

万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券  
投资基金  
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料已经审计，立信会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	18
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>20</b>
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	24
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>50</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	50
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	51
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 .....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	73
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 .....	73
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 .....	73
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 .....	73
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 .....	73
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	73
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	73
8.12 投资组合报告附注 .....	74
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>74</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	74
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	75
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	75
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>75</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>76</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	76
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 .....	76
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	76
11.4 基金投资策略的改变 .....	76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	76
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 .....	76
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	76
11.8 其他重大事件 .....	78
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>79</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	79
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>79</b>
13.1 备查文件目录 .....	79
13.2 存放地点 .....	80
13.3 查阅方式 .....	80

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	万家量化同顺多策略混合	
基金主代码	005650	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 5 月 4 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	300,478,128.85 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	万家量化同顺 A	万家量化同顺 C
下属分级基金的交 易代码	005650	005651
报告期末下属分级 基金的份额总额	51,774,808.79 份	248,703,320.06 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在坚持风险收益合理定价的理念基础上，利用量化方法使投资适应市场变化，并引入多维度数据，建立有效因子组合，在合理控制风险的基础上，寻求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、股票资产的量化投资策略：（1）量化多因子策略、（2）量化择时策略、（3）存托凭证投资策略；2、债券资产投资策略；3、股指期货投资策略；4、国债期货投资策略；5、股票期权投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、权证投资策略；8、融资交易策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*90%+一年期银行定期存款收益率（税后）*10%
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	万家基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	兰剑
	联系电话	021-38909626
	电子邮箱	lanj@wjasset.com
客户服务电话	4008880800	95599
传真	021-38909627	010-68121816
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区浦 电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区浦 电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

邮政编码	200122	100031
法定代表人	方一天	谷澍

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市南京东路 61 号 4 楼新黄浦金融大厦
注册登记机构	万家基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年		2022 年		2021 年	
	万家量化同顺 A	万家量化同顺 C	万家量化同顺 A	万家量化同顺 C	万家量化同顺 A	万家量化同顺 C
本期已实现收益	3,218,261.21	2,795,944.50	-67,267,316.45	-9,394,930.89	37,167,441.69	4,456,743.30
本期利润	1,946,492.89	-182,320.61	-66,750,701.17	-10,084,155.19	7,556,206.00	1,188,269.56
加权平均基金份额本期利润	0.0563	-0.0037	-1.1231	-0.8067	0.0435	0.0487
本期加权平均净值利润率	4.63%	-0.32%	-74.98%	-57.14%	2.42%	2.77%
本期	7.99%	7.45%	-38.12%	-38.45%	4.81%	4.29%

基金份额净值增长率						
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	10,189,508.16	40,082,527.74	2,775,055.63	425,193.15	107,781,900.86	15,866,422.94
期末可供分配基金份额利润	0.1968	0.1612	0.1083	0.0807	0.6670	0.6338
期末基金资产净值	61,964,316.95	288,785,847.80	28,387,343.24	5,696,025.81	289,421,387.69	43,953,862.18
期末基金份额净值	1.1968	1.1612	1.1083	1.0807	1.7911	1.7559
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	19.68%	16.12%	10.83%	8.07%	79.11%	75.59%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家量化同顺 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.23%	0.95%	-5.71%	0.71%	5.48%	0.24%
过去六个月	-4.53%	0.92%	-9.30%	0.75%	4.77%	0.17%
过去一年	7.99%	0.90%	-9.18%	0.74%	17.17%	0.16%
过去三年	-29.97%	1.28%	-26.87%	0.96%	-3.10%	0.32%
过去五年	38.20%	1.29%	13.98%	1.07%	24.22%	0.22%
自基金合同生效起至今	19.68%	1.27%	-3.06%	1.05%	22.74%	0.22%

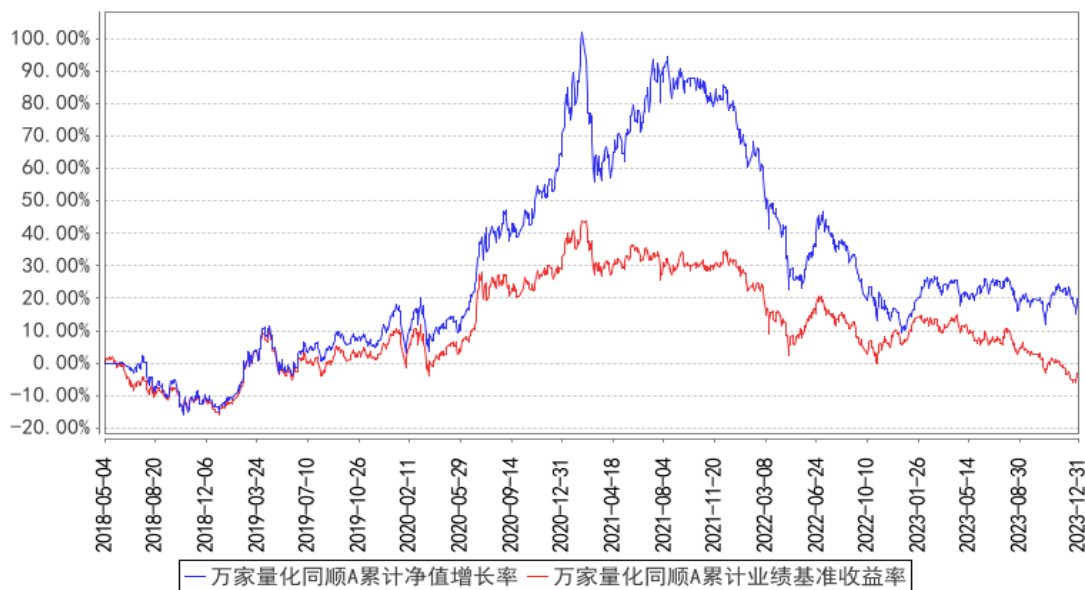
万家量化同顺 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.35%	0.95%	-5.71%	0.71%	5.36%	0.24%
过去六个月	-4.76%	0.92%	-9.30%	0.75%	4.54%	0.17%
过去一年	7.45%	0.90%	-9.18%	0.74%	16.63%	0.16%
过去三年	-31.03%	1.28%	-26.87%	0.96%	-4.16%	0.32%
过去五年	34.68%	1.29%	13.98%	1.07%	20.70%	0.22%
自基金合同生效起至今	16.12%	1.27%	-3.06%	1.05%	19.18%	0.22%

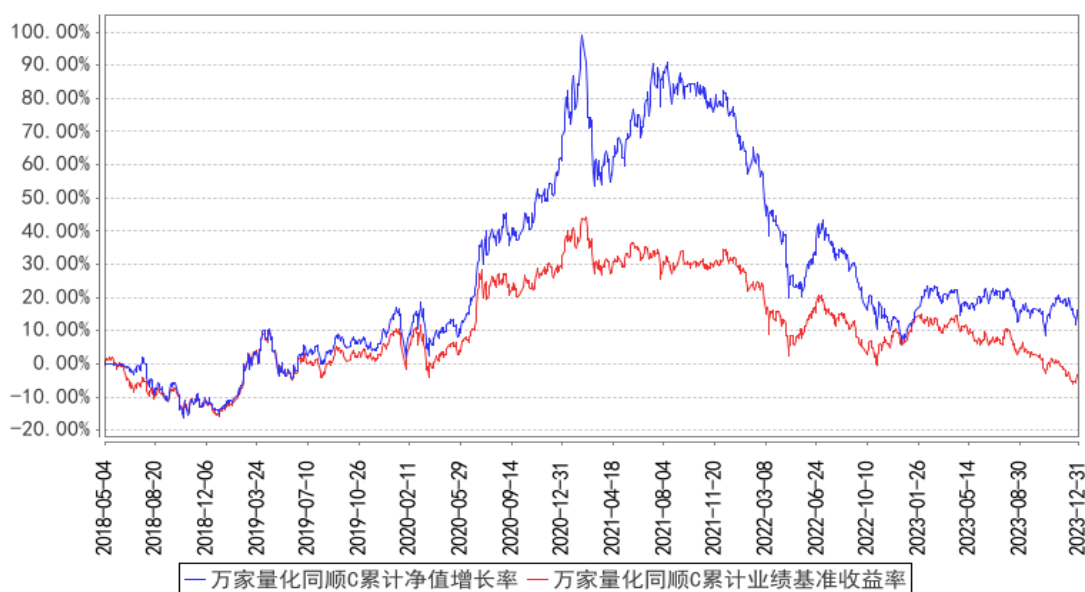


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

万家量化同顺A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



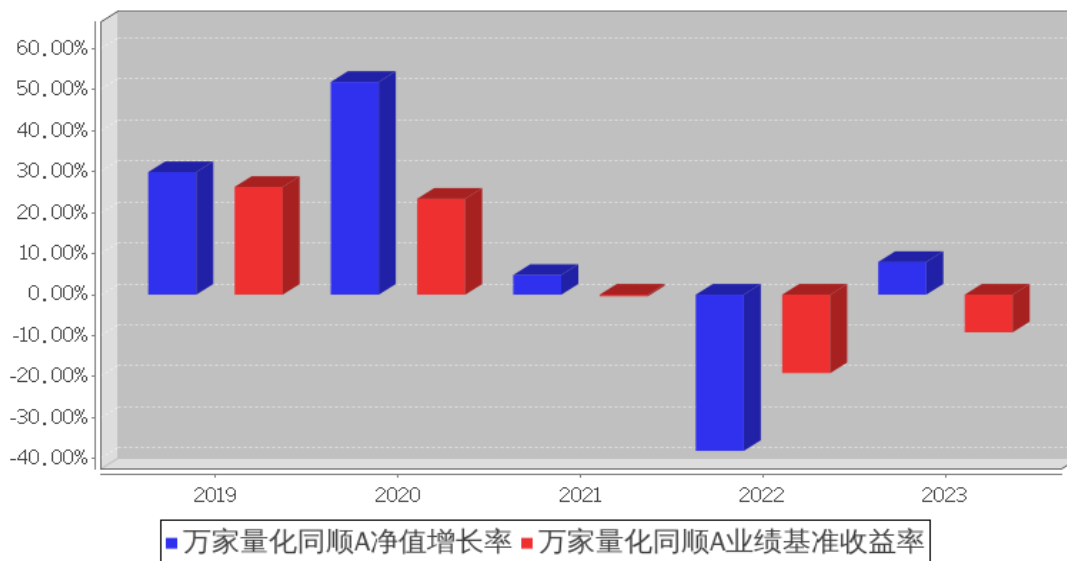
万家量化同顺C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



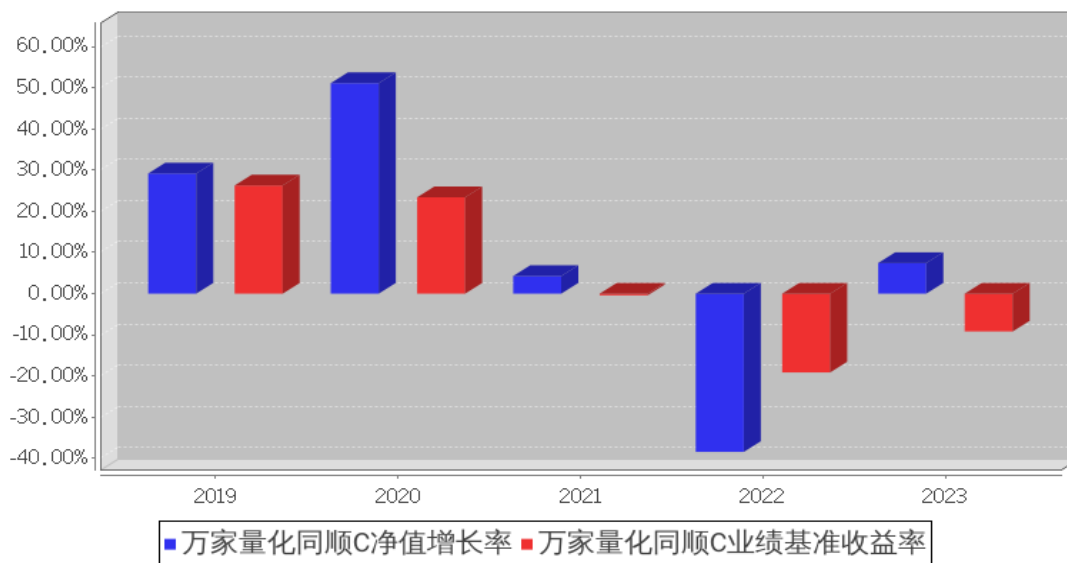
注：本基金于 2018 年 5 月 4 日成立，根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家量化同顺A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



万家量化同顺C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未分配利润。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44号文批准设立。截至报告期末，公司的股东为中泰证券股份有限公司、山东省新动能基金管理有限公司，住所：中国（上海）自由

贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层），办公地点：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层），注册资本 3 亿元人民币。截至报告期末，公司共管理一百四十只开放式基金，分别为万家 180 指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金（LOF）、万家添利债券型证券投资基金（LOF）、万家新机遇价值驱动灵活配置混合型证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家上证 50 交易型开放式指数证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞和灵活配置混合型证券投资基金、万家颐达灵活配置混合型证券投资基金、万家颐和灵活配置混合型证券投资基金、万家恒瑞 18 个月定期开放债券型证券投资基金、万家鑫安纯债债券型证券投资基金、万家鑫璟纯债债券型证券投资基金、万家沪深 300 指数增强型证券投资基金、万家家享中短债债券型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家 1-3 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家瑞隆混合型证券投资基金、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家现金增利货币市场基金、万家消费成长股票型证券投资基金、万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家玖盛纯债 9 个月定期开放债券型证券投资基金、万家天添宝货币市场基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、万家家瑞债券型证券投资基金、万家臻选混合型证券投资基金、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金、万家成长优选灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金、万家经济新动能混合型证券投资基金、万家潜力价值灵活配置混合型证券投资基金、万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家新机遇龙头企业灵活配置混合型证券投资基金、万家智造优势混合型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型证券投资基金、万家人工智能混合型证券投资基金、万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金（LOF）、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、万家平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、万家科创主题

灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、万家鑫盛纯债债券型证券投资基金、万家民安增利 12 个月定期开放债券型证券投资基金、万家汽车新趋势混合型证券投资基金、万家惠享 39 个月定期开放债券型证券投资基金、万家科技创新混合型证券投资基金、万家自主创新混合型证券投资基金、万家民丰回报一年持有期混合型证券投资基金、万家可转债债券型证券投资基金、万家民瑞祥和 6 个月持有期债券型证券投资基金、万家价值优势一年持有期混合型证券投资基金、万家养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、万家鑫动力月月购一年滚动持有混合型证券投资基金、万家科创板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家创业板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家周期优势企业混合型证券投资基金、万家健康产业混合型证券投资基金、万家互联互通中国优势量化策略混合型证券投资基金、万家战略发展产业混合型证券投资基金、万家创业板指数增强型证券投资基金、万家陆家嘴金融城金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家内需增长一年持有期混合型证券投资基金、万家互联互通核心资产量化策略混合型证券投资基金、万家民瑞祥明 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家瑞泽回报一年持有期混合型证券投资基金、万家惠裕回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家悦兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金、万家稳鑫 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、万家全球成长一年持有期混合型证券投资基金 (QDII)、万家沪港深蓝筹混合型证券投资基金、万家北交所慧选两年定期开放混合型证券投资基金、万家鼎鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家新机遇成长一年持有期混合型发起式证券投资基金、万家港股通精选混合型证券投资基金、万家景气驱动混合型证券投资基金、万家安恒纯债 3 个月持有期债券型发起式证券投资基金、万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫橙纯债债券型证券投资基金、万家聚优稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、万家新能源主题混合型发起式证券投资基金、万家中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、万家匠心致远一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫融纯债债券型证券投资基金、万家颐远均衡一年持有期混合型发起式证券投资基金、万家鑫耀纯债债券型证券投资基金、万家欣远混合型证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家惠利债券型证券投资基金、万家鑫怡债券型证券投资基金、万家优享平衡混合型发起式证券投资基金、万家洞见进取混合型发起式证券投资基金、万家沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、万家中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金、万家沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家元贞量化选股股票型证券投资基金、万家 CFETS0-3 年期政策性金融债指数证券投资基金、万家中证软件服务指数型发起式证券投资基金、万家先进制造混合型发起式证券投资基金、万家国证新能源车电池指数型发起

式证券投资基金、万家颐德一年持有期混合型证券投资基金、万家北证 50 成份指数型发起式证券投资基金、万家恒生互联网科技业指数型发起式证券投资基金（QDII）、万家中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家欣优混合型证券投资基金、万家集利债券型发起式证券投资基金、万家远见先锋一年持有期混合型证券投资基金、万家国证 2000 指数增强型证券投资基金、万家纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金（QDII）、万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金、万家稳安 60 天持有期债券型证券投资基金、万家周期驱动股票型发起式证券投资基金、万家优选积极三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、万家养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、万家红利量化选股混合型发起式证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
尹航	量化投资部部门副总监；万家互联互通中国优势量化策略混合型证券投资基金、万家互联互通核心资产量化策略混合型证券投资基金、万家红利量化选股混合型发起式证券投资基金、万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2020 年 7 月 21 日	-	10.5 年	国籍：中国；学历：复旦大学金融专业硕士，2015 年 6 月入职万家基金管理有限公司，现任量化投资部副总监（主持工作）、基金经理，历任量化投资部研究员、专户投资经理。曾任德邦基金管理有限公司金融工程与产品部产品经理，鑫元基金管理有限公司战略发展部产品经理等职。

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内，本基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 40 次，均为量化投资组合或不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年全年维度看，A 股市场整体表现低于预期，风格上呈现小盘优于大盘、价值好于成长的特征。2023 年年初在后疫情时代，经济基本面预期反转与全面注册制的推进一定程度上带动资本市场整体上行，特别是以 ChatGPT 为代表的大模型开始赋能多个领域，在 AI 的带动下，“TMT+半导体”主题形成了一轮较强的行情。二季度随着地产、制造业等数据走弱，国内经济复苏预期转弱，经济进入磨底阶段，低预期使得市场随之转为下行。三季度 7 月政治局会议对资本市场及房地产定调超预期，包括财政、地产、活跃资本市场相关政策在三季度陆续落地，市场的修复预期再起，市场边际回暖但持续时间较短。此后由于对国内经济与政策预期偏弱导致分子端压力加大，尽管美联储政策转向鸽派，但 A 股走势与全球权益市场显著分化，市场又重新趋于谨慎。

在投资运作上，本基金在策略上更加注重捕捉市场微观结构的信息，利用高效的人工智能算法和强大的硬件资源对高频行情数据逐笔进行整合分析，研究日内市场微观结构的规律，并由此挖掘出具有短周期预测能力的特征因子并用于选股，期望捕捉信息优势交易者的交易行为带来的动量效应和常规交易者的过度交易行为带来的反转效应。在风格配置上动态平衡，根据市场微观结构的变化调整持仓在大小盘风格、价值成长风格的平衡，迅速适应震荡行情和风格轮动较快的行情。在量化选股方面持仓标的较多且较分散。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家量化同顺 A 的基金份额净值为 1.1968 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.99%，同期业绩比较基准收益率为-9.18%；截至本报告期末万家量化同顺 C 的基金份额净值为 1.1612 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.45%，同期业绩比较基准收益率为-9.18%。

#### 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 2024 年，经济预期方面，国内政策或密集发力叠加海外补库周期开启背景下，2024 年国内宏观经济预期呈现“前高后低”的走势，在一季度末市场预期和情绪达到峰值后，房地产和出口的下行压力或使得经济修复趋势边际放缓；流动性方面，综合考虑国内政府债的发行节奏和海外美债利率的影响，我们认为在一季度流动性整体呈现中性平衡状态，二季度海外或受到通胀再次上行的影响，加息预期或导致美债利率再次上行，流动性边际趋紧，而到下半年，随着补库周期结束，海外经济或边际下行，流动性有望趋于宽松。

对于国内资本市场来说，我们认为当前至一季度国内外整体宏观预期边际向好，但受制于美债利率高位以及经济修复斜率不高的情形，上行空间并不大，市场主要呈现结构性机会，主题投资相对活跃。二季度由于国内宏观预期边际走弱，并且叠加海外通胀上行可能再次带来鹰派的加息预期，市场波动或显著加大。而下半年，在经历房地产风险和海外通胀风险通过市场定价的调整彻底出清后，市场指数有望真正迎来趋势性的上行机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

##### （一）加强风控文化建设

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

##### （二）制度流程建设

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

##### （三）定期和临时稽核工作

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

##### （四）绩效评估和风险管理工作

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

##### （五）员工行为管理与防控内幕交易

报告期内，公司进一步完善防控内幕交易制度和从业人员投资申报等制度，强化员工行为管理



工作，防范内幕交易和利益输送。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

##### 2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不介入基金日常估值业务。

##### 3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

##### 4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合基金合同的规定。

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

本报告期内，本基金自 2023 年 1 月 3 日至 2023 年 6 月 28 日，连续 116 个工作日基金资产净值低于五千万元。我司已经将该基金情况向监管部门报告并提出解决方案。

本报告期内，本基金基金份额持有人数量不存在低于二百人的情况。

## § 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—万家基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，万家基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，万家基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

# § 6 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	信会师报字[2024]第 ZA30273 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	万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“万家量化同顺多策略混合”）财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了万家量化同顺多策略混合 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于万家量化同顺多策略混合，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
管理层和治理层对财务报表的责任	万家量化同顺多策略混合的基金管理人万家基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则



会计师事务所的地址	中国·上海
审计报告日期	2024 年 03 月 28 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	22,978,860.38	9,504,311.19
结算备付金		1,966,298.13	182,654.46
存出保证金		87,523.54	39,465.60
交易性金融资产	7.4.7.2	318,714,550.35	31,458,478.03
其中：股票投资		318,714,550.35	31,254,436.11
基金投资		-	-
债券投资		-	204,041.92
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		8,955,902.88	7,447.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		352,703,135.28	41,192,356.36
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付清算款		-	6,826,327.96
应付赎回款		159,319.31	9,340.42
应付管理人报酬		336,855.75	19,521.22
应付托管费		56,142.60	3,253.55
应付销售服务费		114,473.89	2,299.16
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	1,286,178.98	248,245.00
负债合计		1,952,970.53	7,108,987.31
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	300,478,128.85	30,883,120.27
其他综合收益	7.4.7.8	-	-
未分配利润	7.4.7.9	50,272,035.90	3,200,248.78
净资产合计		350,750,164.75	34,083,369.05
负债和净资产总计		352,703,135.28	41,192,356.36

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 300,478,128.85 份，其中万家量化同顺 A 基金份额净值 1.1968 元，基金份额总额 51,774,808.79 份；万家量化同顺 C 基金份额净值 1.1612 元，基金份额总额 248,703,320.06 份。

## 7.2 利润表

会计主体：万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		3,675,459.61	-74,748,727.72
1. 利息收入		65,663.19	78,159.41
其中：存款利息收入	7.4.7.10	65,663.19	78,159.41
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		7,461,349.47	-74,717,137.12
其中：股票投资收益	7.4.7.11	6,938,022.30	-76,432,576.29
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	-307.92	2,450.46

资产支持证券投资 收益	7.4.7.13	-	-
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	523,635.09	1,712,988.71
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.17	-4,250,033.43	-172,609.02
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	398,480.38	62,859.01
<b>减：二、营业总支出</b>		1,911,287.33	2,086,128.64
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,245,805.29	1,665,585.21
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	207,634.12	277,597.56
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	278,020.82	91,012.89
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.20	179,827.10	51,932.98
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		1,764,172.28	-76,834,856.36
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		1,764,172.28	-76,834,856.36
<b>五、其他综合收益的税后 净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		1,764,172.28	-76,834,856.36

### 7.3 净资产变动表

会计主体：万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	30,883,120.27	-	3,200,248.78	34,083,369.05
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	30,883,120.27	-	3,200,248.78	34,083,369.05
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	269,595,008.58	-	47,071,787.12	316,666,795.70
(一)、综合收益总额	-	-	1,764,172.28	1,764,172.28
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	269,595,008.58	-	45,307,614.84	314,902,623.42
其中：1. 基金申购款	325,582,713.07	-	55,565,236.12	381,147,949.19
2. 基金赎回款	-55,987,704.49	-	-10,257,621.28	-66,245,325.77
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	300,478,128.85	-	50,272,035.90	350,750,164.75
项目	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	186,620,203.11	-	146,755,046.76	333,375,249.87
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	186,620,203.11	-	146,755,046.76	333,375,249.87
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-155,737,082.84	-	-143,554,797.98	-299,291,880.82
(一)、综合收益总额	-	-	-76,834,856.36	-76,834,856.36
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-155,737,082.84	-	-66,719,941.62	-222,457,024.46
其中：1. 基金申购款	22,429,583.13	-	3,444,739.70	25,874,322.83
2. 基金赎回款	-178,166,665.97	-	-70,164,681.32	-248,331,347.29
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	30,883,120.27	-	3,200,248.78	34,083,369.05

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

万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]2346 号文《关于准予万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由万家基金管理有限公司作为管理人于



2018 年 4 月 2 日至 2018 年 4 月 27 日向社会公开募集，募集期结束经立信会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具信会师报字[2018]第 ZA30601 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2018 年 5 月 4 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 229,795,554.77 元，在募集期间产生的活期存款利息为 54,487.45 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 229,850,042.22 元，折合 229,850,042.22 份基金份额。本基金的基金管理人为万家基金管理有限公司，注册登记机构为万家基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、股指期货、国债期货、股票期权、权证以及债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可交换公司债券、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等金融工具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的相关规定）。本基金可参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率\*90%+一年期银行定期存款收益率（税后）\*10%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》及其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

##### 1、金融资产分类

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

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

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

##### 2、金融负债分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和以摊余成本计量的金融负债。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在债券投资的账面价值中。对于其他金融资产和以摊余成本计量的金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，按照未来 12 个月内（若预期存续期少于 12 个月，则为预期存续期内）的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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

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

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

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

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负

债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

值累计变动额。

其他金融资产在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、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、本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、在符合法律法规及基金合同约定，且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议，但应于变更实施日前在指定媒介公告；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

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

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

指数收益法等估值技术进行估值。

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

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

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

##### (一) 印花税

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

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关

于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》的规定，基金通过深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税；

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

## (二) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

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

债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

### （三）企业所得税

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

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

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

### （四）个人所得税

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》的规定，对基金通过深港通投资香



港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	22,978,860.38	9,504,311.19
等于：本金	22,973,943.63	9,503,362.41
加：应计利息	4,916.75	948.78
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	22,978,860.38	9,504,311.19

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	323,315,468.61	-	318,714,550.35	-4,600,918.26
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	323,315,468.61	-	318,714,550.35	-4,600,918.26
项目	上年度末 2022年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	31,604,854.94	-	31,254,436.11	-350,418.83
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	4,061.92	204,041.92	-466.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	4,061.92	204,041.92	-466.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	31,805,300.94	4,061.92	31,458,478.03	-350,884.83

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有各项买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	0.87
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,129,678.98	103,744.13
其中：交易所市场	1,129,678.98	103,744.13
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	156,500.00	144,500.00
合计	1,286,178.98	248,245.00

#### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

万家量化同顺 A

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	25,612,287.61	25,612,287.61
本期申购	33,247,365.88	33,247,365.88
本期赎回 (以“-”号填列)	-7,084,844.70	-7,084,844.70
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	51,774,808.79	51,774,808.79

万家量化同顺 C

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	5,270,832.66	5,270,832.66
本期申购	292,335,347.19	292,335,347.19
本期赎回 (以“-”号填列)	-48,902,859.79	-48,902,859.79
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	248,703,320.06	248,703,320.06

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

万家量化同顺 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,413,409.51	-2,638,353.88	2,775,055.63
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	5,413,409.51	-2,638,353.88	2,775,055.63
本期利润	3,218,261.21	-1,271,768.32	1,946,492.89
本期基金份额交易产生的变动数	8,681,190.44	-3,213,230.80	5,467,959.64
其中：基金申购款	11,022,578.43	-3,989,989.66	7,032,588.77
基金赎回款	-2,341,387.99	776,758.86	-1,564,629.13
本期已分配利润	-	-	-

本期末	17,312,861.16	-7,123,353.00	10,189,508.16
-----	---------------	---------------	---------------

万家量化同顺 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	951,556.17	-526,363.02	425,193.15
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	951,556.17	-526,363.02	425,193.15
本期利润	2,795,944.50	-2,978,265.11	-182,320.61
本期基金份额交易产生的变动数	69,520,270.28	-29,680,615.08	39,839,655.20
其中：基金申购款	83,563,437.28	-35,030,789.93	48,532,647.35
基金赎回款	-14,043,167.00	5,350,174.85	-8,692,992.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	73,267,770.95	-33,185,243.21	40,082,527.74

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	55,751.16	47,018.37
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	9,316.94	28,789.42
其他	595.09	2,351.62
合计	65,663.19	78,159.41

7.4.7.11 股票投资收益

7.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	6,938,022.30	-76,432,576.29
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-

合计	6,938,022.30	-76,432,576.29
----	--------------	----------------

#### 7.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	937,300,712.83	2,257,482,989.65
减：卖出股票成本总额	927,777,606.43	2,327,294,234.30
减：交易费用	2,585,084.10	6,621,331.64
买卖股票差价收入	6,938,022.30	-76,432,576.29

#### 7.4.7.12 债券投资收益

##### 7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	138.08	42,560.04
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-446.00	-40,109.58
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-307.92	2,450.46

##### 7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	204,200.00	31,545,528.61
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	200,446.00	30,860,078.00

减：应计利息总额	4,200.00	725,523.61
减：交易费用	-	36.58
买卖债券差价收入	-446.00	-40,109.58

#### 7.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	523,635.09	1,712,988.71
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	523,635.09	1,712,988.71

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
1. 交易性金融资产	-4,250,033.43	-172,609.02
股票投资	-4,250,499.43	-197,013.02
债券投资	466.00	24,404.00
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-4,250,033.43	-172,609.02

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	398,470.52	37,770.18
基金转换费收入	9.86	25,088.83
合计	398,480.38	62,859.01

#### 7.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	32,000.00	20,000.00
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行费用	9,827.10	9,432.98
账户维护费	18,000.00	22,500.00
合计	179,827.10	51,932.98

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

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

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司（“万家基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
中泰证券股份有限公司（“中泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
山东省新动能基金管理有限公司	基金管理人的股东
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（“万家共赢”）	基金管理人的子公司
万家财富基金销售（天津）有限公司（“万家财富”）	基金管理人的子公司、基金销售机构

上海万家朴智投资管理有限公司（“万家朴智”）	基金管理人控制的公司
山东能源集团有限公司	基金管理人的实际控制人

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

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

3、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
中泰证券	553,861,091.00	25.68	1,882,745,201.29	43.73

###### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
中泰证券	-	-	12,408,008.00	33.67

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。



### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中泰证券	521,845.39	28.64	274,336.35	24.28
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中泰证券	1,753,396.75	43.97	26,614.37	25.65

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	1,245,805.29
其中：应支付销售机构的客户维护 费	246,804.45	229,363.35
应支付基金管理人的净管理费	999,000.84	1,436,221.86

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
	当期发生的基金应支付的托管费	207,634.12

注：2023年8月21日前，本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提；自2023

年 8 月 21 日起，本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家量化同顺 A	万家量化同顺 C	合计
万家基金	-	189,652.73	189,652.73
合计	-	189,652.73	189,652.73
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家量化同顺 A	万家量化同顺 C	合计
万家基金	-	59,526.48	59,526.48
合计	-	59,526.48	59,526.48

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.50%。销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额的基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据相关协议支付给各销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	万家量化同顺A	万家量化同顺C
基金合同生效日(2018年5月4日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	18,092,093.36	-
报告期间申购/买入总份额	13,028,501.63	-
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	31,120,594.99	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	60.1076%	-
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	万家量化同顺A	万家量化同顺C
基金合同生效日(2018年5月4日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	18,092,093.36	-

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	18,092,093.36	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	70.6383%	-

#### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
农业银行	22,978,860.38	55,751.16	9,504,311.19	47,018.37

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，存款按银行同业利率或约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方所承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间没有需作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000801	四川九洲	2023年12月21日	重大事项停牌	7.70	2024年01月05日	8.47	399,500	3,216,849.28	3,076,150.00	-

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止, 本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止, 本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日

A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	204,041.92
合计	-	204,041.92

注：未评级债券为国债。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

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

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持有的证券大部分具有良好的流动性，部分证券流通暂时受限的情况参见附注 7.4.12 “期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券”，本报告期内本基金未出现因投资品种变现困难或投资集中而无法以合理价格及时变现基金资产以支付赎回款的情况。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>							
货币资金	22,978,860.38	-	-	-	-	-	22,978,860.38
结算备付金	1,966,298.13	-	-	-	-	-	1,966,298.13
存出保证金	87,523.54	-	-	-	-	-	87,523.54
交易性金融资产	-	-	-	-	-	318,714,550.35	318,714,550.35
应收申购款	0.03	-	-	-	-	8,955,902.85	8,955,902.88
资产总计	25,032,682.08	-	-	-	-	327,670,453.20	352,703,135.28
<b>负债</b>							
应付赎回款	-	-	-	-	-	159,319.31	159,319.31
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	336,855.75	336,855.75
应付托管费	-	-	-	-	-	56,142.60	56,142.60
应付销售服务费	-	-	-	-	-	114,473.89	114,473.89
其他负债	-	-	-	-	-	1,286,178.98	1,286,178.98
负债总计	-	-	-	-	-	1,952,970.53	1,952,970.53
利率敏感度缺口	25,032,682.08	-	-	-	-	325,717,482.67	350,750,164.75
<b>上年度末 2022年12月31日</b>							
<b>资产</b>							
货币资金	9,504,311.19	-	-	-	-	-	9,504,311.19
结算备付金	182,654.46	-	-	-	-	-	182,654.46
存出保证金	39,465.60	-	-	-	-	-	39,465.60
交易性金融资产	204,041.92	-	-	-	-	31,254,436.11	31,458,478.03
应收申购款	-	-	-	-	-	7,447.08	7,447.08
资产总计	9,930,473.17	-	-	-	-	31,261,883.19	41,192,356.36
<b>负债</b>							
应付赎回款	-	-	-	-	-	9,340.42	9,340.42
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	19,521.22	19,521.22
应付托管费	-	-	-	-	-	3,253.55	3,253.55
应付清算款	-	-	-	-	-	6,826,327.96	6,826,327.96
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,299.16	2,299.16

其他负债	-	-	-	-	248,245.00	248,245.00
负债总计	-	-	-	-	7,108,987.31	7,108,987.31
利率敏感度缺口	9,930,473.17	-	-	-	24,152,895.88	34,083,369.05

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	-	19.15
	2. 市场利率上升 25 个基点	-	-19.15

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	318,714,550.35	90.87	31,254,436.11	91.70
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-



交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	318,714,550.35	90.87	31,254,436.11	91.70

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除股票基准指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	1. 股票基准指数下降100个基点	-2,784,231.78	-295,470.86
	2. 股票基准指数上升100个基点	2,784,231.78	295,470.86

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	315,638,400.35	31,116,858.11
第二层次	3,076,150.00	341,619.92
第三层次	-	-

合计	318,714,550.35	31,458,478.03
----	----------------	---------------

**7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动**

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、新发未上市、涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

**7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况**

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。

**7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

本基金本期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

**7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

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

**7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

**§ 8 投资组合报告**

**8.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	318,714,550.35	90.36
	其中：股票	318,714,550.35	90.36
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	24,945,158.51	7.07

8	其他各项资产	9,043,426.42	2.56
9	合计	352,703,135.28	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	3,171,410.00	0.90
B	采矿业	9,435,345.00	2.69
C	制造业	195,840,396.22	55.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,478,131.00	2.70
E	建筑业	3,230,706.00	0.92
F	批发和零售业	9,432,721.00	2.69
G	交通运输、仓储和邮政业	3,057,600.00	0.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	50,468,302.00	14.39
J	金融业	9,521,070.00	2.71
K	房地产业	3,144,210.00	0.90
L	租赁和商务服务业	6,260,504.00	1.78
M	科学研究和技术服务业	3,155,373.13	0.90
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,098,645.00	0.88
R	文化、体育和娱乐业	9,420,137.00	2.69
S	综合	-	-
	合计	318,714,550.35	90.87

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603032	德新科技	176,200	3,576,860.00	1.02
2	600114	东睦股份	219,900	3,406,251.00	0.97
3	600312	平高电气	268,000	3,400,920.00	0.97
4	300226	上海钢联	117,300	3,341,877.00	0.95
5	688148	芳源股份	432,900	3,320,343.00	0.95
6	300532	今天国际	201,200	3,303,704.00	0.94

7	000962	东方钨业	265,900	3,294,501.00	0.94
8	603027	千禾味业	203,700	3,293,829.00	0.94
9	300630	普利制药	145,600	3,293,472.00	0.94
10	300433	蓝思科技	249,300	3,290,760.00	0.94
11	688289	圣湘生物	167,900	3,282,445.00	0.94
12	002042	华孚时尚	762,000	3,276,600.00	0.93
13	603633	徕木股份	341,700	3,273,486.00	0.93
14	002600	领益智造	483,200	3,266,432.00	0.93
15	300740	水羊股份	195,200	3,253,984.00	0.93
16	603256	宏和科技	390,500	3,248,960.00	0.93
17	688518	联赢激光	158,500	3,246,080.00	0.93
18	000831	中国稀土	117,300	3,245,691.00	0.93
19	300222	科大智能	440,200	3,239,872.00	0.92
20	600963	岳阳林纸	549,700	3,237,733.00	0.92
21	600237	铜峰电子	418,300	3,237,642.00	0.92
22	300900	广联航空	131,100	3,235,548.00	0.92
23	300403	汉宇集团	365,400	3,233,790.00	0.92
24	600970	中材国际	345,900	3,230,706.00	0.92
25	300079	数码视讯	567,700	3,230,213.00	0.92
26	603379	三美股份	94,900	3,226,600.00	0.92
27	002152	广电运通	262,800	3,221,928.00	0.92
28	300623	捷捷微电	202,800	3,218,436.00	0.92
29	600916	中国黄金	326,000	3,217,620.00	0.92
30	688588	凌志软件	270,300	3,216,570.00	0.92
31	600580	卧龙电驱	274,100	3,215,193.00	0.92
32	603969	银龙股份	535,500	3,213,000.00	0.92
33	603239	浙江仙通	210,400	3,212,808.00	0.92
34	300655	晶瑞电材	330,100	3,211,873.00	0.92
35	002746	仙坛股份	455,613	3,207,515.52	0.91
36	300166	东方国信	341,000	3,205,400.00	0.91
37	000719	中原传媒	329,400	3,205,062.00	0.91
38	300773	拉卡拉	199,800	3,204,792.00	0.91
39	603896	寿仙谷	99,400	3,204,656.00	0.91
40	002765	蓝黛科技	477,300	3,202,683.00	0.91
41	600276	恒瑞医药	70,800	3,202,284.00	0.91
42	600458	时代新材	347,090	3,196,698.90	0.91
43	600206	有研新材	257,800	3,194,142.00	0.91
44	002493	荣盛石化	308,300	3,190,905.00	0.91
45	000862	银星能源	523,800	3,189,942.00	0.91
45	002483	润邦股份	611,100	3,189,942.00	0.91
46	600990	四创电子	159,700	3,189,209.00	0.91
47	000686	东北证券	449,100	3,188,610.00	0.91
48	601606	长城军工	261,700	3,187,506.00	0.91

49	300231	银信科技	309,500	3,184,755.00	0.91
50	002190	成飞集成	167,600	3,179,372.00	0.91
51	601958	金钼股份	336,200	3,177,090.00	0.91
52	002274	华昌化工	420,600	3,175,530.00	0.91
53	601225	陕西煤业	152,000	3,175,280.00	0.91
54	002301	齐心集团	446,500	3,174,615.00	0.91
55	601788	光大证券	205,800	3,173,436.00	0.90
56	002243	力合科创	399,000	3,172,050.00	0.90
57	002234	民和股份	262,100	3,171,410.00	0.90
58	300674	宇信科技	194,800	3,171,344.00	0.90
59	300146	汤臣倍健	186,100	3,169,283.00	0.90
60	601698	中国卫通	183,000	3,167,730.00	0.90
61	603308	应流股份	221,000	3,166,930.00	0.90
62	002332	仙琚制药	247,700	3,163,129.00	0.90
63	300206	理邦仪器	309,500	3,159,995.00	0.90
64	002448	中原内配	475,800	3,159,312.00	0.90
65	601211	国泰君安	212,300	3,159,024.00	0.90
66	300465	高伟达	316,100	3,157,839.00	0.90
67	688238	和元生物	350,987	3,155,373.13	0.90
68	600201	生物股份	292,900	3,154,533.00	0.90
69	000685	中山公用	431,100	3,151,341.00	0.90
70	600859	王府井	197,300	3,150,881.00	0.90
71	002216	三全食品	235,000	3,149,000.00	0.90
72	002544	普天科技	154,900	3,147,568.00	0.90
73	300638	广和通	165,400	3,147,562.00	0.90
74	002183	怡亚通	701,900	3,144,512.00	0.90
75	600639	浦东金桥	311,000	3,144,210.00	0.90
76	300745	欣锐科技	115,600	3,140,852.00	0.90
77	600461	洪城环境	343,200	3,136,848.00	0.89
78	300397	天和防务	303,800	3,135,216.00	0.89
79	688068	热景生物	76,300	3,132,115.00	0.89
80	300747	锐科激光	133,100	3,131,843.00	0.89
81	300513	恒实科技	263,400	3,129,192.00	0.89
82	300365	恒华科技	462,400	3,125,824.00	0.89
83	300249	依米康	362,400	3,123,888.00	0.89
84	301102	兆讯传媒	162,800	3,115,992.00	0.89
85	300997	欢乐家	222,900	3,113,913.00	0.89
86	600757	长江传媒	417,200	3,108,140.00	0.89
87	601098	中南传媒	305,500	3,106,935.00	0.89
88	300143	盈康生命	291,500	3,098,645.00	0.88
89	002180	纳思达	136,900	3,098,047.00	0.88
90	600835	上海机电	260,400	3,090,948.00	0.88
91	600971	恒源煤电	276,500	3,082,975.00	0.88

92	000801	四川九洲	399,500	3,076,150.00	0.88
93	002401	中远海科	169,700	3,074,964.00	0.88
94	000901	航天科技	329,800	3,073,736.00	0.88
95	600278	东方创业	439,000	3,064,220.00	0.87
96	603885	吉祥航空	254,800	3,057,600.00	0.87
97	300299	富春股份	529,100	3,052,907.00	0.87
98	603360	百傲化学	284,340	3,005,473.80	0.86
99	600986	浙文互联	523,800	2,859,948.00	0.82

## 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	601155	新城控股	6,573,322.64	19.29
2	300226	上海钢联	6,244,864.00	18.32
3	300738	奥飞数据	5,800,678.00	17.02
4	002234	民和股份	5,455,565.00	16.01
5	600580	卧龙电驱	5,331,740.00	15.64
6	002544	普天科技	5,315,928.00	15.60
7	600757	长江传媒	4,998,143.00	14.66
8	600970	中材国际	4,827,124.00	14.16
9	601225	陕西煤业	4,794,256.00	14.07
10	300143	盈康生命	4,768,267.00	13.99
11	300397	天和防务	4,762,923.00	13.97
12	601098	中南传媒	4,647,788.00	13.64
13	300900	广联航空	4,606,020.00	13.51
14	002368	太极股份	4,603,573.32	13.51
15	605368	蓝天燃气	4,375,001.40	12.84
16	600846	同济科技	4,366,396.00	12.81
17	300365	恒华科技	4,362,399.00	12.80
18	300674	宇信科技	4,314,129.38	12.66
19	300138	晨光生物	4,311,049.00	12.65
20	300166	东方国信	4,205,644.00	12.34
21	600278	东方创业	4,177,251.00	12.26
22	600986	浙文互联	4,156,429.00	12.19
23	300529	健帆生物	4,133,160.00	12.13
24	300655	晶瑞电材	4,079,943.50	11.97
25	300253	卫宁健康	4,072,803.00	11.95
26	300299	富春股份	4,052,443.00	11.89
27	002301	齐心集团	4,043,236.00	11.86
28	002746	仙坛股份	4,030,180.86	11.82
29	600985	淮北矿业	4,012,604.00	11.77
30	300433	蓝思科技	4,004,833.00	11.75

31	603070	万控智造	3,958,324.00	11.61
32	300079	数码视讯	3,923,104.00	11.51
33	300532	今天国际	3,921,450.00	11.51
34	601958	金钼股份	3,911,083.00	11.48
35	600963	岳阳林纸	3,895,318.00	11.43
36	603032	德新科技	3,861,397.20	11.33
37	300513	恒实科技	3,855,394.00	11.31
38	600135	乐凯胶片	3,853,650.00	11.31
39	603379	三美股份	3,853,210.00	11.31
40	002493	荣盛石化	3,844,436.00	11.28
41	300231	银信科技	3,829,639.00	11.24
42	000901	航天科技	3,802,977.00	11.16
43	600639	浦东金桥	3,767,667.00	11.05
44	002180	纳思达	3,752,387.00	11.01
45	600916	中国黄金	3,750,028.00	11.00
46	002649	博彦科技	3,742,750.00	10.98
47	600732	爱旭股份	3,735,833.00	10.96
48	000685	中山公用	3,727,843.00	10.94
49	603360	百傲化学	3,718,402.60	10.91
50	000528	柳工	3,715,044.00	10.90
51	000818	航锦科技	3,703,601.00	10.87
52	688148	芳源股份	3,673,368.47	10.78
53	600739	辽宁成大	3,655,547.00	10.73
54	603858	步长制药	3,651,210.00	10.71
55	600312	平高电气	3,646,581.00	10.70
56	603308	应流股份	3,645,354.00	10.70
57	603027	千禾味业	3,645,132.00	10.69
58	600461	洪城环境	3,632,923.00	10.66
59	002600	领益智造	3,627,582.00	10.64
60	002448	中原内配	3,625,379.00	10.64
61	000505	京粮控股	3,623,498.00	10.63
62	002555	三七互娱	3,617,038.00	10.61
63	300623	捷捷微电	3,613,708.00	10.60
64	300699	光威复材	3,603,165.60	10.57
65	688289	圣湘生物	3,570,575.93	10.48
66	600206	有研新材	3,518,783.00	10.32
67	603633	徕木股份	3,511,755.00	10.30
68	600458	时代新材	3,510,848.00	10.30
69	300146	汤臣倍健	3,487,330.00	10.23
70	300773	拉卡拉	3,480,958.00	10.21
71	601606	长城军工	3,460,255.00	10.15
72	002274	华昌化工	3,458,080.00	10.15
73	300638	广和通	3,454,179.00	10.13

74	000686	东北证券	3,445,561.00	10.11
75	600859	王府井	3,444,545.00	10.11
76	600237	铜峰电子	3,438,963.00	10.09
77	600990	四创电子	3,433,834.00	10.07
78	600305	恒顺醋业	3,425,684.00	10.05
79	002152	广电运通	3,415,864.00	10.02
80	603920	世运电路	3,394,742.14	9.96
81	600171	上海贝岭	3,392,281.67	9.95
82	003006	百亚股份	3,390,444.00	9.95
83	300087	荃银高科	3,377,552.00	9.91
84	600276	恒瑞医药	3,372,775.00	9.90
85	688518	联赢激光	3,367,834.94	9.88
86	600737	中粮糖业	3,362,948.00	9.87
87	300386	飞天诚信	3,359,721.00	9.86
88	300586	美联新材	3,358,287.60	9.85
89	000768	中航西飞	3,352,765.00	9.84
90	603256	宏和科技	3,351,693.00	9.83
91	601788	光大证券	3,348,203.00	9.82
92	000970	中科三环	3,344,018.00	9.81
93	600876	凯盛新能	3,343,346.00	9.81
94	300465	高伟达	3,320,354.00	9.74
95	688068	热景生物	3,317,724.66	9.73
96	000831	中国稀土	3,317,215.00	9.73
97	600143	金发科技	3,312,507.00	9.72
98	300747	锐科激光	3,309,226.00	9.71
99	600835	上海机电	3,308,745.00	9.71
100	301102	兆讯传媒	3,306,092.00	9.70
101	603939	益丰药房	3,303,178.00	9.69
102	600038	中直股份	3,299,360.00	9.68
103	600114	东睦股份	3,296,485.00	9.67
104	688588	凌志软件	3,296,411.08	9.67
105	300825	阿尔特	3,295,990.00	9.67
106	600373	中文传媒	3,290,781.00	9.66
107	601801	皖新传媒	3,289,042.00	9.65
108	600096	云天化	3,278,308.00	9.62
109	688697	纽威数控	3,277,013.73	9.61
110	300926	博俊科技	3,272,865.00	9.60
111	002155	湖南黄金	3,271,700.00	9.60
112	600073	上海梅林	3,268,130.00	9.59
113	002422	科伦药业	3,266,131.00	9.58
114	000862	银星能源	3,262,519.00	9.57
115	600616	金枫酒业	3,259,769.00	9.56
116	002243	力合科创	3,259,359.00	9.56



117	300497	富祥药业	3,254,179.00	9.55
118	000801	四川九洲	3,251,473.69	9.54
119	603896	寿仙谷	3,242,241.00	9.51
120	300206	理邦仪器	3,234,230.00	9.49
121	600449	宁夏建材	3,228,073.00	9.47
122	601211	国泰君安	3,227,753.00	9.47
123	603398	沐邦高科	3,224,144.00	9.46
124	603158	腾龙股份	3,222,791.00	9.46
125	300222	科大智能	3,221,303.00	9.45
126	300740	水羊股份	3,221,294.00	9.45
127	600741	华域汽车	3,219,786.00	9.45
128	688187	时代电气	3,212,505.92	9.43
129	002332	仙琚制药	3,209,233.00	9.42
130	601156	东航物流	3,208,335.00	9.41
131	000906	浙商中拓	3,207,076.00	9.41
132	300771	智莱科技	3,206,443.00	9.41
133	002190	成飞集成	3,206,169.00	9.41
134	600326	西藏天路	3,201,015.00	9.39
135	688139	海尔生物	3,199,523.29	9.39
136	300403	汉宇集团	3,198,145.00	9.38
137	688238	和元生物	3,195,315.40	9.37
138	002042	华孚时尚	3,194,911.00	9.37
139	002474	榕基软件	3,193,165.00	9.37
140	002216	三全食品	3,191,653.00	9.36
141	603071	物产环能	3,191,651.00	9.36
142	300683	海特生物	3,189,458.19	9.36
143	600886	国投电力	3,178,562.00	9.33
144	600984	建设机械	3,176,257.65	9.32
145	603025	大豪科技	3,174,674.20	9.31
146	000962	东方钨业	3,169,602.00	9.30
147	600571	信雅达	3,167,575.00	9.29
148	600636	国新文化	3,166,994.00	9.29
149	605377	华旺科技	3,158,777.40	9.27
150	603239	浙江仙通	3,151,719.00	9.25
151	601698	中国卫通	3,150,647.00	9.24
152	000623	吉林敖东	3,150,315.00	9.24
153	300997	欢乐家	3,145,301.00	9.23
154	300630	普利制药	3,141,632.00	9.22
155	603885	吉祥航空	3,137,813.00	9.21
156	600266	城建发展	3,137,729.00	9.21
157	002537	海联金汇	3,137,169.00	9.20
158	600318	新力金融	3,137,055.00	9.20
159	300745	欣锐科技	3,135,600.00	9.20

160	600415	小商品城	3,129,787.00	9.18
161	603969	银龙股份	3,127,566.00	9.18
162	002183	怡亚通	3,121,607.00	9.16
163	300302	同有科技	3,110,601.00	9.13
164	002765	蓝黛科技	3,105,530.00	9.11
165	002940	昂利康	3,102,397.95	9.10
166	002483	润邦股份	3,101,697.00	9.10
167	300121	阳谷华泰	3,100,374.00	9.10
168	002129	TCL 中环	3,094,239.00	9.08
169	300249	依米康	3,091,600.00	9.07
170	000719	中原传媒	3,089,298.00	9.06
171	601001	晋控煤业	3,076,948.00	9.03
172	601928	凤凰传媒	3,073,793.34	9.02
173	002401	中远海科	3,073,476.00	9.02
174	600201	生物股份	3,065,723.00	8.99
175	600330	天通股份	3,043,259.00	8.93
176	603227	雪峰科技	3,042,858.00	8.93
177	600971	恒源煤电	3,038,144.00	8.91
178	002027	分众传媒	3,033,551.00	8.90
179	603712	七一二	3,021,092.00	8.86
180	600597	光明乳业	3,019,309.00	8.86
181	688261	东微半导	3,012,300.28	8.84
182	002582	好想你	2,987,051.00	8.76
183	600048	保利发展	2,986,395.00	8.76
184	601995	中金公司	2,971,948.00	8.72
185	300472	新元科技	2,952,678.80	8.66
186	600482	中国动力	2,940,353.00	8.63
187	300578	会畅通讯	2,935,768.00	8.61
188	002979	雷赛智能	2,914,987.00	8.55
189	603093	南华期货	2,914,517.00	8.55
190	000738	航发控制	2,893,369.78	8.49
191	002815	崇达技术	2,877,838.00	8.44
192	600268	国电南自	2,874,632.00	8.43
193	600797	浙大网新	2,869,717.00	8.42
194	600416	湘电股份	2,860,155.00	8.39
195	300999	金龙鱼	2,852,156.00	8.37
196	002507	涪陵榨菜	2,831,378.40	8.31
197	002669	康达新材	2,824,313.00	8.29
198	600683	京投发展	2,821,273.00	8.28
199	300065	海兰信	2,813,177.00	8.25
200	002908	德生科技	2,803,613.00	8.23
201	600850	电科数字	2,799,087.00	8.21
202	688179	阿拉丁	2,797,399.36	8.21

203	001914	招商积余	2,794,198.00	8.20
204	600660	福耀玻璃	2,792,962.00	8.19
205	000852	石化机械	2,789,446.00	8.18
206	000733	振华科技	2,786,598.00	8.18
207	002548	金新农	2,779,483.87	8.15
208	600987	航民股份	2,744,182.00	8.05
209	002434	万里扬	2,722,952.00	7.99
210	688007	光峰科技	2,722,570.08	7.99
211	601456	国联证券	2,696,271.00	7.91
212	600012	皖通高速	2,641,011.00	7.75
213	002585	双星新材	2,622,401.00	7.69
214	600299	安迪苏	2,611,117.00	7.66
215	002423	中粮资本	2,606,208.00	7.65
216	603138	海量数据	2,598,455.00	7.62
217	002777	久远银海	2,585,743.00	7.59
218	600037	歌华有线	2,570,627.00	7.54
219	600873	梅花生物	2,566,242.99	7.53
220	002082	万邦德	2,560,847.00	7.51
221	600818	中路股份	2,550,900.00	7.48
222	300188	国投智能	2,545,949.00	7.47
223	300382	斯莱克	2,540,637.00	7.45
224	601058	赛轮轮胎	2,539,118.98	7.45
225	600584	长电科技	2,539,093.00	7.45
226	600158	中体产业	2,538,698.00	7.45
227	600328	中盐化工	2,537,115.50	7.44
228	600501	航天晨光	2,536,881.00	7.44
229	300785	值得买	2,530,254.00	7.42
230	603918	金桥信息	2,529,615.00	7.42
231	603330	天洋新材	2,523,108.00	7.40
232	600528	中铁工业	2,514,052.16	7.38
233	300024	机器人	2,511,469.00	7.37
234	300490	华自科技	2,501,475.00	7.34
235	300396	迪瑞医疗	2,499,538.00	7.33
236	002675	东诚药业	2,485,468.00	7.29
237	002897	意华股份	2,472,829.00	7.26
238	603387	基蛋生物	2,470,358.80	7.25
239	600783	鲁信创投	2,458,879.00	7.21
240	000999	华润三九	2,456,382.00	7.21
241	000723	美锦能源	2,444,677.00	7.17
242	603662	柯力传感	2,427,902.00	7.12
243	688277	天智航	2,387,240.88	7.00
244	601595	上海电影	2,383,688.00	6.99
245	002961	瑞达期货	2,302,115.00	6.75

246	300229	拓尔思	2,285,890.00	6.71
247	600435	北方导航	2,163,118.00	6.35
248	300766	每日互动	2,142,541.00	6.29
249	002753	永东股份	2,137,359.00	6.27
250	000917	电广传媒	2,137,232.00	6.27
251	002182	宝武镁业	2,134,033.00	6.26
252	002402	和而泰	2,122,309.00	6.23
253	300872	天阳科技	2,122,173.00	6.23
254	300541	先进数通	2,110,533.00	6.19
255	300455	航天智装	2,100,744.00	6.16
256	000737	北方铜业	2,092,257.00	6.14
257	300257	开山股份	2,091,708.00	6.14
258	002727	一心堂	2,083,839.00	6.11
259	600351	亚宝药业	2,081,411.00	6.11
260	002428	云南锗业	2,057,434.00	6.04
261	300510	金冠股份	2,039,620.00	5.98
262	000925	众合科技	2,037,102.25	5.98
263	600549	厦门钨业	2,021,941.00	5.93
264	001979	招商蛇口	2,009,906.00	5.90
265	600562	国睿科技	1,997,655.00	5.86
266	002975	博杰股份	1,972,143.00	5.79
267	300105	龙源技术	1,942,833.00	5.70
268	603619	中曼石油	1,901,130.00	5.58
269	600271	航天信息	1,894,364.00	5.56
270	002253	川大智胜	1,848,911.00	5.42
271	300055	万邦达	1,827,901.00	5.36
272	603987	康德莱	1,800,592.00	5.28
273	300213	佳讯飞鸿	1,784,815.00	5.24
274	600837	海通证券	1,773,704.00	5.20
275	002078	太阳纸业	1,730,553.00	5.08
276	600531	豫光金铅	1,720,825.00	5.05
277	300058	蓝色光标	1,711,218.00	5.02
278	603219	富佳股份	1,692,698.22	4.97
279	002242	九阳股份	1,656,019.00	4.86
280	002658	雪迪龙	1,654,787.00	4.86
281	000582	北部湾港	1,641,857.12	4.82
282	600420	国药现代	1,635,229.00	4.80
283	300007	汉威科技	1,634,153.78	4.79
284	600483	福能股份	1,606,665.00	4.71
285	600663	陆家嘴	1,599,011.04	4.69
286	300552	万集科技	1,591,268.00	4.67
287	300542	新晨科技	1,590,159.00	4.67
288	605555	德昌股份	1,583,975.00	4.65

289	600570	恒生电子	1,578,176.00	4.63
290	300113	顺网科技	1,571,736.00	4.61
291	603191	望变电气	1,569,312.00	4.60
292	300377	赢时胜	1,567,415.00	4.60
293	002019	亿帆医药	1,557,151.00	4.57
294	300680	隆盛科技	1,550,530.00	4.55
295	000919	金陵药业	1,544,312.00	4.53
296	603650	彤程新材	1,534,426.00	4.50
297	600710	苏美达	1,532,556.00	4.50
298	002925	盈趣科技	1,531,250.00	4.49
299	002446	盛路通信	1,530,344.00	4.49
300	300383	光环新网	1,515,272.00	4.45
301	600498	烽火通信	1,511,684.00	4.44
302	000636	风华高科	1,507,743.00	4.42
303	300969	恒帅股份	1,496,993.00	4.39
304	300830	金现代	1,494,068.00	4.38
305	601881	中国银河	1,480,815.00	4.34
306	002819	东方中科	1,479,663.00	4.34
307	300580	贝斯特	1,436,548.00	4.21
308	000938	紫光股份	1,432,617.00	4.20
309	600718	东软集团	1,430,784.00	4.20
310	000557	西部创业	1,414,387.00	4.15
311	300319	麦捷科技	1,408,980.00	4.13
312	002214	大立科技	1,399,429.20	4.11
313	603979	金诚信	1,352,931.82	3.97
314	000829	天音控股	1,350,700.00	3.96
315	603993	洛阳钼业	1,343,864.00	3.94
316	300244	迪安诊断	1,341,769.00	3.94
317	002212	天融信	1,338,215.00	3.93
318	002454	松芝股份	1,329,240.00	3.90
319	301025	读客文化	1,321,462.00	3.88
320	300224	正海磁材	1,307,525.00	3.84
321	002284	亚太股份	1,303,063.00	3.82
322	002318	久立特材	1,299,436.00	3.81
323	002140	东华科技	1,299,084.00	3.81
324	300527	中船应急	1,291,604.00	3.79
325	600377	宁沪高速	1,270,926.00	3.73
326	300682	朗新集团	1,270,543.00	3.73
327	603018	华设集团	1,270,283.00	3.73
328	601666	平煤股份	1,268,397.00	3.72
329	000555	神州信息	1,244,029.00	3.65
330	002227	奥特迅	1,242,832.00	3.65
331	300203	聚光科技	1,238,046.00	3.63

332	603881	数据港	1,235,116.68	3.62
333	300320	海达股份	1,234,368.00	3.62
334	300378	鼎捷软件	1,227,119.00	3.60
335	000581	威孚高科	1,222,350.00	3.59
336	300099	尤洛卡	1,194,881.00	3.51
337	601898	中煤能源	1,192,875.00	3.50
338	002758	浙农股份	1,192,854.00	3.50
339	300416	苏试试验	1,192,487.70	3.50
340	300389	艾比森	1,187,372.00	3.48
341	603128	华贸物流	1,184,317.00	3.47
342	301363	美好医疗	1,182,420.97	3.47
343	300393	中来股份	1,179,731.00	3.46
344	600028	中国石化	1,178,211.00	3.46
345	002380	科远智慧	1,176,383.00	3.45
346	301116	益客食品	1,172,948.00	3.44
347	600026	中远海能	1,171,900.00	3.44
348	601028	玉龙股份	1,169,114.81	3.43
349	000301	东方盛虹	1,160,283.00	3.40
350	300903	科翔股份	1,151,996.40	3.38
351	002128	电投能源	1,102,814.00	3.24
352	600160	巨化股份	1,073,899.00	3.15
353	300161	华中数控	1,069,499.00	3.14
354	603429	集友股份	1,026,684.00	3.01
355	600309	万华化学	1,019,332.00	2.99
356	600273	嘉化能源	1,015,367.00	2.98
357	003005	竞业达	1,005,940.00	2.95
358	688183	生益电子	983,380.86	2.89
359	600398	海澜之家	958,748.00	2.81
360	600353	旭光电子	957,871.00	2.81
361	002625	光启技术	951,457.00	2.79
362	601126	四方股份	947,868.00	2.78
363	000885	城发环境	938,842.00	2.75
364	601369	陕鼓动力	936,524.00	2.75
365	600478	科力远	936,422.00	2.75
366	300404	博济医药	920,774.00	2.70
367	002867	周大生	920,378.00	2.70
368	600993	马应龙	920,372.00	2.70
369	601377	兴业证券	915,443.00	2.69
370	300762	上海瀚讯	909,867.00	2.67
371	000026	飞亚达	905,505.00	2.66
372	603912	佳力图	901,440.00	2.64
373	603707	健友股份	901,420.00	2.64
374	600223	福瑞达	897,357.00	2.63

375	002860	星帅尔	890,164.00	2.61
376	300307	慈星股份	887,960.00	2.61
377	002053	云南能投	886,702.00	2.60
378	600125	铁龙物流	877,593.00	2.57
379	300068	南都电源	875,389.00	2.57
380	300531	优博讯	875,210.00	2.57
381	603567	珍宝岛	874,845.00	2.57
382	300732	设研院	873,795.40	2.56
383	600877	电科芯片	872,274.00	2.56
384	002023	海特高新	870,662.00	2.55
385	300314	戴维医疗	870,580.00	2.55
386	601688	华泰证券	869,211.00	2.55
387	603013	亚普股份	869,189.00	2.55
388	600685	中船防务	868,607.00	2.55
389	002500	山西证券	868,348.00	2.55
390	002527	新时达	868,137.00	2.55
391	002339	积成电子	860,417.00	2.52
392	600084	中信尼雅	855,829.00	2.51
393	002065	东华软件	850,943.00	2.50
394	002297	博云新材	849,948.00	2.49
395	000905	厦门港务	848,170.00	2.49
396	300351	永贵电器	815,934.00	2.39
397	002273	水晶光电	774,638.00	2.27
398	300410	正业科技	772,871.00	2.27
399	002320	海峡股份	771,713.00	2.26
400	600153	建发股份	770,769.00	2.26
401	000998	隆平高科	765,886.00	2.25
402	300081	恒信东方	755,033.00	2.22
403	002387	维信诺	754,831.00	2.21
404	688425	铁建重工	751,988.57	2.21
405	603660	苏州科达	748,654.00	2.20
406	600061	国投资本	744,743.00	2.19
407	600602	云赛智联	734,700.00	2.16
408	002549	凯美特气	734,400.00	2.15
409	002465	海格通信	726,225.00	2.13
410	300686	智动力	724,290.00	2.13
411	002184	海得控制	722,248.00	2.12
412	600161	天坛生物	719,269.00	2.11
413	600348	华阳股份	716,310.00	2.10
414	002092	中泰化学	715,969.00	2.10
415	000888	峨眉山 A	714,013.00	2.09
416	600372	中航机载	712,625.00	2.09
417	002706	良信股份	710,834.00	2.09

418	300102	乾照光电	710,340.00	2.08
419	600855	航天长峰	709,681.00	2.08
420	002298	中电兴发	703,307.00	2.06
421	300427	*ST 红相	703,198.00	2.06
422	002670	国盛金控	701,978.00	2.06
423	600251	冠农股份	700,264.00	2.05
424	301018	申菱环境	699,324.00	2.05
425	002250	联化科技	695,090.00	2.04
426	002769	普路通	693,258.00	2.03
427	000830	鲁西化工	691,666.00	2.03
428	600359	新农开发	689,853.00	2.02
429	300752	隆利科技	688,425.00	2.02
430	600133	东湖高新	686,516.00	2.01
431	002121	科陆电子	686,101.00	2.01
432	300348	长亮科技	686,012.00	2.01
433	600481	双良节能	684,224.00	2.01
434	002391	长青股份	683,180.00	2.00

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601155	新城控股	6,880,526.72	20.19
2	300738	奥飞数据	5,842,280.67	17.14
3	600571	信雅达	5,419,805.80	15.90
4	600985	淮北矿业	4,336,100.63	12.72
5	002368	太极股份	4,331,233.00	12.71
6	600846	同济科技	4,303,173.00	12.63
7	605368	蓝天燃气	4,267,078.20	12.52
8	002649	博彦科技	4,130,090.00	12.12
9	300529	健帆生物	4,084,841.00	11.98
10	600636	国新文化	4,050,052.00	11.88
11	300138	晨光生物	3,944,225.00	11.57
12	601156	东航物流	3,857,142.78	11.32
13	603070	万控智造	3,847,644.00	11.29
14	601801	皖新传媒	3,802,364.00	11.16
15	600135	乐凯胶片	3,778,347.00	11.09
16	000528	柳工	3,778,217.00	11.09
17	300253	卫宁健康	3,739,632.00	10.97
18	600732	爱旭股份	3,711,384.40	10.89
19	300699	光威复材	3,692,588.40	10.83
20	600449	宁夏建材	3,664,171.00	10.75
21	603858	步长制药	3,635,813.00	10.67



22	000818	航锦科技	3,550,658.00	10.42
23	300386	飞天诚信	3,544,002.00	10.40
24	600266	城建发展	3,511,992.00	10.30
25	300926	博俊科技	3,500,951.00	10.27
26	601928	凤凰传媒	3,499,425.72	10.27
27	300121	阳谷华泰	3,461,093.00	10.15
28	600739	辽宁成大	3,446,611.69	10.11
29	603920	世运电路	3,437,814.00	10.09
30	300825	阿尔特	3,433,957.00	10.08
31	603158	腾龙股份	3,426,614.00	10.05
32	002422	科伦药业	3,393,720.00	9.96
33	000505	京粮控股	3,383,761.00	9.93
34	603398	沐邦高科	3,374,755.00	9.90
35	600305	恒顺醋业	3,373,525.00	9.90
36	300771	智莱科技	3,359,839.00	9.86
37	603712	七一二	3,352,642.00	9.84
38	600143	金发科技	3,343,299.00	9.81
39	600038	中直股份	3,341,178.00	9.80
40	600876	凯盛新能	3,327,781.00	9.76
41	600886	国投电力	3,326,494.00	9.76
42	600737	中粮糖业	3,309,139.00	9.71
43	002979	雷赛智能	3,273,849.00	9.61
44	600616	金枫酒业	3,266,802.00	9.58
45	002908	德生科技	3,249,301.00	9.53
46	600318	新力金融	3,244,712.00	9.52
47	600073	上海梅林	3,241,375.00	9.51
48	603939	益丰药房	3,218,860.00	9.44
49	603071	物产环能	3,213,463.00	9.43
50	603025	大豪科技	3,210,467.80	9.42
51	688261	东微半导	3,203,744.82	9.40
52	300226	上海钢联	3,187,077.96	9.35
53	002582	好想你	3,175,857.00	9.32
54	000768	中航西飞	3,174,813.00	9.31
55	000970	中科三环	3,165,111.00	9.29
56	600984	建设机械	3,165,028.03	9.29
57	601995	中金公司	3,163,833.00	9.28
58	601001	晋控煤业	3,158,231.00	9.27
59	600597	光明乳业	3,156,614.00	9.26
60	002548	金新农	3,150,622.36	9.24
61	605377	华旺科技	3,141,675.80	9.22
62	000906	浙商中拓	3,130,739.00	9.19
63	003006	百亚股份	3,128,494.00	9.18
64	300683	海特生物	3,120,759.00	9.16

65	600415	小商品城	3,118,467.00	9.15
66	600741	华域汽车	3,117,426.53	9.15
67	600326	西藏天路	3,103,997.00	9.11
68	002555	三七互娱	3,103,286.00	9.10
69	300472	新元科技	3,091,654.00	9.07
70	002537	海联金汇	3,078,428.00	9.03
71	300065	海兰信	3,050,157.00	8.95
72	002474	榕基软件	3,049,690.00	8.95
73	600797	浙大网新	3,033,526.05	8.90
74	688139	海尔生物	3,032,736.77	8.90
75	601456	国联证券	3,027,710.00	8.88
76	600096	云天化	3,020,587.00	8.86
77	300087	荃银高科	3,020,163.00	8.86
78	600171	上海贝岭	3,018,545.90	8.86
79	002815	崇达技术	3,005,274.00	8.82
80	002940	昂利康	3,000,891.66	8.80
81	300497	富祥药业	2,993,360.00	8.78
82	000623	吉林敖东	2,992,582.50	8.78
83	600330	天通股份	2,984,151.00	8.76
84	002155	湖南黄金	2,979,830.00	8.74
85	600987	航民股份	2,959,472.00	8.68
86	603093	南华期货	2,947,134.00	8.65
87	600683	京投发展	2,942,112.00	8.63
88	300578	会畅通讯	2,940,285.00	8.63
89	600482	中国动力	2,939,210.00	8.62
90	600373	中文传媒	2,935,426.00	8.61
91	688697	纽威数控	2,933,514.87	8.61
92	603330	天洋新材	2,929,419.00	8.59
93	688187	时代电气	2,925,137.27	8.58
94	300302	同有科技	2,918,190.00	8.56
95	002777	久远银海	2,917,182.00	8.56
96	300586	美联新材	2,908,943.20	8.53
97	002129	TCL 中环	2,880,851.00	8.45
98	600268	国电南自	2,871,287.00	8.42
99	300396	迪瑞医疗	2,855,530.00	8.38
100	002027	分众传媒	2,851,965.00	8.37
101	601595	上海电影	2,846,454.00	8.35
102	000738	航发控制	2,842,167.76	8.34
103	600048	保利发展	2,819,313.00	8.27
104	600660	福耀玻璃	2,812,876.00	8.25
105	002507	涪陵榨菜	2,805,007.70	8.23
106	000733	振华科技	2,804,466.00	8.23
107	603227	雪峰科技	2,794,169.00	8.20

108	600416	湘电股份	2,786,546.00	8.18
109	002669	康达新材	2,782,362.00	8.16
110	603918	金桥信息	2,757,413.00	8.09
111	600850	电科数字	2,747,009.00	8.06
112	001914	招商积余	2,739,940.78	8.04
113	300999	金龙鱼	2,728,405.00	8.01
114	688179	阿拉丁	2,713,848.35	7.96
115	688007	光峰科技	2,713,421.07	7.96
116	300785	值得买	2,708,808.00	7.95
117	603662	柯力传感	2,704,147.00	7.93
118	002897	意华股份	2,693,541.00	7.90
119	002585	双星新材	2,673,804.00	7.84
120	600037	歌华有线	2,671,540.00	7.84
121	300188	国投智能	2,670,798.00	7.84
122	000852	石化机械	2,665,254.00	7.82
123	300382	斯莱克	2,662,806.00	7.81
124	002434	万里扬	2,661,734.00	7.81
125	300490	华自科技	2,645,955.85	7.76
126	600501	航天晨光	2,629,437.00	7.71
127	603138	海量数据	2,628,299.00	7.71
128	002082	万邦德	2,607,009.00	7.65
129	300455	航天智装	2,602,928.00	7.64
130	600584	长电科技	2,595,740.00	7.62
131	600012	皖通高速	2,592,694.00	7.61
132	600299	安迪苏	2,580,234.00	7.57
133	002675	东诚药业	2,578,438.00	7.57
134	600580	卧龙电驱	2,545,284.00	7.47
135	300024	机器人	2,538,660.00	7.45
136	600818	中路股份	2,531,228.00	7.43
137	600873	梅花生物	2,519,304.00	7.39
138	603387	基蛋生物	2,508,116.60	7.36
139	000723	美锦能源	2,492,907.00	7.31
140	600783	鲁信创投	2,482,301.00	7.28
141	600158	中体产业	2,477,694.00	7.27
142	600328	中盐化工	2,466,965.10	7.24
143	688277	天智航	2,465,828.04	7.23
144	002423	中粮资本	2,454,573.00	7.20
145	000999	华润三九	2,439,297.00	7.16
146	600528	中铁工业	2,423,431.76	7.11
147	300105	龙源技术	2,410,884.00	7.07
148	601058	赛轮轮胎	2,353,528.97	6.91
149	002753	永东股份	2,313,988.00	6.79
150	002182	宝武镁业	2,251,251.00	6.61

151	300541	先进数通	2,247,553.00	6.59
152	002961	瑞达期货	2,237,807.00	6.57
153	300872	天阳科技	2,174,698.00	6.38
154	300229	拓尔思	2,174,004.00	6.38
155	600435	北方导航	2,154,882.00	6.32
156	002234	民和股份	2,148,020.00	6.30
157	300766	每日互动	2,141,528.00	6.28
158	000737	北方铜业	2,116,605.00	6.21
159	002428	云南锗业	2,111,927.00	6.20
160	002975	博杰股份	2,105,813.00	6.18
161	002253	川大智胜	2,105,161.00	6.18
162	002727	一心堂	2,098,690.00	6.16
163	002402	和而泰	2,085,195.00	6.12
164	603219	富佳股份	2,083,058.00	6.11
165	300257	开山股份	2,075,059.00	6.09
166	001979	招商蛇口	2,061,837.00	6.05
167	000925	众合科技	2,061,772.40	6.05
168	300510	金冠股份	2,061,278.00	6.05
169	000917	电广传媒	2,000,456.00	5.87
170	002544	普天科技	1,969,861.00	5.78
171	600562	国睿科技	1,937,164.00	5.68
172	600549	厦门钨业	1,933,094.00	5.67
173	600351	亚宝药业	1,924,939.00	5.65
174	600498	烽火通信	1,916,269.00	5.62
175	603619	中曼石油	1,879,686.00	5.51
176	300213	佳讯飞鸿	1,879,318.00	5.51
177	300055	万邦达	1,855,508.00	5.44
178	600271	航天信息	1,838,216.00	5.39
179	300319	麦捷科技	1,832,294.00	5.38
180	603987	康德莱	1,825,073.00	5.35
181	600837	海通证券	1,821,569.41	5.34
182	601225	陕西煤业	1,806,758.00	5.30
183	605555	德昌股份	1,802,174.00	5.29
184	002078	太阳纸业	1,787,149.00	5.24
185	300058	蓝色光标	1,766,517.00	5.18
186	300143	盈康生命	1,743,336.00	5.11
187	300113	顺网科技	1,692,042.00	4.96
188	603650	彤程新材	1,685,098.00	4.94
189	300552	万集科技	1,671,758.00	4.90
190	300007	汉威科技	1,661,479.00	4.87
191	600970	中材国际	1,653,620.00	4.85
192	002446	盛路通信	1,648,235.00	4.84
193	300389	艾比森	1,631,067.00	4.79

194	300542	新晨科技	1,631,064.00	4.79
195	600483	福能股份	1,628,879.00	4.78
196	600420	国药现代	1,627,056.00	4.77
197	002019	亿帆医药	1,625,391.00	4.77
198	002284	亚太股份	1,613,879.00	4.74
199	300377	赢时胜	1,609,551.00	4.72
200	600531	豫光金铅	1,608,550.00	4.72
201	300383	光环新网	1,589,998.00	4.67
202	600757	长江传媒	1,581,841.00	4.64
203	000919	金陵药业	1,575,754.00	4.62
204	300580	贝斯特	1,571,346.00	4.61
205	002242	九阳股份	1,565,432.00	4.59
206	000636	风华高科	1,562,629.00	4.58
207	600570	恒生电子	1,561,000.10	4.58
208	000582	北部湾港	1,558,891.55	4.57
209	600663	陆家嘴	1,547,484.00	4.54
210	002658	雪迪龙	1,546,995.00	4.54
211	603191	望变电气	1,546,692.00	4.54
212	600710	苏美达	1,530,150.00	4.49
213	300680	隆盛科技	1,521,452.00	4.46
214	300830	金现代	1,505,493.00	4.42
215	002819	东方中科	1,472,581.00	4.32
216	300969	恒帅股份	1,470,082.00	4.31
217	601881	中国银河	1,452,266.00	4.26
218	002925	盈趣科技	1,447,891.00	4.25
219	000557	西部创业	1,399,347.00	4.11
220	000829	天音控股	1,394,887.00	4.09
221	002454	松芝股份	1,391,766.00	4.08
222	002214	大立科技	1,373,057.40	4.03
223	601666	平煤股份	1,365,868.00	4.01
224	600718	东软集团	1,358,418.00	3.99
225	300224	正海磁材	1,358,099.00	3.98
226	300244	迪安诊断	1,350,802.00	3.96
227	301363	美好医疗	1,337,123.00	3.92
228	600377	宁沪高速	1,330,090.00	3.90
229	000885	城发环境	1,321,185.00	3.88
230	600026	中远海能	1,314,576.00	3.86
231	603979	金诚信	1,312,519.00	3.85
232	301025	读客文化	1,307,797.00	3.84
233	000581	威孚高科	1,303,141.00	3.82
234	000938	紫光股份	1,286,960.00	3.78
235	603993	洛阳钼业	1,281,090.00	3.76
236	300527	中船应急	1,272,123.00	3.73

237	002318	久立特材	1,272,058.00	3.73
238	002140	东华科技	1,268,239.00	3.72
239	000555	神州信息	1,264,667.00	3.71
240	603018	华设集团	1,256,812.00	3.69
241	300900	广联航空	1,250,028.00	3.67
242	300203	聚光科技	1,244,518.00	3.65
243	002227	奥特迅	1,239,487.00	3.64
244	300397	天和防务	1,214,201.00	3.56
245	002212	天融信	1,211,726.00	3.56
246	300682	朗新集团	1,204,714.00	3.53
247	300320	海达股份	1,197,703.00	3.51
248	300378	鼎捷软件	1,195,768.00	3.51
249	601898	中煤能源	1,191,865.00	3.50
250	002758	浙农股份	1,191,678.00	3.50
251	300099	尤洛卡	1,189,324.00	3.49
252	601098	中南传媒	1,185,339.00	3.48
253	002380	科远智慧	1,178,262.00	3.46
254	300416	苏试试验	1,176,523.00	3.45
255	603881	数据港	1,169,820.36	3.43
256	300393	中来股份	1,168,756.00	3.43
257	601028	玉龙股份	1,161,049.00	3.41
258	000301	东方盛虹	1,147,501.00	3.37
259	301116	益客食品	1,143,398.00	3.35
260	600028	中国石化	1,139,441.00	3.34
261	300674	宇信科技	1,133,955.00	3.33
262	300903	科翔股份	1,130,745.00	3.32
263	300161	华中数控	1,122,309.00	3.29
264	600061	国投资本	1,114,867.00	3.27
265	600160	巨化股份	1,109,328.00	3.25
266	002128	电投能源	1,107,672.00	3.25
267	003005	竞业达	1,101,496.00	3.23
268	600278	东方创业	1,098,307.00	3.22
269	603128	华贸物流	1,072,074.00	3.15
270	600309	万华化学	1,066,277.00	3.13
271	300752	隆利科技	1,056,352.00	3.10
272	002527	新时达	1,056,287.00	3.10
273	600602	云赛智联	1,049,432.00	3.08
274	600273	嘉化能源	1,042,700.00	3.06
275	300404	博济医药	1,009,847.00	2.96
276	603429	集友股份	1,005,264.00	2.95
277	600398	海澜之家	997,465.00	2.93
278	688183	生益电子	973,554.08	2.86
279	600353	旭光电子	972,375.00	2.85

280	601688	华泰证券	966,704.00	2.84
281	603567	珍宝岛	966,066.00	2.83
282	300433	蓝思科技	950,662.00	2.79
283	600877	电科芯片	941,578.00	2.76
284	002023	海特高新	937,557.00	2.75
285	601126	四方股份	932,719.00	2.74
286	002339	积成电子	930,189.00	2.73
287	601377	兴业证券	928,257.00	2.72
288	300314	戴维医疗	926,929.00	2.72
289	002867	周大生	920,269.00	2.70
290	300732	设研院	918,806.20	2.70
291	300762	上海瀚讯	918,239.00	2.69
292	002297	博云新材	911,999.00	2.68
293	300307	慈星股份	910,981.00	2.67
294	603707	健友股份	908,247.00	2.66
295	600223	福瑞达	901,081.00	2.64
296	002301	齐心集团	899,036.00	2.64
297	600621	华鑫股份	896,134.00	2.63
298	002860	星帅尔	895,612.00	2.63
299	300531	优博讯	891,667.00	2.62
300	600993	马应龙	889,956.00	2.61
301	002625	光启技术	888,048.00	2.61
302	000026	飞亚达	884,787.00	2.60
303	600125	铁龙物流	882,499.00	2.59
304	600312	平高电气	879,901.00	2.58
305	600478	科力远	876,794.00	2.57
306	300365	恒华科技	876,536.00	2.57
307	600084	中信尼雅	876,224.00	2.57
308	300231	银信科技	874,596.00	2.57
309	603660	苏州科达	872,253.00	2.56
310	603013	亚普股份	871,284.00	2.56
311	601369	陕鼓动力	866,699.00	2.54
312	002065	东华软件	859,626.00	2.52
313	603912	佳力图	858,548.00	2.52
314	600685	中船防务	853,205.00	2.50
315	300068	南都电源	844,397.00	2.48
316	002053	云南能投	844,354.00	2.48
317	301149	隆华新材	843,889.00	2.48
318	600380	健康元	841,624.00	2.47
319	000888	峨眉山 A	839,130.00	2.46
320	300251	光线传媒	838,795.00	2.46
321	002387	维信诺	829,101.00	2.43
322	603626	科森科技	822,584.00	2.41

323	300520	科大国创	818,689.00	2.40
324	000905	厦门港务	817,532.00	2.40
325	603379	三美股份	816,798.00	2.40
326	002500	山西证券	814,158.00	2.39
327	002465	海格通信	784,084.00	2.30
328	300081	恒信东方	778,353.00	2.28
329	601607	上海医药	776,395.20	2.28
330	000807	云铝股份	771,488.00	2.26
331	688425	铁建重工	766,081.08	2.25
332	002273	水晶光电	755,885.00	2.22
333	000998	隆平高科	754,625.00	2.21
334	300348	长亮科技	749,691.00	2.20
335	601108	财通证券	743,838.00	2.18
336	002298	中电兴发	740,290.00	2.17
337	002670	国盛金控	739,920.00	2.17
338	300351	永贵电器	738,033.00	2.17
339	300102	乾照光电	736,370.00	2.16
340	002320	海峡股份	735,491.00	2.16
341	300686	智动力	733,610.00	2.15
342	601555	东吴证券	733,095.00	2.15
343	002746	仙坛股份	732,615.00	2.15
344	600161	天坛生物	732,497.00	2.15
345	600153	建发股份	730,913.00	2.14
346	600855	航天长峰	730,865.00	2.14
347	600879	航天电子	730,233.00	2.14
348	002184	海得控制	727,902.00	2.14
349	600251	冠农股份	727,761.00	2.14
350	002549	凯美特气	725,046.00	2.13
351	600590	泰豪科技	724,615.00	2.13
352	601966	玲珑轮胎	724,185.00	2.12
353	000811	冰轮环境	720,643.00	2.11
354	600583	海油工程	718,303.00	2.11
355	002092	中泰化学	717,817.00	2.11
356	600348	华阳股份	715,613.00	2.10
357	000703	恒逸石化	715,269.00	2.10
358	601111	中国国航	712,612.10	2.09
359	600372	中航机载	711,974.00	2.09
360	002493	荣盛石化	710,733.00	2.09
361	301018	申菱环境	710,605.04	2.08
362	002068	黑猫股份	703,053.00	2.06
363	600481	双良节能	698,057.00	2.05
364	000830	鲁西化工	696,949.00	2.04
365	002736	国信证券	695,796.00	2.04



366	300410	正业科技	693,811.00	2.04
367	000931	中 关 村	689,613.52	2.02
368	002250	联化科技	688,153.00	2.02
369	002706	良信股份	688,013.00	2.02
370	002729	好利科技	685,467.00	2.01
371	600929	雪天盐业	683,827.00	2.01

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

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,219,488,220.10
卖出股票收入（成交）总额	937,300,712.83

注：本项买入金额均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用；本项卖出金额均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易以套期保值为目的，利用股指期货剥离部分多头股票资产的系统性风险。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

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

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

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

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

#### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	87,523.54
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,955,902.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,043,426.42

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
万家量化同顺 A	2,042	25,354.95	39,328,706.81	75.96	12,446,101.98	24.04
万家量化同顺 C	22,404	11,100.84	213,750,427.70	85.95	34,952,892.36	14.05
合计	24,343	12,343.51	253,079,134.51	84.23	47,398,994.34	15.77

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	万家量化同顺 A	485,687.89	0.9381
	万家量化同顺 C	25.27	0.0000
	合计	485,713.16	0.1616

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	万家量化同顺 A	10~50
	万家量化同顺 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	万家量化同顺 A	0~10
	万家量化同顺 C	0
	合计	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家量化同顺 A	万家量化同顺 C
基金合同生效日 (2018年5月4日) 基金份额总额	221,639,798.43	8,210,243.79
本报告期期初基金份	25,612,287.61	5,270,832.66

额总额		
本报告期基金总申购份额	33,247,365.88	292,335,347.19
减：本报告期基金总赎回份额	7,084,844.70	48,902,859.79
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	51,774,808.79	248,703,320.06

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

2023 年 11 月 22 日，公司聘任乔亮先生担任公司副总经理。

基金托管人：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况未发生改变。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
江海证券	2	996,898,624.98	46.22	739,966.29	40.61	-
中泰证券	2	553,861,091.00	25.68	521,845.39	28.64	-
华泰证券	2	393,025,500.58	18.22	371,765.13	20.40	-
方正证券	2	164,840,763.85	7.64	153,516.00	8.42	-
长城证券	1	48,162,952.52	2.23	35,221.59	1.93	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	3	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易席位的选择标准如下：

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

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；

(2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

3、基金专用交易席位的变更情况：

本报告期内，本基金减少国投证券交易单元 1 个。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	指定媒介	2023 年 1 月 20 日
2	万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告	指定媒介	2023 年 3 月 30 日
3	万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	指定媒介	2023 年 4 月 21 日
4	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在陆享基金开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 6 月 1 日
5	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 6 月 13 日
6	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增汇成基金为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 7 月 1 日
7	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在东方证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 7 月 5 日
8	万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	指定媒介	2023 年 7 月 20 日
9	万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同（更新）	指定媒介	2023 年 8 月 19 日
10	万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议（更新）	指定媒介	2023 年 8 月 19 日
11	万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新（2023 年第 1 号）	指定媒介	2023 年 8 月 21 日
12	万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	指定媒介	2023 年 8 月 21 日
13	万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金 2023 年中期报告	指定媒介	2023 年 8 月 30 日
14	万家基金管理有限公司关于旗下基金	指定媒介	2023 年 9 月 26 日

	在中金财富证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告		
15	万家基金管理有限公司关于旗下基金在国海证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 10 月 13 日
16	万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	指定媒介	2023 年 10 月 24 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20230101-20231030	18,092,093.36	13,028,501.63	-	31,120,594.99	10.36
	2	20230907-20231031-20231203	-	51,400,147.70	-	51,400,147.70	17.11
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。未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。
- 4、万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金 2023 年年度报告原文。
- 5、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。
- 7、本报告期内在中国证监会指定媒介公开披露的基金净值、更新招募说明书及其他临时公告。

### 13.2 存放地点

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

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司

2024 年 3 月 29 日