

万家中证 500 指数增强型发起式证券投资
基金
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

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

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	19
§ 5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	19
§ 6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息	20
6.2 审计报告的基本内容	20
§ 7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	23
7.3 净资产变动表	24
7.4 报表附注	26
§ 8 投资组合报告	61

8.1 期末基金资产组合情况	61
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	61
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	63
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	73
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	96
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	96
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	96
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	96
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	96
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	96
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	96
8.12 投资组合报告附注	96
§ 9 基金份额持有人信息	98
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	98
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	98
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	98
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	99
§ 10 开放式基金份额变动	99
§ 11 重大事件揭示	99
11.1 基金份额持有人大会决议	99
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	99
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	100
11.4 基金投资策略的改变	100
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	100
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	100
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	100
11.8 其他重大事件	102
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	105
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	105
§ 13 备查文件目录	106
13.1 备查文件目录	106
13.2 存放地点	106
13.3 查阅方式	106

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	万家中证 500 指数增强发起式	
基金主代码	006729	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 5 月 23 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,262,777,455.77 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 500 指数增强发起式 A	万家中证 500 指数增强发起式 C
下属分级基金的交易代码	006729	006730
报告期末下属分级基金的份额总额	1,298,792,250.06 份	963,985,205.71 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，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。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 500 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑
	联系电话	021-38909626
		郭明
		010-66105799

电子邮箱	lanj@wjasset.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	4008880800	95588
传真	021-38909627	010-66105798
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）	北京市西城区复兴门内大街 55 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 55 号
邮政编码	200122	100140
法定代表人	方一天	陈四清

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	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	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	
	万家中证 500 指数增强发起 式 A	万家中证 500 指数增强发起 式 C	万家中证 500 指数增 强发起式 A	万家中证 500 指数增 强发起式 C	万家中证 500 指数增 强发起式 A	万家中证 500 指数增 强发起式 C
本期已实现收益	-159,930,899.08	-173,972,833.70	23,265,440.89	12,420,400.36	6,819,286.72	2,878,190.65
本	-181,289,120	-220,524,693	12,377,798.	10,368,395.	6,697,729.	2,030,908.

期利润	.04	.23	06	38	38	98
加权平均基金份额本期利润	-0.1857	-0.2037	0.0995	0.0984	0.3480	0.1759
本期加权平均净值利润率	-14.84%	-16.47%	6.97%	6.93%	20.13%	9.88%
本期基金份额净值增长率	-6.41%	-6.79%	-10.43%	-10.79%	22.82%	22.34%
3.1 .2 期末数据和指	2023 年末		2022 年末		2021 年末	

标						
期末可供分配利润	162,972,303.37	99,817,631.31	83,451,329.91	60,778,720.57	19,326,152.69	28,348,986.00
期末可供分配基金份额利润	0.1255	0.1035	0.3636	0.3424	0.8809	0.8578
期末基金资产净值	1,461,764,553.43	1,063,802,837.02	312,974,938.90	238,267,803.03	41,265,177.10	61,399,158.85
期末基金份额净值	1.1255	1.1035	1.3636	1.3424	1.8809	1.8578
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	65.47%	61.96%	76.80%	73.75%	97.40%	94.78%
-------------	--------	--------	--------	--------	--------	--------

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家中证 500 指数增强发起式 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.81%	0.82%	-4.34%	0.82%	-0.47%	0.00%
过去六个月	-9.85%	0.83%	-8.99%	0.81%	-0.86%	0.02%
过去一年	-6.41%	0.78%	-6.96%	0.78%	0.55%	0.00%
过去三年	2.96%	1.04%	-13.68%	1.03%	16.64%	0.01%
自基金合同生效起至今	65.47%	1.16%	9.45%	1.16%	56.02%	0.00%

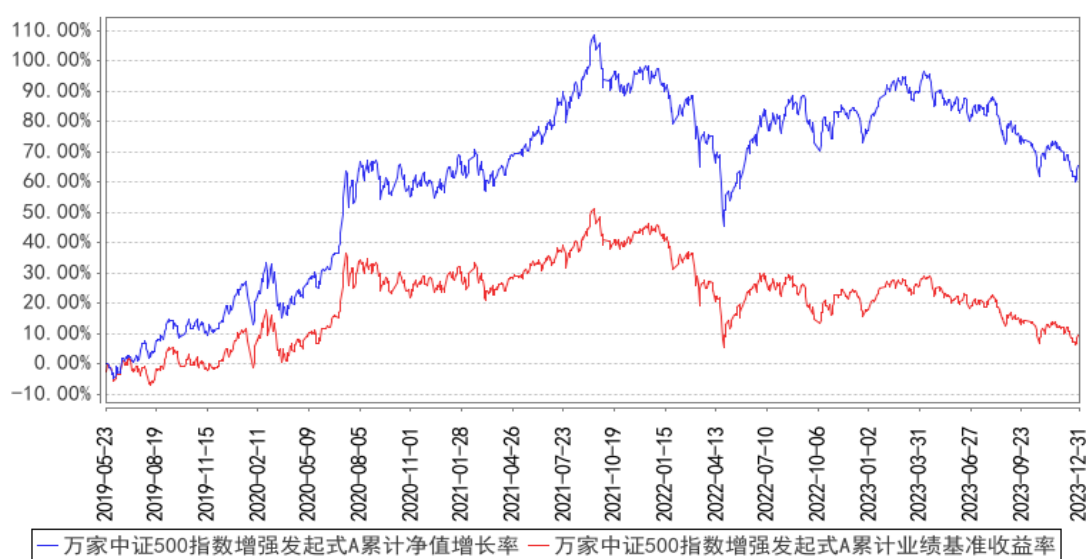
万家中证 500 指数增强发起式 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.91%	0.83%	-4.34%	0.82%	-0.57%	0.01%

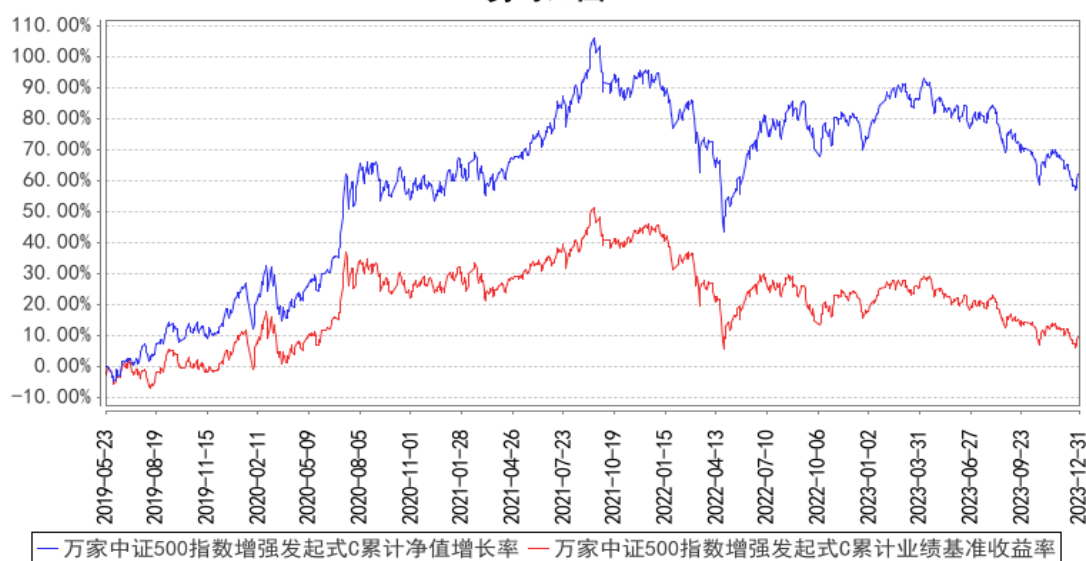
过去六个月	-10.04%	0.83%	-8.99%	0.81%	-1.05%	0.02%
过去一年	-6.79%	0.78%	-6.96%	0.78%	0.17%	0.00%
过去三年	1.73%	1.04%	-13.68%	1.03%	15.41%	0.01%
自基金合同生效起至今	61.96%	1.16%	9.45%	1.16%	52.51%	0.00%

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500指数增强发起式A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



万家中证500指数增强发起式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

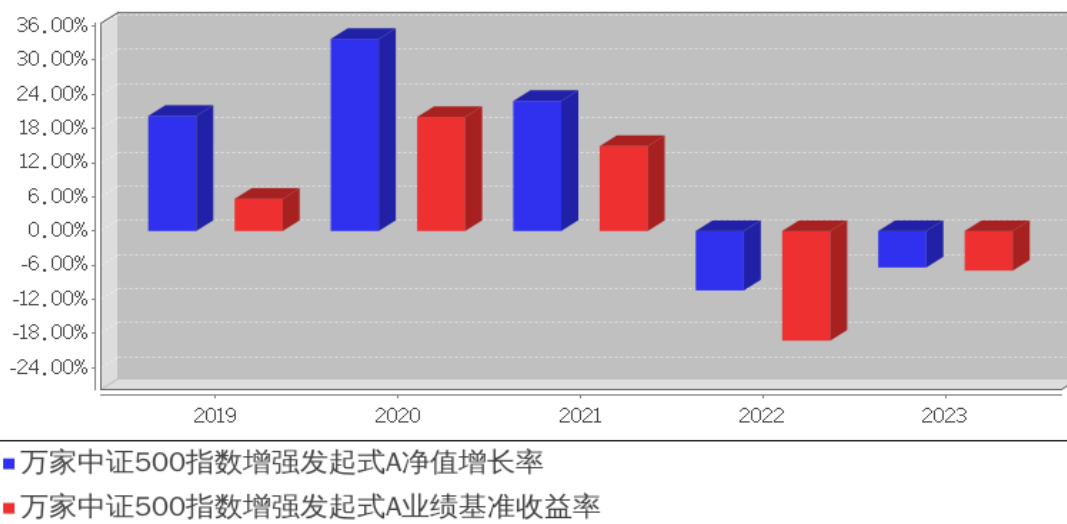


注：本基金于 2019 年 5 月 23 日成立，根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合

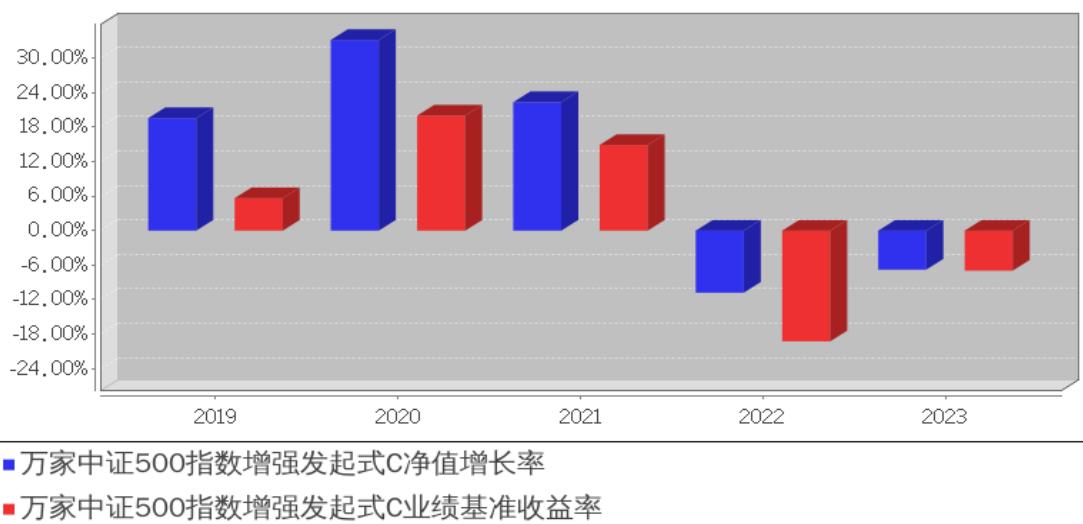
法律法规和基金合同要求。

3.2.3 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500指数增强发起式A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



万家中证500指数增强发起式C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

万家中证 500 指数增强发起式 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2023 年	1.7050	135,651,756.31	62,735,693.86	198,387,450.17	-
2022 年	3.2570	31,628,478.5	6,056,365.34	37,684,843.9	-

		6		0	
2021 年	-	-	-	-	-
合计	4.9620	167,280,234.87	68,792,059.20	236,072,294.07	-

万家中证 500 指数增强发起式 C

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2023 年	1.6760	233,896,737.15	11,384,462.60	245,281,199.75	-
2022 年	3.2020	14,705,776.18	14,427,970.45	29,133,746.63	-
2021 年	-	-	-	-	-
合计	4.8780	248,602,513.33	25,812,433.05	274,414,946.38	-

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

蓝筹混合型证券投资基金、万家北交所慧选两年定期开放混合型证券投资基金、万家鼎鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家新机遇成长一年持有期混合型发起式证券投资基金、万家港股通精选混合型证券投资基金、万家景气驱动混合型证券投资基金、万家安恒纯债 3 个月持有期债券型发起式证券投资基金、万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫橙纯债债券型证券投资基金、万家聚优稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、万家新能源主题混合型发起式证券投资基金、万家中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、万家匠心致远一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫融纯债债券型证券投资基金、万家颐远均衡一年持有期混合型发起式证券投资基金、万家鑫耀纯债债券型证券投资基金、万家欣远混合型证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家惠利债券型证券投资基金、万家鑫怡债券型证券投资基金、万家优享平衡混合型发起式证券投资基金、万家洞见进取混合型发起式证券投资基金、万家沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、万家中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金、万家沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家元贞量化选股股票型证券投资基金、万家 CFETS0-3 年期政策性金融债指数证券投资基金、万家中证软件服务指数型发起式证券投资基金、万家先进制造混合型发起式证券投资基金、万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金、万家颐德一年持有期混合型证券投资基金、万家北证 50 成份指数型发起式证券投资基金、万家恒生互联网科技业指数型发起式证券投资基金 (QDII)、万家中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家欣优混合型证券投资基金、万家集利债券型发起式证券投资基金、万家远见先锋一年持有期混合型证券投资基金、万家国证 2000 指数增强型证券投资基金、万家纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII)、万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金、万家稳安 60 天持有期债券型证券投资基金、万家周期驱动股票型发起式证券投资基金、万家优选积极三个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、万家养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、万家红利量化选股混合型发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
乔亮	公司领导 副总经理；万家 中证 1000	2019 年 9 月 6 日	-	17 年	国籍：中国；学历：美国斯坦福大学工商管理博士，2019 年 7 月入职万家基金管理有限公司，现任公司副总经理、基金经理，历任总经理助理、量化投资部总监（兼）。

<p>指数增强型发起式证券投资基金、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、万家元贞量化选股股票型证券投资基金、万家创业板指数增强型证券投资基金、万家国证 2000 指数增强型证券投资基金、万家家瑞债券型证券投资基金、万家沪深 300 指数增强型证券投资基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家颐达灵活配置混合型证券投资基金的基金经理</p>				<p>曾任美国巴克莱国际投资管理公司投资部基金经理，加拿大退休基金国际投资管理公司量化投资部基金经理，南方基金管理有限公司数量化投资部投资经理，通联数据股份公司联合创始人、首席投资官，上海寻乾资产管理有限公司投资总监、总经理，巨杉（上海）资产管理有限公司量化投资部投资总监等职。</p>
--	--	--	--	---

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内，本基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金在保持相对中证 500 指数较小跟踪误差情况下，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。在组合的行业和风格上相对于中证 500 指数保持了均衡的配置，在量化选股方面精选行业内质优个股，持股较为分散。本基金采用量化风险模型来合理控制组合风险，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 500 成分股，保持了跟标的指数的风格基本一致。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家中证 500 指数增强发起式 A 的基金份额净值为 1.1255 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.41%，同期业绩比较基准收益率为-6.96%；截至本报告期末万家中证 500 指数增强发起式 C 的基金份额净值为 1.1035 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.79%，同期业绩比较基准收益率为-6.96%。基金报告期末 A 份额、C 份额日均跟踪偏离度分别为 0.1374%、0.1377%，年跟踪误差分别为 2.8102%、2.8126%，符合基金合同中日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%的规定。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年初 A 股市场出现了阶段性的恐慌下跌，超出了基于基本面理解的跌幅，当前主要宽基指数的估值均处于历史较低位置。随着中央汇金公司发布公告表示，充分认可当前 A 股市场配置价值，扩大 ETF 指数基金增持范围，并将持续加大增持力度、扩大增持规模，市场流动性得到改善。展望后市，1 月社融数据好于预期、春节消费数据亮点频出，此前市场对经济过于悲观的预期有望得到修复，但持续性有待进一步观察，未来经济核心需要观察地产和出口数据。近期监管

召开系列座谈会，就加强资本市场监管、防范化解风险、推动资本市场高质量发展广泛听取各方面意见建议，为资本市场的健康发展凝聚信心。总体来看，当前 A 股整体估值处于较低区间，随着国内政策继续发力、海外经济需求回暖，未来 A 股指数有望开启震荡向上的行情走势。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

（一）加强风控文化建设

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

（二）制度流程建设

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

（三）定期和临时稽核工作

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

（四）绩效评估和风险管理工作

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

（五）员工行为管理与防控内幕交易

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

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

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不介入基金日常估值业务。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

2023 年 6 月 21 日万家中证 500 指数增强发起式 A 类每 10 份基金份额分红 1.705 元，万家中证 500 指数增强发起式 C 类每 10 份基金份额分红 1.676 元。万家中证 500 指数增强发起式 A 共计分配利润 198,387,450.17 元，万家中证 500 指数增强发起式 C 共计分配利润 245,281,199.75 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——万家基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对万家基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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 ZA30205 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 500 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 500 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“万家中证 500 指数增强发起式”）财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了万家中证 500 指数增强发起式 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于万家中证 500 指数增强发起式，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 500 指数增强发起式的基金管理人万家基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估万家中证 500 指数增强发起式的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督万家中证 500 指数增强发起式的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影</p>

	<p>响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对万家中证 500 指数增强发起式持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致万家中证 500 指数增强发起式不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	立信会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	朱颖 杨利敏
会计师事务所的地址	中国·上海
审计报告日期	2024 年 03 月 28 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	245,230,963.09	54,047,632.99

结算备付金		15,730,244.49	3,085,919.15
存出保证金		569,693.47	105,880.12
交易性金融资产	7.4.7.2	2,376,705,642.21	515,731,786.13
其中：股票投资		2,376,705,642.21	515,731,786.13
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		146,627,646.43	207,368.22
应收股利		-	-
应收申购款		935,470.81	2,261,729.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		2,785,799,660.50	575,440,316.09
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		245,957,367.99	20,945,598.99
应付管理人报酬		2,541,926.76	473,100.52
应付托管费		508,385.37	94,620.13
应付销售服务费		492,206.13	83,899.70
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	10,732,383.80	2,600,354.82
负债合计		260,232,270.05	24,197,574.16
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	2,262,777,455.77	407,012,691.45
其他综合收益	7.4.7.8	-	-

未分配利润	7.4.7.9	262,789,934.68	144,230,050.48
净资产合计		2,525,567,390.45	551,242,741.93
负债和净资产总计		2,785,799,660.50	575,440,316.09

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 2,262,777,455.77 份，其中万家中证 500 指数增强发起式 A 基金份额净值 1.1255 元，基金份额总额 1,298,792,250.06 份；万家中证 500 指数增强发起式 C 基金份额净值 1.1035 元，基金份额总额 963,985,205.71 份。

7.2 利润表

会计主体：万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-365,653,123.72	27,343,015.36
1. 利息收入		824,893.27	114,631.45
其中：存款利息收入	7.4.7.10	824,893.27	114,631.45
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）		-299,551,639.76	39,595,121.52
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-340,360,273.01	35,094,234.46
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	225.96	-
资产支持证券投资	7.4.7.13	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	40,808,407.29	4,500,887.06
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	-67,910,080.49	-12,939,647.81
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”	7.4.7.18	983,703.26	572,910.20

号填列)			
减：二、营业总支出		36,160,689.55	4,596,821.92
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	25,254,905.48	3,180,468.37
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	5,050,981.08	636,093.66
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	5,280,951.26	582,636.93
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	573,851.73	197,622.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-401,813,813.27	22,746,193.44
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-401,813,813.27	22,746,193.44
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-401,813,813.27	22,746,193.44

7.3 净资产变动表

会计主体：万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	407,012,691.45	-	144,230,050.48	551,242,741.93
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	407,012,691.45	-	144,230,050.48	551,242,741.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,855,764,764.32	-	118,559,884.20	1,974,324,648.52
（一）、综合收益总额	-	-	-401,813,813.27	-401,813,813.27

			7	
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	1,855,764,764. 32	-	964,042,347.39	2,819,807,111.7 1
其中：1. 基金申购款	3,380,151,509. 15	-	1,292,376,265. 68	4,672,527,774.8 3
2. 基金赎回款	-1,524,386,744 .83	-	-328,333,918.2 9	-1,852,720,663. 12
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-443,668,649.9 2	-443,668,649.92
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,262,777,455. 77	-	262,789,934.68	2,525,567,390.4 5
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	54,989,197.26	-	47,675,138.69	102,664,335.95
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	54,989,197.26	-	47,675,138.69	102,664,335.95
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	352,023,494.19	-	96,554,911.79	448,578,405.98
(一)、综合收益总额	-	-	22,746,193.44	22,746,193.44
(二)、本期基金份额交易产生的	352,023,494.19	-	140,627,308.88	492,650,803.07

净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)				
其中：1. 基金申 购款	650,209,191.14	-	271,260,808.70	921,469,999.84
2. 基金赎 回款	-298,185,696.9 5	-	-130,633,499.8 2	-428,819,196.77
(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)	-	-	-66,818,590.53	-66,818,590.53
(四)、其他综合 收益结转留存收 益	-	-	-	-
四、本期期末净 资产	407,012,691.45	-	144,230,050.48	551,242,741.93

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（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[2018]1931 号文《关于准予万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》的批准，由万家基金管理有限公司作为基金管理人于 2019 年 5 月 6 日至 2019 年 5 月 17 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[2019]第 ZA30669 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 2019 年 5 月 23 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 215,969,733.39 元，有效认购资金在募集期间内产生的利息为人民币 31,846.50 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 216,001,579.89 元，折合 216,001,579.89 份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为万家基金管理有限公司，基金托管人为中国工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、备选成份股、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，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 500 指数收益率*95%+一年期人民币定期存款利率（税后）*5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

益工具的合同。

1、金融资产分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的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、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最少为 1 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%；
- 5、本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；
- 6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

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

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

(一) 印花税

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

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

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

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

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

(二) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开

放式证券投资基金) 管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税; 国债、地方政府债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;

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	245,230,963.09	54,047,632.99
等于：本金	245,207,651.61	54,043,991.99
加：应计利息	23,311.48	3,641.00
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	245,230,963.09	54,047,632.99

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	2,457,364,244.07	-	2,376,705,642.21	-80,658,601.86
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	2,457,364,244.07	-	2,376,705,642.21	-80,658,601.86
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	528,480,307.50	-	515,731,786.13	-12,748,521.37
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市	-	-	-

	场				
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		528,480,307.50	-	515,731,786.13	-12,748,521.37

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	3,370.25	121.79
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	10,429,638.56	2,359,300.58
其中：交易所市场	10,429,638.56	2,359,300.58
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	168,000.00	220,000.00
应付指数使用费	131,374.99	20,932.45
合计	10,732,383.80	2,600,354.82

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

万家中证 500 指数增强发起式 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	229,523,608.99	229,523,608.99
本期申购	1,375,139,496.43	1,375,139,496.43
本期赎回（以“-”号填列）	-305,870,855.36	-305,870,855.36
基金拆分/份额折算前	-	-

基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,298,792,250.06	1,298,792,250.06

万家中证 500 指数增强发起式 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	177,489,082.46	177,489,082.46
本期申购	2,005,012,012.72	2,005,012,012.72
本期赎回(以“-”号填列)	-1,218,515,889.47	-1,218,515,889.47
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	963,985,205.71	963,985,205.71

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

万家中证 500 指数增强发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	130,525,386.75	-47,074,056.84	83,451,329.91
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	130,525,386.75	-47,074,056.84	83,451,329.91
本期利润	-159,930,899.08	-21,358,220.96	-181,289,120.04
本期基金份额交易产生的变动数	677,002,422.72	-217,804,879.05	459,197,543.67
其中：基金申购款	817,921,242.65	-288,104,612.51	529,816,630.14
基金赎回款	-140,918,819.93	70,299,733.46	-70,619,086.47
本期已分配利润	-198,387,450.17	-	-198,387,450.17
本期末	449,209,460.22	-286,237,156.85	162,972,303.37

万家中证 500 指数增强发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	96,734,309.82	-35,955,589.25	60,778,720.57
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-

本期期初	96,734,309.82	-35,955,589.25	60,778,720.57
本期利润	-173,972,833.70	-46,551,859.53	-220,524,693.23
本期基金份额交易产生的变动数	632,094,382.75	-127,249,579.03	504,844,803.72
其中：基金申购款	1,165,707,380.51	-403,147,744.97	762,559,635.54
基金赎回款	-533,612,997.76	275,898,165.94	-257,714,831.82
本期已分配利润	-245,281,199.75	-	-245,281,199.75
本期末	309,574,659.12	-209,757,027.81	99,817,631.31

7.4.7.10 存款利息收入

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
活期存款利息收入	617,191.68	79,075.25
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	197,108.04	34,003.12
其他	10,593.55	1,553.08
合计	824,893.27	114,631.45

7.4.7.11 股票投资收益

7.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-340,360,273.01	35,094,234.46
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	-340,360,273.01	35,094,234.46

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	18,387,506,779.01	3,170,584,771.34

额		
减：卖出股票成本总额	18,676,429,940.20	3,125,935,212.97
减：交易费用	51,437,111.82	9,555,323.91
买卖股票差价收入	-340,360,273.01	35,094,234.46

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	673.96	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-448.00	-
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	225.96	-

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	3,030,773.69	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,999,208.00	-
减：应计利息总额	32,013.69	-
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-448.00	-

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	40,808,407.29	4,500,887.06
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	40,808,407.29	4,500,887.06

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	-67,910,080.49	-12,939,647.81
股票投资	-67,910,080.49	-12,939,647.81
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-67,910,080.49	-12,939,647.81

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	978,650.31	565,232.19
基金转换费收入	5,052.95	7,678.01
合计	983,703.26	572,910.20

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	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
审计费用	48,000.00	20,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	1,773.38	847.00
指数使用费	404,078.35	56,775.96
合计	573,851.73	197,622.96

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
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
中泰证券股份有限公司（“中泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
山东省新动能基金管理有限公司	基金管理人的股东
齐河众鑫投资有限公司	基金管理人的股东
万家财富基金销售（天津）有限公司（“万家财富”）	基金管理人的子公司、基金销售机构
万家共赢资产管理有限公司（“万家共赢”）	基金管理人的子公司
上海万家朴智投资管理有限公司（“万家朴智”）	基金管理人控制的公司
山东能源集团有限公司	基金管理人的实际控制人

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	10,220,556,030.57	26.23	645,888,581.33	9.62

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	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	9,203,135.65	26.52	566,214.40	5.43
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	578,911.40	9.96	578,911.40	24.54

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
----	----	---------

	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
当期发生的基金应支付的管理费	25,254,905.48	3,180,468.37
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,162,500.08	532,537.94
应支付基金管理人的净管理费	22,092,405.40	2,647,930.43

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。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 2 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

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
	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
当期发生的基金应支付的托管费	5,050,981.08	636,093.66

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家中证 500 指数增	万家中证 500 指数增	合计

	强发起式 A	强发起式 C	
工商银行	-	42,095.77	42,095.77
万家基金	-	3,485,197.15	3,485,197.15
中泰证券	-	13,915.94	13,915.94
合计	-	3,541,208.86	3,541,208.86
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家中证 500 指数增强发起式 A	万家中证 500 指数增强发起式 C	合计
万家基金	-	141,217.56	141,217.56
中泰证券	-	12,059.91	12,059.91
工商银行	-	13,704.39	13,704.39
合计	-	166,981.86	166,981.86

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	万家中证 500 指数增强发起式 A	万家中证 500 指数增强发起式 C
基金合同生效日（2019 年 5 月 23 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,001,000.10	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	10,001,000.10	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	万家中证 500 指数增强发起式 A	万家中证 500 指数增强发起式 C
基金合同生效日（2019 年 5 月 23 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,001,000.10	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,000.10	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.3573%	-

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
	工商银行	245,230,963.09	617,191.68	54,047,632.99

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方所承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间没有需作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

万家中证 500 指数增强发起式 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2023 年 6 月 21 日	-	2023 年 6 月 21 日	1.7050	135,651,756.31	62,735,693.86	198,387,450.17	-
合计	-	-	-	1.7050	135,651,756.31	62,735,693.86	198,387,450.17	-
万家中证 500 指数增强发起式 C								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2023 年 6 月 21 日	-	2023 年 6 月 21 日	1.6760	233,896,737.15	11,384,462.60	245,281,199.75	-
合计	-	-	-	1.6760	233,896,737.15	11,384,462.60	245,281,199.75	-

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证 券	成功 认购	受 限	流通 受限	认购 价格	期末 估值	数量 (单	期末 成本总额	期末估值 总额	备注

	名称	日期	类型	单价	位：股)					
001239	永达股份	2023年12月4日	6个月	新股流通受限	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001306	夏厦精密	2023年11月9日	6个月	新股流通受限	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
001358	兴欣新材	2023年12月14日	6个月	新股流通受限	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
001378	德冠新材	2023年10月23日	6个月	新股流通受限	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-
300904	威力传动	2023年8月2日	6个月	新股流通受限	35.41	61.53	304	10,764.64	18,705.12	-
301172	君逸数码	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	31.33	38.16	438	13,722.54	16,714.08	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	57.88	45.48	281	16,264.28	12,779.88	-
301251	威尔高	2023年8月30日	6个月	新股流通受限	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301272	英华特	2023年7月6日	6个月	新股流通受限	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-

301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.35	583	11,654.17	11,281.05	-
301329	信音电子	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301348	蓝箭电子	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-
301372	科净源	2023年8月3日	6个月	新股流通受限	45.00	43.59	231	10,395.00	10,069.29	-
301393	昊帆生物	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.68	18.69	520	13,873.60	9,718.80	-
301413	安培龙	2023年12月11日	6个月	新股流通受限	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301456	盘古智能	2023年7月6日	6个月	新股流通受限	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-
301459	丰茂股份	2023年12月6日	6个月	新股流通受限	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
301469	恒达新材	2023年8月10日	6个月	新股流通受限	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	57.66	47.25	482	27,792.12	22,774.50	-
301487	盟	2023	6个月	新股	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-

	固利	年8月1日		流通受限						
301499	维科精密	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
301500	飞南资源	2023年9月13日	6个月	新股流通受限	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-
301505	苏州规划	2023年7月12日	6个月	新股流通受限	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301507	民生健康	2023年8月24日	6个月	新股流通受限	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301510	固高科技	2023年8月4日	6个月	新股流通受限	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301511	德福科技	2023年8月8日	6个月	新股流通受限	28.00	22.67	982	27,496.00	22,261.94	-
301516	中远通	2023年12月1日	6个月	新股流通受限	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕西华达	2023年10月9日	6个月	新股流通受限	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301518	长华化学	2023年7月26日	6个月	新股流通受限	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-
301519	舜禹股份	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-
301520	万邦医	2023年9月18日	6个月	新股流通受限	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-

	药									
301525	儒竞科技	2023年8月23日	6个月	新股流通受限	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-
301526	国际复材	2023年12月19日	6个月	新股流通受限	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-
301528	多浦乐	2023年8月17日	6个月	新股流通受限	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
301529	福赛科技	2023年8月31日	6个月	新股流通受限	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301548	崇德科技	2023年9月11日	6个月	新股流通受限	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-
301550	斯菱股份	2023年9月6日	6个月	新股流通受限	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-
301555	惠柏新材	2023年10月24日	6个月	新股流通受限	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301558	三态股份	2023年9月21日	6个月	新股流通受限	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-
301559	中集环科	2023年9月26日	6个月	新股流通受限	24.22	18.24	1,315	31,849.30	23,985.60	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股流通受限	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301568	思泰克	2023年11月21日	6个月	新股流通受限	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-

301578	辰奕智能	2023年12月21日	6个月	新股流通受限	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
601083	锦江航运	2023年11月28日	6个月	新股流通受限	11.25	11.07	1,263	14,208.75	13,981.41	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	新股流通受限	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-
603004	鼎龙科技	2023年12月20日	6个月	新股流通受限	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603062	麦加芯彩	2023年10月31日	6个月	新股流通受限	58.08	57.81	126	7,318.08	7,284.06	-
603075	热威股份	2023年9月1日	6个月	新股流通受限	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
603107	上海汽配	2023年10月25日	6个月	新股流通受限	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-
603119	浙江荣泰	2023年7月21日	6个月	新股流通受限	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
603193	润本股份	2023年10月9日	6个月	新股流通受限	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-
603231	索宝蛋白	2023年12月6日	6个月	新股流通受限	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-
603270	金帝股份	2023年8月25日	6个月	新股流通受限	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-

603273	天元智能	2023年10月16日	6个月	新股流通受限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒兴新材	2023年9月18日	6个月	新股流通受限	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603373	安邦护卫	2023年12月13日	6个月	新股流通受限	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688548	广钢气体	2023年8月8日	6个月	新股流通受限	9.87	12.75	4,048	39,953.76	51,612.00	-
688549	中巨芯	2023年8月30日	6个月	新股流通受限	5.18	8.09	4,294	22,242.92	34,738.46	-
688563	航材股份	2023年7月12日	6个月	新股流通受限	78.99	60.49	1,501	118,563.99	90,795.49	-
688573	信宇人	2023年8月9日	6个月	新股流通受限	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	-
688591	泰凌微	2023年8月18日	6个月	新股流通受限	24.98	28.02	681	17,011.38	19,081.62	-
688602	康鹏科技	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-
688610	埃科光	2023年7月10日	6个月	新股流通受限	73.33	51.00	275	20,165.75	14,025.00	-

	电									
688612	威迈斯	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	47.29	37.97	422	19,956.38	16,023.34	-
688627	精智达	2023年7月11日	6个月	新股流通受限	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-
688648	中邮科技	2023年11月6日	6个月	新股流通受限	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688651	盛邦安全	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月	新股流通受限	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
688653	康希通信	2023年11月10日	6个月	新股流通受限	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
688657	浩辰软件	2023年9月25日	6个月	新股流通受限	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688671	碧兴物联	2023年8月2日	6个月	新股流通受限	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-
688693	锆威特	2023年8月10日	6个月	新股流通受限	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
688702	盛科通信	2023年9月6日	6个月	新股流通受限	42.66	48.18	549	23,420.34	26,450.82	-
688716	中研股份	2023年9月13日	6个月	新股流通受限	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-
688719	爱科	2023年9月	6个月	新股流通	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-

	赛博	20 日		受限						
688720	艾森股份	2023 年 11 月 29 日	6 个月	新股流通受限	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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 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。

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资。(2022 年 12 月 31 日：同)

7.4.13.3 流动性风险

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

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

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	245,230,963.09	-	-	-	-	-	245,230,963.09
结算备付金	15,730,244.49	-	-	-	-	-	15,730,244.49
存出保证金	569,693.47	-	-	-	-	-	569,693.47
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-2,376,705,642.21	2,376,705,642.21
应收申购款	1,015.46	-	-	-	-	934,455.35	935,470.81
应收清算款	-	-	-	-	-	146,627,646.43	146,627,646.43
资产总计	261,531,916.51	-	-	-	-	-2,524,267,743.99	2,785,799,660.50
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	245,957,367.99	245,957,367.99
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,541,926.76	2,541,926.76
应付托管费	-	-	-	-	-	508,385.37	508,385.37
应付销售服务费	-	-	-	-	-	492,206.13	492,206.13
其他负债	-	-	-	-	-	10,732,383.80	10,732,383.80
负债总计	-	-	-	-	-	260,232,270.05	260,232,270.05
利率敏感度缺口	261,531,916.51	-	-	-	-	-2,264,035,473.94	2,525,567,390.45
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	54,047,632.99	-	-	-	-	-	54,047,632.99
结算备付金	3,085,919.15	-	-	-	-	-	3,085,919.15
存出保证金	105,880.12	-	-	-	-	-	105,880.12
交易性金融资产	-	-	-	-	-	515,731,786.13	515,731,786.13
应收申购款	3,401.71	-	-	-	-	2,258,327.77	2,261,729.48
应收清算款	-	-	-	-	-	207,368.22	207,368.22
资产总计	57,242,833.97	-	-	-	-	518,197,482.12	575,440,316.09

负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	20,945,598.99	20,945,598.99
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	473,100.52	473,100.52
应付托管费	-	-	-	-	-	94,620.13	94,620.13
应付销售服务费	-	-	-	-	-	83,899.70	83,899.70
其他负债	-	-	-	-	-	2,600,354.82	2,600,354.82
负债总计	-	-	-	-	-	24,197,574.16	24,197,574.16
利率敏感度缺口	57,242,833.97	-	-	-	-	493,999,907.96	551,242,741.93

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2022 年 12 月 31 日：同），银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2022 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,376,705,642.21	94.11	515,731,786.13	93.56
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	2,376,705,642.21	94.11	515,731,786.13	93.56

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	-23,632,914.21	-5,179,770.22
	2. 股票基准指数上升100个基点	23,632,914.21	5,179,770.22

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	2,375,604,999.23	508,690,449.51
第二层次	-	5,630,832.00
第三层次	1,100,642.98	1,410,504.62

合计	2,376,705,642.21	515,731,786.13
----	------------------	----------------

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,410,504.62	1,410,504.62
当期购买	-	949,574.88	949,574.88
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,564,002.36	1,564,002.36
当期利得或损失总额	-	304,565.84	304,565.84
其中：计入损益的利得或损失	-	304,565.84	304,565.84
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,100,642.98	1,100,642.98
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	151,068.10	151,068.10
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	1,173,718.92	1,173,718.92

当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	236,785.70	236,785.70
其中：计入损益的利得或损失	-	236,785.70	236,785.70
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,410,504.62	1,410,504.62
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	236,785.70	236,785.70

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,100,642.98	亚式期权模型	预期波动率	0.1962-2.1988	预期波动率越大公允价值越低
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,410,504.62	亚式期权模型	预期波动率	0.2063-2.4756	预期波动率越大公允价值越低

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,376,705,642.21	85.32
	其中：股票	2,376,705,642.21	85.32
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	260,961,207.58	9.37
8	其他各项资产	148,132,810.71	5.32
9	合计	2,785,799,660.50	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	39,100,490.39	1.55
C	制造业	1,265,142,580.09	50.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	41,097,698.00	1.63
E	建筑业	12,433,680.00	0.49
F	批发和零售业	53,930,004.00	2.14
G	交通运输、仓储和邮政业	30,096,251.56	1.19
H	住宿和餐饮业	19,950,067.06	0.79
I	信息传输、软件和信息技术服务业	130,361,984.51	5.16
J	金融业	213,525,555.00	8.45
K	房地产业	3,538,738.00	0.14
L	租赁和商务服务业	3,843,297.00	0.15
M	科学研究和技术服务业	86,196,111.46	3.41
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	16,085,083.60	0.64
R	文化、体育和娱乐业	9,615,508.00	0.38
S	综合	-	-
	合计	1,924,917,048.67	76.22

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	15,941,401.16	0.63
B	采矿业	21,330,361.82	0.84
C	制造业	245,541,769.92	9.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,848,295.00	0.55
E	建筑业	6,730,517.00	0.27
F	批发和零售业	9,770,142.20	0.39
G	交通运输、仓储和邮政业	13,981.41	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,986,262.68	1.03
J	金融业	94,679,315.10	3.75
K	房地产业	2,788,244.00	0.11
L	租赁和商务服务业	4,626,343.00	0.18
M	科学研究和技术服务业	4,503,776.58	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	1,014,482.11	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	5,013,701.56	0.20
S	综合	-	-
	合计	451,788,593.54	17.89

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000039	中集集团	6,336,980	48,477,897.00	1.92
2	600369	西南证券	9,470,100	38,732,709.00	1.53
3	600392	盛和资源	3,771,980	38,398,756.40	1.52
4	000932	华菱钢铁	6,854,000	35,298,100.00	1.40
5	688169	石头科技	110,080	31,147,136.00	1.23
6	601577	长沙银行	4,467,700	30,469,714.00	1.21
7	300136	信维通信	1,279,394	30,193,698.40	1.20
8	300012	华测检测	2,090,900	29,690,780.00	1.18
9	300676	华大基因	581,172	27,896,256.00	1.10
10	601077	渝农商行	6,779,500	27,660,360.00	1.10
11	603228	景旺电子	1,213,500	27,376,560.00	1.08
12	002557	洽洽食品	781,200	27,201,384.00	1.08
13	688099	晶晨股份	430,901	26,987,329.63	1.07
14	601198	东兴证券	3,253,800	26,778,774.00	1.06
15	300595	欧普康视	1,172,362	26,471,933.96	1.05
16	603858	步长制药	1,464,468	24,910,600.68	0.99
17	600885	宏发股份	896,500	24,779,260.00	0.98
18	603589	口子窖	546,894	24,774,298.20	0.98
19	002444	巨星科技	1,032,100	23,242,892.00	0.92
20	600161	天坛生物	721,920	22,336,204.80	0.88
21	000519	中兵红箭	1,554,900	21,830,796.00	0.86
22	600141	兴发集团	1,121,100	20,460,075.00	0.81
23	600258	首旅酒店	1,277,213	19,950,067.06	0.79
24	600160	巨化股份	1,195,900	19,720,391.00	0.78
25	600511	国药股份	687,400	19,673,388.00	0.78
26	688567	孚能科技	1,185,173	19,330,171.63	0.77
27	002372	伟星新材	1,332,100	19,275,487.00	0.76
28	600315	上海家化	903,200	19,129,776.00	0.76
29	600096	云天化	1,220,200	19,035,120.00	0.75
30	603866	桃李面包	2,374,814	18,191,075.24	0.72
31	600498	烽火通信	1,084,700	18,049,408.00	0.71
32	000703	恒逸石化	2,566,900	17,249,568.00	0.68
33	300296	利亚德	2,727,700	16,366,200.00	0.65
34	300244	迪安诊断	675,560	16,085,083.60	0.64
35	002409	雅克科技	278,037	15,495,002.01	0.61
36	002600	领益智造	2,283,600	15,437,136.00	0.61
37	603379	三美股份	437,500	14,875,000.00	0.59
38	603267	鸿远电子	291,880	14,652,376.00	0.58
39	002463	沪电股份	657,500	14,543,900.00	0.58

40	601000	唐山港	4,104,600	14,366,100.00	0.57
41	002500	山西证券	2,644,900	14,256,011.00	0.56
42	002673	西部证券	2,222,900	14,159,873.00	0.56
43	601168	西部矿业	964,557	13,764,228.39	0.54
44	600399	抚顺特钢	1,412,100	13,725,612.00	0.54
45	600499	科达制造	1,251,500	13,203,325.00	0.52
46	000547	航天发展	1,575,700	13,188,609.00	0.52
47	002195	岩山科技	4,275,600	13,126,092.00	0.52
48	002465	海格通信	993,600	12,767,760.00	0.51
49	002340	格林美	2,331,600	12,730,536.00	0.50
50	600118	中国卫星	472,421	12,197,910.22	0.48
51	000830	鲁西化工	1,211,700	12,153,351.00	0.48
52	603885	吉祥航空	1,003,180	12,038,160.00	0.48
53	600008	首创环保	4,392,700	11,816,363.00	0.47
54	300724	捷佳伟创	159,596	11,811,699.96	0.47
55	600927	永安期货	741,600	11,650,536.00	0.46
56	300418	昆仑万维	293,100	10,961,940.00	0.43
57	300776	帝尔激光	181,520	10,938,395.20	0.43
58	603529	爱玛科技	434,800	10,887,392.00	0.43
59	002152	广电运通	887,400	10,879,524.00	0.43
60	300568	星源材质	687,235	10,597,163.70	0.42
61	300682	朗新集团	639,800	10,486,322.00	0.42
62	300073	当升科技	270,400	10,329,280.00	0.41
63	002608	江苏国信	1,562,100	10,262,997.00	0.41
64	600482	中国动力	565,300	10,181,053.00	0.40
65	688105	诺唯赞	314,090	10,057,161.80	0.40
66	300009	安科生物	976,300	9,977,786.00	0.40
67	603517	绝味食品	371,000	9,965,060.00	0.39
68	688778	厦钨新能	250,400	9,925,856.00	0.39
69	600637	东方明珠	1,309,300	9,845,936.00	0.39
70	601456	国联证券	897,300	9,726,732.00	0.39
71	601933	永辉超市	3,448,300	9,724,206.00	0.39
72	600820	隧道股份	1,644,200	9,470,592.00	0.37
73	002595	豪迈科技	311,200	9,264,424.00	0.37
74	002156	通富微电	396,900	9,176,328.00	0.36
75	600095	湘财股份	1,218,700	9,152,437.00	0.36
76	600378	昊华科技	294,254	8,968,861.92	0.36
77	000975	银泰黄金	590,000	8,850,000.00	0.35
78	002030	达安基因	908,020	8,789,633.60	0.35
79	600546	山煤国际	493,400	8,639,434.00	0.34
80	603127	昭衍新药	363,800	8,625,698.00	0.34
81	688521	芯原股份	171,850	8,585,626.00	0.34
82	600481	双良节能	1,005,800	8,509,068.00	0.34

83	002032	苏泊尔	160,300	8,497,503.00	0.34
84	601108	财通证券	1,093,900	8,488,664.00	0.34
85	601636	旗滨集团	1,207,500	8,259,300.00	0.33
86	000050	深天马 A	764,559	8,142,553.35	0.32
87	688276	百克生物	148,000	8,111,880.00	0.32
88	003035	南网能源	1,542,100	8,111,446.00	0.32
89	002019	亿帆医药	523,600	7,738,808.00	0.31
90	600863	内蒙华电	1,922,800	7,498,920.00	0.30
91	600056	中国医药	668,500	7,467,145.00	0.30
92	300363	博腾股份	290,100	7,296,015.00	0.29
93	000021	深科技	449,300	7,283,153.00	0.29
94	600418	江淮汽车	443,600	7,164,140.00	0.28
95	000156	华数传媒	950,400	7,004,448.00	0.28
96	600153	建发股份	722,600	6,958,638.00	0.28
97	002080	中材科技	433,300	6,898,136.00	0.27
98	688005	容百科技	173,100	6,889,380.00	0.27
99	002273	水晶光电	503,000	6,810,620.00	0.27
100	600967	内蒙一机	824,400	6,809,544.00	0.27
101	600339	中油工程	2,238,300	6,782,049.00	0.27
102	688819	天能股份	242,372	6,767,026.24	0.27
103	002423	中粮资本	1,000,800	6,685,344.00	0.26
104	000738	航发控制	335,482	6,676,091.80	0.26
105	600316	洪都航空	310,900	6,581,753.00	0.26
106	003022	联泓新科	357,244	6,541,137.64	0.26
107	002008	大族激光	309,200	6,406,624.00	0.25
108	002791	坚朗五金	156,188	6,324,052.12	0.25
109	603156	养元饮品	297,035	6,314,964.10	0.25
110	000970	中科三环	609,100	6,304,185.00	0.25
111	300866	安克创新	65,600	5,812,160.00	0.23
112	600563	法拉电子	62,092	5,749,719.20	0.23
113	002517	恺英网络	507,200	5,665,424.00	0.22
114	002797	第一创业	971,000	5,641,510.00	0.22
115	603893	瑞芯微	88,800	5,629,920.00	0.22
116	300212	易华录	178,000	5,598,100.00	0.22
117	300529	健帆生物	248,500	5,524,155.00	0.22
118	002624	完美世界	464,700	5,502,048.00	0.22
119	600968	海油发展	1,921,600	5,476,560.00	0.22
120	688208	道通科技	219,515	5,213,481.25	0.21
121	600808	马钢股份	1,905,200	5,182,144.00	0.21
122	603000	人民网	183,400	5,131,532.00	0.20
123	300383	光环新网	519,600	5,050,512.00	0.20
124	601568	北元集团	1,062,300	5,035,302.00	0.20
125	600177	雅戈尔	761,500	4,987,825.00	0.20

126	600906	财达证券	663,800	4,978,500.00	0.20
127	600066	宇通客车	374,300	4,959,475.00	0.20
128	603927	中科软	164,906	4,943,881.88	0.20
129	603185	弘元绿能	147,600	4,912,128.00	0.19
130	000598	兴蓉环境	839,900	4,779,031.00	0.19
131	002925	盈趣科技	241,600	4,703,952.00	0.19
132	000930	中粮科技	707,100	4,695,144.00	0.19
133	688234	天岳先进	70,926	4,686,080.82	0.19
134	300001	特锐德	232,505	4,673,350.50	0.19
135	600707	彩虹股份	689,100	4,651,425.00	0.18
136	688180	君实生物	108,100	4,521,823.00	0.18
137	603026	胜华新材	96,430	4,422,279.80	0.18
138	600765	中航重机	227,600	4,349,436.00	0.17
139	600566	济川药业	137,000	4,305,910.00	0.17
140	000423	东阿阿胶	85,600	4,221,792.00	0.17
141	000513	丽珠集团	119,000	4,166,190.00	0.16
142	601665	齐鲁银行	1,004,100	3,926,031.00	0.16
143	300357	我武生物	134,867	3,911,143.00	0.15
144	601828	美凯龙	993,100	3,843,297.00	0.15
145	605358	立昂微	137,736	3,772,589.04	0.15
146	002653	海思科	162,100	3,752,615.00	0.15
147	002558	巨人网络	336,800	3,751,952.00	0.15
148	603056	德邦股份	255,148	3,691,991.56	0.15
149	000997	新大陆	187,300	3,672,953.00	0.15
150	300474	景嘉微	50,000	3,535,500.00	0.14
151	002326	永太科技	300,700	3,494,134.00	0.14
152	000559	万向钱潮	670,900	3,481,971.00	0.14
153	000060	中金岭南	805,000	3,477,600.00	0.14
154	600380	健康元	269,700	3,352,371.00	0.13
155	688772	珠海冠宇	151,315	3,330,443.15	0.13
156	000893	亚钾国际	123,600	3,243,264.00	0.13
157	300088	长信科技	479,300	3,206,517.00	0.13
158	300373	扬杰科技	83,900	3,079,130.00	0.12
159	002761	浙江建投	288,800	2,963,088.00	0.12
160	600497	驰宏锌锗	581,600	2,937,080.00	0.12
161	300114	中航电测	67,100	2,935,625.00	0.12
162	601158	重庆水务	493,500	2,798,145.00	0.11
163	603444	吉比特	11,300	2,769,856.00	0.11
164	002497	雅化集团	210,400	2,754,136.00	0.11
165	603737	三棵树	57,800	2,751,858.00	0.11
166	002138	顺络电子	100,700	2,719,907.00	0.11
167	300558	贝达药业	52,600	2,711,530.00	0.11
168	688516	奥特维	29,870	2,703,235.00	0.11

169	688536	思瑞浦	18,200	2,662,660.00	0.11
170	600299	安迪苏	319,933	2,559,464.00	0.10
171	002092	中泰化学	414,700	2,529,670.00	0.10
172	002384	东山精密	138,800	2,523,384.00	0.10
173	000591	太阳能	444,100	2,478,078.00	0.10
174	002056	横店东磁	182,900	2,476,466.00	0.10
175	002738	中矿资源	66,000	2,462,460.00	0.10
176	300601	康泰生物	90,500	2,457,075.00	0.10
177	600663	陆家嘴	280,400	2,453,500.00	0.10
178	301236	软通动力	51,450	2,376,990.00	0.09
179	688002	睿创微纳	51,140	2,261,410.80	0.09
180	603317	天味食品	160,600	2,134,374.00	0.08
181	601058	赛轮轮胎	178,100	2,092,675.00	0.08
182	002373	千方科技	185,400	2,078,334.00	0.08
183	688114	华大智造	22,900	1,969,858.00	0.08
184	603160	汇顶科技	26,900	1,858,790.00	0.07
185	688248	南网科技	72,678	1,814,769.66	0.07
186	300394	天孚通信	19,800	1,812,096.00	0.07
187	603305	旭升集团	87,580	1,727,953.40	0.07
188	601928	凤凰传媒	177,800	1,566,418.00	0.06
189	600998	九州通	209,300	1,467,193.00	0.06
190	300118	东方日升	81,800	1,443,770.00	0.06
191	000723	美锦能源	216,200	1,439,892.00	0.06
192	000959	首钢股份	391,200	1,353,552.00	0.05
193	688220	翱捷科技	19,075	1,343,643.00	0.05
194	300502	新易盛	27,100	1,336,572.00	0.05
195	000960	锡业股份	91,500	1,310,280.00	0.05
196	002407	多氟多	85,400	1,299,788.00	0.05
197	001203	大中矿业	126,900	1,290,573.00	0.05
198	301029	怡合达	49,600	1,278,688.00	0.05
199	002353	杰瑞股份	44,600	1,253,706.00	0.05
200	002432	九安医疗	32,500	1,224,275.00	0.05
201	001227	兰州银行	468,600	1,218,360.00	0.05
202	600801	华新水泥	94,700	1,177,121.00	0.05
203	002025	航天电器	24,400	1,171,688.00	0.05
204	000883	湖北能源	271,700	1,149,291.00	0.05
205	000031	大悦城	365,400	1,085,238.00	0.04
206	300253	卫宁健康	144,300	1,037,517.00	0.04
207	600977	中国电影	82,900	1,014,696.00	0.04
208	300026	红日药业	234,300	993,432.00	0.04
209	603596	伯特利	14,000	970,200.00	0.04
210	600126	杭钢股份	178,600	951,938.00	0.04
211	600867	通化东宝	83,200	901,056.00	0.04

212	000729	燕京啤酒	98,100	846,603.00	0.03
213	300285	国瓷材料	35,912	830,285.44	0.03
214	002429	兆驰股份	143,650	801,567.00	0.03
215	688331	荣昌生物	10,000	620,600.00	0.02
216	600329	达仁堂	17,700	595,605.00	0.02
217	002430	杭氧股份	17,000	496,570.00	0.02
218	002563	森马服饰	84,100	485,257.00	0.02
219	000933	神火股份	26,600	446,880.00	0.02
220	601139	深圳燃气	45,700	314,873.00	0.01
221	002385	大北农	46,800	278,928.00	0.01
222	002472	双环传动	8,100	210,762.00	0.01
223	300850	新强联	5,700	181,431.00	0.01
224	600062	华润双鹤	9,000	167,400.00	0.01
225	002368	太极股份	4,300	126,979.00	0.01
226	002739	万达电影	2,300	29,946.00	0.00
227	300748	金力永磁	616	12,455.52	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600030	中信证券	1,499,430	30,543,389.10	1.21
2	300498	温氏股份	794,686	15,941,401.16	0.63
3	600111	北方稀土	814,200	15,746,628.00	0.62
4	002745	木林森	1,501,000	12,998,660.00	0.51
5	601969	海南矿业	1,842,898	12,144,697.82	0.48
6	601878	浙商证券	1,097,300	11,444,839.00	0.45
7	601328	交通银行	1,807,000	10,372,180.00	0.41
8	601881	中国银河	819,200	9,871,360.00	0.39
9	600372	中航机载	683,500	9,008,530.00	0.36
10	600025	华能水电	979,900	8,456,537.00	0.33
11	603013	亚普股份	480,000	8,294,400.00	0.33
12	000807	云铝股份	674,100	8,237,502.00	0.33
13	000627	天茂集团	2,533,400	7,194,856.00	0.28
14	603678	火炬电子	265,720	7,033,608.40	0.28
15	002662	京威股份	1,914,400	6,719,544.00	0.27
16	002916	深南电路	90,000	6,389,100.00	0.25
17	601633	长城汽车	250,200	6,310,044.00	0.25
18	601698	中国卫通	362,700	6,278,337.00	0.25
19	601288	农业银行	1,724,300	6,276,452.00	0.25
20	600015	华夏银行	1,069,600	6,011,152.00	0.24
21	601390	中国中铁	1,046,100	5,941,848.00	0.24
22	601901	方正证券	735,100	5,924,906.00	0.23
23	600132	重庆啤酒	84,100	5,588,445.00	0.22
24	002839	张家港行	1,400,100	5,432,388.00	0.22

25	300514	友讯达	320,400	5,222,520.00	0.21
26	600507	方大特钢	1,129,000	5,204,690.00	0.21
27	601001	晋控煤业	419,800	5,176,134.00	0.20
28	300279	和晶科技	757,500	4,901,025.00	0.19
29	300709	精研科技	148,700	4,637,953.00	0.18
30	002901	大博医疗	113,599	4,610,983.41	0.18
31	300184	力源信息	763,800	4,544,610.00	0.18
32	603110	东方材料	180,200	4,342,820.00	0.17
33	002466	天齐锂业	77,200	4,306,988.00	0.17
34	300780	德恩精工	207,000	4,102,740.00	0.16
35	601699	潞安环能	183,000	4,009,530.00	0.16
36	600426	华鲁恒升	142,700	3,937,093.00	0.16
37	300213	佳讯飞鸿	541,000	3,895,200.00	0.15
38	688018	乐鑫科技	36,727	3,781,044.65	0.15
39	688235	百济神州	26,400	3,670,656.00	0.15
40	002007	华兰生物	165,135	3,654,437.55	0.14
41	688116	天奈科技	119,483	3,469,786.32	0.14
42	605188	国光连锁	400,300	3,406,553.00	0.13
43	001896	豫能控股	760,600	3,323,822.00	0.13
44	300473	德尔股份	178,400	3,261,152.00	0.13
45	000818	航锦科技	102,800	3,225,864.00	0.13
46	603196	日播时尚	237,100	3,203,221.00	0.13
47	603682	锦和商管	555,000	3,185,700.00	0.13
48	600775	南京熊猫	239,800	3,177,350.00	0.13
49	300746	汉嘉设计	312,800	3,143,640.00	0.12
50	600449	宁夏建材	172,132	3,086,326.76	0.12
51	301052	果麦文化	68,302	2,990,261.56	0.12
52	000727	冠捷科技	992,100	2,658,828.00	0.11
53	603028	赛福天	237,900	2,652,585.00	0.11
54	603278	大业股份	209,799	2,643,467.40	0.10
55	002664	信质集团	154,000	2,561,020.00	0.10
56	688468	科美诊断	235,300	2,538,887.00	0.10
57	300127	银河磁体	141,100	2,442,441.00	0.10
58	002601	龙佰集团	141,000	2,415,330.00	0.10
59	002988	豪美新材	99,200	2,367,904.00	0.09
60	603767	中马传动	153,800	2,366,982.00	0.09
61	688007	光峰科技	90,900	2,352,492.00	0.09
62	002241	歌尔股份	111,800	2,348,918.00	0.09
63	688158	优刻得	139,100	2,288,195.00	0.09
64	603236	移远通信	41,815	2,247,556.25	0.09
65	688289	圣湘生物	113,100	2,211,105.00	0.09
66	300625	三雄极光	142,400	2,110,368.00	0.08
67	000876	新希望	225,400	2,100,728.00	0.08

68	600795	国电电力	497,100	2,067,936.00	0.08
69	002705	新宝股份	141,000	2,054,370.00	0.08
70	300618	寒锐钴业	72,000	2,036,880.00	0.08
71	300047	天源迪科	228,400	1,998,500.00	0.08
72	300880	迦南智能	100,100	1,993,992.00	0.08
73	000925	众合科技	229,000	1,983,140.00	0.08
74	300957	贝泰妮	28,400	1,936,028.00	0.08
75	600576	祥源文旅	258,400	1,922,496.00	0.08
76	603005	晶方科技	86,300	1,895,148.00	0.08
77	603899	晨光股份	49,800	1,869,990.00	0.07
78	600710	苏美达	253,800	1,799,442.00	0.07
79	600105	永鼎股份	323,700	1,793,298.00	0.07
80	000977	浪潮信息	53,700	1,782,840.00	0.07
81	002968	新大正	139,200	1,741,392.00	0.07
82	688229	博睿数据	34,500	1,658,415.00	0.07
83	300882	万胜智能	66,300	1,615,068.00	0.06
84	300242	佳云科技	408,300	1,612,785.00	0.06
85	601377	兴业证券	273,900	1,607,793.00	0.06
86	002246	北化股份	192,000	1,572,480.00	0.06
87	688010	福光股份	62,900	1,513,374.00	0.06
88	300180	华峰超纤	335,600	1,483,352.00	0.06
89	300380	安硕信息	69,100	1,465,611.00	0.06
90	000058	深赛格	200,500	1,437,585.00	0.06
91	300030	阳普医疗	177,700	1,377,175.00	0.05
92	688368	晶丰明源	12,500	1,349,250.00	0.05
93	600629	华建集团	258,300	1,332,828.00	0.05
94	300368	汇金股份	187,800	1,280,796.00	0.05
95	000790	华神科技	251,600	1,273,096.00	0.05
96	300231	银信科技	119,600	1,230,684.00	0.05
97	300446	航天智造	77,600	1,215,992.00	0.05
98	301201	诚达药业	47,700	1,213,011.00	0.05
99	600468	百利电气	178,100	1,193,270.00	0.05
100	300846	首都在线	79,000	1,128,910.00	0.04
101	688071	华依科技	22,900	1,115,459.00	0.04
102	600577	精达股份	268,000	1,109,520.00	0.04
103	300319	麦捷科技	112,200	1,081,608.00	0.04
104	600292	远达环保	164,000	995,480.00	0.04
105	688159	有方科技	25,905	975,323.25	0.04
106	300660	江苏雷利	30,600	925,956.00	0.04
107	002687	乔治白	172,600	919,958.00	0.04
108	002826	易明医药	76,800	911,616.00	0.04
109	603486	科沃斯	21,700	899,248.00	0.04
110	600383	金地集团	197,300	860,228.00	0.03

111	300292	吴通控股	216,000	803,520.00	0.03
112	600853	龙建股份	184,700	788,669.00	0.03
113	300432	富临精工	72,600	762,300.00	0.03
114	688160	步科股份	13,000	756,340.00	0.03
115	688733	壹石通	24,400	714,188.00	0.03
116	003007	直真科技	21,500	703,050.00	0.03
117	300341	麦克奥迪	58,100	685,580.00	0.03
118	301007	德迈仕	38,700	654,417.00	0.03
119	300218	安利股份	47,800	647,690.00	0.03
120	600184	光电股份	50,000	571,500.00	0.02
121	002841	视源股份	12,100	553,696.00	0.02
122	301171	易点天下	26,700	527,859.00	0.02
123	601615	明阳智能	41,200	516,648.00	0.02
124	300878	维康药业	19,500	494,715.00	0.02
125	300522	世名科技	36,400	491,400.00	0.02
126	300735	光弘科技	20,800	489,632.00	0.02
127	000338	潍柴动力	34,100	465,465.00	0.02
128	002773	康弘药业	24,100	444,404.00	0.02
129	600446	金证股份	37,600	435,032.00	0.02
130	603033	三维股份	25,605	404,815.05	0.02
131	603489	八方股份	7,300	401,135.00	0.02
132	688300	联瑞新材	6,900	365,355.00	0.01
133	002730	电光科技	38,100	361,188.00	0.01
134	300295	三六五网	25,900	319,347.00	0.01
135	688505	复旦张江	30,700	283,361.00	0.01
136	002351	漫步者	15,100	266,817.00	0.01
137	300211	亿通科技	22,800	230,508.00	0.01
138	300369	绿盟科技	21,200	199,916.00	0.01
139	600791	京能置业	38,400	186,624.00	0.01
140	300707	威唐工业	8,500	158,015.00	0.01
141	300769	德方纳米	2,500	152,575.00	0.01
142	688306	均普智能	26,712	148,785.84	0.01
143	002602	世纪华通	28,400	146,544.00	0.01
144	603626	科森科技	12,900	117,261.00	0.00
145	603002	宏昌电子	18,200	114,296.00	0.00
146	603721	中广天择	3,600	100,944.00	0.00
147	688563	航材股份	1,501	90,795.49	0.00
148	688548	广钢气体	4,048	51,612.00	0.00
149	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.00
150	000612	焦作万方	7,200	41,400.00	0.00
151	301487	盟固利	867	35,512.32	0.00
152	688549	中巨芯	4,294	34,738.46	0.00
153	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00

154	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
155	688582	芯动联科	648	25,058.16	0.00
156	301559	中集环科	1,315	23,985.60	0.00
157	301486	致尚科技	482	22,774.50	0.00
158	301511	德福科技	982	22,261.94	0.00
159	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
160	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
161	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
162	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
163	688591	泰凌微	681	19,081.62	0.00
164	300904	威力传动	304	18,705.12	0.00
165	301172	君逸数码	438	16,714.08	0.00
166	688612	威迈斯	422	16,023.34	0.00
167	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
168	301393	吴帆生物	260	15,436.20	0.00
169	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.00
170	601083	锦江航运	1,263	13,981.41	0.00
171	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
172	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
173	301210	金杨股份	281	12,779.88	0.00
174	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
175	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
176	688334	西高院	688	11,923.04	0.00
177	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
178	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
179	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
180	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
181	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
182	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
183	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
184	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
185	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
186	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
187	301372	科净源	231	10,069.29	0.00
188	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
189	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
190	301395	仁信新材	520	9,718.80	0.00
191	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
192	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
193	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
194	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
195	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
196	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00

197	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
198	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
199	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
200	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
201	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
202	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
203	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
204	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
205	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
206	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
207	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
208	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
209	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
210	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
211	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00
212	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
213	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
214	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
215	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
216	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
217	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
218	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
219	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
220	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
221	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
222	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
223	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
224	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
225	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
226	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
227	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
228	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
229	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601077	渝农商行	124,922,797.00	22.66
2	688521	芯原股份	122,760,176.82	22.27
3	688002	睿创微纳	109,222,583.24	19.81
4	603893	瑞芯微	100,725,245.95	18.27
5	600489	中金黄金	98,070,937.51	17.79

6	300136	信维通信	94,879,985.60	17.21
7	600418	江淮汽车	94,462,526.00	17.14
8	002624	完美世界	94,447,094.90	17.13
9	603444	吉比特	93,320,398.00	16.93
10	688234	天岳先进	92,445,579.64	16.77
11	603589	口子窖	92,125,802.70	16.71
12	000060	中金岭南	92,119,904.00	16.71
13	688385	复旦微电	91,522,911.33	16.60
14	601939	建设银行	90,025,844.00	16.33
15	300558	贝达药业	88,393,433.86	16.04
16	002465	海格通信	87,894,260.00	15.94
17	002568	百润股份	86,157,096.78	15.63
18	300474	景嘉微	85,928,628.68	15.59
19	300724	捷佳伟创	82,846,712.60	15.03
20	601688	华泰证券	82,130,965.80	14.90
21	000932	华菱钢铁	82,072,244.52	14.89
22	600511	国药股份	80,500,506.60	14.60
23	603885	吉祥航空	80,394,141.00	14.58
24	601098	中南传媒	80,170,796.00	14.54
25	000987	越秀资本	79,470,407.98	14.42
26	600258	首旅酒店	78,995,789.99	14.33
27	603026	胜华新材	78,881,622.64	14.31
28	601233	桐昆股份	78,538,871.39	14.25
29	600667	太极实业	78,069,909.00	14.16
30	600030	中信证券	77,494,057.84	14.06
31	002384	东山精密	76,910,036.50	13.95
32	600482	中国动力	76,774,664.00	13.93
33	300699	光威复材	76,253,450.46	13.83
34	600535	天士力	76,023,357.35	13.79
35	002745	木林森	75,523,438.00	13.70
36	600369	西南证券	75,187,976.00	13.64
37	603858	步长制药	74,698,135.03	13.55
38	688116	天奈科技	74,252,294.34	13.47
39	688099	晶晨股份	73,956,709.03	13.42
40	600968	海油发展	73,844,808.00	13.40
41	300012	华测检测	73,783,057.43	13.38
42	000039	中集集团	73,360,981.30	13.31
43	688390	固德威	72,618,708.64	13.17
44	603160	汇顶科技	72,500,850.90	13.15
45	688169	石头科技	71,458,895.74	12.96
46	002152	广电运通	69,731,598.00	12.65
47	002138	顺络电子	69,104,562.00	12.54
48	002925	盈趣科技	68,982,670.69	12.51

49	002299	圣农发展	68,769,248.08	12.48
50	300001	特锐德	68,723,225.32	12.47
51	600373	中文传媒	68,673,859.40	12.46
52	000997	新大陆	68,344,491.14	12.40
53	000050	深天马 A	66,189,457.80	12.01
54	002500	山西证券	65,325,658.88	11.85
55	002326	永太科技	65,274,143.58	11.84
56	002156	通富微电	64,671,599.71	11.73
57	601225	陕西煤业	64,486,974.00	11.70
58	601577	长沙银行	64,251,542.00	11.66
59	300037	新宙邦	63,842,562.80	11.58
60	688567	孚能科技	63,635,497.73	11.54
61	601198	东兴证券	63,511,941.00	11.52
62	300482	万孚生物	63,335,966.60	11.49
63	600392	盛和资源	62,826,914.50	11.40
64	300285	国瓷材料	62,770,389.61	11.39
65	600153	建发股份	62,744,567.00	11.38
66	002056	横店东磁	62,386,068.47	11.32
67	600372	中航机载	62,025,002.24	11.25
68	000807	云铝股份	61,834,035.00	11.22
69	000975	银泰黄金	61,810,079.66	11.21
70	600498	烽火通信	61,738,368.10	11.20
71	000703	恒逸石化	61,674,350.00	11.19
72	600079	人福医药	60,561,789.12	10.99
73	603658	安图生物	59,872,029.90	10.86
74	603267	鸿远电子	59,384,836.80	10.77
75	601108	财通证券	59,183,078.00	10.74
76	002683	广东宏大	59,180,230.56	10.74
77	601377	兴业证券	58,989,895.00	10.70
78	601869	长飞光纤	58,854,824.54	10.68
79	600325	华发股份	58,377,138.00	10.59
80	002155	湖南黄金	58,347,181.91	10.58
81	002690	美亚光电	58,296,944.54	10.58
82	300676	华大基因	57,966,626.07	10.52
83	002429	兆驰股份	57,911,522.00	10.51
84	600536	中国软件	57,765,770.04	10.48
85	601992	金隅集团	57,644,759.00	10.46
86	600095	湘财股份	56,865,640.36	10.32
87	603379	三美股份	56,446,318.00	10.24
88	603927	中科软	56,087,325.42	10.17
89	600765	中航重机	55,944,473.27	10.15
90	300308	中际旭创	54,984,091.75	9.97
91	002797	第一创业	54,855,368.00	9.95

92	688185	康希诺	54,774,842.41	9.94
93	600885	宏发股份	54,495,962.95	9.89
94	600166	福田汽车	54,147,762.18	9.82
95	000581	威孚高科	53,881,064.91	9.77
96	688009	中国通号	53,662,725.29	9.73
97	601168	西部矿业	53,364,407.37	9.68
98	002518	科士达	52,908,750.97	9.60
99	002423	中粮资本	52,681,414.00	9.56
100	002791	坚朗五金	52,584,197.63	9.54
101	300009	安科生物	52,570,164.20	9.54
102	300383	光环新网	51,702,999.00	9.38
103	000627	天茂集团	51,045,875.00	9.26
104	603517	绝味食品	50,901,827.29	9.23
105	600177	雅戈尔	50,759,991.80	9.21
106	600380	健康元	50,597,653.66	9.18
107	002563	森马服饰	50,002,204.95	9.07
108	600259	广晟有色	49,903,188.48	9.05
109	601928	凤凰传媒	49,731,026.00	9.02
110	002409	雅克科技	49,612,739.73	9.00
111	601696	中银证券	49,499,845.50	8.98
112	000629	钒钛股份	49,466,851.80	8.97
113	601555	东吴证券	49,321,051.60	8.95
114	601969	海南矿业	49,071,171.20	8.90
115	688772	珠海冠宇	49,032,511.95	8.89
116	002080	中材科技	48,659,560.00	8.83
117	002373	千方科技	48,577,947.92	8.81
118	689009	九号公司	48,184,977.10	8.74
119	603939	益丰药房	47,549,970.76	8.63
120	601187	厦门银行	47,308,303.00	8.58
121	002025	航天电器	47,258,655.47	8.57
122	000783	长江证券	47,119,203.00	8.55
123	600985	淮北矿业	47,095,586.50	8.54
124	600497	驰宏锌锗	46,766,128.00	8.48
125	300418	昆仑万维	46,659,221.37	8.46
126	002463	沪电股份	46,594,189.70	8.45
127	300017	网宿科技	45,956,388.00	8.34
128	603218	日月股份	45,912,713.98	8.33
129	601179	中国西电	45,590,838.53	8.27
130	300357	我武生物	45,530,244.42	8.26
131	600315	上海家化	45,502,837.00	8.25
132	002557	洽洽食品	45,195,170.00	8.20
133	002372	伟星新材	45,186,770.50	8.20
134	688777	中控技术	44,997,407.65	8.16

135	600316	洪都航空	44,677,398.81	8.10
136	000930	中粮科技	44,065,971.50	7.99
137	600399	抚顺特钢	43,779,729.00	7.94
138	300253	卫宁健康	43,657,895.01	7.92
139	300595	欧普康视	43,533,265.39	7.90
140	300618	寒锐钴业	43,311,535.66	7.86
141	601456	国联证券	43,148,820.00	7.83
142	600859	王府井	42,909,082.49	7.78
143	000738	航发控制	42,653,842.40	7.74
144	603228	景旺电子	42,443,508.00	7.70
145	000960	锡业股份	42,413,546.99	7.69
146	600988	赤峰黄金	42,284,207.00	7.67
147	600378	昊华科技	42,214,035.63	7.66
148	600871	石化油服	42,189,477.84	7.65
149	603516	淳中科技	42,171,908.00	7.65
150	688029	南微医学	42,030,182.04	7.62
151	002032	苏泊尔	41,789,339.00	7.58
152	600998	九州通	41,643,123.03	7.55
153	601633	长城汽车	41,481,069.00	7.53
154	600161	天坛生物	41,453,623.96	7.52
155	000027	深圳能源	41,228,106.00	7.48
156	600663	陆家嘴	40,642,948.00	7.37
157	002368	太极股份	40,431,357.02	7.33
158	002273	水晶光电	40,427,346.00	7.33
159	601958	金钼股份	40,095,597.00	7.27
160	000513	丽珠集团	39,983,697.60	7.25
161	300529	健帆生物	39,975,657.25	7.25
162	002242	九阳股份	39,920,624.36	7.24
163	601636	旗滨集团	39,761,875.00	7.21
164	600160	巨化股份	39,407,759.00	7.15
165	002901	大博医疗	39,309,938.06	7.13
166	000400	许继电气	39,076,860.90	7.09
167	002223	鱼跃医疗	39,037,294.40	7.08
168	002926	华西证券	38,533,042.00	6.99
169	600546	山煤国际	37,924,729.00	6.88
170	600906	财达证券	37,853,031.00	6.87
171	300244	迪安诊断	37,812,461.51	6.86
172	002705	新宝股份	37,683,822.37	6.84
173	600499	科达制造	37,317,244.00	6.77
174	002444	巨星科技	37,173,860.80	6.74
175	601665	齐鲁银行	37,138,200.00	6.74
176	603866	桃李面包	36,982,037.16	6.71
177	603883	老百姓	36,550,050.06	6.63

178	600486	扬农化工	36,493,318.05	6.62
179	601000	唐山港	36,325,099.61	6.59
180	603127	昭衍新药	36,273,277.57	6.58
181	688208	道通科技	35,584,143.94	6.46
182	000898	鞍钢股份	34,968,498.00	6.34
183	601818	光大银行	34,775,349.00	6.31
184	600718	东软集团	34,655,769.24	6.29
185	000559	万向钱潮	34,650,440.00	6.29
186	600556	天下秀	34,567,761.00	6.27
187	600038	中直股份	34,367,707.12	6.23
188	000547	航天发展	34,359,630.00	6.23
189	600015	华夏银行	34,319,451.00	6.23
190	002422	科伦药业	34,142,090.95	6.19
191	002739	万达电影	34,111,185.15	6.19
192	300395	菲利华	34,080,175.00	6.18
193	000739	普洛药业	33,816,003.31	6.13
194	603236	移远通信	33,744,190.85	6.12
195	603338	浙江鼎力	33,730,739.00	6.12
196	600909	华安证券	33,584,225.00	6.09
197	603727	博迈科	33,499,223.00	6.08
198	600563	法拉电子	33,283,607.49	6.04
199	000166	申万宏源	33,242,646.00	6.03
200	688220	翱捷科技	33,051,860.33	6.00
201	600808	马钢股份	33,027,193.48	5.99
202	000883	湖北能源	33,027,169.00	5.99
203	002019	亿帆医药	32,866,641.00	5.96
204	300363	博腾股份	32,834,571.00	5.96
205	688289	圣湘生物	32,816,068.38	5.95
206	300463	迈克生物	32,800,198.60	5.95
207	603638	艾迪精密	32,791,750.00	5.95
208	688660	电气风电	32,696,665.18	5.93
209	000933	神火股份	32,655,383.00	5.92
210	603225	新凤鸣	32,653,049.00	5.92
211	000009	中国宝安	32,466,430.00	5.89
212	600764	中国海防	32,465,826.20	5.89
213	002961	瑞达期货	32,200,141.95	5.84
214	002600	领益智造	32,099,472.95	5.82
215	300866	安克创新	32,067,911.00	5.82
216	601118	海南橡胶	32,025,038.00	5.81
217	600967	内蒙一机	31,946,095.00	5.80
218	600141	兴发集团	31,741,318.00	5.76
219	000830	鲁西化工	31,540,218.00	5.72
220	002608	江苏国信	31,429,290.00	5.70

221	000021	深科技	31,302,087.32	5.68
222	600348	华阳股份	31,101,609.27	5.64
223	688030	山石网科	30,929,066.86	5.61
224	000519	中兵红箭	30,810,587.47	5.59
225	002340	格林美	30,455,779.00	5.52
226	600566	济川药业	30,377,766.76	5.51
227	300438	鹏辉能源	30,295,367.00	5.50
228	002407	多氟多	30,046,439.80	5.45
229	600737	中粮糖业	30,009,898.80	5.44
230	002396	星网锐捷	29,945,473.00	5.43
231	002506	协鑫集成	29,943,660.00	5.43
232	600507	方大特钢	29,886,062.20	5.42
233	300498	温氏股份	29,681,605.04	5.38
234	600862	中航高科	29,398,073.00	5.33
235	300604	长川科技	29,381,222.88	5.33
236	601997	贵阳银行	29,286,609.00	5.31
237	601990	南京证券	29,235,123.00	5.30
238	688010	福光股份	29,179,991.91	5.29
239	601211	国泰君安	29,168,450.00	5.29
240	601878	浙商证券	28,958,510.00	5.25
241	601717	郑煤机	28,919,648.00	5.25
242	688779	长远锂科	28,880,294.15	5.24
243	600580	卧龙电驱	28,835,255.08	5.23
244	002268	电科网安	28,832,126.34	5.23
245	002531	天顺风能	28,634,739.00	5.19
246	600705	中航产融	28,424,082.00	5.16
247	601328	交通银行	28,327,115.00	5.14
248	603056	德邦股份	28,269,836.44	5.13
249	600048	保利发展	27,970,611.00	5.07
250	601231	环旭电子	27,755,501.20	5.04
251	603317	天味食品	27,693,328.08	5.02
252	601699	潞安环能	27,661,090.78	5.02
253	001203	大中矿业	27,581,587.00	5.00
254	002153	石基信息	27,558,864.68	5.00
255	600185	格力地产	27,509,445.73	4.99
256	002030	达安基因	27,501,584.40	4.99
257	600728	佳都科技	27,412,872.00	4.97
258	600487	亨通光电	27,368,647.00	4.96
259	300706	阿石创	27,352,259.00	4.96
260	002128	电投能源	27,323,616.00	4.96
261	300458	全志科技	26,991,475.00	4.90
262	002294	信立泰	26,813,208.12	4.86
263	002603	以岭药业	26,812,142.00	4.86

264	002195	岩山科技	26,784,183.00	4.86
265	603737	三棵树	26,668,191.00	4.84
266	600598	北大荒	26,495,901.00	4.81
267	300850	新强联	26,282,915.00	4.77
268	300296	利亚德	26,271,067.00	4.77
269	600867	通化东宝	26,266,347.91	4.76
270	002497	雅化集团	26,235,781.00	4.76
271	600820	隧道股份	26,119,433.00	4.74
272	600707	彩虹股份	26,024,797.46	4.72
273	600118	中国卫星	25,835,549.39	4.69
274	600989	宝丰能源	25,675,631.00	4.66
275	601088	中国神华	25,579,332.00	4.64
276	002385	大北农	25,428,025.00	4.61
277	603233	大参林	25,411,045.09	4.61
278	688256	寒武纪	25,339,280.50	4.60
279	002646	天佑德酒	25,291,610.31	4.59
280	688255	凯尔达	25,284,349.70	4.59
281	300776	帝尔激光	25,197,125.80	4.57
282	601169	北京银行	24,751,788.00	4.49
283	601998	中信银行	24,731,135.00	4.49
284	002850	科达利	24,670,015.05	4.48
285	600704	物产中大	24,642,048.00	4.47
286	600999	招商证券	24,474,024.00	4.44
287	000970	中科三环	24,345,465.50	4.42
288	601106	中国一重	24,270,413.00	4.40
289	003816	中国广核	24,232,914.00	4.40
290	601966	玲珑轮胎	24,138,750.25	4.38
291	688662	富信科技	23,890,853.90	4.33
292	600008	首创环保	23,803,278.00	4.32
293	605358	立昂微	23,768,963.48	4.31
294	600339	中油工程	23,754,816.00	4.31
295	601139	深圳燃气	23,507,525.00	4.26
296	300146	汤臣倍健	23,394,052.00	4.24
297	300144	宋城演艺	23,390,228.72	4.24
298	300058	蓝色光标	23,337,471.00	4.23
299	002948	青岛银行	23,298,936.00	4.23
300	600027	华电国际	23,228,883.00	4.21
301	600481	双良节能	22,933,219.00	4.16
302	600062	华润双鹤	22,911,220.08	4.16
303	300212	易华录	22,896,960.00	4.15
304	601128	常熟银行	22,805,066.80	4.14
305	688107	安路科技	22,786,767.98	4.13
306	002110	三钢闽光	22,621,345.00	4.10

307	601828	美凯龙	22,446,171.00	4.07
308	000729	燕京啤酒	22,380,321.00	4.06
309	603712	七一二	22,271,494.66	4.04
310	600029	南方航空	22,155,323.00	4.02
311	600329	达仁堂	21,999,899.00	3.99
312	688488	艾迪药业	21,963,537.19	3.98
313	603039	泛微网络	21,895,400.00	3.97
314	600655	豫园股份	21,656,932.00	3.93
315	002410	广联达	21,598,240.00	3.92
316	002131	利欧股份	21,541,985.00	3.91
317	300568	星源材质	21,446,927.85	3.89
318	601991	大唐发电	21,321,533.65	3.87
319	000656	金科股份	21,249,875.00	3.85
320	300206	理邦仪器	21,145,695.00	3.84
321	600839	四川长虹	21,130,249.00	3.83
322	000031	大悦城	20,678,119.00	3.75
323	600096	云天化	20,670,563.00	3.75
324	688039	当虹科技	20,667,239.68	3.75
325	000514	渝开发	20,655,745.00	3.75
326	000998	隆平高科	20,648,905.03	3.75
327	600352	浙江龙盛	20,605,010.98	3.74
328	000593	德龙汇能	20,568,049.40	3.73
329	600299	安迪苏	20,411,513.20	3.70
330	300972	万辰集团	20,393,241.00	3.70
331	603660	苏州科达	20,275,461.00	3.68
332	688561	奇安信	19,904,087.05	3.61
333	600637	东方明珠	19,779,391.00	3.59
334	002532	天山铝业	19,743,483.00	3.58
335	600642	申能股份	19,705,102.12	3.57
336	688519	南亚新材	19,599,836.09	3.56
337	688052	纳芯微	19,596,845.25	3.56
338	300957	贝泰妮	19,539,366.57	3.54
339	601611	中国核建	19,435,456.37	3.53
340	600516	方大炭素	19,420,822.26	3.52
341	600409	三友化工	19,329,883.00	3.51
342	002468	申通快递	19,306,768.55	3.50
343	300115	长盈精密	19,250,013.00	3.49
344	688536	思瑞浦	19,063,296.27	3.46
345	601881	中国银河	18,960,748.00	3.44
346	600016	民生银行	18,774,685.00	3.41
347	002559	亚威股份	18,630,311.00	3.38
348	300748	金力永磁	18,579,150.60	3.37
349	603345	安井食品	18,567,871.56	3.37

350	600126	杭钢股份	18,537,649.00	3.36
351	603919	金徽酒	18,481,893.00	3.35
352	002673	西部证券	18,480,992.28	3.35
353	601038	一拖股份	18,467,102.00	3.35
354	688105	诺唯赞	18,405,197.25	3.34
355	300073	当升科技	18,391,125.53	3.34
356	603688	石英股份	18,262,991.00	3.31
357	300515	三德科技	18,148,604.00	3.29
358	600710	苏美达	18,118,806.00	3.29
359	600688	上海石化	18,089,047.00	3.28
360	300747	锐科激光	18,075,594.40	3.28
361	001696	宗申动力	18,023,359.00	3.27
362	603808	歌力思	17,994,831.00	3.26
363	601825	沪农商行	17,886,630.00	3.24
364	600801	华新水泥	17,884,341.16	3.24
365	300026	红日药业	17,846,453.00	3.24
366	002803	吉宏股份	17,764,250.00	3.22
367	002415	海康威视	17,701,091.00	3.21
368	000338	潍柴动力	17,662,863.00	3.20
369	002250	联化科技	17,624,385.00	3.20
370	603217	元利科技	17,600,565.00	3.19
371	300582	英飞特	17,580,322.26	3.19
372	000600	建投能源	17,520,357.00	3.18
373	688063	派能科技	17,471,536.51	3.17
374	300465	高伟达	17,434,056.00	3.16
375	000571	新大洲 A	17,387,311.46	3.15
376	601319	中国人保	17,354,154.00	3.15
377	688819	天能股份	17,337,353.67	3.15
378	600171	上海贝岭	17,217,181.00	3.12
379	600582	天地科技	17,165,510.00	3.11
380	600917	重庆燃气	17,146,019.90	3.11
381	000598	兴蓉环境	17,119,712.00	3.11
382	603156	养元饮品	17,053,180.55	3.09
383	603093	南华期货	17,004,613.00	3.08
384	603986	兆易创新	16,940,934.96	3.07
385	300096	ST 易联众	16,845,274.00	3.06
386	300188	国投智能	16,834,891.00	3.05
387	002185	华天科技	16,761,948.00	3.04
388	688318	财富趋势	16,492,599.33	2.99
389	600111	北方稀土	16,465,924.00	2.99
390	688608	恒玄科技	16,427,016.97	2.98
391	688072	拓荆科技	16,407,432.69	2.98
392	600685	中船防务	16,318,082.00	2.96

393	601058	赛轮轮胎	16,169,485.00	2.93
394	300423	昇辉科技	16,138,375.00	2.93
395	002028	思源电气	16,126,888.60	2.93
396	300832	新产业	16,003,487.00	2.90
397	300788	中信出版	15,977,888.00	2.90
398	300514	友讯达	15,710,231.00	2.85
399	002493	荣盛石化	15,618,163.00	2.83
400	002595	豪迈科技	15,392,751.88	2.79
401	600056	中国医药	15,370,522.00	2.79
402	600072	中船科技	15,242,395.00	2.77
403	600927	永安期货	15,078,314.00	2.74
404	603650	彤程新材	15,060,657.41	2.73
405	600977	中国电影	15,016,830.88	2.72
406	603355	莱克电气	15,006,410.00	2.72
407	600521	华海药业	14,950,683.80	2.71
408	300279	和晶科技	14,926,348.00	2.71
409	688088	虹软科技	14,807,912.77	2.69
410	600025	华能水电	14,750,724.00	2.68
411	601618	中国中冶	14,716,135.00	2.67
412	300719	安达维尔	14,714,696.00	2.67
413	002831	裕同科技	14,648,754.00	2.66
414	300711	广哈通信	14,618,979.00	2.65
415	600195	中牧股份	14,611,066.58	2.65
416	300746	汉嘉设计	14,589,307.00	2.65
417	603013	亚普股份	14,427,894.00	2.62
418	000800	一汽解放	14,394,409.00	2.61
419	601390	中国中铁	14,390,298.00	2.61
420	688126	沪硅产业	14,350,611.38	2.60
421	300888	稳健医疗	14,246,855.20	2.58
422	002221	东华能源	14,208,642.00	2.58
423	002738	中矿资源	14,189,400.20	2.57
424	688699	明微电子	14,189,073.68	2.57
425	600449	宁夏建材	14,156,153.15	2.57
426	603882	金域医学	14,139,467.00	2.57
427	002601	龙佰集团	14,116,279.00	2.56
428	300682	朗新集团	13,939,436.00	2.53
429	688262	国芯科技	13,722,267.38	2.49
430	000596	古井贡酒	13,712,554.62	2.49
431	300088	长信科技	13,635,864.00	2.47
432	601901	方正证券	13,410,443.00	2.43
433	002625	光启技术	13,393,527.00	2.43
434	600848	上海临港	13,355,416.00	2.42
435	000568	泸州老窖	13,303,118.00	2.41

436	000776	广发证券	13,275,799.00	2.41
437	002971	和远气体	13,268,033.00	2.41
438	000423	东阿阿胶	13,219,840.00	2.40
439	600390	五矿资本	13,210,016.00	2.40
440	301029	怡合达	13,170,323.80	2.39
441	603529	爱玛科技	13,140,836.50	2.38
442	603501	韦尔股份	13,066,466.35	2.37
443	600066	宇通客车	12,978,662.00	2.35
444	603682	锦和商管	12,975,758.00	2.35
445	603596	伯特利	12,970,388.00	2.35
446	000825	太钢不锈	12,934,494.00	2.35
447	000988	华工科技	12,926,574.95	2.34
448	300373	扬杰科技	12,925,263.00	2.34
449	002527	新时达	12,891,231.00	2.34
450	600643	爱建集团	12,822,678.00	2.33
451	601933	永辉超市	12,769,635.00	2.32
452	600351	亚宝药业	12,732,085.00	2.31
453	688301	奕瑞科技	12,727,996.34	2.31
454	688418	震有科技	12,712,044.92	2.31
455	688036	传音控股	12,693,665.69	2.30
456	300661	圣邦股份	12,610,596.40	2.29
457	000831	中国稀土	12,492,939.00	2.27
458	300035	中科电气	12,480,809.55	2.26
459	002203	海亮股份	12,427,719.00	2.25
460	688766	普冉股份	12,245,991.65	2.22
461	688778	厦钨新能	12,225,573.33	2.22
462	600346	恒力石化	12,107,805.00	2.20
463	600863	内蒙华电	12,077,489.00	2.19
464	000425	徐工机械	11,997,759.00	2.18
465	688005	容百科技	11,989,404.37	2.17
466	600282	南钢股份	11,975,472.00	2.17
467	000869	张裕 A	11,964,005.00	2.17
468	600180	瑞茂通	11,893,040.00	2.16
469	002254	泰和新材	11,855,717.00	2.15
470	300257	开山股份	11,787,209.35	2.14
471	300557	理工光科	11,754,791.00	2.13
472	002060	广东建工	11,720,383.00	2.13
473	601872	招商轮船	11,718,678.40	2.13
474	601598	中国外运	11,679,252.00	2.12
475	600644	乐山电力	11,624,160.00	2.11
476	002648	卫星化学	11,617,554.09	2.11
477	002092	中泰化学	11,596,253.00	2.10
478	002839	张家港行	11,583,260.00	2.10

479	002388	新亚制程	11,577,983.00	2.10
480	003035	南网能源	11,454,915.00	2.08
481	688239	航宇科技	11,406,040.79	2.07
482	000062	深圳华强	11,398,445.00	2.07
483	600131	国网信通	11,365,607.00	2.06
484	600064	南京高科	11,356,855.40	2.06
485	002867	周大生	11,279,714.00	2.05
486	301236	软通动力	11,270,774.00	2.04
487	300168	万达信息	11,215,091.00	2.03
488	300378	鼎捷软件	11,132,260.00	2.02
489	300213	佳讯飞鸿	11,031,841.00	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	688002	睿创微纳	110,388,373.35	20.03
2	688521	芯原股份	105,735,218.07	19.18
3	600489	中金黄金	103,516,631.38	18.78
4	603893	瑞芯微	96,969,944.68	17.59
5	601077	渝农商行	96,883,892.00	17.58
6	600667	太极实业	96,517,527.21	17.51
7	600418	江淮汽车	93,995,783.00	17.05
8	000987	越秀资本	90,279,637.97	16.38
9	300558	贝达药业	89,491,325.24	16.23
10	601233	桐昆股份	88,957,475.11	16.14
11	601939	建设银行	86,861,956.00	15.76
12	300474	景嘉微	86,294,123.78	15.65
13	688385	复旦微电	85,844,801.84	15.57
14	601688	华泰证券	85,717,878.38	15.55
15	603444	吉比特	84,175,369.00	15.27
16	002384	东山精密	83,965,654.27	15.23
17	688234	天岳先进	83,917,406.03	15.22
18	688390	固德威	83,417,961.99	15.13
19	000060	中金岭南	81,795,091.00	14.84
20	601098	中南传媒	81,064,215.93	14.71
21	002568	百润股份	80,396,392.92	14.58
22	002624	完美世界	80,125,911.00	14.54
23	600535	天士力	78,950,832.34	14.32
24	002465	海格通信	76,621,231.00	13.90
25	603160	汇顶科技	72,594,750.30	13.17
26	002299	圣农发展	71,979,194.86	13.06
27	300699	光威复材	71,957,825.02	13.05

28	002138	顺络电子	69,818,386.69	12.67
29	300724	捷佳伟创	68,557,676.00	12.44
30	603589	口子窖	67,478,956.75	12.24
31	600482	中国动力	66,101,308.00	11.99
32	002429	兆驰股份	65,710,642.00	11.92
33	603658	安图生物	65,005,290.53	11.79
34	000997	新大陆	64,914,563.14	11.78
35	603885	吉祥航空	64,866,935.00	11.77
36	601225	陕西煤业	64,728,535.00	11.74
37	002925	盈趣科技	64,620,032.68	11.72
38	300482	万孚生物	64,426,354.80	11.69
39	600968	海油发展	63,690,423.00	11.55
40	300001	特锐德	63,210,608.57	11.47
41	300037	新宙邦	62,627,603.72	11.36
42	603026	胜华新材	62,529,331.18	11.34
43	601869	长飞光纤	61,584,473.42	11.17
44	600373	中文传媒	61,384,022.00	11.14
45	688116	天奈科技	61,046,372.02	11.07
46	000050	深天马 A	60,744,129.00	11.02
47	600079	人福医药	60,717,536.00	11.01
48	600511	国药股份	60,155,950.22	10.91
49	002152	广电运通	60,081,938.35	10.90
50	300136	信维通信	59,694,286.00	10.83
51	002745	木林森	59,653,445.27	10.82
52	002056	横店东磁	59,377,741.77	10.77
53	000581	威孚高科	58,158,041.00	10.55
54	002155	湖南黄金	57,695,229.00	10.47
55	300285	国瓷材料	57,402,710.00	10.41
56	600166	福田汽车	57,212,504.40	10.38
57	000807	云铝股份	56,914,004.00	10.32
58	002690	美亚光电	56,023,901.50	10.16
59	601992	金隅集团	55,765,476.00	10.12
60	300308	中际旭创	55,706,568.85	10.11
61	002326	永太科技	55,451,455.06	10.06
62	000975	银泰黄金	55,391,607.85	10.05
63	600536	中国软件	54,755,348.44	9.93
64	601377	兴业证券	54,636,536.20	9.91
65	002156	通富微电	53,564,279.00	9.72
66	689009	九号公司	53,199,960.76	9.65
67	002683	广东宏大	52,939,371.00	9.60
68	300017	网宿科技	52,574,398.00	9.54
69	600372	中航机载	52,313,428.96	9.49
70	002500	山西证券	51,807,328.00	9.40

71	600258	首旅酒店	51,673,516.13	9.37
72	600325	华发股份	51,508,293.00	9.34
73	300009	安科生物	51,276,292.29	9.30
74	600153	建发股份	51,163,238.00	9.28
75	603927	中科软	50,945,451.80	9.24
76	002563	森马服饰	50,857,040.20	9.23
77	601108	财通证券	50,636,255.00	9.19
78	002518	科士达	50,540,323.79	9.17
79	600095	湘财股份	49,562,330.38	8.99
80	603939	益丰药房	49,539,865.16	8.99
81	601696	中银证券	49,412,257.50	8.96
82	000629	钒钛股份	49,343,605.76	8.95
83	600985	淮北矿业	49,279,571.03	8.94
84	688009	中国通号	49,236,394.17	8.93
85	688185	康希诺	49,137,758.42	8.91
86	002797	第一创业	49,132,525.00	8.91
87	600177	雅戈尔	48,119,319.16	8.73
88	600259	广晟有色	48,082,556.16	8.72
89	601187	厦门银行	47,813,862.00	8.67
90	688029	南微医学	47,574,695.33	8.63
91	002025	航天电器	47,503,688.00	8.62
92	603379	三美股份	47,351,511.60	8.59
93	601928	凤凰传媒	47,218,110.00	8.57
94	601555	东吴证券	46,297,076.00	8.40
95	600380	健康元	46,185,614.76	8.38
96	000783	长江证券	46,146,639.00	8.37
97	002791	坚朗五金	46,104,063.56	8.36
98	002373	千方科技	45,923,398.40	8.33
99	000627	天茂集团	45,896,240.00	8.33
100	002080	中材科技	45,357,974.00	8.23
101	600871	石化油服	44,994,954.82	8.16
102	000703	恒逸石化	44,900,365.00	8.15
103	688567	孚能科技	44,396,989.93	8.05
104	688772	珠海冠宇	44,301,927.70	8.04
105	300383	光环新网	43,290,291.00	7.85
106	600030	中信证券	43,176,860.20	7.83
107	600497	驰宏锌锗	43,004,714.00	7.80
108	600498	烽火通信	42,846,603.00	7.77
109	600988	赤峰黄金	42,740,082.88	7.75
110	601179	中国西电	42,385,527.08	7.69
111	688777	中控技术	42,347,799.43	7.68
112	601168	西部矿业	42,258,795.96	7.67
113	603516	淳中科技	42,110,235.59	7.64

114	002901	大博医疗	42,077,038.87	7.63
115	600765	中航重机	41,851,075.60	7.59
116	600998	九州通	41,828,885.16	7.59
117	002423	中粮资本	41,533,165.33	7.53
118	002223	鱼跃医疗	41,252,312.10	7.48
119	000027	深圳能源	41,035,486.00	7.44
120	603858	步长制药	40,908,915.75	7.42
121	000400	许继电气	40,709,913.42	7.39
122	000932	华菱钢铁	40,597,342.80	7.36
123	300253	卫宁健康	40,579,662.80	7.36
124	002409	雅克科技	39,971,126.72	7.25
125	002273	水晶光电	39,892,426.20	7.24
126	603267	鸿远电子	39,753,178.94	7.21
127	002242	九阳股份	39,571,030.53	7.18
128	300618	寒锐钴业	39,526,420.68	7.17
129	603218	日月股份	39,304,632.52	7.13
130	600859	王府井	39,249,913.85	7.12
131	688169	石头科技	39,124,796.96	7.10
132	300357	我武生物	38,939,900.00	7.06
133	601633	长城汽车	38,936,845.00	7.06
134	000513	丽珠集团	38,919,528.66	7.06
135	002926	华西证券	38,828,814.32	7.04
136	688099	晶晨股份	38,168,664.77	6.92
137	601958	金钼股份	37,617,305.00	6.82
138	600038	中直股份	37,258,729.20	6.76
139	601456	国联证券	37,206,721.00	6.75
140	600316	洪都航空	37,049,087.48	6.72
141	600556	天下秀	36,950,557.00	6.70
142	300012	华测检测	36,899,926.98	6.69
143	000930	中粮科技	36,568,517.00	6.63
144	603883	老百姓	36,554,617.90	6.63
145	600909	华安证券	36,338,351.00	6.59
146	603225	新凤鸣	35,876,917.92	6.51
147	002368	太极股份	35,763,195.25	6.49
148	600906	财达证券	35,749,498.23	6.49
149	601969	海南矿业	35,643,876.40	6.47
150	603338	浙江鼎力	35,566,306.02	6.45
151	000898	鞍钢股份	35,303,203.00	6.40
152	002422	科伦药业	35,139,222.00	6.37
153	000960	锡业股份	34,851,318.00	6.32
154	600486	扬农化工	34,817,090.00	6.32
155	601665	齐鲁银行	34,478,211.00	6.25
156	601198	东兴证券	34,052,901.00	6.18

157	601818	光大银行	34,023,219.00	6.17
158	603517	绝味食品	33,901,318.95	6.15
159	601577	长沙银行	33,891,907.00	6.15
160	600663	陆家嘴	33,822,258.00	6.14
161	300395	菲利华	33,770,098.21	6.13
162	600369	西南证券	33,763,878.27	6.13
163	300418	昆仑万维	33,294,393.80	6.04
164	002739	万达电影	33,292,296.00	6.04
165	601990	南京证券	33,187,902.98	6.02
166	300529	健帆生物	33,062,942.00	6.00
167	002506	协鑫集成	33,024,312.04	5.99
168	603638	艾迪精密	33,023,534.00	5.99
169	600764	中国海防	32,876,089.39	5.96
170	603727	博迈科	32,828,527.00	5.96
171	601231	环旭电子	32,722,007.00	5.94
172	000166	申万宏源	32,718,485.50	5.94
173	002961	瑞达期货	32,416,817.95	5.88
174	300676	华大基因	32,390,952.42	5.88
175	600378	昊华科技	32,211,215.72	5.84
176	600718	东软集团	32,145,393.43	5.83
177	600399	抚顺特钢	32,103,911.36	5.82
178	601118	海南橡胶	32,092,291.00	5.82
179	688220	翱捷科技	32,029,475.80	5.81
180	000738	航发控制	31,947,889.00	5.80
181	601636	旗滨集团	31,587,767.00	5.73
182	600348	华阳股份	31,360,340.07	5.69
183	002463	沪电股份	31,355,504.20	5.69
184	000739	普洛药业	31,323,414.46	5.68
185	300463	迈克生物	31,062,253.72	5.63
186	002032	苏泊尔	30,981,215.00	5.62
187	002153	石基信息	30,955,370.48	5.62
188	300866	安克创新	30,684,324.00	5.57
189	688030	山石网科	30,665,931.02	5.56
190	002705	新宝股份	30,618,587.03	5.55
191	000933	神火股份	30,582,153.00	5.55
192	600546	山煤国际	30,581,780.03	5.55
193	603127	昭衍新药	30,547,523.29	5.54
194	688256	寒武纪	30,526,101.16	5.54
195	600705	中航产融	30,297,033.00	5.50
196	600737	中粮糖业	30,244,866.20	5.49
197	600487	亨通光电	30,143,950.55	5.47
198	688660	电气风电	30,102,840.62	5.46
199	600027	华电国际	30,080,765.00	5.46

200	000883	湖北能源	30,040,617.00	5.45
201	600862	中航高科	29,921,178.00	5.43
202	600728	佳都科技	29,519,941.00	5.36
203	603233	大参林	29,359,018.95	5.33
204	002396	星网锐捷	29,336,535.00	5.32
205	603236	移远通信	29,249,524.62	5.31
206	000009	中国宝安	28,895,945.00	5.24
207	601211	国泰君安	28,859,665.00	5.24
208	300438	鹏辉能源	28,779,784.81	5.22
209	000559	万向钱潮	28,725,267.40	5.21
210	002531	天顺风能	28,700,220.00	5.21
211	002131	利欧股份	28,534,592.00	5.18
212	600160	巨化股份	28,363,223.36	5.15
213	600580	卧龙电驱	28,286,870.75	5.13
214	002407	多氟多	28,117,871.00	5.10
215	300144	宋城演艺	27,984,062.28	5.08
216	002128	电投能源	27,923,778.00	5.07
217	688289	圣湘生物	27,661,427.39	5.02
218	600015	华夏银行	27,609,083.00	5.01
219	601997	贵阳银行	27,381,668.80	4.97
220	002372	伟星新材	27,311,490.55	4.95
221	002294	信立泰	27,264,807.62	4.95
222	000729	燕京啤酒	27,252,256.04	4.94
223	600808	马钢股份	27,009,256.92	4.90
224	603056	德邦股份	26,946,295.00	4.89
225	600885	宏发股份	26,874,458.20	4.88
226	002268	电科网安	26,820,852.62	4.87
227	601000	唐山港	26,810,874.56	4.86
228	000039	中集集团	26,650,591.00	4.83
229	601699	潞安环能	26,596,284.71	4.82
230	300706	阿石创	26,547,705.00	4.82
231	002603	以岭药业	26,485,184.00	4.80
232	600048	保利发展	26,344,753.00	4.78
233	300604	长川科技	26,261,512.00	4.76
234	300458	全志科技	25,992,915.00	4.72
235	002110	三钢闽光	25,894,948.00	4.70
236	688208	道通科技	25,807,789.88	4.68
237	601717	郑煤机	25,796,925.28	4.68
238	300146	汤臣倍健	25,758,901.00	4.67
239	001203	大中矿业	25,750,932.00	4.67
240	688010	福光股份	25,723,603.03	4.67
241	600598	北大荒	25,664,322.61	4.66
242	600989	宝丰能源	25,578,908.00	4.64

243	600704	物产中大	25,436,888.00	4.61
244	600867	通化东宝	25,429,435.00	4.61
245	601991	大唐发电	25,342,820.02	4.60
246	600566	济川药业	25,215,626.44	4.57
247	601088	中国神华	25,073,209.00	4.55
248	688779	长远锂科	25,003,587.95	4.54
249	002019	亿帆医药	25,000,818.00	4.54
250	600967	内蒙一机	24,915,665.00	4.52
251	600839	四川长虹	24,845,760.70	4.51
252	002646	天佑德酒	24,795,493.25	4.50
253	688255	凯尔达	24,760,139.33	4.49
254	603345	安井食品	24,758,121.00	4.49
255	601998	中信银行	24,736,972.00	4.49
256	300115	长盈精密	24,695,696.00	4.48
257	300363	博腾股份	24,692,465.00	4.48
258	600507	方大特钢	24,680,741.60	4.48
259	300850	新强联	24,667,834.85	4.47
260	000021	深科技	24,660,094.79	4.47
261	600642	申能股份	24,633,976.69	4.47
262	600062	华润双鹤	24,509,284.72	4.45
263	601966	玲珑轮胎	24,367,996.60	4.42
264	002850	科达利	24,298,351.56	4.41
265	600029	南方航空	24,248,858.00	4.40
266	603737	三棵树	24,059,246.00	4.36
267	600329	达仁堂	23,972,958.00	4.35
268	600499	科达制造	23,870,528.00	4.33
269	601169	北京银行	23,611,550.58	4.28
270	600315	上海家化	23,587,961.00	4.28
271	601106	中国一重	23,516,152.00	4.27
272	003816	中国广核	23,489,045.00	4.26
273	300188	国投智能	23,485,407.80	4.26
274	600999	招商证券	23,367,337.00	4.24
275	600161	天坛生物	23,358,495.80	4.24
276	600185	格力地产	23,241,928.16	4.22
277	600118	中国卫星	23,173,539.43	4.20
278	002468	申通快递	23,129,583.00	4.20
279	688662	富信科技	23,113,075.53	4.19
280	603317	天味食品	22,905,980.12	4.16
281	603660	苏州科达	22,564,572.00	4.09
282	601139	深圳燃气	22,497,927.00	4.08
283	600563	法拉电子	22,462,862.40	4.07
284	002497	雅化集团	22,155,938.00	4.02
285	601128	常熟银行	22,040,238.00	4.00

286	600409	三友化工	22,010,766.00	3.99
287	002948	青岛银行	21,960,440.00	3.98
288	002385	大北农	21,950,552.00	3.98
289	688519	南亚新材	21,816,213.12	3.96
290	600707	彩虹股份	21,698,729.12	3.94
291	603919	金徽酒	21,516,562.00	3.90
292	600655	豫园股份	21,466,757.00	3.89
293	300058	蓝色光标	21,309,905.00	3.87
294	000593	德龙汇能	21,044,467.52	3.82
295	000998	隆平高科	20,765,209.00	3.77
296	688488	艾迪药业	20,680,482.76	3.75
297	600392	盛和资源	20,582,964.95	3.73
298	300244	迪安诊断	20,522,121.93	3.72
299	002559	亚威股份	20,446,906.00	3.71
300	600352	浙江龙盛	20,335,925.00	3.69
301	300972	万辰集团	20,294,033.00	3.68
302	688107	安路科技	20,256,180.17	3.67
303	000514	渝开发	20,141,779.00	3.65
304	603712	七一二	20,126,232.30	3.65
305	603866	桃李面包	19,956,639.30	3.62
306	000547	航天发展	19,904,667.00	3.61
307	300776	帝尔激光	19,856,524.62	3.60
308	002250	联化科技	19,794,160.88	3.59
309	002532	天山铝业	19,688,140.00	3.57
310	300206	理邦仪器	19,662,123.99	3.57
311	002831	裕同科技	19,523,898.00	3.54
312	688561	奇安信	19,504,750.11	3.54
313	002608	江苏国信	19,460,508.00	3.53
314	002803	吉宏股份	19,358,312.00	3.51
315	688039	当虹科技	19,313,103.02	3.50
316	300748	金力永磁	19,236,643.00	3.49
317	688063	派能科技	19,231,900.42	3.49
318	002527	新时达	19,182,031.02	3.48
319	600016	民生银行	19,055,966.00	3.46
320	002030	达安基因	19,046,417.28	3.46
321	000830	鲁西化工	19,033,080.00	3.45
322	603688	石英股份	18,973,779.00	3.44
323	000571	新大洲 A	18,965,596.00	3.44
324	600516	方大炭素	18,916,237.40	3.43
325	002410	广联达	18,910,010.20	3.43
326	603039	泛微网络	18,815,829.00	3.41
327	600299	安迪苏	18,688,544.00	3.39
328	688052	纳芯微	18,652,528.93	3.38

329	600688	上海石化	18,593,491.00	3.37
330	300515	三德科技	18,578,793.00	3.37
331	601611	中国核建	18,545,879.00	3.36
332	002444	巨星科技	18,539,493.80	3.36
333	688088	虹软科技	18,533,172.19	3.36
334	300212	易华录	18,491,461.04	3.35
335	300747	锐科激光	18,490,209.40	3.35
336	601878	浙商证券	18,443,129.00	3.35
337	600126	杭钢股份	18,323,648.00	3.32
338	002028	思源电气	18,297,221.20	3.32
339	600064	南京高科	18,280,168.80	3.32
340	300096	ST 易联众	18,179,865.03	3.30
341	601038	一拖股份	18,155,994.00	3.29
342	603808	歌力思	18,108,916.00	3.29
343	001696	宗申动力	17,995,965.00	3.26
344	002415	海康威视	17,899,072.00	3.25
345	000970	中科三环	17,861,339.85	3.24
346	600582	天地科技	17,710,185.00	3.21
347	601328	交通银行	17,698,154.60	3.21
348	605358	立昂微	17,676,114.65	3.21
349	300582	英飞特	17,653,258.00	3.20
350	603228	景旺电子	17,575,181.00	3.19
351	300788	中信出版	17,408,503.00	3.16
352	601825	沪农商行	17,386,105.00	3.15
353	000656	金科股份	17,357,454.46	3.15
354	688318	财富趋势	17,176,617.43	3.12
355	002340	格林美	17,155,281.00	3.11
356	002600	领益智造	17,097,021.43	3.10
357	603217	元利科技	16,996,870.40	3.08
358	000031	大悦城	16,824,286.00	3.05
359	000338	潍柴动力	16,803,593.00	3.05
360	002557	洽洽食品	16,749,964.00	3.04
361	600820	隧道股份	16,708,080.00	3.03
362	000600	建投能源	16,690,445.00	3.03
363	601828	美凯龙	16,664,972.80	3.02
364	688418	震有科技	16,625,531.27	3.02
365	300832	新产业	16,537,844.64	3.00
366	300465	高伟达	16,523,974.00	3.00
367	601319	中国人保	16,449,894.00	2.98
368	300026	红日药业	16,435,904.00	2.98
369	600917	重庆燃气	16,402,026.00	2.98
370	603093	南华期货	16,384,033.00	2.97
371	600549	厦门钨业	16,327,677.00	2.96

372	688608	恒玄科技	16,093,430.84	2.92
373	002493	荣盛石化	16,013,504.00	2.90
374	002572	索菲亚	15,944,604.11	2.89
375	300423	昇辉科技	15,904,686.50	2.89
376	601058	赛轮轮胎	15,886,518.00	2.88
377	600685	中船防务	15,880,408.41	2.88
378	600072	中船科技	15,656,523.55	2.84
379	600171	上海贝岭	15,645,047.34	2.84
380	688536	思瑞浦	15,632,972.76	2.84
381	600710	苏美达	15,461,146.00	2.80
382	002185	华天科技	15,348,882.00	2.78
383	300719	安达维尔	15,269,065.00	2.77
384	603986	兆易创新	15,202,735.36	2.76
385	000988	华工科技	15,177,654.84	2.75
386	300498	温氏股份	15,031,822.00	2.73
387	300711	广哈通信	15,008,798.76	2.72
388	000596	古井贡酒	14,989,550.00	2.72
389	600339	中油工程	14,935,254.00	2.71
390	600801	华新水泥	14,746,090.48	2.68
391	603882	金域医学	14,739,038.00	2.67
392	000568	泸州老窖	14,643,651.00	2.66
393	600481	双良节能	14,547,138.00	2.64
394	600521	华海药业	14,486,703.70	2.63
395	000800	一汽解放	14,486,368.00	2.63
396	300957	贝泰妮	14,408,361.59	2.61
397	603650	彤程新材	14,383,800.32	2.61
398	688072	拓荆科技	14,296,011.22	2.59
399	002430	杭氧股份	14,167,114.93	2.57
400	688126	沪硅产业	14,039,291.51	2.55
401	000825	太钢不锈	13,877,493.00	2.52
402	002221	东华能源	13,874,420.01	2.52
403	600390	五矿资本	13,842,109.80	2.51
404	600195	中牧股份	13,808,464.08	2.50
405	688699	明微电子	13,800,845.29	2.50
406	601618	中国中冶	13,769,082.00	2.50
407	603501	韦尔股份	13,759,864.50	2.50
408	600170	上海建工	13,735,905.00	2.49
409	603355	莱克电气	13,674,795.18	2.48
410	603596	伯特利	13,598,807.00	2.47
411	002971	和远气体	13,516,793.00	2.45
412	600977	中国电影	13,494,584.19	2.45
413	600848	上海临港	13,491,634.00	2.45
414	300168	万达信息	13,471,544.00	2.44

415	688819	天能股份	13,439,905.69	2.44
416	688262	国芯科技	13,369,340.93	2.43
417	688301	奕瑞科技	13,263,228.07	2.41
418	600346	恒力石化	13,232,222.00	2.40
419	600351	亚宝药业	13,112,440.00	2.38
420	002625	光启技术	13,092,602.00	2.38
421	300888	稳健医疗	13,008,431.00	2.36
422	000598	兴蓉环境	12,879,914.00	2.34
423	300595	欧普康视	12,851,322.84	2.33
424	688036	传音控股	12,818,895.68	2.33
425	300568	星源材质	12,804,918.00	2.32
426	000776	广发证券	12,781,179.32	2.32
427	600643	爱建集团	12,594,718.00	2.28
428	300661	圣邦股份	12,492,171.10	2.27
429	000425	徐工机械	12,368,403.00	2.24
430	600180	瑞茂通	12,363,909.00	2.24
431	000831	中国稀土	12,350,101.00	2.24
432	002195	岩山科技	12,315,561.00	2.23
433	300746	汉嘉设计	12,304,890.22	2.23
434	601598	中国外运	12,210,260.00	2.22
435	002353	杰瑞股份	12,206,603.00	2.21
436	002867	周大生	12,100,099.00	2.20
437	002203	海亮股份	12,072,260.47	2.19
438	002648	卫星化学	12,063,934.20	2.19
439	688239	航宇科技	12,029,140.52	2.18
440	600282	南钢股份	12,011,670.00	2.18
441	300557	理工光科	11,990,511.00	2.18
442	600131	国网信通	11,948,133.00	2.17
443	600008	首创环保	11,802,288.00	2.14
444	601872	招商轮船	11,765,562.80	2.13
445	000999	华润三九	11,751,586.14	2.13
446	002601	龙佰集团	11,726,127.00	2.13
447	300257	开山股份	11,706,897.72	2.12
448	000869	张裕 A	11,633,152.49	2.11
449	000906	浙商中拓	11,630,132.27	2.11
450	600529	山东药玻	11,605,420.00	2.11
451	300035	中科电气	11,548,545.70	2.10
452	301029	怡合达	11,539,754.00	2.09
453	600644	乐山电力	11,450,499.00	2.08
454	002060	广东建工	11,434,384.00	2.07
455	603605	珀莱雅	11,246,948.60	2.04
456	000062	深圳华强	11,239,944.39	2.04
457	002388	新亚制程	11,175,139.00	2.03

458	002254	泰和新材	11,062,092.00	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	20,605,313,876.77
卖出股票收入（成交）总额	18,387,506,779.01

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行交易，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地实现投资目标。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

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

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，长沙银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行长沙中心支行的处罚，中信证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国

人民银行的处罚，本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	569,693.47
2	应收清算款	146,627,646.43
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	935,470.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	148,132,810.71

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
万家中证 500 指数增强发起式 A	116,136	11,183.37	969,492,340.50	74.65	329,299,909.56	25.35
万家中证 500 指数增强发起式 C	20,574	46,854.54	784,763,612.82	81.41	179,221,592.89	18.59
合计	135,572	16,690.60	1,754,255,953.32	77.53	508,521,502.45	22.47

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

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	万家中证 500 指数增强发起式 A	375,329.76	0.0289
	万家中证 500 指数增强发起式 C	114,570.02	0.0119
	合计	489,899.78	0.0217

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	万家中证 500 指数增强发起式 A	10~50
	万家中证 500 指数增强发起式 C	0~10
	合计	10~50

本基金基金经理持有 本开放式基金	万家中证 500 指数增强发起 式 A	10~50
	万家中证 500 指数增强发起 式 C	0
	合计	10~50

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金成立后有 10,001,000.10 份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为 2019 年 5 月 23 日（合同生效日）起 3 年。截至本报告期末，最低持有期限届满，发起资金持有份额为 0.00 份。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家中证 500 指数增强发起式 A	万家中证 500 指数增强发起式 C
基金合同生效日 (2019 年 5 月 23 日) 基金份额总额	193,620,037.68	22,381,542.21
本报告期期初基金份 额总额	229,523,608.99	177,489,082.46
本报告期基金总申购 份额	1,375,139,496.43	2,005,012,012.72
减：本报告期基金总 赎回份额	305,870,855.36	1,218,515,889.47
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期末基金份 额总额	1,298,792,250.06	963,985,205.71

§ 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

本报告期内托管人及其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 (%)	
中泰证券	1	10,220,556.0 30.57	26.23	9,203,135.65	26.52	-
德邦证券	2	5,225,737.41 6.76	13.41	4,880,222.52	14.06	-
民生证券	1	3,095,317.10 0.95	7.94	2,276,777.18	6.56	-
广发证券	2	2,728,810.53 4.38	7.00	2,541,369.68	7.32	-
财通证券	3	2,304,961.07 2.90	5.91	1,891,090.84	5.45	-
国信证券	2	2,100,616.05 1.06	5.39	1,986,980.68	5.73	-
上海证券	1	2,043,944.42 3.39	5.25	1,910,697.21	5.51	-
中信建投	1	1,942,309.86 5.43	4.98	1,837,233.42	5.29	-
东方财富证券	1	1,736,754.71 6.21	4.46	1,629,627.22	4.70	-
招商证券	1	1,702,571.69	4.37	1,591,565.05	4.59	-

		0.72				
开源证券	1	1,556,574,856.83	3.99	1,472,374.79	4.24	-
浙商证券	1	1,364,282,003.91	3.50	1,290,848.88	3.72	-
财达证券	1	1,144,590,680.76	2.94	853,789.31	2.46	-
第一创业证券	2	1,114,391,532.22	2.86	820,873.21	2.37	-
中邮证券	1	687,143,355.62	1.76	512,543.93	1.48	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	3	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	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,本基金新增财通证券交易单元 2 个,新增方正证券交易单元 2 个,新增财达证券交易单元 1 个,新增广发证券交易单元 1 个,新增银泰证券交易单元 1 个,新增中邮证券交易单元 1 个、减少大同证券交易单元 1 个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中泰证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	5,997,968.00	100.00	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在红塔证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 1 月 17 日

2	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在东兴证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 1 月 18 日
3	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	指定媒介	2023 年 1 月 20 日
4	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在东莞证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 1 月 31 日
5	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在国元证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 2 月 9 日
6	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在民生证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 2 月 14 日
7	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在万联证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 2 月 16 日
8	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增民商基金为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 2 月 16 日
9	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在粤开证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 2 月 28 日
10	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在国元证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 3 月 1 日
11	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在华龙证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 3 月 3 日
12	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在兴业证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 3 月 8 日
13	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在华林证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 3 月 9 日
14	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2022 年年度报告	指定媒介	2023 年 3 月 30 日
15	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华夏财富为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 4 月 10 日
16	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在浙商证券开通申购、转换、定	指定媒介	2023 年 4 月 19 日

	投业务及参与其费率优惠活动的公告		
17	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	指定媒介	2023 年 4 月 21 日
18	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增泉州银行为销售机构并开通转换、基金定投业务的公告	指定媒介	2023 年 4 月 26 日
19	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增杭州银行为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 5 月 17 日
20	关于万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）的公告	指定媒介	2023 年 5 月 19 日
21	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
22	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在国盛证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 6 月 6 日
23	万家基金管理有限公司关于旗下基金在国泰君安证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 6 月 16 日
24	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金分红公告	指定媒介	2023 年 6 月 20 日
25	关于万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金恢复大额申购（含转换转入、定期定额投资）的公告	指定媒介	2023 年 6 月 21 日
26	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在杭州银行开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 6 月 28 日
27	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
28	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在东方证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 7 月 6 日
29	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	指定媒介	2023 年 7 月 20 日
30	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东莞银行为销售机构并开通转换、基金定投业务的公告	指定媒介	2023 年 7 月 20 日
31	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在华融融达期货开通申购、转换、	指定媒介	2023 年 8 月 4 日

	定投业务及参与其费率优惠活动的公告		
32	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在华安证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 8 月 28 日
33	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年中期报告	指定媒介	2023 年 8 月 30 日
34	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在方正证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 8 月 31 日
35	万家基金管理有限公司关于旗下基金在麦高证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 10 月 12 日
36	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金产品资料概要（更新）	指定媒介	2023 年 10 月 21 日
37	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书更新(2023 年第 1 号)	指定媒介	2023 年 10 月 21 日
38	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	指定媒介	2023 年 10 月 24 日
39	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增浦发银行为销售机构并开通转换、基金定投业务的公告	指定媒介	2023 年 11 月 2 日
40	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增博时财富为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 11 月 18 日

§ 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	20230301-20230417、20230522-20230601	69,467,870.79	558,635,532.37	549,123,588.93	78,979,814.23	3.49
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</p>							

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。

§ 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 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》。
- 4、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年年度报告原文。
- 5、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。
- 7、本报告期内在中国证监会指定媒介公开披露的基金净值、更新招募说明书及其他临时公告。

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司

2024 年 3 月 29 日