00	11.03
443	603313	梦百合	1,997,155.00	10.98
444	002396	星网锐捷	1,994,776.00	10.97

445	603596	伯特利	1,987,268.00	10.93
446	603113	金能科技	1,977,509.00	10.87
447	601233	桐昆股份	1,966,237.00	10.81
448	300158	振东制药	1,963,103.00	10.79
449	300803	指南针	1,958,676.00	10.77
450	601900	南方传媒	1,948,550.80	10.71
451	603009	北特科技	1,947,084.00	10.71
452	300168	万达信息	1,932,811.97	10.63
453	000848	承德露露	1,924,297.00	10.58
454	300240	飞力达	1,904,977.81	10.48
455	603515	欧普照明	1,901,207.00	10.45
456	002347	泰尔股份	1,899,521.00	10.45
457	603660	苏州科达	1,895,779.00	10.42
458	300149	睿智医药	1,868,341.00	10.27
459	000795	英洛华	1,865,208.00	10.26
460	300007	汉威科技	1,864,931.00	10.26
461	600325	华发股份	1,862,803.00	10.24
462	300346	南大光电	1,857,901.56	10.22
463	600622	光大嘉宝	1,853,569.00	10.19
464	601231	环旭电子	1,851,416.33	10.18
465	002876	三利谱	1,837,520.00	10.10
466	688598	金博股份	1,835,655.44	10.09
467	600338	西藏珠峰	1,835,182.00	10.09
468	000677	恒天海龙	1,831,287.25	10.07
469	000598	兴蓉环境	1,807,728.00	9.94
470	603208	江山欧派	1,807,229.00	9.94
471	601101	昊华能源	1,806,408.00	9.93
472	603738	泰晶科技	1,801,802.02	9.91

473	601818	光大银行	1,799,836.00	9.90
474	603180	金牌厨柜	1,799,104.29	9.89
475	002792	通宇通讯	1,792,608.00	9.86
476	000789	万年青	1,781,679.00	9.80
477	000921	海信家电	1,777,416.25	9.77
478	002158	汉钟精机	1,775,991.00	9.77
479	600812	华北制药	1,772,365.00	9.75
480	300705	九典制药	1,772,121.63	9.74
481	002651	利君股份	1,771,371.00	9.74
482	300102	乾照光电	1,754,619.00	9.65
483	000830	鲁西化工	1,748,659.00	9.62
484	002810	山东赫达	1,748,133.00	9.61
485	601882	海天精工	1,746,187.00	9.60
486	601519	大智慧	1,740,404.00	9.57
487	300855	图南股份	1,740,291.00	9.57
488	002739	万达电影	1,737,527.00	9.55
489	300365	恒华科技	1,735,178.00	9.54
490	002722	金轮股份	1,730,811.00	9.52
491	600185	格力地产	1,729,421.00	9.51
492	300288	朗玛信息	1,726,261.00	9.49
493	300785	值得买	1,723,266.75	9.48
494	600963	岳阳林纸	1,711,818.00	9.41
495	000852	石化机械	1,700,664.20	9.35
496	600456	宝钛股份	1,695,316.00	9.32
497	003009	中天火箭	1,678,783.00	9.23
498	300655	晶瑞电材	1,671,963.76	9.19
499	300527	中船应急	1,667,796.00	9.17
500	688185	康希诺	1,665,597.07	9.16

501	300398	飞凯材料	1,662,004.42	9.14
502	002034	旺能环境	1,660,000.00	9.13
503	002314	南山控股	1,654,782.00	9.10
504	603606	东方电缆	1,653,948.92	9.09
505	600664	哈药股份	1,649,738.00	9.07
506	002531	天顺风能	1,632,939.00	8.98
507	603897	长城科技	1,618,661.87	8.90
508	603363	傲农生物	1,614,124.34	8.88
509	300170	汉得信息	1,608,379.00	8.84
510	603603	博天环境	1,602,636.00	8.81
511	600676	交运股份	1,587,115.30	8.73
512	300448	浩云科技	1,587,033.00	8.73
513	600372	中航电子	1,586,729.00	8.73
514	600710	苏美达	1,581,592.00	8.70
515	600635	大众公用	1,577,762.00	8.68
516	300394	天孚通信	1,569,227.80	8.63
517	002773	康弘药业	1,561,024.00	8.58
518	002293	罗莱生活	1,558,551.10	8.57
519	002840	华统股份	1,553,537.00	8.54
520	002550	千红制药	1,550,067.00	8.52
521	600692	亚通股份	1,548,481.00	8.52
522	000851	高鸿股份	1,537,161.00	8.45
523	600105	永鼎股份	1,531,635.00	8.42
524	600502	安徽建工	1,527,975.00	8.40
525	600012	皖通高速	1,523,182.00	8.38
526	300266	兴源环境	1,514,989.00	8.33
527	603912	佳力图	1,501,299.00	8.26
528	000938	紫光股份	1,497,168.00	8.23

529	600715	文投控股	1,494,604.00	8.22
530	002037	保利联合	1,488,055.00	8.18
531	603520	司太立	1,482,857.00	8.15
532	300230	永利股份	1,481,172.00	8.14
533	000011	深物业 A	1,477,754.00	8.13
534	600480	凌云股份	1,472,454.80	8.10
535	002361	神剑股份	1,468,465.50	8.08
536	600549	厦门钨业	1,467,252.00	8.07
537	688030	山石网科	1,465,107.06	8.06
538	603686	龙马环卫	1,462,752.80	8.04
539	600621	华鑫股份	1,453,463.00	7.99
540	300429	强力新材	1,448,393.00	7.96
541	000683	远兴能源	1,446,510.00	7.95
542	002812	恩捷股份	1,440,911.00	7.92
543	300002	神州泰岳	1,432,598.00	7.88
544	300369	绿盟科技	1,431,993.00	7.87
545	002003	伟星股份	1,430,934.00	7.87
546	600162	香江控股	1,428,427.00	7.85
547	603598	引力传媒	1,417,253.00	7.79
548	002344	海宁皮城	1,416,446.00	7.79
549	603919	金徽酒	1,412,683.00	7.77
550	002151	北斗星通	1,412,296.00	7.77
551	300122	智飞生物	1,402,321.00	7.71
552	300091	金通灵	1,401,051.00	7.70
553	300097	智云股份	1,378,934.00	7.58
554	300506	名家汇	1,376,834.00	7.57
555	600428	中远海特	1,375,672.00	7.56
556	002161	远望谷	1,374,059.00	7.56

557	603959	百利科技	1,357,391.00	7.46
558	002285	世联行	1,356,263.00	7.46
559	000863	三湘印象	1,352,509.00	7.44
560	002641	永高股份	1,351,028.68	7.43
561	600507	方大特钢	1,350,333.00	7.43
562	603565	中谷物流	1,349,046.00	7.42
563	600223	鲁商发展	1,346,790.00	7.41
564	002410	广联达	1,341,829.00	7.38
565	000887	中鼎股份	1,338,580.22	7.36
566	603773	沃格光电	1,337,508.80	7.35
567	688077	大地熊	1,324,329.48	7.28
568	300627	华测导航	1,321,901.00	7.27
569	603060	国检集团	1,319,570.60	7.26
570	601375	中原证券	1,318,327.00	7.25
571	600114	东睦股份	1,315,362.00	7.23
572	300332	天壕环境	1,314,165.00	7.23
573	002601	龙佰集团	1,309,881.00	7.20
574	300888	稳健医疗	1,308,776.00	7.20
575	000034	神州数码	1,300,854.00	7.15
576	002026	山东威达	1,299,633.14	7.15
577	000059	华锦股份	1,288,928.00	7.09
578	603889	新澳股份	1,284,176.00	7.06
579	002141	贤丰控股	1,283,728.00	7.06
580	600420	国药现代	1,277,946.00	7.03
581	300525	博思软件	1,274,281.00	7.01
582	300767	震安科技	1,272,768.40	7.00
583	601789	宁波建工	1,271,819.00	6.99
584	300810	中科海讯	1,269,618.00	6.98

585	600132	重庆啤酒	1,265,195.00	6.96
586	002458	益生股份	1,263,957.00	6.95
587	600111	北方稀土	1,260,193.00	6.93
588	603602	纵横通信	1,245,650.48	6.85
589	601015	陕西黑猫	1,237,066.00	6.80
590	002611	东方精工	1,236,226.00	6.80
591	600855	航天长峰	1,236,179.00	6.80
592	300166	东方国信	1,235,866.00	6.80
593	600587	新华医疗	1,231,004.00	6.77
594	000039	中集集团	1,228,362.00	6.75
595	300773	拉卡拉	1,223,891.00	6.73
596	603728	鸣志电器	1,223,614.00	6.73
597	002231	奥维通信	1,219,144.00	6.70
598	600548	深高速	1,213,676.00	6.67
599	300474	景嘉微	1,210,593.00	6.66
600	300124	汇川技术	1,208,163.00	6.64
601	300132	青松股份	1,204,891.00	6.63
602	300208	青岛中程	1,204,107.00	6.62
603	603587	地素时尚	1,198,793.68	6.59
604	688099	晶晨股份	1,196,969.36	6.58
605	300322	硕贝德	1,196,156.00	6.58
606	002126	银轮股份	1,193,414.00	6.56
607	688277	天智航	1,178,557.41	6.48
608	002494	华斯股份	1,175,941.00	6.47
609	002405	四维图新	1,163,357.00	6.40
610	600641	万业企业	1,159,824.00	6.38
611	002609	捷顺科技	1,158,287.00	6.37
612	600696	岩石股份	1,156,719.00	6.36

613	002906	华阳集团	1,146,013.00	6.30
614	300385	雪浪环境	1,144,744.20	6.29
615	300657	弘信电子	1,143,863.00	6.29
616	688526	科前生物	1,129,804.16	6.21
617	000811	冰轮环境	1,116,432.88	6.14
618	603013	亚普股份	1,113,916.00	6.13
619	600151	航天机电	1,110,933.00	6.11
620	002461	珠江啤酒	1,106,952.00	6.09
621	300910	瑞丰新材	1,101,054.00	6.05
622	600761	安徽合力	1,096,671.00	6.03
623	300579	数字认证	1,093,175.00	6.01
624	002277	友阿股份	1,091,021.00	6.00
625	600277	亿利洁能	1,085,682.20	5.97
626	002691	冀凯股份	1,082,441.00	5.95
627	002049	紫光国微	1,068,064.00	5.87
628	600035	楚天高速	1,058,367.39	5.82
629	300196	长海股份	1,055,948.79	5.81
630	300348	长亮科技	1,054,546.00	5.80
631	002737	葵花药业	1,048,837.00	5.77
632	002183	怡亚通	1,048,006.00	5.76
633	603018	华设集团	1,045,556.00	5.75
634	002843	泰嘉股份	1,044,519.00	5.74
635	600933	爱柯迪	1,038,874.00	5.71
636	300721	怡达股份	1,035,584.00	5.69
637	300732	设研院	1,035,063.71	5.69
638	000555	神州信息	1,034,760.00	5.69
639	600248	陕西建工	1,030,612.00	5.67
640	600843	上工申贝	1,025,813.00	5.64

641	603667	五洲新春	1,024,476.00	5.63
642	600775	南京熊猫	1,018,145.00	5.60
643	600075	新疆天业	1,016,144.00	5.59
644	002713	东易日盛	1,015,863.48	5.59
645	603551	奥普家居	1,014,358.90	5.58
646	000553	安道麦 A	1,011,538.00	5.56
647	300456	赛微电子	1,008,022.00	5.54
648	002662	京威股份	1,007,725.00	5.54
649	300009	安科生物	1,006,069.00	5.53
650	002905	金逸影视	1,004,590.00	5.52
651	688158	优刻得	1,000,828.03	5.50
652	002191	劲嘉股份	994,340.00	5.47
653	603833	欧派家居	991,365.00	5.45
654	000990	诚志股份	988,692.00	5.44
655	603429	集友股份	984,729.46	5.41
656	603081	大丰实业	983,738.00	5.41
657	603328	依顿电子	979,759.00	5.39
658	603256	宏和科技	979,303.00	5.39
659	300616	尚品宅配	979,168.00	5.38
660	002635	安洁科技	977,062.00	5.37
661	300900	广联航空	976,347.00	5.37
662	002218	拓日新能	974,833.00	5.36
663	002330	得利斯	966,268.00	5.31
664	000723	美锦能源	964,574.00	5.30
665	000546	金圆股份	962,518.00	5.29
666	688586	江航装备	962,305.53	5.29
667	002234	民和股份	955,002.00	5.25
668	688235	百济神州	950,196.40	5.23

669	002847	盐津铺子	947,594.00	5.21
670	002870	香山股份	945,893.00	5.20
671	002765	蓝黛科技	945,561.00	5.20
672	300121	阳谷华泰	945,282.00	5.20
673	300047	天源迪科	942,659.00	5.18
674	600728	佳都科技	942,224.00	5.18
675	000717	韶钢松山	941,027.00	5.17
676	300353	东土科技	937,399.00	5.15
677	300650	太龙股份	935,052.00	5.14
678	601609	金田铜业	934,933.00	5.14
679	002895	川恒股份	934,842.00	5.14
680	002544	杰赛科技	931,705.00	5.12
681	002664	长鹰信质	930,719.00	5.12
682	600252	中恒集团	929,560.97	5.11
683	600531	豫光金铅	928,772.00	5.11
684	600258	首旅酒店	928,326.00	5.10
685	002318	久立特材	927,104.00	5.10
686	603053	成都燃气	918,951.00	5.05
687	688023	安恒信息	913,489.20	5.02
688	603220	中贝通信	904,853.00	4.98
689	300222	科大智能	904,232.00	4.97
690	601699	潞安环能	903,191.00	4.97
691	002013	中航机电	899,900.00	4.95
692	300263	隆华科技	897,032.00	4.93
693	000900	现代投资	895,983.00	4.93
694	300702	天宇股份	891,663.00	4.90
695	300401	花园生物	890,275.00	4.90
696	002382	蓝帆医疗	888,851.00	4.89

697	300181	佐力药业	886,823.54	4.88
698	603730	岱美股份	882,647.39	4.85
699	300872	天阳科技	882,286.00	4.85
700	601886	江河集团	880,028.90	4.84
701	000049	德赛电池	876,096.20	4.82
702	603187	海容冷链	873,789.20	4.80
703	600997	开滦股份	872,510.00	4.80
704	002371	北方华创	870,563.00	4.79
705	688301	奕瑞科技	863,210.16	4.75
706	300687	赛意信息	860,463.00	4.73
707	603421	鼎信通讯	859,565.00	4.73
708	300821	东岳硅材	855,867.00	4.71
709	603693	江苏新能	854,773.00	4.70
710	002733	雄韬股份	853,526.00	4.69
711	601163	三角轮胎	847,877.00	4.66
712	601689	拓普集团	841,525.00	4.63
713	300035	中科电气	840,062.00	4.62
714	300670	大烨智能	837,941.00	4.61
715	601908	京运通	837,252.00	4.60
716	600172	黄河旋风	837,213.00	4.60
717	002498	汉缆股份	836,446.00	4.60
718	600150	中国船舶	835,744.00	4.60
719	002543	万和电气	835,201.66	4.59
720	002941	新疆交建	830,335.00	4.57
721	603595	东尼电子	829,581.00	4.56
722	002061	浙江交科	826,862.00	4.55
723	603025	大豪科技	824,059.77	4.53
724	002267	陕天然气	821,662.00	4.52

725	002745	木林森	817,869.00	4.50
726	002320	海峡股份	810,922.00	4.46
727	688106	金宏气体	809,223.33	4.45
728	603868	飞科电器	803,274.00	4.42
729	600230	沧州大化	797,313.40	4.38
730	300523	辰安科技	796,426.00	4.38
731	300307	慈星股份	795,948.00	4.38
732	601872	招商轮船	793,583.00	4.36
733	600133	东湖高新	792,724.00	4.36
734	300472	新元科技	790,537.00	4.35
735	000976	华铁股份	789,249.00	4.34
736	603638	艾迪精密	781,908.24	4.30
737	002055	得润电子	780,835.00	4.29
738	002522	浙江众成	779,870.00	4.29
739	000615	奥园美谷	779,538.00	4.29
740	600180	瑞茂通	775,939.00	4.27
741	300326	凯利泰	775,505.00	4.26
742	002137	实益达	774,189.00	4.26
743	300788	中信出版	772,708.00	4.25
744	002284	亚太股份	771,047.00	4.24
745	600967	内蒙一机	769,731.00	4.23
746	000783	长江证券	769,283.00	4.23
747	300439	美康生物	764,962.00	4.21
748	600876	洛阳玻璃	764,826.00	4.21
749	002881	美格智能	763,342.00	4.20
750	002930	宏川智慧	758,828.80	4.17
751	002239	奥特佳	757,056.00	4.16
752	300777	中简科技	752,451.00	4.14

753	603301	振德医疗	748,831.00	4.12
754	002416	爱施德	742,980.00	4.09
755	688578	艾力斯	741,444.28	4.08
756	603360	百傲化学	740,248.67	4.07
757	002251	步步高	739,720.00	4.07
758	300776	帝尔激光	739,078.00	4.06
759	300618	寒锐钴业	735,199.00	4.04
760	300151	昌红科技	734,606.00	4.04
761	002261	拓维信息	732,387.00	4.03
762	605117	德业股份	730,402.23	4.02
763	000989	九芝堂	726,788.00	4.00
764	000560	我爱我家	722,772.00	3.97
765	000796	凯撒旅业	722,709.00	3.97
766	002108	沧州明珠	712,709.00	3.92
767	300339	润和软件	712,460.00	3.92
768	002298	中电兴发	711,227.00	3.91
769	002603	以岭药业	710,621.00	3.91
770	002955	鸿合科技	710,614.00	3.91
771	002283	天润工业	710,536.00	3.91
772	002106	莱宝高科	708,677.00	3.90
773	300857	协创数据	706,130.00	3.88
774	600971	恒源煤电	699,730.00	3.85
775	300602	飞荣达	699,289.00	3.85
776	000823	超声电子	698,977.79	3.84
777	300131	英唐智控	698,040.00	3.84
778	300473	德尔股份	696,734.00	3.83
779	688288	鸿泉物联	696,408.38	3.83
780	300061	旗天科技	695,337.00	3.82

781	600746	江苏索普	694,717.00	3.82
782	600197	伊力特	691,582.00	3.80
783	300017	网宿科技	690,979.00	3.80
784	002368	太极股份	690,733.74	3.80
785	000680	山推股份	690,631.00	3.80
786	000603	盛达资源	689,683.00	3.79
787	603477	巨星农牧	689,321.00	3.79
788	601222	林洋能源	686,671.14	3.78
789	000959	首钢股份	685,966.00	3.77
790	600970	中材国际	683,198.00	3.76
791	688300	联瑞新材	681,560.35	3.75
792	600439	瑞贝卡	674,854.00	3.71
793	300757	罗博特科	674,039.98	3.71
794	300621	维业股份	672,082.00	3.70
795	600072	中船科技	670,719.00	3.69
796	688050	爱博医疗	669,839.42	3.68
797	300177	中海达	666,252.66	3.66
798	600018	上港集团	664,906.00	3.66
799	000968	蓝焰控股	664,309.00	3.65
800	603156	养元饮品	659,015.00	3.62
801	002821	凯莱英	658,817.00	3.62
802	600988	赤峰黄金	656,774.47	3.61
803	600645	中源协和	656,003.00	3.61
804	002960	青鸟消防	654,951.00	3.60
805	603501	韦尔股份	654,385.00	3.60
806	000881	中广核技	652,614.02	3.59
807	300562	乐心医疗	651,456.00	3.58
808	002559	亚威股份	651,056.00	3.58

809	603008	喜临门	650,711.00	3.58
810	000949	新乡化纤	649,762.00	3.57
811	300358	楚天科技	649,709.00	3.57
812	300180	华峰超纤	642,595.00	3.53
813	601127	小康股份	639,381.00	3.52
814	002484	江海股份	630,247.00	3.47
815	603600	永艺股份	629,374.00	3.46
816	603486	科沃斯	629,266.00	3.46
817	600381	青海春天	627,808.00	3.45
818	600741	华域汽车	627,196.00	3.45
819	300852	四会富仕	625,748.00	3.44
820	600067	冠城大通	625,500.00	3.44
821	002940	昂利康	622,322.00	3.42
822	300673	佩蒂股份	620,568.00	3.41
823	002977	天箭科技	618,953.00	3.40
824	688617	惠泰医疗	618,131.36	3.40
825	002419	天虹股份	613,938.00	3.38
826	002860	星帅尔	612,380.00	3.37
827	002104	恒宝股份	608,949.58	3.35
828	002978	安宁股份	599,830.00	3.30
829	002649	博彦科技	597,257.00	3.28
830	601881	中国银河	595,747.00	3.28
831	002024	苏宁易购	595,566.00	3.27
832	603416	信捷电气	592,543.00	3.26
833	603896	寿仙谷	590,678.00	3.25
834	300531	优博讯	587,060.00	3.23
835	600481	双良节能	586,718.00	3.23
836	688168	安博通	586,438.75	3.22

837	000685	中山公用	583,944.00	3.21
838	300548	博创科技	583,282.00	3.21
839	600586	金晶科技	580,923.00	3.19
840	603799	华友钴业	578,059.00	3.18
841	002056	横店东磁	574,642.00	3.16
842	300842	帝科股份	567,295.00	3.12
843	300415	伊之密	566,172.00	3.11
844	002967	广电计量	566,018.00	3.11
845	603825	华扬联众	561,802.00	3.09
846	300759	康龙化成	560,399.00	3.08
847	603068	博通集成	560,009.00	3.08
848	000019	深粮控股	558,982.80	3.07
849	002315	焦点科技	557,692.00	3.07
850	300596	利安隆	554,940.00	3.05
851	002637	赞宇科技	553,967.00	3.05
852	000045	深纺织 A	551,325.00	3.03
853	000692	惠天热电	545,330.00	3.00
854	603517	绝味食品	545,166.00	3.00
855	000623	吉林敖东	544,328.00	2.99
856	002068	黑猫股份	543,964.00	2.99
857	688561	奇安信	542,244.28	2.98
858	300020	银江技术	541,978.00	2.98
859	300493	润欣科技	540,575.00	2.97
860	688516	奥特维	540,318.00	2.97
861	300846	首都在线	535,538.00	2.94
862	002837	英维克	533,316.00	2.93
863	002677	浙江美大	532,183.00	2.93
864	601866	中远海发	529,806.00	2.91

865	300871	回盛生物	529,290.00	2.91
866	600546	山煤国际	529,114.00	2.91
867	300424	航新科技	529,052.00	2.91
868	002638	勤上股份	525,363.00	2.89
869	600478	科力远	524,120.00	2.88
870	002528	英飞拓	523,175.58	2.88
871	002768	国恩股份	521,591.00	2.87
872	688521	芯原股份	521,243.20	2.87
873	603217	元利科技	512,845.40	2.82
874	600851	海欣股份	510,024.00	2.80
875	300833	浩洋股份	510,014.00	2.80
876	600545	卓郎智能	509,688.00	2.80
877	000937	冀中能源	508,411.00	2.80
878	300499	高澜股份	508,198.00	2.79
879	603610	麒盛科技	505,829.00	2.78
880	000606	ST 顺利	502,506.00	2.76
881	688026	洁特生物	499,845.92	2.75
882	601005	重庆钢铁	496,019.00	2.73
883	600678	四川金顶	495,993.00	2.73
884	000012	南玻 A	495,974.39	2.73
885	000969	安泰科技	491,899.00	2.70
886	603238	诺邦股份	490,355.00	2.70
887	300078	思创医惠	489,912.00	2.69
888	688339	亿华通	489,231.68	2.69
889	002743	富煌钢构	486,040.00	2.67
890	002962	五方光电	485,662.00	2.67
891	603329	上海雅仕	485,333.00	2.67
892	601952	苏垦农发	485,143.00	2.67

893	002441	众业达	484,683.00	2.67
894	300316	晶盛机电	483,910.00	2.66
895	603787	新日股份	483,229.09	2.66
896	002903	宇环数控	480,882.00	2.64
897	000519	中兵红箭	480,519.00	2.64
898	002051	中工国际	474,744.00	2.61
899	002560	通达股份	473,415.00	2.60
900	600550	保变电气	473,349.00	2.60
901	300219	鸿利智汇	472,520.41	2.60
902	688707	振华新材	471,540.00	2.59
903	603258	电魂网络	470,453.00	2.59
904	002117	东港股份	466,549.00	2.57
905	002287	奇正藏药	464,842.21	2.56
906	600282	南钢股份	464,402.00	2.55
907	000068	华控赛格	464,290.00	2.55
908	000859	国风塑业	462,575.00	2.54
909	002472	双环传动	462,088.31	2.54
910	603533	掌阅科技	461,926.00	2.54
911	603228	景旺电子	460,456.00	2.53
912	000510	新金路	458,313.00	2.52
913	600707	彩虹股份	458,024.00	2.52
914	000731	四川美丰	457,591.00	2.52
915	688399	硕世生物	456,549.42	2.51
916	605222	起帆电缆	456,321.00	2.51
917	000026	飞亚达	451,027.00	2.48
918	600903	贵州燃气	450,690.00	2.48
919	603229	奥翔药业	450,271.00	2.48
920	002761	浙江建投	449,002.00	2.47

921	603118	共进股份	447,675.00	2.46
922	300217	东方电热	446,349.00	2.45
923	300572	安车检测	446,256.00	2.45
924	300117	嘉寓股份	443,591.00	2.44
925	002351	漫步者	442,191.00	2.43
926	300498	温氏股份	440,178.00	2.42
927	301050	雷电微力	439,760.73	2.42
928	603083	剑桥科技	436,189.00	2.40
929	300727	润禾材料	435,186.00	2.39
930	688155	先惠技术	429,173.92	2.36
931	002682	龙洲股份	428,500.00	2.36
932	300280	紫天科技	424,409.00	2.33
933	000829	天音控股	420,361.00	2.31
934	603355	莱克电气	419,337.64	2.31
935	300079	数码视讯	419,234.00	2.31
936	603990	麦迪科技	417,212.00	2.29
937	600285	羚锐制药	416,519.00	2.29
938	000030	富奥股份	414,607.00	2.28
939	603690	至纯科技	411,254.00	2.26
940	000920	沃顿科技	410,449.00	2.26
941	603197	保隆科技	407,695.00	2.24
942	000659	珠海中富	406,219.00	2.23
943	300617	安靠智电	405,798.00	2.23
944	688108	赛诺医疗	403,558.14	2.22
945	300318	博晖创新	401,244.06	2.21
946	300495	*ST 美尚	399,791.00	2.20
947	003006	百亚股份	398,167.00	2.19
948	600303	曙光股份	394,893.00	2.17

949	002621	美吉姆	392,840.00	2.16
950	600259	广晟有色	392,538.00	2.16
951	300024	机器人	391,504.00	2.15
952	600256	广汇能源	390,270.00	2.15
953	002645	华宏科技	389,282.00	2.14
954	002035	华帝股份	387,950.67	2.13
955	603708	家家悦	387,571.00	2.13
956	688032	禾迈股份	386,561.70	2.13
957	002079	苏州固锔	384,192.00	2.11
958	600778	友好集团	383,770.39	2.11
959	603855	华荣股份	381,926.00	2.10
960	603010	万盛股份	381,904.80	2.10
961	002907	华森制药	381,236.43	2.10
962	600388	龙净环保	380,602.00	2.09
963	603725	天安新材	379,962.00	2.09
964	600831	广电网络	379,823.00	2.09
965	002176	江特电机	379,161.00	2.08
966	603055	台华新材	379,069.00	2.08
967	603976	正川股份	378,702.00	2.08
968	688162	巨一科技	378,418.00	2.08
969	000833	粤桂股份	375,426.00	2.06
970	002023	海特高新	374,159.00	2.06
971	688068	热景生物	373,561.17	2.05
972	688233	神工股份	371,917.63	2.05
973	300529	健帆生物	371,856.00	2.04
974	002582	好想你	371,475.00	2.04
975	300595	欧普康视	371,330.00	2.04
976	301177	迪阿股份	371,316.10	2.04

977	300207	欣旺达	371,118.00	2.04
978	688187	时代电气	370,118.76	2.04
979	688779	长远锂科	369,610.88	2.03
980	688357	建龙微纳	368,728.37	2.03
981	603507	振江股份	367,667.00	2.02
982	688385	复旦微电	367,078.00	2.02
983	300010	豆神教育	365,162.00	2.01
984	300796	贝斯美	364,539.00	2.00
985	000762	西藏矿业	364,328.00	2.00
986	301127	天源环保	363,846.79	2.00

注：“卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,382,098,166.22
卖出股票收入（成交）总额	2,834,483,178.06

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货持仓。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,503.15
5	应收申购款	4,297,967.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	4,302,470.24

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份 额比例
万 家 中 证 1000 指 数 增 强 A	9,553	24,178.18	71,167,098.47	30.81%	159,807,069.96	69.19%
万 家 中 证 1000 指 数 增 强 C	13,322	20,861.24	101,125,863.01	36.39%	176,787,544.66	63.61%
合计	22,627	22,490.28	172,292,961.48	33.86%	336,594,614.62	66.14%

注：本基金存在同时持有 A 级和 C 级的客户。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额 比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	万家中证	360,032.00	0.1559%
	1000 指数 增强 A		
	万家中证	2,719.28	0.0010%

	1000 指数 增强 C		
	合计	362,751.28	0.0713%

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的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金 投资和研究部门负责人持 有本开放式基金	万家中证 1000 指数 增强 A	0
	万家中证 1000 指数 增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	万家中证 1000 指数 增强 A	0
	万家中证 1000 指数 增强 C	0
	合计	0

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份额 比例（%）	发起份额总数	发起份额占 基金总份额 比例（%）	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资 金	9,887,305.69	1.94	9,887,305.69	1.94	3 年
基金管理人高级管 理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	9,887,305.69	1.94	9,887,305.69	1.94	3 年

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家中证 1000 指数增强 A	万家中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日（2018 年 12 月 3 日）基金份额总额	25,437.93	595,564.60
本报告期期初基金份额总额	11,120,961.79	2,136,315.37
本报告期基金总申购份额	443,480,824.01	692,504,650.63
减：本报告期基金总赎回份额	223,627,617.37	416,727,558.33
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	230,974,168.43	277,913,407.67

§ 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：

公司高级管理人员：

2021 年 3 月 16 日，公司聘任陈广益先生担任公司总经理。

2021 年 7 月 20 日，公司聘任戴晓云女士担任公司副总经理。

2021 年 7 月 20 日，李杰先生因个人原因离职，不再担任本公司副总经理职务。

2021 年 7 月 24 日，公司聘任王静女士担任公司副总经理。

2021 年 8 月 28 日，满黎先生因个人原因离职，不再担任本公司副总经理职务。

基金托管人：

自 2021 年 10 月 27 日起，刘波先生不再担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期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

报告期期为基金进行审计的会计师事务所未发生改变。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

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	佣金	占当期佣金 总量的比例	

			例			
浙商证券	3	6,200,805,093.31	100.00%	4,340,607.56	100.00%	-

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

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

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

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

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

§ 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	20210101 - 20210117	9,887,305.69	-	-	9,887,305.69	1.94%
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；本基金基金合同生效满三年后继续存续时，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。持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》。
- 3、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 4、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的基金净值、更新招募说明书及其他临时公告。
- 5、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2021 年年度报告原文。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。
- 7、《万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》。

13.2 存放地点

基金管理人的办公场所，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

2022 年 3 月 30 日