

万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资 基金 2019 年年度报告摘要

2019 年 12 月 31 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 3 月 25 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2020 年 3 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

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 2019 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	万家中证 1000 指数增强	
基金主代码	005313	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 12 月 3 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	22,685,000.42 份	
下属分级基金的基金简称:	万家中证 1000 指数增强 A	万家中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码:	005313	005314
报告期末下属分级基金的份额总额	11,199,170.60 份	11,485,829.82 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投资收益。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率*95%+一年期人民币定期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	万家基金管理有限公司	招商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	兰剑	张燕
	联系电话	021-38909626	0755-83199084
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4008880800	95555
传真		021-38909627	0755-83195201

2.4 信息披露方式

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

§ 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	2019 年		2018 年 12 月 3 日(基金合同生效日)-2018 年 12 月 31 日	
	万家中证 1000 指数增强 A	万家中证 1000 指数增强 C	万家中证 1000 指数增强 A	万家中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	4,449,479.55	22,351,174.93	-20,333.98	-1,907.31
本期利润	3,803,682.41	24,871,518.86	-617,930.09	-37,619.00
加权平均基金份额本期利润	0.3496	0.5092	-0.0727	-0.0632
本期基金份额净值增长率	40.77%	40.57%	-6.28%	-6.30%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末		2018 年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0576	0.0562	-0.0509	-0.0621
期末基金资产净值	11,844,421.18	12,130,844.35	9,414,386.58	558,648.42
期末基金份额净值	1.0576	1.0562	0.9491	0.9379

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家中证 1000 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.26%	0.95%	6.10%	0.96%	4.16%	-0.01%
过去六个月	15.00%	1.08%	4.46%	1.12%	10.54%	-0.04%
过去一年	40.77%	1.41%	24.51%	1.49%	16.26%	-0.08%
自基金合同生效起至今	31.84%	1.37%	18.97%	1.47%	12.87%	-0.10%

万家中证 1000 指数增强 C

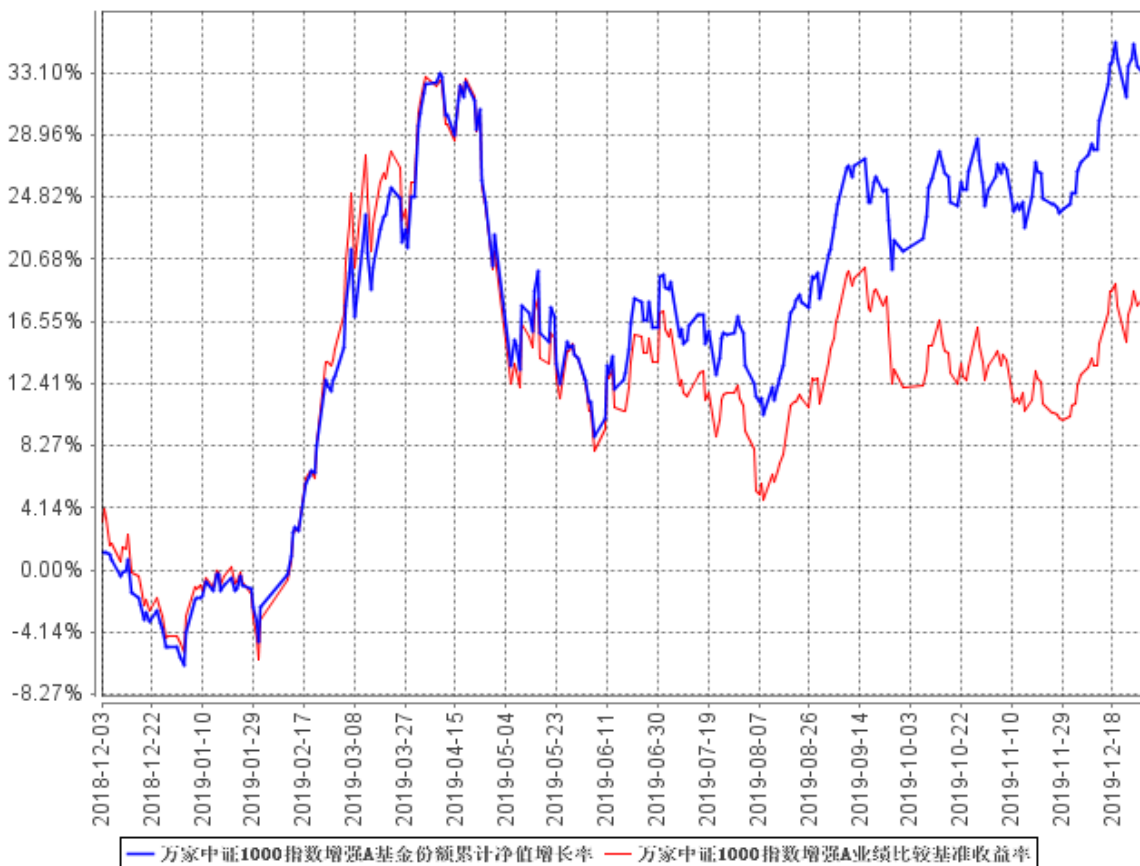
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.08%	0.95%	6.10%	0.96%	3.98%	-0.01%
过去六个月	14.72%	1.08%	4.46%	1.12%	10.26%	-0.04%
过去一年	40.57%	1.41%	24.51%	1.49%	16.06%	-0.08%
自基金合同生效起至今	31.61%	1.37%	18.97%	1.47%	12.64%	-0.10%

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

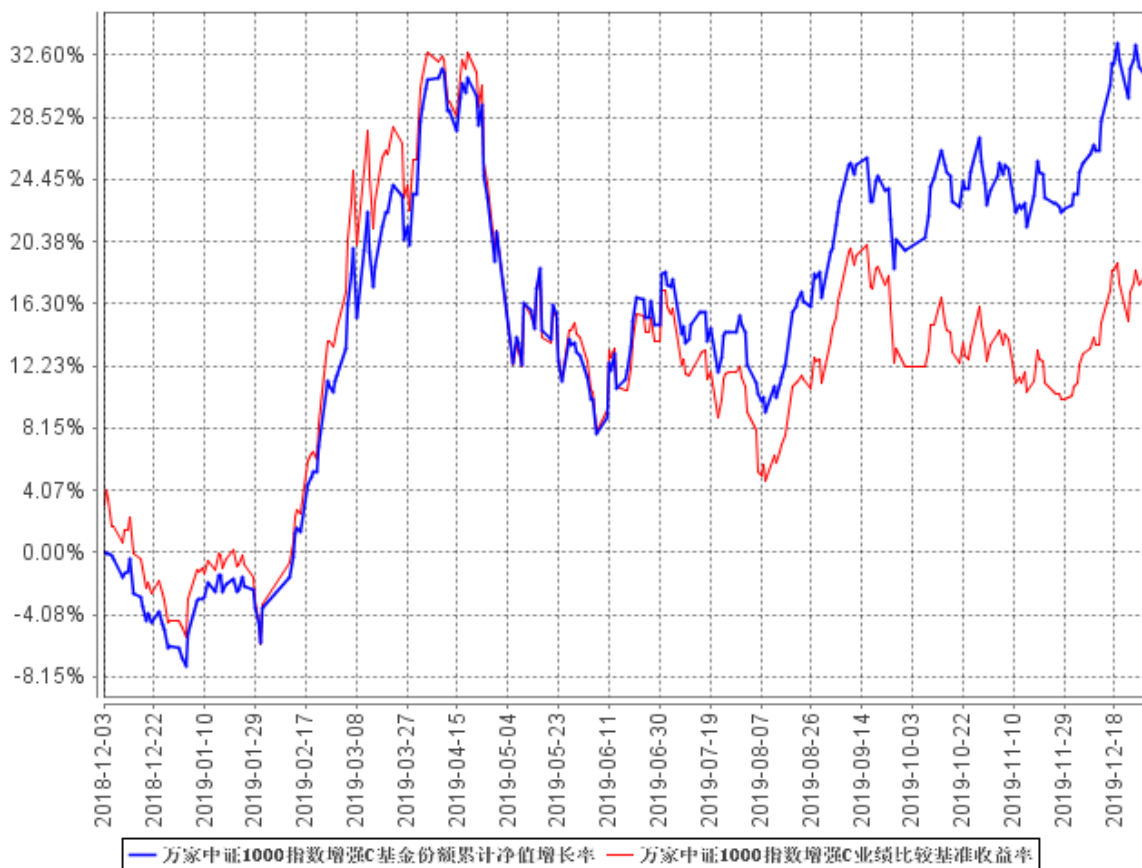
*5%

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

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



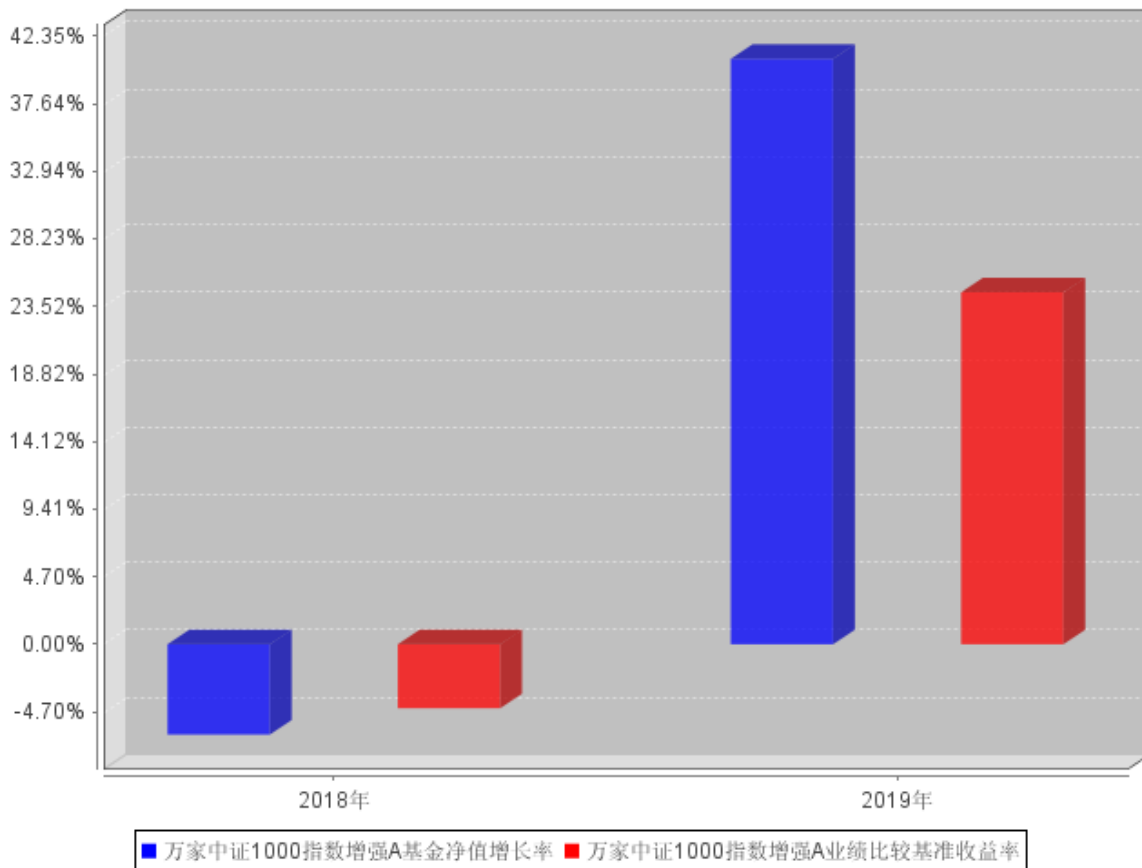
万家中证1000指数增强C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



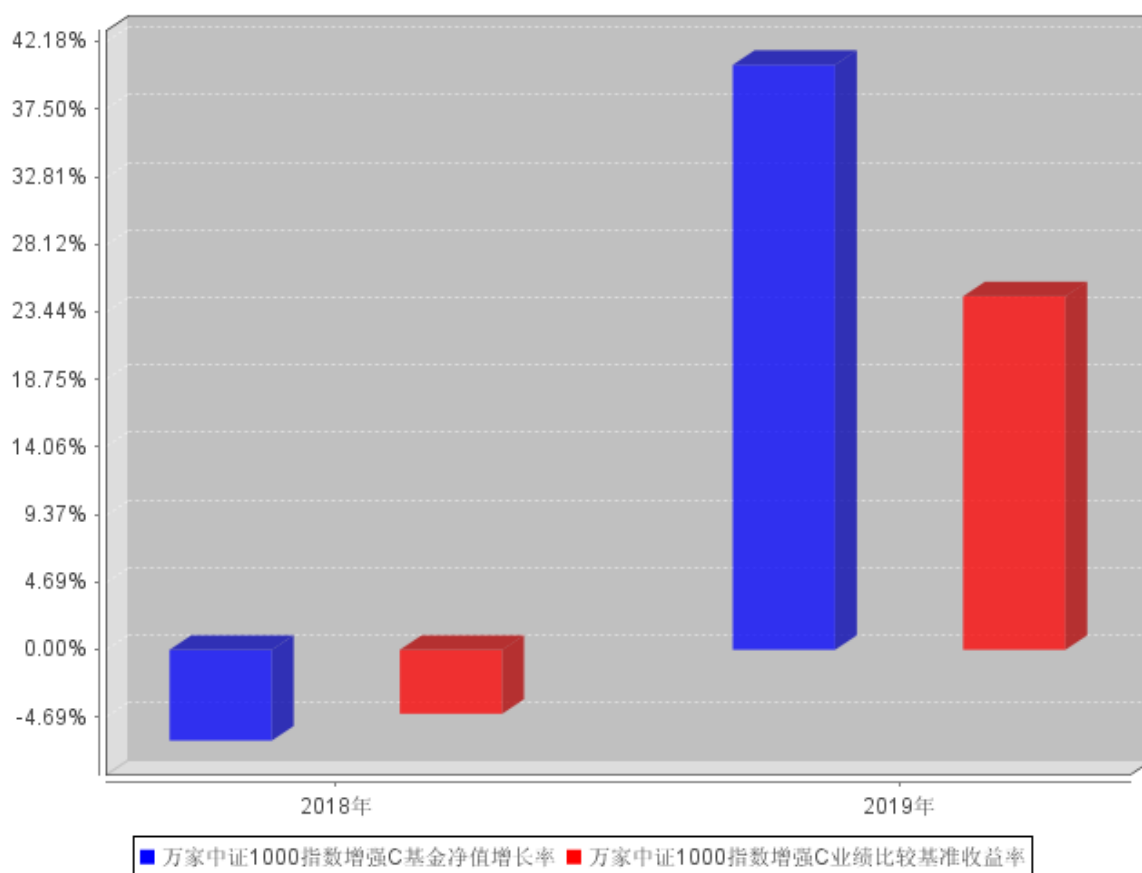
注：本基金合同生效日期为 2018 年 12 月 03 日，基金建仓期为基金合同生效后六个月，基金合同生效后各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

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

万家中证1000指数增强A自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



万家中证1000指数增强C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

万家中证 1000 指数增强 A					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2019	2.6670	2,819,285.16	126,287.24	2,945,572.40	
2018	-	-	-	-	
合计	2.6670	2,819,285.16	126,287.24	2,945,572.40	

单位：人民币元

万家中证 1000 指数增强 C					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注

2019	2.5130	382,394.80	30,329,130.54	30,711,525.34	
2018	-	-	-	-	
合计	2.5130	382,394.80	30,329,130.54	30,711,525.34	

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44号文批准设立。公司现股东为中泰证券股份有限公司、新疆国际实业股份有限公司和齐河众鑫投资有限公司,住所:中国(上海)自由贸易试验区浦电路360号8楼(名义楼层9层),办公地点:上海市浦东新区浦电路360号9楼,注册资本3亿元人民币。目前管理七十只开放式基金,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3-5年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家鑫安纯债债券型证券投资基金、万家鑫璟纯债债券型证券投资基金、万家沪深300指数增强型证券投资基金、万家家享中短债债券型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家1-3年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家瑞隆混合型证券投资基金、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家现金增利货币市场基金、万家消费成长股票型证券投资基金、万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家玖盛纯债9个月定期开放债券型证券投资基金、万家天添宝货币市场基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、万家家瑞债券型证券投资基金、万家臻选混合型证券投资基金、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金、万家中证1000指数增强型发起式证券投资基金、万家成长优选灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金、万家经济新动能混合型证券投资基金、万家潜力价值灵

活配置混合型证券投资基金、万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家新机遇龙头企业灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型证券投资基金、万家智造优势混合型证券投资基金、万家稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、万家人工智能混合型证券投资基金、万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金（LOF）、万家平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、万家民安增利 12 个月定期开放债券型证券投资基金、万家鑫盛纯债债券型证券投资基金、万家汽车新趋势混合型证券投资基金和万家惠享 39 个月定期开放债券型证券投资基金。

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	万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家沪深 300	2019 年 8 月 21 日	-	13.5 年	美国斯坦福大学商学（工商管理）博士研究生。2006 年 8 月至 2009 年 3 月在巴克莱国际投资管理公司（BGI）（后并入贝莱德公司（Black Rock））担任投资部基金经理；2009 年 7 月至 2010 年 8 月在加拿大退休基金国际投资管理公司（CPPIB）担任量化投资部基金经理；2010 年 9 月至 2013 年 3 月在南方基金管理有限公司担任量化投资部

	指数增强型证券投资基金、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理				<p>基金经理；2013 年 3 月至 2015 年 3 月为通联数据股份公司联合创始人，担任投资部首席投资官；2015 年 5 月至 2017 年 7 月在上海寻乾资产管理有限公司（后并入巨杉资产）担任投资部投资总监、公司总经理；2017 年 7 月至 2019 年 6 月在巨杉（上海）资产管理有限公司担任量化投资部投资总监；2019 年 7 月加入万家基金管理有限公司，担任总经理助理、基金经理，2019 年 9 月起兼任量化投资部总监。</p>
陈旭	因个人原因离职	2018年12月3日	2019年10月22日	7年	<p>上海交通大学模式识别与智能系统硕士。2010 年 3 月至 2012 年 9 月在易安信中国卓越研发中心工作，担任高级软件工程师；2013 年 1 月至 2015 年 6 月在</p>

					<p>国信证券股份有限公司工作,先后担任经济研究所分析师、自营金融工程部投资经理等职,主要从事量化投资研究分析及交易等工作;</p> <p>2015年7月加入万家基金管理有限公司,自2017年11月起担任基金经理职务,现任量化投资部副总监(主持工作)、基金经理。2019年10月,因个人原因离职。</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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

在投资决策上:(1)公司对不同类别的投资组合分别设定独立的投资部门,公募基金经理和特

定客户资产管理投资经理不得互相兼任。(2) 公司投资管理实行分层次决策, 投资决策委员会下设的公募基金投资决策小组和专户投资决策小组分别根据公募基金和专户投资组合的规模、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。(3) 公司接受的外部研究报告、研究员撰写的研究报告等均通过统一的投研管理平台发布, 确保各投资组合经理在获得投资信息、投资建议和实施决策方面享有公平的机会。

在交易执行上:(1) 公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离, 实行集中交易制度;(2) 对于交易公开竞价交易, 所有指令必须通过系统下达, 公司执行交易系统内的公平交易程序;(3) 对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易, 各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量, 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。

本报告期内无下列情况:所有投资组合参与的交易所公开竞价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%。

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

万家中证 1000 指数增强型证券投资基金采用中证 1000 指数增强的投资策略, 运用量化多因子选股模型, 在力求对中证 1000 指数进行有效跟踪的基础上, 通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制, 力争实现超越目标指数的投资收益, 谋求基金资产的长期增值。

万家中证 1000 指数增强型证券投资基金在保持相对中证 1000 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 1000 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 1000 成分股，保持了跟标的指数的风格基本一致。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家中证 1000 指数增强 A 基金份额净值为 1.0576 元，本报告期基金份额净值增长率为 40.77%；截至本报告期末万家中证 1000 指数增强 C 基金份额净值为 1.0562 元，本报告期基金份额净值增长率为 40.57%；同期业绩比较基准收益率为 24.51%。基金报告期末 A 份额、C 份额日均跟踪偏离度分别为 0.2189%、0.2182%，年跟踪误差分别为 4.7822%、4.7815%，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

2019 年的市场主线是盈利修复叠加风险溢价的回落，股票的超额收益主要来源于盈利超预期。整体市场呈现出了结构性牛市的特征。

展望 2020 年，盈利仍将是市场的主要驱动力，同时政策层面引导的流动性宽松，伴随着无风险利率的持续下行，也有利于风险资产的进一步上行。在基本面方面，市场仍将处于信用扩张周期之中，以平滑经济下行的斜率。从资产配置的角度来看，股债的性价比受盈利周期驱动明显，盈利修正下大概率股票相较于债券更优配置价值。在行业层面，科技类公司有望领涨市场，成为中长期市场的强势力量；二级市场中的核心资产，在高盈利、高持仓、高涨幅的压力下，收益与风险并存，未来市场风格的焦点更倾向于成长风格。

市场未来的主要风险集中在海外政治局势波动、地缘政治风险带来的黑天鹅事件以及疫情对经济影响超预期。

4.6 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。估值委员会由督察长、基金运营部负责人、合规稽核部负责人、权益投资部负责人、固定收益部负责人等组成。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》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同规定：“在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最少为 1 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%”。2019 年 12 月 13 日，本基金进行了利润分配，A 类每 10 份基金份额分红 2.667 元，共计分配利润 2,945,572.40 元；C 类每 10 份基金份额分红 2.513 元，共计分配利润 30,711,525.34 元。

4.8 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

本基金为发起式基金，不适用本项说明。

§ 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

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

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

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

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

本基金 2019 年年度财务会计报告已经立信会计师事务所（特殊普通合伙）审计,注册会计师签字出具了信会师报字[2020]第 ZA30173 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	38,850,913.62	1,032,385.23
结算备付金	809,279.82	2,006.13
存出保证金	50,575.27	-
交易性金融资产	22,474,923.86	8,993,920.00
其中：股票投资	22,474,923.86	8,993,920.00
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	6,321.06	228.20
应收股利	-	-
应收申购款	62,643.27	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	62,254,656.90	10,028,539.56
负债和所有者权益	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负 债：		

短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	60,013.24	-
应付赎回款	37,410,279.81	-
应付管理人报酬	111,304.94	7,409.22
应付托管费	22,260.98	1,483.90
应付销售服务费	40,227.40	197.07
应付交易费用	529,080.45	8,966.23
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	106,224.55	37,448.14
负债合计	38,279,391.37	55,504.56
所有者权益：		
实收基金	22,685,000.42	10,515,125.88
未分配利润	1,290,265.11	-542,090.88
所有者权益合计	23,975,265.53	9,973,035.00
负债和所有者权益总计	62,254,656.90	10,028,539.56

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0569 元，基金份额总额 22,685,000.42 份。
其中万家中证 1000 指数增强 A 基金份额参考净值 1.0576 元，基金份额总额 11,199,170.60 份；
万家中证 1000 指数增强 C 基金份额参考净值 1.0562 元，基金份额总额 11,485,829.82 份。

7.2 利润表

会计主体：万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 12 月 3 日 (基金合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 日
一、收入	31,722,229.38	-629,237.37
1.利息收入	51,795.30	1,560.69
其中：存款利息收入	51,795.30	1,296.61
债券利息收入	-	264.08
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）	29,524,740.83	2,503.00
其中：股票投资收益	29,220,158.07	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-697.00
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	304,582.76	3,200.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	1,874,546.79	-633,307.80
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	271,146.46	6.74
减：二、费用	3,047,028.11	26,311.72
1. 管理人报酬	711,065.96	7,385.36
2. 托管费	142,213.21	1,477.08
3. 销售服务费	233,550.02	183.99
4. 交易费用	1,830,575.82	9,820.79
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-

7. 其他费用	129,623.10	7,444.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	28,675,201.27	-655,549.09
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	28,675,201.27	-655,549.09

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	10,515,125.88	-542,090.88	9,973,035.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	28,675,201.27	28,675,201.27
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	12,169,874.54	6,814,252.46	18,984,127.00
其中：1. 基金申购款	161,062,368.15	16,497,703.70	177,560,071.85
2. 基金赎回款	-148,892,493.61	-9,683,451.24	-158,575,944.85
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-33,657,097.74	-33,657,097.74

五、期末所有者权益（基金净值）	22,685,000.42	1,290,265.11	23,975,265.53
项目	上年度可比期间 2018年12月3日(基金合同生效日)至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	620,903.93	933.55	621,837.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-655,549.09	-655,549.09
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	9,894,221.95	112,524.66	10,006,746.61
其中：1. 基金申购款	9,895,133.04	112,513.83	10,007,646.87
2. 基金赎回款	-911.09	10.83	-900.26
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	10,515,125.88	-542,090.88	9,973,035.00

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

方一天

经晓云

陈广益

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

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

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》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 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 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

1、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。

2、增值税

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，继续免征营业税；

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

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

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

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

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

的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3、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。

4、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。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
新疆国际实业股份有限公司	基金管理人的股东
齐河众鑫投资有限公司	基金管理人的股东
山东省国有资产投资控股有限公司	基金管理人的原股东
万家共赢资产管理有限公司	基金管理人的子公司
万家财富基金销售（天津）有限公司	基金管理人的子公司
上海万家朴智投资管理有限公司	基金管理人控制的公司

注：1、经中国证券监督管理委员会证监许可[2019]126 号文核准，基金管理人原股东山东省国有资产投资控股有限公司将其持有的基金管理人的 11% 股权转让给齐河众鑫投资有限公司。本次股权变更的工商变更登记手续已办理完毕，基金管理人于 2019 年 2 月 13 日发布了《关于公司股权变更的公告》，公司股东由山东省国有资产投资控股有限公司变更为齐河众鑫投资有限公司。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 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。

7.4.8.1.4 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。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 12 月 3 日 (基金合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	711,065.96	7,385.36
其中：支付销售机构的客户维护费	12,707.36	52.62

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 12 月 3 日 (基金合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	142,213.21	1,477.08

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

休息日, 支付日期顺延。

7.4.8.2.3 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		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家中证 1000 指数 增强 A	万家中证 1000 指数 增强 C	合计
万家基金管理有限公司	-	225,922.76	225,922.76
中泰证券股份有限公司	-	363.17	363.17
合计	-	226,285.93	226,285.93
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间		
	2018 年 12 月 3 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家中证 1000 指数 增强 A	万家中证 1000 指数 增强 C	合计
中泰证券股份有限公司	-	72.74	72.74
合计	-	72.74	72.74

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

计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	万家中证 1000 指数增强 A	万家中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日（2018 年 12 月 3 日）持有的基金份额	0.00	-
报告期初持有的基金份额	9,887,305.69	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	9,887,305.69	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	43.5852%	-

项目	上年度可比期间	
	2018 年 12 月 3 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	
	万家中证 1000 指数增强 A	万家中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日（2018 年 12 月 3 日）持有的基金份额	0.00	-
报告期初持有的基金份额	0.00	-
报告期间申购/买入总份额	9,887,305.69	-
报告期间因拆分变动份额	-	-

减：报告期内赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	9,887,305.69	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	94.0294%	-

注：基金管理人申购本基金份额时所适用的费率与本基金公告的费率一致。期间申购/买入总份额含转换入份额；期间因拆分变动份额含红利再投份额；期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

万家中证 1000 指数增强 C				
关联方名称	本期末 2019 年 12 月 31 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
	万家共赢资产 管理有限公司	-	-	249,850.09

注：本基金本报告期内无除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.8.5 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2018 年 12 月 3 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	招商银行股份有 限公司	38,850,913.62	43,975.82	1,032,385.23

注：本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2019 年 1 月 1 日至 12 月 31 日获得的利息收入为人民币 7,503.34 元(2018 年 12 月 3 日(基金转型日)至 12 月 31 日获得的利息收入为人民币 2.52 元)，2019 年 12 月 31 日结算备付金余额为人民币 809,279.82 元(2018 年末结算备付金余额为人民币 2,006.13 元)。

7.4.8.6 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。

7.4.8.7 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。

7.4.9 期末（2019 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688128	中国电研	2019 年 10 月 29 日	2020 年 5 月 5 日	新股流通受限	18.79	17.52	9,027	169,617.33	158,153.04	-
688202	美迪西	2019 年 10 月 29 日	2020 年 5 月 5 日	新股流通受限	41.50	50.80	2,120	87,980.00	107,696.00	-
688258	卓易信息	2019 年 11 月 28 日	2020 年 6 月 9 日	新股流通受限	26.49	70.05	3,465	91,787.85	242,723.25	-
688368	晶丰明源	2019 年 9 月 27 日	2020 年 4 月 14 日	新股流通受限	56.68	75.13	2,557	144,930.76	192,107.41	-
601077	渝农商行	2019 年 10 月 16 日	2020 年 4 月 29 日	新股流通受限	7.36	6.26	73,889	543,823.04	462,545.14	-
002973	侨银环保	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 6 日	新股未上市	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-
688181	八亿	2019 年	2020	新股流	43.98	43.98	1,255	55,194.90	55,194.90	-

	时空	12 月 27 日	年 7 月 6 日	通受限					
--	----	--------------	--------------	-----	--	--	--	--	--

7.4.9.2 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.10.1 公允价值

7.4.10.1.1 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。

7.4.10.1.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.10.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 21,249,926.08 元, 属于第二层次的余额为 1,224,997.78 元, 无属于第三层次的余额。(2018 年 12 月 31 日, 属于第一层次的余额为 8,993,920.00 元, 无属于第二层次和第三层次的余额。)

7.4.10.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

7.4.10.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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

7.4.10.1.3 非持续的以公允价值计量的金融工具

本基金本期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.10.1.4 不以公允价值计量的金融工具

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

7.4.10.2 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	22,474,923.86	36.10
	其中：股票	22,474,923.86	36.10
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	39,660,193.44	63.71
8	其他各项资产	119,539.60	0.19
9	合计	62,254,656.90	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	162,380.85	0.68
B	采矿业	222,809.00	0.93
C	制造业	12,722,111.20	53.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	753,879.00	3.14
E	建筑业	687,413.60	2.87
F	批发和零售业	779,923.00	3.25
G	交通运输、仓储和邮政业	525,927.00	2.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务	1,301,814.00	5.43

	业		
J	金融业	31,923.00	0.13
K	房地产业	581,048.04	2.42
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	179,446.00	0.75
N	水利、环境和公共设施管理业	318,633.00	1.33
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	249,877.00	1.04
S	综合	-	-
	合计	18,517,184.69	77.23

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,171,193.29	9.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	9,450.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	497,578.66	2.08
J	金融业	462,545.14	1.93

K	房地产业	261,221.00	1.09
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	265,849.04	1.11
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,244.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	273,080.00	1.14
S	综合	-	-
	合计	3,957,739.17	16.51

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资组合。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002367	康力电梯	57,700	458,715.00	1.91
2	603368	柳药股份	13,600	457,504.00	1.91
3	600063	皖维高新	111,700	437,864.00	1.83
4	300497	富祥股份	23,100	435,897.00	1.82
5	603063	禾望电气	45,900	428,706.00	1.79
6	600343	航天动力	44,700	409,005.00	1.71
7	600855	航天长峰	32,600	400,654.00	1.67
8	600846	同济科技	42,100	391,951.00	1.63
9	000591	太阳能	106,300	389,058.00	1.62
10	601058	赛轮轮胎	76,100	340,167.00	1.42

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站的年度

报告正文。

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前五名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601077	渝农商行	73,889	462,545.14	1.93
2	688258	卓易信息	3,465	242,723.25	1.01
3	002869	金溢科技	3,300	215,589.00	0.90
4	002752	昇兴股份	33,500	205,690.00	0.86
5	300251	光线传媒	16,300	192,340.00	0.80

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站的年度报告正文。

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	601677	明泰铝业	4,857,865.00	48.71
2	600846	同济科技	4,710,021.00	47.23
3	002139	拓邦股份	4,281,569.50	42.93
4	600728	佳都科技	4,228,170.00	42.40
5	600995	文山电力	4,204,596.00	42.16
6	600533	栖霞建设	4,201,597.00	42.13
7	000973	佛塑科技	3,884,151.71	38.95
8	603368	柳药股份	3,804,468.40	38.15
9	600063	皖维高新	3,701,382.00	37.11
10	601058	赛轮轮胎	3,579,903.60	35.90
11	603063	禾望电气	3,479,040.00	34.88
12	600261	阳光照明	3,456,572.00	34.66

13	002016	世荣兆业	3,372,576.48	33.82
14	000601	韶能股份	3,284,719.02	32.94
15	600502	安徽建工	3,205,399.00	32.14
16	600720	祁连山	3,196,698.80	32.05
17	600343	航天动力	3,146,492.00	31.55
18	300014	亿纬锂能	3,019,403.00	30.28
19	000672	上峰水泥	3,008,404.00	30.17
20	603118	共进股份	2,954,791.00	29.63
21	300231	银信科技	2,929,007.00	29.37
22	300303	聚飞光电	2,838,169.00	28.46
23	300660	江苏雷利	2,803,302.60	28.11
24	300497	富祥股份	2,798,120.60	28.06
25	603699	纽威股份	2,727,925.00	27.35
26	002907	华森制药	2,721,382.00	27.29
27	603126	中材节能	2,716,934.00	27.24
28	300209	天泽信息	2,700,437.00	27.08
29	002792	通宇通讯	2,630,025.00	26.37
30	002367	康力电梯	2,518,428.00	25.25
31	002928	华夏航空	2,453,232.00	24.60
32	300114	中航电测	2,450,598.00	24.57
33	000913	钱江摩托	2,448,718.78	24.55
34	002182	云海金属	2,428,179.00	24.35
35	600675	中华企业	2,417,860.00	24.24
36	600552	凯盛科技	2,398,518.00	24.05
37	600855	航天长峰	2,268,231.00	22.74
38	603298	杭叉集团	2,242,262.29	22.48
39	002094	青岛金王	2,217,894.00	22.24
40	600449	宁夏建材	2,215,817.00	22.22

41	002734	利民股份	2,215,776.00	22.22
42	300628	亿联网络	2,199,358.00	22.05
43	300171	东富龙	2,175,518.00	21.81
44	002020	京新药业	2,138,081.00	21.44
45	002746	仙坛股份	2,119,549.00	21.25
46	600136	当代明诚	2,117,451.00	21.23
47	000905	厦门港务	2,104,043.00	21.10
48	601163	三角轮胎	2,098,934.00	21.05
49	600446	金证股份	2,091,402.00	20.97
50	002396	星网锐捷	2,086,013.00	20.92
51	601107	四川成渝	2,070,880.00	20.76
52	001896	豫能控股	2,053,649.00	20.59
53	300130	新国都	2,033,978.00	20.39
54	000810	创维数字	2,029,987.00	20.35
55	300571	平治信息	2,022,718.00	20.28
56	000957	中通客车	2,011,491.00	20.17
57	002458	益生股份	2,009,658.00	20.15
58	002362	汉王科技	1,994,344.00	20.00
59	000550	江铃汽车	1,992,586.00	19.98
60	300016	北陆药业	1,938,194.00	19.43
61	300438	鹏辉能源	1,932,866.00	19.38
62	300233	金城医药	1,924,686.59	19.30
63	603385	惠达卫浴	1,900,759.47	19.06
64	600668	尖峰集团	1,897,907.00	19.03
65	002318	久立特材	1,873,741.00	18.79
66	600185	格力地产	1,865,668.00	18.71
67	000035	中国天楹	1,860,953.00	18.66
68	600180	瑞茂通	1,857,409.80	18.62

69	300349	金卡智能	1,851,062.00	18.56
70	002379	宏创控股	1,838,633.00	18.44
71	002605	姚记科技	1,825,616.00	18.31
72	000915	山大华特	1,816,452.00	18.21
73	002869	金溢科技	1,786,120.00	17.91
74	300682	朗新科技	1,773,452.00	17.78
75	300298	三诺生物	1,768,063.28	17.73
76	002577	雷柏科技	1,765,018.00	17.70
77	600229	城市传媒	1,747,863.00	17.53
78	601599	鹿港文化	1,738,397.00	17.43
79	601886	江河集团	1,727,777.00	17.32
80	000411	英特集团	1,725,385.00	17.30
81	300523	辰安科技	1,722,444.10	17.27
82	600581	八一钢铁	1,714,726.00	17.19
83	600132	重庆啤酒	1,705,800.04	17.10
84	300417	南华仪器	1,702,123.00	17.07
85	000576	广东甘化	1,700,332.00	17.05
86	603067	振华股份	1,700,229.24	17.05
87	300568	星源材质	1,694,572.00	16.99
88	600405	动力源	1,694,087.00	16.99
89	300726	宏达电子	1,693,751.00	16.98
90	600310	桂东电力	1,688,727.00	16.93
91	000650	仁和药业	1,683,243.00	16.88
92	300236	上海新阳	1,680,868.00	16.85
93	601126	四方股份	1,677,286.00	16.82
94	300502	新易盛	1,675,878.00	16.80
95	603277	银都股份	1,675,467.56	16.80
96	600985	淮北矿业	1,669,633.00	16.74

97	002351	漫步者	1,658,090.18	16.63
98	002377	国创高新	1,646,455.00	16.51
99	603043	广州酒家	1,644,900.00	16.49
100	002314	南山控股	1,626,693.00	16.31
101	002335	科华恒盛	1,617,399.88	16.22
102	002249	大洋电机	1,616,737.00	16.21
103	300012	华测检测	1,614,788.00	16.19
104	300613	富瀚微	1,613,647.00	16.18
105	002219	恒康医疗	1,608,596.68	16.13
106	000034	神州数码	1,597,776.00	16.02
107	603013	亚普股份	1,588,544.00	15.93
108	300045	华力创通	1,573,947.00	15.78
109	300322	硕贝德	1,568,425.00	15.73
110	002705	新宝股份	1,566,702.00	15.71
111	601918	新集能源	1,554,505.00	15.59
112	600768	宁波富邦	1,540,288.00	15.44
113	600510	黑牡丹	1,527,546.00	15.32
114	603026	石大胜华	1,522,597.00	15.27
115	600490	鹏欣资源	1,516,604.00	15.21
116	603609	禾丰牧业	1,509,973.00	15.14
117	300487	蓝晓科技	1,506,553.00	15.11
118	002782	可立克	1,498,608.25	15.03
119	600267	海正药业	1,492,807.80	14.97
120	600997	开滦股份	1,487,815.00	14.92
121	002084	海鸥住工	1,484,398.00	14.88
122	600626	申达股份	1,470,246.00	14.74
123	002851	麦格米特	1,465,976.00	14.70
124	000710	贝瑞基因	1,464,429.00	14.68

125	300198	纳川股份	1,460,292.00	14.64
126	300636	同和药业	1,444,038.00	14.48
127	300039	上海凯宝	1,408,388.23	14.12
128	600936	广西广电	1,404,216.00	14.08
129	002234	民和股份	1,401,318.00	14.05
130	601666	平煤股份	1,396,689.00	14.00
131	600873	梅花生物	1,393,350.00	13.97
132	002611	东方精工	1,393,078.00	13.97
133	600381	青海春天	1,383,775.30	13.88
134	002299	圣农发展	1,383,119.00	13.87
135	000802	北京文化	1,378,407.00	13.82
136	600012	皖通高速	1,376,464.80	13.80
137	000999	华润三九	1,368,734.00	13.72
138	603606	东方电缆	1,350,631.00	13.54
139	603458	勘设股份	1,347,310.18	13.51
140	000739	普洛药业	1,347,060.00	13.51
141	600391	航发科技	1,341,337.00	13.45
142	000019	深粮控股	1,331,457.20	13.35
143	600250	南纺股份	1,326,774.00	13.30
144	002895	川恒股份	1,317,511.00	13.21
145	000662	天夏智慧	1,303,879.00	13.07
146	300219	鸿利智汇	1,298,844.00	13.02
147	002011	盾安环境	1,297,466.00	13.01
148	300251	光线传媒	1,295,707.00	12.99
149	002124	天邦股份	1,284,996.00	12.88
150	002276	万马股份	1,272,988.00	12.76
151	600284	浦东建设	1,251,616.20	12.55
152	600273	嘉化能源	1,227,182.00	12.31

153	600129	太极集团	1,226,004.00	12.29
154	300118	东方日升	1,225,466.00	12.29
155	300020	银江股份	1,222,929.20	12.26
156	600323	瀚蓝环境	1,196,650.00	12.00
157	300533	冰川网络	1,195,514.00	11.99
158	300007	汉威科技	1,191,864.00	11.95
159	300043	星辉娱乐	1,180,708.00	11.84
160	000637	茂化实华	1,176,069.00	11.79
161	002755	奥赛康	1,173,710.00	11.77
162	002568	百润股份	1,168,091.50	11.71
163	300432	富临精工	1,159,878.00	11.63
164	603882	金域医学	1,158,510.00	11.62
165	601566	九牧王	1,157,227.00	11.60
166	300017	网宿科技	1,154,677.00	11.58
167	600715	文投控股	1,148,615.00	11.52
168	603733	仙鹤股份	1,143,295.00	11.46
169	000829	天音控股	1,142,760.00	11.46
170	000663	永安林业	1,141,677.00	11.45
171	600210	紫江企业	1,127,502.00	11.31
172	002531	天顺风能	1,120,770.00	11.24
173	000987	越秀金控	1,114,475.00	11.17
174	603309	维力医疗	1,092,828.00	10.96
175	000923	河钢资源	1,083,650.00	10.87
176	601360	三六零	1,082,585.00	10.86
177	600731	湖南海利	1,079,987.00	10.83
178	002246	北化股份	1,070,413.00	10.73
179	002664	长鹰信质	1,063,668.00	10.67
180	600382	广东明珠	1,062,955.80	10.66

181	300075	数字政通	1,054,166.00	10.57
182	603843	正平股份	1,049,119.00	10.52
183	603098	森特股份	1,046,528.60	10.49
184	002912	中新赛克	1,045,380.00	10.48
185	300529	健帆生物	1,043,895.00	10.47
186	300269	联建光电	1,039,395.00	10.42
187	600612	老凤祥	1,028,227.00	10.31
188	603959	百利科技	1,023,859.46	10.27
189	600217	中再资环	1,013,743.00	10.16
190	300034	钢研高纳	1,006,325.00	10.09
191	000042	中洲控股	1,001,055.00	10.04
192	000639	西王食品	994,256.00	9.97
193	603008	喜临门	993,277.00	9.96
194	603887	城地股份	988,365.20	9.91
195	002906	华阳集团	987,693.00	9.90
196	600501	航天晨光	980,508.00	9.83
197	300531	优博讯	976,206.00	9.79
198	600662	强生控股	970,401.00	9.73
199	002045	国光电器	967,937.00	9.71
200	000591	太阳能	961,319.00	9.64
201	300066	三川智慧	961,201.00	9.64
202	300378	鼎捷软件	959,896.00	9.62
203	600641	万业企业	958,395.00	9.61
204	002653	海思科	953,298.00	9.56
205	300393	中来股份	950,219.72	9.53
206	603508	思维列控	948,258.00	9.51
207	300602	飞荣达	947,313.00	9.50
208	603585	苏利股份	941,686.00	9.44

209	002756	永兴材料	939,423.40	9.42
210	600740	山西焦化	929,753.00	9.32
211	000700	模塑科技	929,574.00	9.32
212	603579	荣泰健康	927,918.00	9.30
213	002036	联创电子	924,444.49	9.27
214	002262	恩华药业	920,924.00	9.23
215	603058	永吉股份	916,731.00	9.19
216	603980	吉华集团	916,490.60	9.19
217	600805	悦达投资	916,213.00	9.19
218	002651	利君股份	910,796.00	9.13
219	601588	北辰实业	907,703.00	9.10
220	300158	振东制药	899,573.00	9.02
221	002534	杭锅股份	897,519.00	9.00
222	300366	创意信息	895,695.00	8.98
223	603218	日月股份	888,308.00	8.91
224	603393	新天然气	876,395.80	8.79
225	601900	南方传媒	875,485.97	8.78
226	601717	郑煤机	872,122.00	8.74
227	000951	中国重汽	867,464.00	8.70
228	002279	久其软件	867,426.10	8.70
229	600336	澳柯玛	856,393.00	8.59
230	300702	天宇股份	847,308.00	8.50
231	000751	锌业股份	839,160.00	8.41
232	002850	科达利	831,024.00	8.33
233	300624	万兴科技	829,177.00	8.31
234	601369	陕鼓动力	826,120.57	8.28
235	603819	神力股份	821,404.60	8.24
236	002292	奥飞娱乐	820,908.00	8.23

237	000967	盈峰环境	814,677.00	8.17
238	002609	捷顺科技	809,978.00	8.12
239	603666	亿嘉和	806,967.00	8.09
240	300310	宜通世纪	804,675.16	8.07
241	002567	唐人神	801,103.00	8.03
242	300558	贝达药业	799,533.00	8.02
243	000933	神火股份	782,855.00	7.85
244	601116	三江购物	782,459.00	7.85
245	601077	渝农商行	776,884.80	7.79
246	600812	华北制药	771,490.00	7.74
247	000900	现代投资	771,230.00	7.73
248	603596	伯特利	770,810.00	7.73
249	300277	海联讯	765,441.00	7.68
250	300738	奥飞数据	765,247.00	7.67
251	600422	昆药集团	764,145.00	7.66
252	002698	博实股份	761,538.00	7.64
253	000573	粤宏远 A	760,115.00	7.62
254	603208	江山欧派	756,319.00	7.58
255	300205	天喻信息	755,071.00	7.57
256	603658	安图生物	754,980.00	7.57
257	300038	数知科技	752,100.00	7.54
258	600664	哈药股份	737,564.00	7.40
259	002105	信隆健康	734,345.00	7.36
260	002435	长江健康	734,041.00	7.36
261	603638	艾迪精密	720,393.00	7.22
262	002867	周大生	716,390.00	7.18
263	002100	天康生物	713,282.00	7.15
264	600200	江苏吴中	709,539.00	7.11

265	600685	中船防务	708,515.00	7.10
266	002712	思美传媒	704,338.00	7.06
267	600287	江苏舜天	700,835.00	7.03
268	300083	劲胜智能	696,535.00	6.98
269	000560	我爱我家	694,858.00	6.97
270	000718	苏宁环球	694,578.60	6.96
271	300570	太辰光	692,193.00	6.94
272	600470	六国化工	690,171.00	6.92
273	002197	证通电子	688,763.00	6.91
274	600096	云天化	688,319.00	6.90
275	600322	天房发展	686,401.00	6.88
276	002035	华帝股份	679,319.00	6.81
277	300559	佳发教育	674,306.00	6.76
278	688111	金山办公	672,261.74	6.74
279	300411	金盾股份	671,138.00	6.73
280	002759	天际股份	670,803.00	6.73
281	000657	中钨高新	669,760.64	6.72
282	300248	新开普	669,407.00	6.71
283	603999	读者传媒	668,569.00	6.70
284	603660	苏州科达	664,450.00	6.66
285	002237	恒邦股份	662,140.00	6.64
286	300496	中科创达	660,520.00	6.62
287	002135	东南网架	658,805.00	6.61
288	002833	弘亚数控	655,878.00	6.58
289	603603	博天环境	653,370.00	6.55
290	002657	中科金财	644,139.00	6.46
291	601811	新华文轩	642,034.00	6.44
292	603989	艾华集团	639,856.00	6.42

293	600987	航民股份	638,308.00	6.40
294	600346	恒力石化	636,521.00	6.38
295	600207	安彩高科	629,004.00	6.31
296	300256	星星科技	628,781.00	6.30
297	300634	彩讯股份	622,548.00	6.24
298	300311	任子行	622,108.00	6.24
299	603357	设计总院	619,575.00	6.21
300	002402	和而泰	619,192.00	6.21
301	603356	华菱精工	618,586.00	6.20
302	300242	佳云科技	617,510.00	6.19
303	600211	西藏药业	616,109.00	6.18
304	603199	九华旅游	615,799.00	6.17
305	300737	科顺股份	614,876.00	6.17
306	600162	香江控股	609,696.00	6.11
307	600667	太极实业	608,339.00	6.10
308	002228	合兴包装	607,272.00	6.09
309	600828	茂业商业	603,140.14	6.05
310	002433	太安堂	601,487.00	6.03
311	300465	高伟达	598,278.00	6.00
312	603737	三棵树	594,852.00	5.96
313	000993	闽东电力	592,812.00	5.94
314	603801	志邦家居	590,645.00	5.92
315	600512	腾达建设	590,105.00	5.92
316	300061	旗天科技	588,197.00	5.90
317	002649	博彦科技	585,772.00	5.87
318	000838	财信发展	585,245.00	5.87
319	000736	中交地产	585,141.20	5.87
320	002022	科华生物	584,421.00	5.86

321	300213	佳讯飞鸿	577,862.00	5.79
322	300460	惠伦晶体	576,875.00	5.78
323	300131	英唐智控	571,489.00	5.73
324	603165	荣晟环保	568,031.00	5.70
325	603811	诚意药业	567,690.00	5.69
326	300661	圣邦股份	563,662.00	5.65
327	600496	精工钢构	562,317.00	5.64
328	300447	全信股份	561,454.60	5.63
329	600251	冠农股份	556,998.00	5.59
330	002521	齐峰新材	556,892.00	5.58
331	603129	春风动力	555,470.00	5.57
332	300223	北京君正	549,806.00	5.51
333	600031	三一重工	548,168.00	5.50
334	000151	中成股份	546,104.00	5.48
335	601336	新华保险	541,777.00	5.43
336	002308	威创股份	534,719.00	5.36
337	002156	通富微电	534,111.00	5.36
338	601700	风范股份	529,970.00	5.31
339	601718	际华集团	529,624.00	5.31
340	002329	皇氏集团	528,083.00	5.30
341	002091	江苏国泰	526,136.00	5.28
342	600456	宝钛股份	525,692.00	5.27
343	603587	地素时尚	521,961.00	5.23
344	600677	*ST 航通	515,217.00	5.17
345	600984	建设机械	511,514.00	5.13
346	600681	百川能源	510,922.60	5.12
347	002876	三利谱	510,011.00	5.11
348	603299	苏盐井神	503,597.00	5.05

349	600691	阳煤化工	503,095.00	5.04
350	603160	汇顶科技	502,617.00	5.04
351	600587	新华医疗	500,976.00	5.02
352	002024	苏宁易购	500,698.00	5.02
353	300690	双一科技	498,634.00	5.00
354	603528	多伦科技	496,588.00	4.98
355	603693	江苏新能	495,250.00	4.97
356	600090	同济堂	494,230.00	4.96
357	600589	广东榕泰	492,499.00	4.94
358	603920	世运电路	492,404.00	4.94
359	300735	光弘科技	491,490.00	4.93
360	600988	赤峰黄金	490,708.00	4.92
361	000049	德赛电池	490,051.00	4.91
362	600571	信雅达	487,716.00	4.89
363	002539	云图控股	482,118.00	4.83
364	600117	西宁特钢	480,416.00	4.82
365	002913	奥士康	474,925.00	4.76
366	603678	火炬电子	469,538.00	4.71
367	002933	新兴装备	466,835.00	4.68
368	600727	鲁北化工	465,438.00	4.67
369	002502	鼎龙文化	461,864.00	4.63
370	300401	花园生物	460,104.00	4.61
371	601890	亚星锚链	458,677.00	4.60
372	000851	高鸿股份	458,300.00	4.60
373	603618	杭电股份	458,121.00	4.59
374	002518	科士达	456,969.00	4.58
375	002326	永太科技	450,824.00	4.52
376	300132	青松股份	450,320.00	4.52

377	300162	雷曼光电	449,276.00	4.50
378	000708	中信特钢	447,519.00	4.49
379	002429	兆驰股份	446,899.00	4.48
380	002511	中顺洁柔	445,779.00	4.47
381	300306	远方信息	445,684.80	4.47
382	603798	康普顿	443,989.00	4.45
383	002662	京威股份	443,679.00	4.45
384	002123	梦网集团	441,746.00	4.43
385	300170	汉得信息	441,733.00	4.43
386	600418	江淮汽车	436,505.00	4.38
387	002481	双塔食品	436,043.00	4.37
388	000812	陕西金叶	435,307.00	4.36
389	603696	安记食品	433,417.00	4.35
390	603800	道森股份	432,203.00	4.33
391	300379	东方通	429,488.00	4.31
392	000921	海信家电	428,703.00	4.30
393	600594	益佰制药	427,032.00	4.28
394	603533	掌阅科技	426,493.00	4.28
395	600057	厦门象屿	425,042.00	4.26
396	300664	鹏鹞环保	422,674.00	4.24
397	600894	广日股份	421,087.00	4.22
398	603360	百傲化学	420,861.00	4.22
399	300543	朗科智能	419,493.00	4.21
400	603988	中电电机	415,560.00	4.17
401	300078	思创医惠	414,887.00	4.16
402	603042	华脉科技	411,065.00	4.12
403	002360	同德化工	406,002.00	4.07
404	603359	东珠生态	405,818.60	4.07

405	603289	泰瑞机器	405,761.00	4.07
406	688036	传音控股	405,384.95	4.06
407	601788	光大证券	401,911.25	4.03
408	600676	交运股份	401,003.00	4.02
409	002322	理工环科	397,983.00	3.99
410	688196	卓越新能	394,226.19	3.95
411	603619	中曼石油	394,196.00	3.95
412	002752	昇兴股份	389,120.60	3.90
413	603081	大丰实业	388,889.00	3.90
414	002171	楚江新材	388,255.00	3.89
415	688363	华熙生物	386,382.15	3.87
416	600206	有研新材	383,190.00	3.84
417	002810	山东赫达	381,661.00	3.83
418	603599	广信股份	380,127.00	3.81
419	300302	同有科技	379,541.00	3.81
420	601636	旗滨集团	379,157.00	3.80
421	000860	顺鑫农业	378,348.00	3.79
422	600127	金健米业	377,911.00	3.79
423	600986	科达股份	377,197.00	3.78
424	603676	卫信康	377,126.00	3.78
425	603516	淳中科技	376,447.00	3.77
426	300363	博腾股份	375,042.00	3.76
427	603871	嘉友国际	374,432.00	3.75
428	002413	雷科防务	373,787.00	3.75
429	300552	万集科技	373,070.00	3.74
430	300630	普利制药	373,057.00	3.74
431	000668	荣丰控股	371,813.00	3.73
432	300458	全志科技	371,606.00	3.73

433	603038	华立股份	370,520.40	3.72
434	300625	三雄极光	369,639.00	3.71
435	002557	洽洽食品	365,929.00	3.67
436	002666	德联集团	365,128.00	3.66
437	603099	长白山	362,072.00	3.63
438	300494	盛天网络	361,968.00	3.63
439	000622	恒立实业	361,344.00	3.62
440	002203	海亮股份	359,376.00	3.60
441	300352	北信源	358,549.00	3.60
442	600076	康欣新材	356,498.00	3.57
443	000697	炼石航空	355,647.00	3.57
444	600331	宏达股份	352,104.00	3.53
445	300640	德艺文创	351,836.00	3.53
446	603707	健友股份	351,049.00	3.52
447	002852	道道全	350,725.47	3.52
448	600761	安徽合力	347,869.00	3.49
449	300423	鲁亿通	346,939.00	3.48
450	002130	沃尔核材	343,263.00	3.44
451	002798	帝欧家居	342,574.00	3.44
452	603825	华扬联众	341,872.00	3.43
453	600797	浙大网新	341,560.00	3.42
454	002160	常铝股份	339,840.00	3.41
455	603378	亚士创能	339,725.00	3.41
456	000040	东旭蓝天	339,205.00	3.40
457	600107	美尔雅	336,842.00	3.38
458	601601	中国太保	336,446.00	3.37
459	000715	中兴商业	335,432.00	3.36
460	002512	达华智能	335,096.00	3.36

461	002158	汉钟精机	332,174.00	3.33
462	300149	量子生物	330,688.00	3.32
463	002099	海翔药业	324,201.00	3.25
464	002436	兴森科技	323,647.00	3.25
465	300357	我武生物	320,784.40	3.22
466	600616	金枫酒业	320,464.60	3.21
467	300314	戴维医疗	320,452.00	3.21
468	300107	建新股份	320,044.00	3.21
469	603919	金徽酒	317,212.00	3.18
470	603890	春秋电子	316,810.00	3.18
471	000925	众合科技	314,640.00	3.15
472	300684	中石科技	313,427.00	3.14
473	000885	城发环境	310,316.00	3.11
474	300224	正海磁材	309,055.00	3.10
475	000404	长虹华意	308,569.00	3.09
476	002161	远望谷	307,365.00	3.08
477	002822	中装建设	307,299.00	3.08
478	300076	GQY 视讯	305,314.00	3.06
479	600557	康缘药业	304,554.00	3.05
480	300592	华凯创意	304,380.00	3.05
481	000656	金科股份	304,375.00	3.05
482	000705	浙江震元	301,228.00	3.02
483	002111	威海广泰	300,905.00	3.02
484	002621	美吉姆	300,443.00	3.01
485	600197	伊力特	299,937.00	3.01
486	688199	久日新材	299,659.92	3.00
487	603555	贵人鸟	299,382.00	3.00
488	002917	金奥博	296,945.00	2.98

489	300618	寒锐钴业	294,362.00	2.95
490	002731	萃华珠宝	291,569.00	2.92
491	600143	金发科技	290,116.00	2.91
492	002199	东晶电子	289,672.00	2.90
493	000555	神州信息	287,390.00	2.88
494	300679	电连技术	286,872.00	2.88
495	600351	亚宝药业	286,761.00	2.88
496	600702	舍得酒业	286,191.00	2.87
497	300030	阳普医疗	284,599.00	2.85
498	603180	金牌厨柜	283,649.00	2.84
499	002226	江南化工	282,293.00	2.83
500	002090	金智科技	281,860.00	2.83
501	000026	飞亚达	281,483.00	2.82
502	002060	粤水电	281,156.00	2.82
503	002331	皖通科技	277,849.00	2.79
504	000333	美的集团	276,503.00	2.77
505	300693	盛弘股份	275,335.00	2.76
506	002313	日海智能	274,628.00	2.75
507	600580	卧龙电驱	274,516.00	2.75
508	603303	得邦照明	273,841.40	2.75
509	600777	新潮能源	273,243.00	2.74
510	300347	泰格医药	272,259.00	2.73
511	600330	天通股份	271,593.00	2.72
512	002449	国星光电	270,952.00	2.72
513	300050	世纪鼎利	270,877.00	2.72
514	002637	赞宇科技	270,701.00	2.71
515	603363	傲农生物	270,672.00	2.71
516	300221	银禧科技	269,840.00	2.71

517	300446	乐凯新材	265,971.00	2.67
518	300567	精测电子	265,682.00	2.66
519	000425	徐工机械	263,588.00	2.64
520	002530	金财互联	262,830.00	2.64
521	300036	超图软件	262,588.00	2.63
522	300724	捷佳伟创	261,949.00	2.63
523	600521	华海药业	260,904.00	2.62
524	600548	深高速	259,703.00	2.60
525	000157	中联重科	258,454.00	2.59
526	002732	燕塘乳业	257,915.00	2.59
527	300451	创业慧康	257,433.00	2.58
528	300755	华致酒行	255,635.00	2.56
529	600622	光大嘉宝	255,132.00	2.56
530	300455	康拓红外	254,778.00	2.55
531	600570	恒生电子	254,561.70	2.55
532	600191	华资实业	248,338.00	2.49
533	002301	齐心集团	245,456.00	2.46
534	603598	引力传媒	244,565.00	2.45
535	603315	福鞍股份	243,510.00	2.44
536	300140	中环装备	241,821.00	2.42
537	600900	长江电力	241,336.00	2.42
538	002918	蒙娜丽莎	239,999.00	2.41
539	600020	中原高速	237,676.00	2.38
540	002467	二六三	235,342.00	2.36
541	002133	广宇集团	234,484.00	2.35
542	300212	易华录	232,106.00	2.33
543	002911	佛燃股份	231,215.00	2.32
544	000889	中嘉博创	230,476.00	2.31

545	002882	金龙羽	228,160.00	2.29
546	300348	长亮科技	227,826.00	2.28
547	600213	亚星客车	227,380.00	2.28
548	300397	天和防务	224,950.00	2.26
549	603039	泛微网络	224,513.00	2.25
550	300429	强力新材	223,707.00	2.24
551	000156	华数传媒	221,604.00	2.22
552	300239	东宝生物	221,589.00	2.22
553	300081	恒信东方	221,103.00	2.22
554	603105	芯能科技	220,561.00	2.21
555	300761	立华股份	219,585.00	2.20
556	600711	盛屯矿业	219,323.00	2.20
557	002847	盐津铺子	218,736.00	2.19
558	300476	胜宏科技	218,582.00	2.19
559	600531	豫光金铅	217,497.00	2.18
560	300369	绿盟科技	217,264.00	2.18
561	300234	开尔新材	216,344.00	2.17
562	600483	福能股份	215,450.00	2.16
563	603345	安井食品	213,413.00	2.14
564	600745	闻泰科技	213,358.00	2.14
565	300680	隆盛科技	213,039.00	2.14
566	603600	永艺股份	213,035.00	2.14
567	603068	博通集成	211,959.00	2.13
568	600611	大众交通	211,273.00	2.12
569	002554	惠博普	209,779.00	2.10
570	600529	山东药玻	207,680.40	2.08
571	002929	润建股份	207,087.00	2.08
572	601515	东风股份	206,718.00	2.07

573	688139	海尔生物	205,756.97	2.06
574	688366	昊海生科	205,585.92	2.06
575	600477	杭萧钢构	204,236.00	2.05
576	688025	杰普特	204,168.30	2.05
577	600300	维维股份	204,105.00	2.05
578	300577	开润股份	203,710.00	2.04
579	600110	诺德股份	203,468.00	2.04
580	002063	远光软件	202,575.00	2.03
581	002214	大立科技	202,545.00	2.03
582	600962	国投中鲁	202,545.00	2.03
583	002261	拓维信息	202,323.00	2.03
584	002893	华通热力	201,039.00	2.02
585	600352	浙江龙盛	200,613.00	2.01
586	603278	大业股份	200,133.00	2.01

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。

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	601677	明泰铝业	4,839,748.03	48.53
2	600846	同济科技	4,659,270.82	46.72
3	002139	拓邦股份	4,389,470.57	44.01
4	600728	佳都科技	4,340,566.00	43.52
5	600995	文山电力	4,312,766.00	43.24
6	600533	栖霞建设	4,229,415.40	42.41
7	000973	佛塑科技	3,826,648.00	38.37
8	600063	皖维高新	3,784,338.00	37.95
9	601058	赛轮轮胎	3,738,821.00	37.49

10	600261	阳光照明	3,713,261.00	37.23
11	000672	上峰水泥	3,576,888.00	35.87
12	300014	亿纬锂能	3,554,212.00	35.64
13	002016	世荣兆业	3,478,518.00	34.88
14	000601	韶能股份	3,401,875.00	34.11
15	603063	禾望电气	3,353,853.00	33.63
16	600720	祁连山	3,324,030.83	33.33
17	300303	聚飞光电	3,254,752.40	32.64
18	603368	柳药股份	3,126,025.00	31.34
19	600502	安徽建工	3,058,313.66	30.67
20	300231	银信科技	3,032,430.20	30.41
21	603699	纽威股份	2,913,396.25	29.21
22	603118	共进股份	2,860,549.00	28.68
23	300209	天泽信息	2,823,310.00	28.31
24	300114	中航电测	2,798,595.42	28.06
25	300660	江苏雷利	2,779,398.38	27.87
26	600343	航天动力	2,773,242.92	27.81
27	300628	亿联网络	2,726,045.00	27.33
28	002907	华森制药	2,709,588.00	27.17
29	603126	中材节能	2,694,871.00	27.02
30	300497	富祥股份	2,584,120.60	25.91
31	000913	钱江摩托	2,573,223.16	25.80
32	600449	宁夏建材	2,471,400.35	24.78
33	300571	平治信息	2,446,203.73	24.53
34	002094	青岛金王	2,405,929.40	24.12
35	002792	通宇通讯	2,403,880.00	24.10
36	002458	益生股份	2,399,023.90	24.06
37	600552	凯盛科技	2,360,191.00	23.67

38	002928	华夏航空	2,305,247.00	23.11
39	002396	星网锐捷	2,301,726.00	23.08
40	002182	云海金属	2,298,453.00	23.05
41	603298	杭叉集团	2,283,925.56	22.90
42	603385	惠达卫浴	2,241,832.06	22.48
43	600675	中华企业	2,234,600.40	22.41
44	002605	姚记科技	2,233,300.00	22.39
45	300682	朗新科技	2,196,205.00	22.02
46	002351	漫步者	2,176,330.19	21.82
47	000810	创维数字	2,139,422.00	21.45
48	002734	利民股份	2,108,208.00	21.14
49	601163	三角轮胎	2,098,473.00	21.04
50	002746	仙坛股份	2,097,103.70	21.03
51	000905	厦门港务	2,084,473.00	20.90
52	002020	京新药业	2,072,841.14	20.78
53	600185	格力地产	2,041,132.92	20.47
54	002362	汉王科技	2,034,806.97	20.40
55	600132	重庆啤酒	2,033,613.69	20.39
56	002367	康力电梯	2,030,454.00	20.36
57	002318	久立特材	2,028,441.00	20.34
58	601107	四川成渝	2,024,521.00	20.30
59	688111	金山办公	2,019,127.70	20.25
60	600668	尖峰集团	2,011,188.00	20.17
61	300233	金城医药	1,994,445.86	20.00
62	300322	硕贝德	1,990,057.00	19.95
63	300236	上海新阳	1,984,457.00	19.90
64	300438	鹏辉能源	1,982,896.00	19.88
65	300613	富瀚微	1,955,433.30	19.61

66	001896	豫能控股	1,921,666.00	19.27
67	600136	当代明诚	1,915,948.00	19.21
68	002379	宏创控股	1,905,967.00	19.11
69	300502	新易盛	1,904,817.00	19.10
70	300130	新国都	1,903,476.00	19.09
71	600855	航天长峰	1,903,195.00	19.08
72	002335	科华恒盛	1,898,082.57	19.03
73	000550	江铃汽车	1,892,794.00	18.98
74	600446	金证股份	1,888,046.00	18.93
75	300349	金卡智能	1,886,362.00	18.91
76	300171	东富龙	1,885,391.92	18.90
77	002577	雷柏科技	1,881,560.00	18.87
78	601126	四方股份	1,878,599.00	18.84
79	000957	中通客车	1,866,970.00	18.72
80	300417	南华仪器	1,854,585.00	18.60
81	300298	三诺生物	1,839,264.56	18.44
82	000650	仁和药业	1,834,701.36	18.40
83	300016	北陆药业	1,825,145.00	18.30
84	000034	神州数码	1,821,093.00	18.26
85	603067	振华股份	1,802,318.20	18.07
86	601599	鹿港文化	1,777,798.48	17.83
87	600180	瑞茂通	1,769,034.00	17.74
88	002314	南山控股	1,766,329.00	17.71
89	601886	江河集团	1,758,008.00	17.63
90	300523	辰安科技	1,743,449.00	17.48
91	002219	恒康医疗	1,740,716.00	17.45
92	600310	桂东电力	1,723,069.00	17.28
93	002705	新宝股份	1,717,103.00	17.22

94	300012	华测检测	1,707,408.70	17.12
95	000915	山大华特	1,704,768.20	17.09
96	000035	中国天楹	1,672,079.00	16.77
97	600229	城市传媒	1,638,630.75	16.43
98	300198	纳川股份	1,629,959.00	16.34
99	603277	银都股份	1,628,988.00	16.33
100	002084	海鸥住工	1,618,310.00	16.23
101	600405	动力源	1,615,487.80	16.20
102	000710	贝瑞基因	1,615,167.00	16.20
103	000411	英特集团	1,614,722.60	16.19
104	300045	华力创通	1,611,053.00	16.15
105	600985	淮北矿业	1,609,968.00	16.14
106	600581	八一钢铁	1,595,841.56	16.00
107	603013	亚普股份	1,595,089.00	15.99
108	603026	石大胜华	1,589,851.00	15.94
109	002869	金溢科技	1,565,562.00	15.70
110	300726	宏达电子	1,555,783.00	15.60
111	300568	星源材质	1,533,983.00	15.38
112	600626	申达股份	1,530,718.00	15.35
113	300487	蓝晓科技	1,530,442.00	15.35
114	600768	宁波富邦	1,524,112.00	15.28
115	300251	光线传媒	1,513,915.00	15.18
116	002851	麦格米特	1,490,045.43	14.94
117	000662	天夏智慧	1,489,188.00	14.93
118	000576	广东甘化	1,473,060.00	14.77
119	002249	大洋电机	1,466,449.00	14.70
120	600510	黑牡丹	1,465,301.00	14.69
121	002377	国创高新	1,450,631.00	14.55

122	000999	华润三九	1,448,445.08	14.52
123	601918	新集能源	1,442,990.00	14.47
124	300039	上海凯宝	1,430,109.00	14.34
125	000739	普洛药业	1,424,873.00	14.29
126	600381	青海春天	1,417,524.00	14.21
127	002276	万马股份	1,403,246.00	14.07
128	000019	深粮控股	1,395,694.60	13.99
129	300432	富临精工	1,391,628.00	13.95
130	601666	平煤股份	1,390,001.00	13.94
131	300636	同和药业	1,387,968.00	13.92
132	603043	广州酒家	1,380,574.00	13.84
133	603606	东方电缆	1,375,770.00	13.79
134	000802	北京文化	1,363,932.00	13.68
135	002011	盾安环境	1,358,524.00	13.62
136	600490	鹏欣资源	1,345,720.00	13.49
137	002299	圣农发展	1,339,253.00	13.43
138	002568	百润股份	1,336,903.00	13.41
139	002782	可立克	1,334,184.00	13.38
140	600997	开滦股份	1,328,086.00	13.32
141	600873	梅花生物	1,326,894.00	13.30
142	002755	奥赛康	1,322,999.24	13.27
143	603609	禾丰牧业	1,322,820.00	13.26
144	002124	天邦股份	1,295,389.00	12.99
145	300007	汉威科技	1,294,291.00	12.98
146	600936	广西广电	1,294,201.00	12.98
147	300219	鸿利智汇	1,281,836.00	12.85
148	600812	华北制药	1,276,613.00	12.80
149	600012	皖通高速	1,276,286.63	12.80

150	002045	国光电器	1,269,422.00	12.73
151	002234	民和股份	1,263,281.00	12.67
152	600267	海正药业	1,244,336.00	12.48
153	600273	嘉化能源	1,234,677.00	12.38
154	002895	川恒股份	1,229,023.00	12.32
155	600250	南纺股份	1,211,811.00	12.15
156	300020	银江股份	1,210,300.60	12.14
157	600129	太极集团	1,206,316.00	12.10
158	300602	飞荣达	1,200,822.00	12.04
159	300533	冰川网络	1,196,488.00	12.00
160	600391	航发科技	1,193,755.00	11.97
161	603309	维力医疗	1,192,689.00	11.96
162	300118	东方日升	1,189,175.00	11.92
163	603458	勘设股份	1,180,002.20	11.83
164	600210	紫江企业	1,177,592.00	11.81
165	300269	联建光电	1,173,019.00	11.76
166	300043	星辉娱乐	1,162,068.00	11.65
167	000663	永安林业	1,153,856.00	11.57
168	603882	金域医学	1,150,370.00	11.53
169	300017	网宿科技	1,147,052.95	11.50
170	600715	文投控股	1,146,920.00	11.50
171	000637	茂化实华	1,146,389.00	11.49
172	000987	越秀金控	1,138,989.63	11.42
173	002611	东方精工	1,131,498.00	11.35
174	000829	天音控股	1,131,493.00	11.35
175	601566	九牧王	1,130,992.00	11.34
176	603733	仙鹤股份	1,118,527.00	11.22
177	600284	浦东建设	1,108,156.00	11.11

178	300531	优博讯	1,107,927.00	11.11
179	601360	三六零	1,097,042.00	11.00
180	600641	万业企业	1,094,964.73	10.98
181	300075	数字政通	1,090,572.00	10.94
182	603887	城地股份	1,090,429.60	10.93
183	002664	长鹰信质	1,082,217.00	10.85
184	300378	鼎捷软件	1,076,957.00	10.80
185	002036	联创电子	1,073,224.00	10.76
186	300529	健帆生物	1,067,823.00	10.71
187	603008	喜临门	1,066,782.00	10.70
188	300034	钢研高纳	1,049,476.56	10.52
189	600382	广东明珠	1,047,920.00	10.51
190	300393	中来股份	1,047,324.00	10.50
191	000042	中洲控股	1,046,031.00	10.49
192	000923	河钢资源	1,045,361.00	10.48
193	002653	海思科	1,035,562.00	10.38
194	002912	中新赛克	1,034,032.00	10.37
195	002906	华阳集团	1,012,970.00	10.16
196	600323	瀚蓝环境	1,012,468.00	10.15
197	002756	永兴材料	1,007,986.00	10.11
198	603098	森特股份	1,005,677.20	10.08
199	600217	中再资环	982,348.00	9.85
200	300702	天宇股份	976,563.12	9.79
201	600731	湖南海利	973,425.00	9.76
202	002531	天顺风能	966,091.00	9.69
203	002850	科达利	960,890.00	9.63
204	603208	江山欧派	954,595.00	9.57
205	002651	利君股份	954,322.00	9.57

206	000951	中国重汽	953,480.00	9.56
207	002433	太安堂	953,180.00	9.56
208	600662	强生控股	949,344.00	9.52
209	603843	正平股份	943,806.00	9.46
210	600740	山西焦化	943,447.00	9.46
211	000700	模塑科技	936,348.00	9.39
212	603508	思维列控	932,427.00	9.35
213	002262	恩华药业	929,769.00	9.32
214	300066	三川智慧	927,108.00	9.30
215	603980	吉华集团	922,803.40	9.25
216	300624	万兴科技	919,877.00	9.22
217	002246	北化股份	909,186.00	9.12
218	000639	西王食品	908,163.00	9.11
219	600805	悦达投资	906,485.00	9.09
220	603585	苏利股份	903,685.80	9.06
221	601588	北辰实业	901,813.00	9.04
222	600501	航天晨光	901,075.54	9.04
223	603959	百利科技	895,645.15	8.98
224	300559	佳发教育	893,630.96	8.96
225	600612	老凤祥	892,892.00	8.95
226	002833	弘亚数控	887,185.00	8.90
227	600336	澳柯玛	885,981.00	8.88
228	300738	奥飞数据	878,074.20	8.80
229	002567	唐人神	867,211.00	8.70
230	000933	神火股份	866,354.00	8.69
231	000967	盈峰环境	864,040.00	8.66
232	601900	南方传媒	852,640.13	8.55
233	002534	杭锅股份	851,617.00	8.54

234	300038	数知科技	850,823.00	8.53
235	601717	郑煤机	848,867.00	8.51
236	603579	荣泰健康	839,010.00	8.41
237	300366	创意信息	837,203.00	8.39
238	601369	陕鼓动力	832,359.98	8.35
239	603218	日月股份	826,080.40	8.28
240	600828	茂业商业	825,570.87	8.28
241	603638	艾迪精密	816,589.47	8.19
242	601116	三江购物	815,813.00	8.18
243	603666	亿嘉和	811,083.26	8.13
244	603058	永吉股份	807,611.00	8.10
245	002279	久其软件	807,568.40	8.10
246	300158	振东制药	805,417.00	8.08
247	603596	伯特利	794,557.00	7.97
248	603819	神力股份	793,261.00	7.95
249	300310	宜通世纪	786,101.84	7.88
250	002435	长江健康	782,809.50	7.85
251	300223	北京君正	774,733.00	7.77
252	002292	奥飞娱乐	774,634.00	7.77
253	603393	新天然气	773,939.00	7.76
254	000591	太阳能	770,397.00	7.72
255	300277	海联讯	769,253.00	7.71
256	002712	思美传媒	765,940.00	7.68
257	300460	惠伦晶体	764,514.00	7.67
258	002035	华帝股份	759,106.00	7.61
259	300083	劲胜智能	755,575.00	7.58
260	300311	任子行	753,684.00	7.56
261	600287	江苏舜天	748,240.60	7.50

262	002698	博实股份	746,777.00	7.49
263	000751	锌业股份	746,737.00	7.49
264	600096	云天化	724,182.00	7.26
265	603658	安图生物	722,398.00	7.24
266	600664	哈药股份	719,720.00	7.22
267	688036	传音控股	719,057.00	7.21
268	000657	中钨高新	716,703.48	7.19
269	000900	现代投资	716,669.60	7.19
270	002609	捷顺科技	713,539.00	7.15
271	300465	高伟达	703,176.00	7.05
272	002197	证通电子	700,448.00	7.02
273	600322	天房发展	700,125.00	7.02
274	600422	昆药集团	699,678.00	7.02
275	300661	圣邦股份	694,876.00	6.97
276	002105	信隆健康	693,087.00	6.95
277	600200	江苏吴中	693,009.00	6.95
278	603603	博天环境	692,271.00	6.94
279	000560	我爱我家	685,653.00	6.88
280	601811	新华文轩	681,148.00	6.83
281	300242	佳云科技	679,785.00	6.82
282	002060	粤水电	675,425.00	6.77
283	600162	香江控股	670,038.00	6.72
284	600512	腾达建设	667,125.00	6.69
285	000718	苏宁环球	666,528.60	6.68
286	000573	粤宏远 A	665,441.00	6.67
287	688363	华熙生物	664,819.50	6.67
288	002135	东南网架	663,683.00	6.65
289	300205	天喻信息	663,442.00	6.65

290	603199	九华旅游	662,842.00	6.65
291	002867	周大生	660,707.00	6.62
292	300558	贝达药业	659,017.00	6.61
293	600667	太极实业	658,058.00	6.60
294	603811	诚意药业	657,606.00	6.59
295	603989	艾华集团	656,246.00	6.58
296	600470	六国化工	651,990.00	6.54
297	603660	苏州科达	650,384.00	6.52
298	603999	读者传媒	649,558.00	6.51
299	300131	英唐智控	649,021.00	6.51
300	603129	春风动力	645,544.00	6.47
301	600685	中船防务	644,531.00	6.46
302	600031	三一重工	644,421.00	6.46
303	300411	金盾股份	643,943.00	6.46
304	600346	恒力石化	641,449.00	6.43
305	300496	中科创达	640,629.00	6.42
306	603356	华菱精工	635,311.00	6.37
307	002237	恒邦股份	634,675.00	6.36
308	600987	航民股份	634,359.00	6.36
309	600207	安彩高科	629,718.00	6.31
310	300248	新开普	627,755.00	6.29
311	300634	彩讯股份	626,416.00	6.28
312	002649	博彦科技	625,346.00	6.27
313	603357	设计总院	625,211.00	6.27
314	002657	中科金财	625,175.00	6.27
315	600456	宝钛股份	622,988.00	6.25
316	002156	通富微电	620,063.00	6.22
317	300256	星星科技	598,109.73	6.00

318	002228	合兴包装	584,588.00	5.86
319	300735	光弘科技	579,972.80	5.82
320	603165	荣晟环保	579,240.00	5.81
321	002308	威创股份	574,489.00	5.76
322	300213	佳讯飞鸿	573,532.00	5.75
323	002759	天际股份	573,442.00	5.75
324	603801	志邦家居	571,323.00	5.73
325	000993	闽东电力	570,046.00	5.72
326	600677	航天通信	569,904.00	5.71
327	002100	天康生物	566,327.00	5.68
328	300061	康旗股份	566,055.00	5.68
329	002329	皇氏集团	566,023.00	5.68
330	600251	冠农股份	565,400.00	5.67
331	300570	太辰光	562,565.00	5.64
332	601700	风范股份	560,864.00	5.62
333	002521	齐峰新材	558,889.00	5.60
334	002022	科华生物	555,955.00	5.57
335	002402	和而泰	549,000.00	5.50
336	300447	全信股份	548,184.00	5.50
337	300690	双一科技	544,007.00	5.45
338	300306	远方信息	543,095.00	5.45
339	603160	汇顶科技	542,949.00	5.44
340	601336	新华保险	541,202.00	5.43
341	000151	中成股份	538,899.00	5.40
342	603920	世运电路	538,046.00	5.40
343	600587	新华医疗	534,466.00	5.36
344	002091	江苏国泰	533,005.00	5.34
345	600984	建设机械	532,387.00	5.34

346	600211	西藏药业	529,081.00	5.31
347	002322	理工环科	526,332.00	5.28
348	000921	海信家电	522,651.00	5.24
349	000736	中交地产	519,806.00	5.21
350	002933	新兴装备	519,715.00	5.21
351	603587	地素时尚	518,032.00	5.19
352	603528	多伦科技	510,639.00	5.12
353	600681	百川能源	508,789.60	5.10
354	600067	冠城大通	507,302.00	5.09
355	300302	同有科技	506,902.00	5.08
356	600496	精工钢构	505,400.00	5.07
357	002539	云图控股	504,689.00	5.06
358	002876	三利谱	504,293.00	5.06
359	002024	苏宁易购	503,694.00	5.05
360	603693	江苏新能	503,135.00	5.04
361	000708	中信特钢	500,619.00	5.02
362	002788	鹭燕医药	499,316.34	5.01
363	603737	三棵树	496,793.00	4.98
364	300737	科顺股份	495,347.00	4.97
365	600090	同济堂	491,065.00	4.92
366	000851	高鸿股份	490,743.00	4.92
367	600691	阳煤化工	490,630.00	4.92
368	601718	际华集团	487,636.00	4.89
369	300132	青松股份	483,795.00	4.85
370	603798	康普顿	483,600.00	4.85
371	002326	永太科技	481,024.00	4.82
372	600589	广东榕泰	478,578.00	4.80
373	600571	信雅达	476,941.00	4.78

374	000049	德赛电池	475,352.00	4.77
375	002518	科士达	473,896.00	4.75
376	600117	西宁特钢	473,314.98	4.75
377	600988	赤峰黄金	472,237.00	4.74
378	002502	鼎龙文化	468,322.00	4.70
379	603678	火炬电子	467,734.00	4.69
380	300401	花园生物	462,332.00	4.64
381	300162	雷曼光电	462,318.00	4.64
382	600727	鲁北化工	461,691.00	4.63
383	600594	益佰制药	452,832.00	4.54
384	002429	兆驰股份	452,114.00	4.53
385	603533	掌阅科技	451,440.00	4.53
386	300552	万集科技	449,181.00	4.50
387	002810	山东赫达	446,561.19	4.48
388	600894	广日股份	445,078.00	4.46
389	600057	厦门象屿	442,518.00	4.44
390	603299	苏盐井神	442,143.00	4.43
391	002662	京威股份	441,896.00	4.43
392	300078	思创医惠	438,871.00	4.40
393	000030	富奥股份	431,575.00	4.33
394	300170	汉得信息	430,895.00	4.32
395	688196	卓越新能	430,487.40	4.32
396	603800	道森股份	430,076.00	4.31
397	300363	博腾股份	425,281.00	4.26
398	000812	陕西金叶	423,330.00	4.24
399	002511	中顺洁柔	421,035.00	4.22
400	603696	安记食品	420,540.64	4.22
401	688139	海尔生物	416,381.87	4.18

402	603360	百傲化学	416,307.00	4.17
403	603359	东珠生态	415,758.00	4.17
404	002171	楚江新材	414,370.00	4.15
405	601788	光大证券	412,602.12	4.14
406	002913	奥士康	412,567.00	4.14
407	600418	江淮汽车	412,467.00	4.14
408	002360	同德化工	411,353.00	4.12
409	300379	东方通	411,025.00	4.12
410	601890	亚星锚链	402,201.00	4.03
411	300494	盛天网络	401,868.00	4.03
412	300664	鹏鹞环保	400,929.00	4.02
413	000668	荣丰控股	397,739.00	3.99
414	603289	泰瑞机器	397,068.80	3.98
415	603618	杭电股份	396,073.00	3.97
416	000697	炼石航空	395,878.00	3.97
417	600676	交运股份	394,848.00	3.96
418	603988	中电电机	394,648.00	3.96
419	002512	达华智能	393,950.00	3.95
420	688030	山石网科	392,859.46	3.94
421	600127	金健米业	392,774.00	3.94
422	300446	乐凯新材	391,430.00	3.92
423	603516	淳中科技	390,146.20	3.91
424	300543	朗科智能	388,577.00	3.90
425	603081	大丰实业	382,586.00	3.84
426	603599	广信股份	382,521.05	3.84
427	603598	引力传媒	382,014.00	3.83
428	002481	双塔食品	380,267.00	3.81
429	603825	华扬联众	376,500.00	3.78

430	000860	顺鑫农业	375,461.00	3.76
431	300458	全志科技	373,863.00	3.75
432	002436	兴森科技	373,003.00	3.74
433	300423	鲁亿通	372,531.00	3.74
434	603707	健友股份	369,972.00	3.71
435	603042	华脉科技	369,964.00	3.71
436	603619	中曼石油	369,356.00	3.70
437	002449	国星光电	365,236.00	3.66
438	600206	有研新材	363,485.00	3.64
439	603099	长白山	363,235.00	3.64
440	002203	海亮股份	363,080.75	3.64
441	300625	三雄极光	362,789.00	3.64
442	002852	道道全	360,806.18	3.62
443	601636	旗滨集团	360,431.00	3.61
444	300618	寒锐钴业	359,706.00	3.61
445	002158	汉钟精机	358,918.00	3.60
446	600761	安徽合力	358,553.00	3.60
447	603871	嘉友国际	358,490.00	3.59
448	002123	梦网集团	355,889.00	3.57
449	603038	华立股份	354,904.00	3.56
450	000622	恒立实业	353,665.00	3.55
451	300640	德艺文创	352,977.00	3.54
452	300684	中石科技	352,922.00	3.54
453	603378	亚士创能	352,427.00	3.53
454	600076	康欣新材	351,754.00	3.53
455	600331	宏达股份	348,656.00	3.50
456	002798	帝欧家居	348,557.00	3.49
457	600616	金枫酒业	346,505.00	3.47

458	600107	美尔雅	345,136.00	3.46
459	002666	德联集团	344,800.00	3.46
460	601601	中国太保	344,156.00	3.45
461	002161	远望谷	343,936.00	3.45
462	002413	雷科防务	343,179.00	3.44
463	600797	浙大网新	342,229.34	3.43
464	300352	北信源	342,127.00	3.43
465	000838	财信发展	341,443.00	3.42
466	002160	常铝股份	340,244.00	3.41
467	000040	东旭蓝天	339,142.00	3.40
468	603676	卫信康	337,439.00	3.38
469	002130	沃尔核材	330,718.00	3.32
470	600986	科达股份	328,841.00	3.30
471	002557	洽洽食品	328,202.92	3.29
472	300107	建新股份	325,602.00	3.26
473	300076	GQY 视讯	323,836.00	3.25
474	002099	海翔药业	323,692.00	3.25
475	002637	赞宇科技	320,736.00	3.22
476	688199	久日新材	320,049.08	3.21
477	688366	昊海生科	317,985.96	3.19
478	300630	普利制药	314,083.50	3.15
479	300224	正海磁材	314,032.00	3.15
480	000656	金科股份	312,902.00	3.14
481	600580	卧龙电驱	312,123.00	3.13
482	300592	华凯创意	311,449.00	3.12
483	002822	中装建设	310,394.00	3.11
484	002917	金奥博	310,321.00	3.11
485	300755	华致酒行	309,361.00	3.10

486	300149	量子生物	306,683.00	3.08
487	002530	金财互联	305,632.00	3.06
488	000705	浙江震元	303,458.00	3.04
489	002621	美吉姆	302,289.00	3.03
490	000555	神州信息	302,260.00	3.03
491	000404	长虹华意	301,511.00	3.02
492	601515	东风股份	300,890.00	3.02
493	000715	中兴商业	300,485.19	3.01
494	600557	康缘药业	300,137.00	3.01
495	000333	美的集团	297,329.00	2.98
496	300030	阳普医疗	297,105.00	2.98
497	603890	春秋电子	296,882.00	2.98
498	603180	金牌厨柜	296,494.00	2.97
499	000026	飞亚达 A	294,871.00	2.96
500	300314	戴维医疗	294,766.00	2.96
501	601077	渝农商行	294,493.80	2.95
502	600330	天通股份	294,243.00	2.95
503	002080	中材科技	293,042.00	2.94
504	300357	我武生物	290,983.00	2.92
505	002296	辉煌科技	290,064.00	2.91
506	600570	恒生电子	289,503.40	2.90
507	000925	众合科技	289,308.00	2.90
508	300455	康拓红外	287,963.00	2.89
509	600548	深高速	285,218.00	2.86
510	002313	日海智能	284,989.00	2.86
511	300679	电连技术	282,330.00	2.83
512	300451	创业慧康	281,726.00	2.82
513	300050	世纪鼎利	281,696.00	2.82

514	603555	贵人鸟	281,628.00	2.82
515	600469	风神股份	281,435.00	2.82
516	000157	中联重科	281,226.00	2.82
517	000885	城发环境	280,597.00	2.81
518	002467	二六三	280,067.20	2.81
519	002111	威海广泰	278,484.00	2.79
520	600143	金发科技	278,008.00	2.79
521	688025	杰普特	275,001.54	2.76
522	600702	舍得酒业	272,785.00	2.74
523	600363	联创光电	272,608.00	2.73
524	000425	徐工机械	271,792.00	2.73
525	002731	萃华珠宝	271,758.00	2.72
526	300347	泰格医药	270,992.00	2.72
527	600622	光大嘉宝	270,446.00	2.71
528	600777	新潮能源	268,152.00	2.69
529	002301	齐心集团	267,880.00	2.69
530	600351	亚宝药业	267,602.00	2.68
531	002847	盐津铺子	265,531.00	2.66
532	300036	超图软件	262,271.00	2.63
533	300397	天和防务	261,886.00	2.63
534	688098	申联生物	261,363.80	2.62
535	600197	伊力特	261,191.00	2.62
536	002918	蒙娜丽莎	258,492.00	2.59
537	600191	华资实业	258,361.00	2.59
538	300221	银禧科技	258,075.00	2.59
539	688101	三达膜	255,393.39	2.56
540	002226	江南化工	255,358.00	2.56
541	603258	电魂网络	254,208.00	2.55

542	002683	宏大爆破	253,415.00	2.54
543	000789	万年青	252,671.68	2.53
544	002331	皖通科技	249,700.00	2.50
545	002214	大立科技	249,666.00	2.50
546	300724	捷佳伟创	249,617.00	2.50
547	300239	东宝生物	248,019.00	2.49
548	002090	金智科技	247,974.00	2.49
549	300140	中环装备	245,490.00	2.46
550	600521	华海药业	245,387.00	2.46
551	600900	长江电力	244,547.00	2.45
552	688039	当虹科技	244,020.98	2.45
553	688166	博瑞医药	243,686.41	2.44
554	002199	东晶电子	243,682.00	2.44
555	002732	燕塘乳业	241,990.00	2.43
556	300693	盛弘股份	241,151.00	2.42
557	300429	强力新材	240,461.00	2.41
558	000889	中嘉博创	240,297.00	2.41
559	300567	精测电子	236,308.00	2.37
560	600020	中原高速	234,086.00	2.35
561	002133	广宇集团	231,840.00	2.32
562	002063	远光软件	230,427.00	2.31
563	603363	傲农生物	228,812.00	2.29
564	603105	芯能科技	227,723.00	2.28
565	002882	金龙羽	227,102.00	2.28
566	688068	热景生物	224,200.80	2.25
567	300081	恒信东方	223,949.00	2.25
568	603600	永艺股份	223,818.00	2.24
569	000156	华数传媒	222,922.00	2.24

570	688369	致远互联	221,530.20	2.22
571	603197	保隆科技	220,639.00	2.21
572	688108	赛诺医疗	220,119.98	2.21
573	600213	亚星客车	219,785.00	2.20
574	603315	福鞍股份	219,248.00	2.20
575	600033	福建高速	217,742.00	2.18
576	600745	闻泰科技	216,721.00	2.17
577	300234	开尔新材	216,380.00	2.17
578	600319	ST 亚星	215,344.00	2.16
579	603345	安井食品	214,934.00	2.16
580	300476	胜宏科技	213,502.00	2.14
581	300680	隆盛科技	213,423.00	2.14
582	600483	福能股份	211,517.00	2.12
583	002554	惠博普	210,895.00	2.11
584	300348	长亮科技	210,832.00	2.11
585	601168	西部矿业	209,671.00	2.10
586	603039	泛微网络	206,630.00	2.07
587	002617	露笑科技	206,269.00	2.07
588	600300	维维股份	205,495.00	2.06
589	603041	美思德	205,358.00	2.06
590	002911	佛燃股份	204,555.00	2.05
591	603127	昭衍新药	204,406.00	2.05
592	603068	博通集成	204,304.00	2.05
593	600529	山东药玻	204,300.00	2.05
594	600961	株冶集团	204,126.00	2.05
595	002752	昇兴股份	203,480.00	2.04
596	603519	立霸股份	202,948.00	2.03
597	300369	绿盟科技	202,848.00	2.03

598	600110	诺德股份	202,666.00	2.03
599	600611	大众交通	202,456.00	2.03
600	688299	长阳科技	201,856.98	2.02
601	600585	海螺水泥	201,699.00	2.02

注：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。

8.4.3 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	583,301,582.50
卖出股票收入（成交）总额	600,915,283.50

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名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货持仓。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	50,575.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,321.06
5	应收申购款	62,643.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	119,539.60

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601077	渝农商行	462,545.14	1.93	网下发行锁定
2	688258	卓易信息	242,723.25	1.01	科创板股票流通受限

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份 额比例
万 家 中 证 1000 指 数 增 强 A	276	40,576.71	9,887,305.69	88.29%	1,311,864.91	11.71%
万 家 中 证 1000 指 数 增 强 C	505	22,744.22	9,754,318.60	84.92%	1,731,511.22	15.08%
合计	748	30,327.54	19,641,624.29	86.58%	3,043,376.13	13.42%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额 比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	万家中证 1000 指数 增强 A	179.00	0.0016%
	万家中证 1000 指数	10,979.02	0.0956%

	增强 C		
	合计	11,158.02	0.0492%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金 投资和研究部门负责人持 有本开放式基金	万家中证 1000 指数 增强 A	0~10
	万家中证 1000 指数 增强 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开 放式基金	万家中证 1000 指数 增强 A	0
	万家中证 1000 指数 增强 C	0
	合计	0

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份额 比例（%）	发起份额总数	发起份额占 基金总份额 比例（%）	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资 金	9,887,305.69	43.59	9,887,305.69	43.59	3 年
基金管理人高级管 理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	9,887,305.69	43.59	9,887,305.69	43.59	3 年

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家中证 1000 指数增强 A	万家中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日（2018 年 12 月 3 日）基金份额总额	25,339.33	595,564.60
本报告期期初基金份额总额	9,919,465.90	595,659.98
本报告期基金总申购份额	3,977,053.64	157,085,314.51
减:本报告期基金总赎回份额	2,697,348.94	146,195,144.67
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	11,199,170.60	11,485,829.82

§ 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：

2019 年 8 月 21 日，公司增聘乔亮为万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，与陈旭共同管理该基金。

2019 年 10 月 22 日，陈旭因个人原因离职，公司免去其万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。

2019 年 6 月 13 日，公司聘任陈广益先生担任公司首席信息官。

2019 年 7 月 20 日，公司聘任满黎先生担任公司副总经理。

基金托管人：

自 2019 年 12 月 18 日起，姜然女士不再担任招商银行股份有限公司总行资产托管部总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期期为基金进行审计的会计师事务所未发生改变。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票	佣金	占当期佣金	

			成交总额的比 例		总量的比例	
太平洋证券	2	928,606,932.90	78.88%	864,814.81	78.88%	-
西南证券	1	134,946,136.73	11.46%	125,677.45	11.46%	-
申万宏源	1	84,902,871.37	7.21%	79,074.40	7.21%	-
中信证券	2	28,753,063.44	2.44%	26,779.66	2.44%	-

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、个股分析报告及丰富全面的信息服务; 能根据公司所管理基金的特定要求, 提供专门研究报告, 具有开发量化投资组合模型的能力; 能积极为公司投资业务的开展, 投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

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，本基金新增太平洋证券交易单元 2 个、西南证券交易单元 1 个、申万宏源交易单元 1 个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

§ 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	20190101 - 20190805 , 20191230 - 20191231	9,887,305.69	0.00	0.00	9,887,305.69	43.59%
	2	20190806 - 20191218	0.00	67,206,394.14	67,206,394.14	0.00	0.00%
	3	20190806 - 20191231	0.00	41,443,943.04	36,704,556.00	4,739,387.04	20.89%
	4	20190806 - 20191231	0.00	41,443,943.04	36,434,852.00	5,009,091.04	22.08%
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。</p> <p>未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；本基金基金合同生效满三年后继续存续时，若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。持有基金份额占比较高的投资者 在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

万家基金管理有限公司

2020 年 3 月 25 日