

万家元贞量化选股股票型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
7.6 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	62

7.7 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	63
7.8 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	63
7.9 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	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.12 投资组合报告附注	63
§ 8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2 盈利投资者数量占比	64
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
8.4 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	65
§ 9 开放式基金份额变动	65
§ 10 重大事件揭示	66
10.1 基金份额持有人大会决议	66
10.2 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	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
10.4 基金投资策略的改变	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	66
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	67
10.8 其他重大事件	68
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	69
11.1 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	69
§ 12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录	69
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家元贞量化选股股票型证券投资基金	
基金简称	万家元贞量化选股股票	
基金主代码	012350	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 3 月 14 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	3,140,664,945.63 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	万家元贞量化选股股票 A	万家元贞量化选股股票 C
下属分级基金的交 易代码	012350	012351
报告期末下属分级 基金的份额总额	1,422,823,066.77 份	1,717,841,878.86 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险并保持良好流动性的前提下，通过数量化模型精选个股，力争实现基金资产长期稳健的增值。
投资策略	1、大类资产配置策略；2、股票投资策略：（1）量化多因子策略；（2）组合优化策略；（3）港股通标的股票投资策略；（4）存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、可转换债券与可交换债券投资策略；6、金融衍生产品投资策略：（1）股指期货交易策略；（2）国债期货交易策略；（3）股票期权投资策略；7、信用衍生品投资策略；8、融资交易策略；9、其他。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率×20%+中债综合指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险收益水平理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 本基金可投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		万家基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	兰剑	任航
	联系电话	021-38909626	010-66060069
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	tgxxpl@abchina.com

客户服务电话	4008880800	95599
传真	021-38909627	010-68121816
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区浦 电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	上海市浦东新区浦电路 360 号陆 家嘴投资大厦 9 楼、15 楼、16 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	200122	100031
法定代表人	陈广益	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.wjasset.com
基金中期报告置备地点	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
注册登记机构	万家基金管理有限公司	上海市浦东新区浦电路 360 号 陆家嘴投资大厦 9 楼、15 楼、 16 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	万家元贞量化选股股票 A	万家元贞量化选股股票 C
本期已实现收益	228, 843, 382. 63	286, 043, 412. 07
本期利润	617, 193, 119. 98	763, 930, 711. 43
加权平均基金份 额本期利润	0. 7321	0. 7202
本期加权平均净 值利润率	44. 90%	44. 65%
本期基金份额净 值增长率	45. 31%	44. 95%
3.1.2 期 末 数 据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	700, 386, 568. 43	802, 776, 634. 61
期末可供分配基	0. 4923	0. 4673

金份额利润		
期末基金资产净值	2, 798, 816, 058. 73	3, 324, 097, 640. 63
期末基金份额净值	1. 9671	1. 9350
3. 1. 3 累计期末指标	报告期末 (2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	96. 71%	93. 50%

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

万家元贞量化选股股票 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	37. 88%	1. 86%	5. 53%	0. 91%	32. 35%	0. 95%
过去六个月	45. 31%	1. 72%	2. 51%	0. 86%	42. 80%	0. 86%
过去一年	97. 34%	1. 49%	14. 26%	0. 78%	83. 08%	0. 71%
过去三年	89. 40%	1. 50%	24. 36%	0. 87%	65. 04%	0. 63%
自基金合同生效起至今	96. 71%	1. 44%	20. 63%	0. 85%	76. 08%	0. 59%

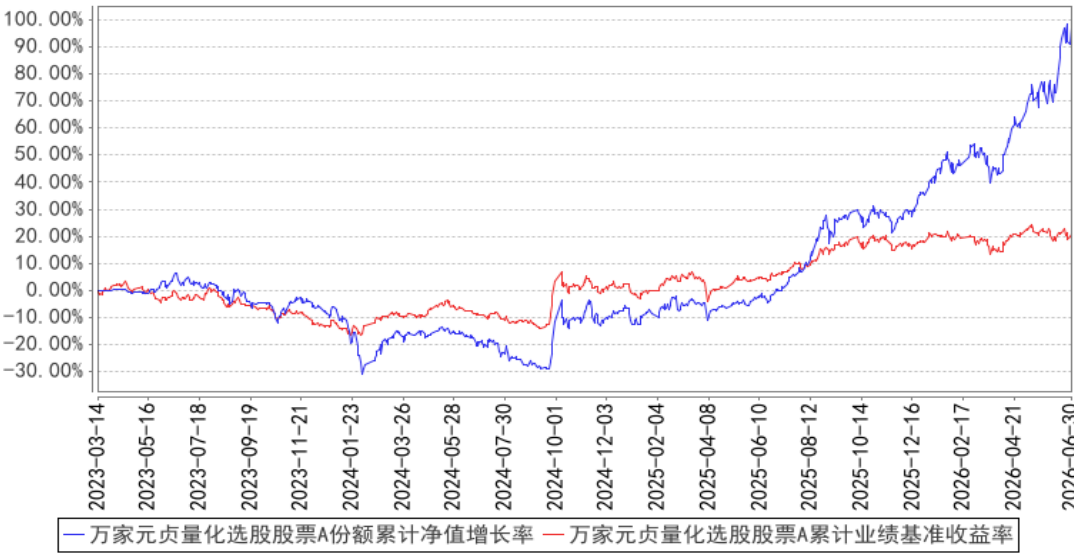
万家元贞量化选股股票 C

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	37. 71%	1. 86%	5. 53%	0. 91%	32. 18%	0. 95%
过去六个月	44. 95%	1. 72%	2. 51%	0. 86%	42. 44%	0. 86%
过去一年	96. 35%	1. 49%	14. 26%	0. 78%	82. 09%	0. 71%

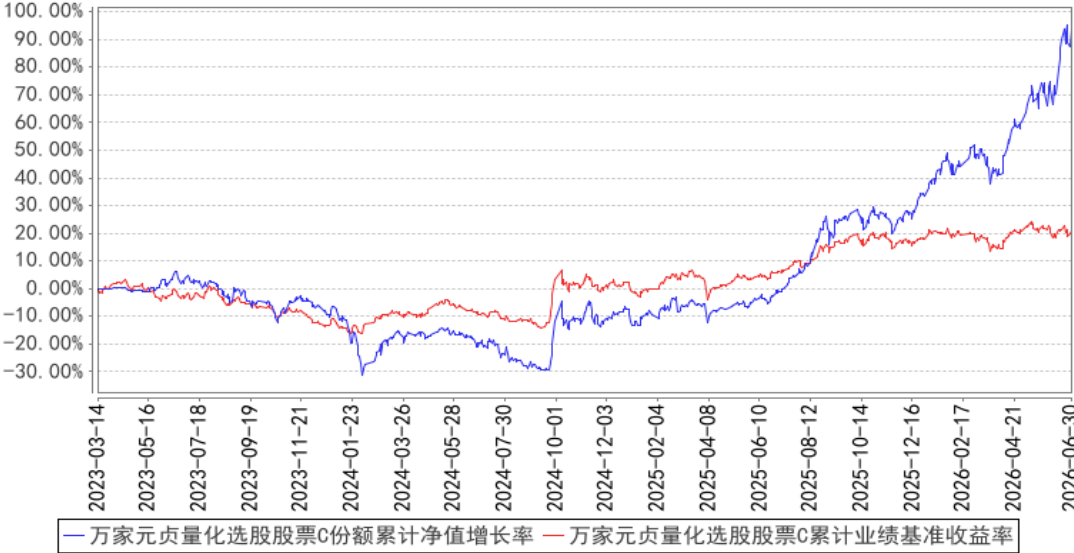
过去三年	86.58%	1.50%	24.36%	0.87%	62.22%	0.63%
自基金合同 生效起至今	93.50%	1.44%	20.63%	0.85%	72.87%	0.59%

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

万家元贞量化选股股票A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



万家元贞量化选股股票C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：本基金于 2023 年 3 月 14 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。

§ 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 楼（名义楼层 9 层）。截至 2026 年 6 月 30 日，公司共管理 208 只开放式基金，其中包括 59 只股票型基金、80 只混合型基金、48 只债券型基金、5 只货币市场基金、4 只 QDII 基金、12 只基金中基金。

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,首席量化投资官;万家上证科创板 100 指数增强型发起式证券投资基金、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家中证 2000 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、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。	2023 年 3 月 14 日	-	19.5 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，现任公司首席量化投资官、基金经理，历任公司总经理助理、量化投资部总监（兼）、副总经理。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。

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。

4.2 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 公平交易制度的执行情况

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》，管理人制定了《公平交易管理办法》和《异常交易监控及报告管理办法》等规章制度，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，确保公平对待不同投资组合，防范导致不公平交易以及利益输送的异常交易发生。

管理人制订了明确的投资授权制度，并建立了统一的投资管理平台，确保不同投资组合获得公平的投资决策机会。实行集中交易制度，对于交易所公开竞价交易，执行交易系统内的公平交易程序；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，原则上按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；对于银行间交易，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。为保证公平交易原则的实现，通过制度规范、流程审批、系统风控参数设置等进行事前控制，通过对投资交易系统的实时监控进行事中控制，通过对异常交易的监控和分析实现事后控制。

4.3.2 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，管理人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 4 次，为量化投资组合或不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本产品为主动量化选股策略，运用量化选股模型和行业配置策略，主动适应不同的市场风格，前瞻性选股，提高选股胜率，以追求能获得长期稳定的超额收益。万家元贞量化在风格上配置相

对均衡，行业配置偏向于行业景气度高的行业。在量化选股方面精选行业内质优个股组合，持股较为分散。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家元贞量化选股股票 A 的基金份额净值为 1.9671 元，本报告期基金份额净值增长率为 45.31%，同期业绩比较基准收益率为 2.51%；截至本报告期末万家元贞量化选股股票 C 的基金份额净值为 1.9350 元，本报告期基金份额净值增长率为 44.95%，同期业绩比较基准收益率为 2.51%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年上半年，A 股市场呈现“科技领涨、指数震荡抬升”的结构分化格局。人工智能产业革命、国产替代加速与全球科技周期共振向上，三重驱动之下，资金深度抱团 AI 相关板块，科技成长走出独立行情；而传统价值板块则持续承压，资金流出与价格下跌并行，市场分化显著。

展望后市，7 月以来 AI 板块杠杆资金快速出清，市场经历大幅调整后估值已回归合理区间，A 股有望逐步企稳回升。从政策层面看，近期决策层对资本市场积极表态，稳定信号明确，维稳资金正有序入场，托底力度增强；从基本面看，二季度 PPI 中枢较一季度显著抬升，价格端改善正向企业盈利传导，上市公司盈利有望进一步上行，为市场走强提供有力支撑；从政策定调看，7 月政治局会议基调积极，强调高度重视经济运行中的困难挑战，要求及时谋划增量政策，加大逆周期调节与扩内需力度，财政与货币表述均较 4 月更为积极—财政端加快支出与债券资金使用进度，推进“两重”“两新”落地，货币端要求适时调整政策工具，降准降息预期升温，且股市表述从“稳信心”升级为“提升韧性信心”，政策呵护力度进一步加码。总体而言，市场调整已较为充分，叠加政策托底与基本面改善的双重支撑，A 股有望企稳回升。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金

融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合基金合同的规定。

4.8 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，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中的财务指标、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进行核查，以上内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：万家元贞量化选股股票型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末	上年度末
-----	-----	-----	------

		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
资 产:			
货币资金	6. 4. 7. 1	962, 341, 720. 48	196, 421, 036. 93
结算备付金		13, 274, 570. 24	2, 184, 281. 82
存出保证金		1, 164, 745. 08	414, 015. 67
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	5, 354, 711, 272. 67	1, 182, 517, 780. 72
其中：股票投资		5, 354, 711, 272. 67	1, 182, 517, 780. 72
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	6. 4. 7. 3	-	-
买入返售金融资产	6. 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		-	123, 778. 33
应收股利		-	-
应收申购款		55, 266, 763. 21	20, 553, 000. 22
递延所得税资产		-	-
其他资产	6. 4. 7. 5	-	-
资产总计		6, 386, 759, 071. 68	1, 402, 213, 893. 69
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6. 4. 7. 3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		157, 405, 940. 56	-
应付赎回款		95, 587, 898. 39	28, 128, 232. 23
应付管理人报酬		5, 376, 629. 51	1, 056, 430. 26
应付托管费		896, 104. 92	176, 071. 73
应付销售服务费		1, 240, 274. 96	204, 411. 89
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	6. 4. 7. 6	3, 338, 523. 98	1, 062, 919. 95

负债合计		263,845,372.32	30,628,066.06
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	3,140,664,945.63	1,021,425,633.81
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	2,982,248,753.73	350,160,193.82
净资产合计		6,122,913,699.36	1,371,585,827.63
负债和净资产总计		6,386,759,071.68	1,402,213,893.69

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 3,140,664,945.63 份，其中万家元贞量化选股股票 A 基金份额净值 1.9671 元，基金份额总额 1,422,823,066.77 份；万家元贞量化选股股票 C 基金份额净值 1.9350 元，基金份额总额 1,717,841,878.86 份。

6.2 利润表

会计主体：万家元贞量化选股股票型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,406,582,001.43	35,892,606.33
1. 利息收入		859,371.09	63,023.63
其中：存款利息收入	6.4.7.10	859,371.09	63,023.63
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）		528,629,544.29	32,952,030.13
其中：股票投资收益	6.4.7.11	510,664,869.68	28,589,319.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	17,964,674.61	4,362,710.81
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	6.4.7.17	866,237,036.71	2,867,609.76

失以“-”号填列)			
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列)	6. 4. 7. 18	10, 856, 049. 34	9, 942. 81
减：二、营业总支出		25, 458, 170. 02	3, 151, 186. 49
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	18, 132, 688. 28	2, 346, 557. 01
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	3, 022, 114. 68	391, 092. 85
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	4, 186, 515. 25	322, 732. 98
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	6. 4. 7. 19	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 20	116, 851. 81	90, 803. 65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列)		1, 381, 123, 831. 41	32, 741, 419. 84
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		1, 381, 123, 831. 41	32, 741, 419. 84
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1, 381, 123, 831. 41	32, 741, 419. 84

6.3 净资产变动表

会计主体：万家元贞量化选股股票型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 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	1, 021, 425, 633. 81	-	350, 160, 193. 82	1, 371, 585, 827. 63
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1, 021, 425, 633. 81	-	350, 160, 193. 82	1, 371, 585, 827. 63

	81			3
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2, 119, 239, 311.82	-	2, 632, 088, 559.91	4, 751, 327, 871.73
(一)、综合收益总额	-	-	1, 381, 123, 831.41	1, 381, 123, 831.41
(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)	2, 119, 239, 311.82	-	1, 250, 964, 728.50	3, 370, 204, 040.32
其中：1. 基金申购款	4, 065, 296, 280.03	-	2, 618, 637, 954.73	6, 683, 934, 234.76
2. 基金赎回款	-1, 946, 056, 968.21	-	-1, 367, 673, 226.23	-3, 313, 730, 194.44
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	3, 140, 664, 945.63	-	2, 982, 248, 753.73	6, 122, 913, 699.36
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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	457, 845, 994. 87	-	-39, 879, 837. 89	417, 966, 156. 98
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	457, 845, 994. 87	-	-39, 879, 837. 89	417, 966, 156. 98
三、本期增减变	-87, 829, 383. 67	-	37, 311, 326. 07	-50, 518, 057. 60

动额(减少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	32,741,419.84	32,741,419.84
(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)	-87,829,383.67	-	4,569,906.23	-83,259,477.44
其中: 1. 基金申购款	9,000,530.06	-	-700,436.61	8,300,093.45
2. 基金赎回款	-96,829,913.73	-	5,270,342.84	-91,559,570.89
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	370,016,611.20	-	-2,568,511.82	367,448,099.38

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

陈广益

莫海波

尹超

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

万家元贞量化选股股票型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]232号文《关于准予万家元贞量化选股股票型证券投资基金注册的批复》的核准,由万家基金管理有限公司作为基金管理人于2023年2月20日至2023年3月10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[2023]第ZA30067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2023年3月14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 1,381,361,850.89 元，有效认购资金在基金验资确认日之前产生的利息为人民币 483,092.16 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,381,844,943.05 元，折合 1,381,844,943.05 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金的主要投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板以及其他中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、股指期货、国债期货、股票期权以及债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、政府支持机构债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。在条件许可的情况下，本基金可根据相关法律法规，在履行适当程序后，参与融券业务和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times$ 60%+恒生指数收益率 $\times$ 20%+中债综合指数收益率 $\times$ 20%。

6.4.2 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》、《公开募集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。

6.4.3 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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 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

本中期报告所采用的会计政策、会计估计与上年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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、城建税、教育费附加及地方教育附加

根据 2026 年 1 月 1 日起施行的《中华人民共和国增值税法》的规定，取得存款利息收入不征收增值税；

根据 2026 年 1 月 1 日起施行的《中华人民共和国增值税法实施条例》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；

根据财政部、国家税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，公募证券投资基金（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、债券取得的收入免征增值税；金融同业往来利息收入免征增值税；资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税

行为可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税；

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	962,341,720.48
等于：本金	962,248,361.88
加：应计利息	93,358.60
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	962,341,720.48

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	4,421,154,361.24	-	5,354,711,272.67	933,556,911.43
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		4,421,154,361.24	-	5,354,711,272.67	933,556,911.43

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8,443.66
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,245,777.76
其中：交易所市场	3,245,777.76
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
合计	3,338,523.98

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

万家元贞量化选股股票 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	428,991,705.99	428,991,705.99
本期申购	1,653,400,668.31	1,653,400,668.31

本期赎回（以“-”号填列）	-659,569,307.53	-659,569,307.53
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	1,422,823,066.77	1,422,823,066.77

万家元贞量化选股股票 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	592,433,927.82	592,433,927.82
本期申购	2,411,895,611.72	2,411,895,611.72
本期赎回（以“-”号填列）	-1,286,487,660.68	-1,286,487,660.68
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	1,717,841,878.86	1,717,841,878.86

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

万家元贞量化选股股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	111,974,365.16	39,772,859.49	151,747,224.65
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	111,974,365.16	39,772,859.49	151,747,224.65
本期利润	228,843,382.63	388,349,737.35	617,193,119.98
本期基金份额交易产生的变动数	359,568,820.64	247,483,826.69	607,052,647.33
其中：基金申购款	615,530,680.91	476,553,451.00	1,092,084,131.91
基金赎回款	-255,961,860.27	-229,069,624.31	-485,031,484.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	700,386,568.43	675,606,423.53	1,375,992,991.96

万家元贞量化选股股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	144,207,712.62	54,205,256.55	198,412,969.17
加：会计政策变更	-	-	-

前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	144,207,712.62	54,205,256.55	198,412,969.17
本期利润	286,043,412.07	477,887,299.36	763,930,711.43
本期基金份额交易产生的变动数	372,525,509.92	271,386,571.25	643,912,081.17
其中：基金申购款	834,010,944.28	692,542,878.54	1,526,553,822.82
基金赎回款	-461,485,434.36	-421,156,307.29	-882,641,741.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	802,776,634.61	803,479,127.16	1,606,255,761.77

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	847,138.71
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	10,840.46
其他	1,391.92
合计	859,371.09

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	510,664,869.68
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	510,664,869.68

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	3,660,679,115.60
减：卖出股票成本总额	3,143,029,818.80
减：交易费用	6,984,427.12
买卖股票差价收入	510,664,869.68

6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	17,964,674.61
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	17,964,674.61

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	866,237,036.71
股票投资	866,237,036.71
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	866,237,036.71

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	10,570,081.76
基金转换费收入	285,967.58
合计	10,856,049.34

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	23,549.25
账户维护费	9,000.00
合计	116,851.81

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司（“万家基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
中泰证券股份有限公司（“中泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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	332,961,472.61	3.29	1,248,041,286.24	37.49

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30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	148,466.08	3.29	65,281.82	2.01
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30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	556,596.83	37.49	483,003.83	60.67

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	18,132,688.28	2,346,557.01
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,116,491.71	1,012,545.76
应支付基金管理人的净管理费	14,016,196.57	1,334,011.25

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,022,114.68	391,092.85

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家元贞量化选股股票 A	万家元贞量化选股股票 C	合计
农业银行	-	1,039,016.98	1,039,016.98
万家财富	-	11.20	11.20
万家基金	-	1,924,410.16	1,924,410.16
中泰证券	-	146,443.60	146,443.60
合计	-	3,109,881.94	3,109,881.94
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家元贞量化选股股票 A	万家元贞量化选股股票 C	合计

农业银行	-	73,173.95	73,173.95
万家基金	-	161.57	161.57
中泰证券	-	25,397.19	25,397.19
合计	-	98,732.71	98,732.71

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.50%。

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

$$H=E\times 0.50\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 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、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 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适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
农业银行	962,341,720.48	847,138.71	24,285,409.39	59,153.80

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

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	58,873	595,206.03	595,206.03	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	25,231	255,085.41	255,085.41	-

001257	盛龙股份	2026年3月24日	6个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026年4月14日	6个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026年5月11日	6个月	新股流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001399	惠科股份	2026年6月16日	6个月	新股流通受限	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
301513	尚水智能	2026年4月10日	6个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026年4月28日	6个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026年4月22日	6个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026年4月8日	6个月	新股流通受限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301669	高特电子	2026年6月2日	6个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026年2月27日	6个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026年3月18日	6个月	新股流通受限	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-

301683	慧谷新材	2026年3月24日	6个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025年12月24日	6个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026年3月31日	6个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026年1月21日	6个月	新股流通受限	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
603284	林平发展	2026年2月3日	6个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026年4月9日	6个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026年1月8日	6个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603407	长裕集团	2026年4月29日	6个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026年5月15日	6个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026年3月31日	6个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026年5月20日	6个月	新股流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-

688712	北芯生命	2026年1月28日	6个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688781	视涯科技	2026年3月18日	9个月	新股流通受限	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-
688785	恒运昌	2026年1月20日	6个月	新股流通受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688795	摩尔线程	2025年11月26日	9个月	新股流通受限	114.28	676.94	2,510	286,842.80	1,699,119.40	-
688797	臻宝科技	2026年6月16日	6个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688802	沐曦股份	2025年12月9日	9个月	新股流通受限	104.66	768.89	1,864	195,086.24	1,433,210.96	-
688808	联讯仪器	2026年4月16日	6个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研复材	2026年4月1日	6个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026年3月24日	6个月	新股流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026年2月4日	6个月	新股流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026年2月3日	6个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-

688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-
--------	------	-----------------	------	--------	-------	--------	-------	-----------	------------	---

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688260	昀冢科技	2026 年 6 月 26 日	异常波动停牌	145.02	2026 年 7 月 1 日	132.00	45,400	2,028,477.62	6,583,908.00	-
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	4,500	2,246,347.93	3,957,885.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 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。

6.4.12.4 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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，建立了四道防线：以各岗位目标责任制为基础，形成第一道防线；合规风控部门通过完善的风险控制制度和手段对各一线部门的风险管理工作进行指导、管理和监督，形成第二道防线；独立的监察稽核部门对公司内部控制制度的总体执行情况

况和有效性进行监督、检查、评估和反馈，形成第三道防线；董事会及其风险管理委员会听取公司管理层对公司整体运营情况的报告，并提出指导性意见，形成第四道防线。

6.4.13.2 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同责任，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%。

本基金的货币资金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 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。(2025 年 12 月 31 日：同)

6.4.13.3 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 6.4.12 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。

6.4.13.3.1 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 6.4.12 “期末（2026 年 6 月 30 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 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	962,341,720.48	-	-	-	-	-	962,341,720.48
结算备付金	13,274,570.24	-	-	-	-	-	13,274,570.24
存出保证金	1,164,745.08	-	-	-	-	-	1,164,745.08
交易性金融资产	-	-	-	-	-	5,354,711,272.67	5,354,711,272.67
应收申购款	62.63	-	-	-	-	55,266,700.58	55,266,763.21
资产总计	976,781,098.43	-	-	-	-	5,409,977,973.25	6,386,759,071.68
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	95,587,898.39	95,587,898.39
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,376,629.51	5,376,629.51
应付托管费	-	-	-	-	-	896,104.92	896,104.92
应付清算款	-	-	-	-	-	157,405,940.	157,405,940.

						0.56	56
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,240,274.96	1,240,274.96
其他负债	-	-	-	-	-	3,338,523.98	3,338,523.98
负债总计	-	-	-	-	-	263,845,372.32	263,845,372.32
利率敏感度缺口	976,781,098.43	-	-	-	-	5,146,132,600.93	6,122,913,699.36
上年度末 2025 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	196,421,036.93	-	-	-	-	-	196,421,036.93
结算备付金	2,184,281.82	-	-	-	-	-	2,184,281.82
存出保证金	414,015.67	-	-	-	-	-	414,015.67
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,182,517,780.72	1,182,517,780.72
应收申购款	185.08	-	-	-	-	20,552,815.14	20,553,000.22
应收清算款	-	-	-	-	-	123,778.33	123,778.33
资产总计	199,019,519.50	-	-	-	-	1,203,194,374.19	1,402,213,893.69
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	28,128,232.23	28,128,232.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,056,430.26	1,056,430.26
应付托管费	-	-	-	-	-	176,071.73	176,071.73
应付销售服务费	-	-	-	-	-	204,411.89	204,411.89
其他负债	-	-	-	-	-	1,062,919.95	1,062,919.95
负债总计	-	-	-	-	-	30,628,066.06	30,628,066.06
利率敏感度缺口	199,019,519.50	-	-	-	-	1,172,566,308.13	1,371,585,827.63

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2025 年 12 月 31 日：同），货币资金、

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（2025 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025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	5,354,711,272.67	87.45	1,182,517,780.72	86.22
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	5,354,711,272.67	87.45	1,182,517,780.72	86.22

6.4.13.4.3.2 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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	股票基准指数上升	86,269,293.06	18,238,323.13

	100 个基点		
	股票基准指数下降 100 个基点	-86, 269, 293. 06	-18, 238, 323. 13

6. 4. 14 公允价值

6. 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。

6. 4. 14. 2 持续的以公允价值计量的金融工具

6. 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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	5, 337, 775, 970. 39	1, 178, 680, 927. 05
第二层次	11, 392, 084. 44	1, 268, 841. 00
第三层次	5, 543, 217. 84	2, 568, 012. 67
合计	5, 354, 711, 272. 67	1, 182, 517, 780. 72

6. 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。

6. 4. 14. 3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6. 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货币资金、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。

6. 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。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	5,354,711,272.67	83.84
	其中：股票	5,354,711,272.67	83.84
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	975,616,290.72	15.28
8	其他各项资产	56,431,508.29	0.88
9	合计	6,386,759,071.68	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	788,205.00	0.01
B	采矿业	153,759,875.96	2.51
C	制造业	4,250,215,572.88	69.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	48,867,354.44	0.80
E	建筑业	57,294,273.57	0.94
F	批发和零售业	117,510,335.50	1.92
G	交通运输、仓储和邮政业	41,472,623.18	0.68
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	318,310,453.18	5.20
J	金融业	335,789,032.44	5.48
K	房地产业	2,879,980.00	0.05
L	租赁和商务服务业	15,122,753.00	0.25
M	科学研究和技术服务业	8,713,069.32	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	2,645,200.20	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	208,014.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	244,660.00	0.00
S	综合	889,870.00	0.01
	合计	5,354,711,272.67	87.45

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688498	源杰科技	45,305	85,445,230.00	1.40
2	300502	新易盛	129,976	78,895,432.00	1.29
3	002384	东山精密	287,500	75,425,625.00	1.23
4	300308	中际旭创	57,700	73,279,000.00	1.20
5	300475	香农芯创	236,300	70,890,000.00	1.16
6	688630	芯碁微装	113,493	62,351,919.27	1.02
7	002837	英维克	752,100	59,837,076.00	0.98
8	688503	聚和材料	447,200	59,343,440.00	0.97
9	688025	杰普特	123,948	58,255,560.00	0.95
10	002353	杰瑞股份	379,807	57,920,567.50	0.95
11	688627	精智达	80,300	57,414,500.00	0.94
12	600105	永鼎股份	834,600	56,318,808.00	0.92
13	001309	德明利	59,100	55,725,390.00	0.91
14	688002	睿创微纳	356,500	55,146,985.00	0.90
15	002916	深南电路	119,518	54,727,292.20	0.89
16	600487	亨通光电	486,605	53,205,390.70	0.87
17	603083	剑桥科技	207,852	52,975,239.24	0.87
18	300394	天孚通信	173,903	52,636,960.04	0.86
19	300223	君正股份	210,320	52,348,648.00	0.85
20	300236	上海新阳	388,200	51,048,300.00	0.83
21	002008	大族激光	338,600	50,827,246.00	0.83
22	688416	恒烁股份	354,399	49,615,860.00	0.81
23	600183	生益科技	276,900	48,014,460.00	0.78
24	301191	菲菱科思	417,458	47,402,355.90	0.77
25	688559	海目星	562,500	47,205,000.00	0.77
26	300476	胜宏科技	134,800	46,698,764.00	0.76
27	002463	沪电股份	303,856	46,429,196.80	0.76
28	300490	华自科技	3,366,700	44,541,441.00	0.73
29	002460	赣锋锂业	668,371	43,711,463.40	0.71
30	000657	中钨高新	455,891	43,637,886.52	0.71
31	688337	普源精电	569,500	42,672,635.00	0.70
32	300842	帝科股份	477,600	42,587,592.00	0.70

33	688525	佰维存储	83,700	41,408,901.00	0.68
34	301377	鼎泰高科	74,941	41,284,996.90	0.67
35	002281	光迅科技	160,511	41,241,696.34	0.67
36	300548	长芯博创	146,500	40,727,000.00	0.67
37	301219	腾远钴业	727,789	39,882,837.20	0.65
38	002080	中材科技	430,400	38,736,000.00	0.63
39	605060	联德股份	675,900	38,350,566.00	0.63
40	601869	长飞光纤	69,400	37,885,460.00	0.62
41	300811	铂科新材	375,940	35,672,946.60	0.58
42	603256	宏和科技	133,200	35,341,956.00	0.58
43	688787	海天瑞声	262,500	35,293,125.00	0.58
44	301086	鸿富瀚	162,500	34,008,000.00	0.56
45	688045	必易微	415,615	33,573,379.70	0.55
46	002028	思源电气	191,358	33,104,934.00	0.54
47	688313	仕佳光子	178,200	32,904,630.00	0.54
48	688531	日联科技	183,800	32,686,992.00	0.53
49	688521	芯原股份	87,400	32,437,636.00	0.53
50	600875	东方电气	1,090,600	31,376,562.00	0.51
51	300442	润泽科技	375,593	31,200,510.51	0.51
52	300620	光库科技	82,305	31,127,751.00	0.51
53	601138	工业富联	430,447	31,056,751.05	0.51
54	002240	盛新锂能	671,585	30,107,155.55	0.49
55	688170	德龙激光	303,358	29,125,401.58	0.48
56	688147	微导纳米	177,800	28,782,264.00	0.47
57	688167	炬光科技	79,131	28,028,991.51	0.46
58	601009	南京银行	2,700,100	26,703,989.00	0.44
59	688766	普冉股份	34,700	26,601,020.00	0.43
60	601872	招商轮船	1,498,900	26,335,673.00	0.43
61	000988	华工科技	137,900	25,457,719.00	0.42
62	300857	协创数据	72,860	24,765,114.00	0.40
63	600549	厦门钨业	288,700	24,597,240.00	0.40
64	688048	长光华芯	48,881	24,538,262.00	0.40
65	600015	华夏银行	3,777,900	24,140,781.00	0.39
66	002805	丰元股份	836,000	23,901,240.00	0.39
67	300042	朗科科技	300,800	22,911,936.00	0.37
68	300480	光力科技	527,700	22,522,236.00	0.37
69	688610	埃科光电	84,109	22,154,310.60	0.36
70	603993	洛阳钼业	1,256,700	22,055,085.00	0.36
71	002414	高德红外	1,615,200	21,417,552.00	0.35
72	301099	雅创电子	222,529	21,251,519.50	0.35
73	600919	江苏银行	1,963,561	21,167,187.58	0.35
74	601963	重庆银行	2,090,000	21,067,200.00	0.34
75	601825	沪农商行	2,806,700	21,022,183.00	0.34

76	300762	上海瀚讯	445,700	20,346,205.00	0.33
77	300153	科泰电源	892,448	20,187,173.76	0.33
78	603799	华友钴业	416,700	20,109,942.00	0.33
79	002466	天齐锂业	310,200	19,021,464.00	0.31
80	000977	浪潮信息	268,500	18,795,000.00	0.31
81	300065	海兰信	837,699	18,689,064.69	0.31
82	688095	福昕软件	314,093	18,666,546.99	0.30
83	301338	凯格精机	114,020	18,572,717.80	0.30
84	300861	美畅股份	735,100	18,517,169.00	0.30
85	301308	江波龙	26,200	18,439,560.00	0.30
86	300395	菲利华	135,288	18,092,064.24	0.30
87	688400	凌云光	273,007	18,073,063.40	0.30
88	688257	新锐股份	175,620	17,895,678.00	0.29
89	301200	大族数控	49,600	17,888,240.00	0.29
90	300604	长川科技	52,200	17,822,124.00	0.29
91	601998	中信银行	2,546,800	17,649,324.00	0.29
92	603124	江南新材	94,000	17,576,120.00	0.29
93	600900	长江电力	652,200	17,263,734.00	0.28
94	601658	邮储银行	3,500,538	17,257,652.34	0.28
95	301150	中一科技	272,340	17,187,377.40	0.28
96	002396	星网锐捷	890,030	17,061,875.10	0.28
97	301085	亚康股份	280,300	16,988,983.00	0.28
98	601088	中国神华	432,300	16,876,992.00	0.28
99	600519	贵州茅台	14,200	16,833,958.00	0.27
100	601229	上海银行	1,938,675	16,827,699.00	0.27
101	601939	建设银行	1,743,300	16,787,979.00	0.27
102	601398	工商银行	2,373,300	16,779,231.00	0.27
103	600803	新奥股份	1,059,900	16,746,420.00	0.27
104	601328	交通银行	2,587,900	16,640,197.00	0.27
105	600028	中国石化	3,716,500	16,575,590.00	0.27
106	601988	中国银行	2,858,900	16,352,908.00	0.27
107	600601	方正科技	1,161,800	16,079,312.00	0.26
108	601857	中国石油	1,850,500	16,062,340.00	0.26
109	601225	陕西煤业	785,200	15,978,820.00	0.26
110	300882	万胜智能	956,440	15,857,775.20	0.26
111	002491	通鼎互联	484,800	15,707,520.00	0.26
112	002851	麦格米特	93,901	15,698,369.18	0.26
113	600036	招商银行	440,700	15,644,850.00	0.26
114	000895	双汇发展	690,300	15,462,720.00	0.25
115	301511	德福科技	106,300	15,291,255.00	0.25
116	603929	亚翔集成	55,700	15,151,514.00	0.25
117	688258	卓易信息	123,600	14,651,544.00	0.24
118	601117	中国化学	1,993,400	14,651,490.00	0.24

119	002297	博云新材	502,700	14,573,273.00	0.24
120	300590	移为通信	989,400	14,197,890.00	0.23
121	601665	齐鲁银行	2,402,700	13,863,579.00	0.23
122	688387	信科移动	692,100	13,731,264.00	0.22
123	000776	广发证券	585,300	13,696,020.00	0.22
124	688519	南亚新材	35,499	13,491,039.96	0.22
125	301002	崧盛股份	343,309	13,251,727.40	0.22
126	300570	太辰光	53,500	13,198,985.00	0.22
127	000603	盛达资源	568,700	13,136,970.00	0.21
128	603444	吉比特	36,400	13,046,488.00	0.21
129	601898	中煤能源	1,039,300	12,658,674.00	0.21
130	301382	蜂助手	273,900	12,599,400.00	0.21
131	002582	好想你	1,479,800	12,504,310.00	0.20
132	002560	通达股份	1,676,920	12,476,284.80	0.20
133	300408	三环集团	74,700	12,467,430.00	0.20
134	688556	高测股份	933,700	12,399,536.00	0.20
135	600926	杭州银行	850,000	12,282,500.00	0.20
136	300975	商络电子	236,600	12,244,050.00	0.20
137	300731	科创新源	206,600	12,057,176.00	0.20
138	301165	锐捷网络	146,520	11,787,534.00	0.19
139	300870	欧陆通	33,360	11,532,218.40	0.19
140	688031	星环科技	98,182	11,308,602.76	0.18
141	603067	振华股份	243,131	11,254,533.99	0.18
142	688256	寒武纪	6,996	11,162,467.80	0.18
143	002518	科士达	207,600	11,125,284.00	0.18
144	002897	意华股份	125,897	11,076,418.06	0.18
145	688388	嘉元科技	247,145	10,874,380.00	0.18
146	301396	宏景科技	32,700	10,843,320.00	0.18
147	688418	震有科技	224,415	10,789,873.20	0.18
148	688668	鼎通科技	28,800	10,751,040.00	0.18
149	601077	渝农商行	1,728,600	10,561,746.00	0.17
150	603019	中科曙光	98,200	10,529,986.00	0.17
151	301205	联特科技	30,600	10,223,460.00	0.17
152	688001	华兴源创	118,700	10,172,590.00	0.17
153	000933	神火股份	466,800	9,896,160.00	0.16
154	002446	盛路通信	915,600	9,833,544.00	0.16
155	688311	盟升电子	374,000	9,795,060.00	0.16
156	600262	北方股份	492,820	9,752,907.80	0.16
157	000426	兴业银锡	294,900	9,719,904.00	0.16
158	301235	华康洁净	128,357	9,628,058.57	0.16
159	301517	陕西华达	190,900	9,474,367.00	0.15
160	300136	信维通信	78,500	9,361,125.00	0.15
161	301217	铜冠铜箔	56,539	9,332,892.73	0.15

162	002796	世嘉科技	225,300	9,187,734.00	0.15
163	600176	中国巨石	122,700	8,942,376.00	0.15
164	600166	福田汽车	3,006,800	8,749,788.00	0.14
165	688676	金盘科技	103,200	8,734,848.00	0.14
166	300491	通合科技	226,600	8,653,854.00	0.14
167	300751	迈为股份	30,600	8,643,276.00	0.14
168	603185	弘元绿能	506,540	8,454,152.60	0.14
169	301169	零点有数	117,400	8,295,484.00	0.14
170	002056	横店东磁	269,800	8,223,504.00	0.13
171	603703	盛洋科技	737,500	8,186,250.00	0.13
172	603115	海星股份	65,400	8,009,538.00	0.13
173	002588	史丹利	998,000	7,884,200.00	0.13
174	300724	捷佳伟创	111,600	7,878,960.00	0.13
175	688261	东微半导	73,152	7,675,839.36	0.13
176	603986	兆易创新	9,400	7,661,000.00	0.13
177	600377	宁沪高速	654,400	7,571,408.00	0.12
178	002497	雅化集团	371,200	7,561,344.00	0.12
179	000960	锡业股份	174,540	7,451,112.60	0.12
180	688307	中润光学	93,140	7,446,543.00	0.12
181	601600	中国铝业	897,600	7,378,272.00	0.12
182	601126	四方股份	115,500	7,299,600.00	0.12
183	002824	和胜股份	210,200	7,268,716.00	0.12
184	688411	海博思创	24,900	7,250,880.00	0.12
185	688143	长盈通	41,117	7,231,657.96	0.12
186	688216	气派科技	170,489	7,162,242.89	0.12
187	600522	中天科技	115,500	7,008,540.00	0.11
188	301487	盟固利	365,900	7,006,985.00	0.11
189	300450	先导智能	171,100	6,967,192.00	0.11
190	603186	华正新材	30,802	6,939,690.60	0.11
191	688378	奥来德	111,300	6,900,600.00	0.11
192	603889	新澳股份	1,349,310	6,894,974.10	0.11
193	600000	浦发银行	798,500	6,875,085.00	0.11
194	600667	太极实业	227,200	6,629,696.00	0.11
195	688328	深科达	69,100	6,612,870.00	0.11
196	688260	昀冢科技	45,400	6,583,908.00	0.11
197	688312	燕麦科技	77,630	6,520,143.70	0.11
198	600710	苏美达	679,100	6,492,196.00	0.11
199	603268	松发股份	45,800	6,379,024.00	0.10
200	300073	当升科技	132,300	6,355,692.00	0.10
201	688322	奥比中光	48,558	6,339,246.90	0.10
202	300499	高澜股份	163,653	6,333,371.10	0.10
203	300017	网宿科技	486,500	6,329,365.00	0.10
204	002792	通宇通讯	176,500	6,278,105.00	0.10

205	688183	生益电子	47,149	6,242,527.60	0.10
206	300567	精测电子	19,600	6,224,960.00	0.10
207	600026	中远海能	339,400	6,088,836.00	0.10
208	000408	藏格矿业	87,662	6,076,729.84	0.10
209	002379	宏桥控股	404,600	5,975,942.00	0.10
210	300263	隆华科技	363,900	5,931,570.00	0.10
211	002246	北化股份	314,400	5,910,720.00	0.10
212	603061	金海通	11,715	5,883,507.30	0.10
213	002738	中矿资源	97,000	5,722,030.00	0.09
214	605305	中际联合	134,900	5,655,008.00	0.09
215	002943	宇晶股份	127,650	5,645,959.50	0.09
216	300745	欣锐科技	133,300	5,627,926.00	0.09
217	300418	昆仑万维	139,300	5,622,148.00	0.09
218	688017	绿的谐波	13,400	5,599,324.00	0.09
219	300048	合康新能	1,187,100	5,543,757.00	0.09
220	003031	中瓷电子	30,400	5,481,120.00	0.09
221	603516	淳中科技	40,500	5,451,705.00	0.09
222	002558	巨人网络	196,000	5,401,760.00	0.09
223	688158	优刻得	146,600	5,389,016.00	0.09
224	600928	西安银行	1,628,400	5,324,868.00	0.09
225	301369	联动科技	21,625	5,298,125.00	0.09
226	688027	国盾量子	10,500	5,292,105.00	0.09
227	603659	璞泰来	182,700	5,285,511.00	0.09
228	688691	灿芯股份	45,136	5,232,616.48	0.09
229	002975	博杰股份	36,410	5,170,220.00	0.08
230	688375	国博电子	48,500	5,058,550.00	0.08
231	601336	新华保险	84,587	5,046,460.42	0.08
232	300438	鹏辉能源	59,200	4,904,720.00	0.08
233	600160	巨化股份	89,600	4,749,696.00	0.08
234	688012	中微公司	9,933	4,653,610.50	0.08
235	600498	烽火通信	62,600	4,607,360.00	0.08
236	300656	民德电子	120,700	4,597,463.00	0.08
237	002284	亚太股份	482,100	4,575,129.00	0.07
238	002115	三维通信	439,100	4,522,730.00	0.07
239	601211	国泰海通	244,100	4,442,620.00	0.07
240	688059	华锐精密	22,200	4,433,562.00	0.07
241	001389	广合科技	18,600	4,412,850.00	0.07
242	002546	新联电子	603,900	4,396,392.00	0.07
243	603688	石英股份	53,000	4,378,330.00	0.07
244	603118	共进股份	361,200	4,374,132.00	0.07
245	688372	伟测科技	23,300	4,333,800.00	0.07
246	603486	科沃斯	85,200	4,323,900.00	0.07
247	002156	通富微电	56,200	4,263,894.00	0.07

248	603969	银龙股份	577,100	4,195,517.00	0.07
249	601390	中国中铁	1,003,400	4,184,178.00	0.07
250	002345	潮宏基	450,100	4,127,417.00	0.07
251	301468	博盈特焊	98,460	4,106,766.60	0.07
252	002155	湖南黄金	167,600	4,000,612.00	0.07
253	301110	青木科技	105,640	3,999,530.40	0.07
254	300769	德方纳米	60,100	3,996,650.00	0.07
255	300756	金马游乐	120,820	3,993,101.00	0.07
256	002202	金风科技	166,500	3,979,350.00	0.06
257	688072	拓荆科技	4,500	3,957,885.00	0.06
258	601899	紫金矿业	156,101	3,924,379.14	0.06
259	688127	蓝特光学	40,000	3,904,000.00	0.06
260	603236	移远通信	74,552	3,814,825.84	0.06
261	300435	中泰股份	140,500	3,803,335.00	0.06
262	300531	优博讯	244,900	3,710,235.00	0.06
263	600685	中船防务	143,000	3,637,920.00	0.06
264	001267	汇绿生态	66,200	3,541,700.00	0.06
265	600589	大位科技	336,200	3,442,688.00	0.06
266	688700	东威科技	38,500	3,441,900.00	0.06
267	601677	明泰铝业	207,000	3,436,200.00	0.06
268	001270	铖昌科技	21,900	3,416,181.00	0.06
269	600502	安徽建工	778,400	3,386,040.00	0.06
270	300895	铜牛信息	64,500	3,356,580.00	0.05
271	688202	美迪西	41,200	3,325,252.00	0.05
272	301018	申菱环境	28,740	3,322,631.40	0.05
273	688041	海光信息	8,900	3,295,670.00	0.05
274	002948	青岛银行	648,100	3,292,348.00	0.05
275	688283	坤恒顺维	98,393	3,257,792.23	0.05
276	300757	罗博特科	5,200	3,218,800.00	0.05
277	300835	龙磁科技	13,900	3,189,911.00	0.05
278	688120	华海清科	9,780	3,150,920.40	0.05
279	688205	德科立	15,100	3,143,669.00	0.05
280	603379	三美股份	40,100	3,043,189.00	0.05
281	603663	三祥新材	31,400	3,023,820.00	0.05
282	688148	芳源股份	345,612	2,965,350.96	0.05
283	603308	应流股份	48,800	2,947,520.00	0.05
284	601877	正泰电器	116,100	2,910,627.00	0.05
285	300619	金银河	93,330	2,903,496.30	0.05
286	603045	福达合金	40,000	2,855,600.00	0.05
287	688636	智明达	78,700	2,851,301.00	0.05
288	002602	世纪华通	202,200	2,851,020.00	0.05
289	601668	中国建筑	655,300	2,844,002.00	0.05
290	002478	常宝股份	459,100	2,837,238.00	0.05

291	600361	创新新材	786,600	2,831,760.00	0.05
292	300700	岱勒新材	132,000	2,808,960.00	0.05
293	688039	当虹科技	74,400	2,776,608.00	0.05
294	002222	福晶科技	29,956	2,764,339.68	0.05
295	603699	纽威股份	54,200	2,726,260.00	0.04
296	688392	骄成超声	12,000	2,726,160.00	0.04
297	300814	中富电路	13,200	2,699,400.00	0.04
298	002487	大金重工	45,600	2,643,432.00	0.04
299	688652	京仪装备	13,200	2,642,244.00	0.04
300	600489	中金黄金	143,000	2,581,150.00	0.04
301	002993	奥海科技	35,830	2,565,786.30	0.04
302	002170	芭田股份	233,500	2,535,810.00	0.04
303	300252	金信诺	145,700	2,513,325.00	0.04
304	600459	贵研铂业	85,200	2,460,576.00	0.04
305	600711	盛屯矿业	220,000	2,413,400.00	0.04
306	301005	超捷股份	21,600	2,409,696.00	0.04
307	002475	立讯精密	34,100	2,400,640.00	0.04
308	300399	天利科技	124,100	2,367,828.00	0.04
309	002237	恒邦股份	161,000	2,365,090.00	0.04
310	688292	浩瀚深度	126,200	2,347,320.00	0.04
311	603979	金诚信	39,500	2,331,685.00	0.04
312	300852	四会富仕	33,400	2,312,616.00	0.04
313	688019	安集科技	6,640	2,254,014.40	0.04
314	688779	五矿新能	273,400	2,217,274.00	0.04
315	688778	厦钨新能	40,200	2,186,880.00	0.04
316	688347	华虹宏力	6,500	2,185,950.00	0.04
317	002709	天赐材料	42,200	2,170,346.00	0.04
318	002545	东方铁塔	133,200	2,160,504.00	0.04
319	000630	铜陵有色	338,800	2,154,768.00	0.04
320	300079	数码视讯	508,300	2,134,860.00	0.03
321	605599	菜百股份	155,500	2,130,350.00	0.03
322	688512	慧智微	133,000	2,124,010.00	0.03
323	688551	科威尔	30,160	2,119,343.20	0.03
324	603678	火炬电子	25,200	2,091,600.00	0.03
325	688365	光云科技	132,293	2,086,260.61	0.03
326	688172	燕东微	24,900	2,083,134.00	0.03
327	688220	翱捷科技	16,700	2,076,144.00	0.03
328	002609	捷顺科技	272,000	2,072,640.00	0.03
329	603296	华勤技术	27,800	2,064,706.00	0.03
330	301128	强瑞技术	13,120	2,045,408.00	0.03
331	688629	华丰科技	10,900	2,043,859.00	0.03
332	601601	中国太保	71,500	2,039,180.00	0.03
333	688097	博众精工	31,800	2,004,990.00	0.03

334	002812	恩捷股份	29,800	1,993,918.00	0.03
335	601577	长沙银行	228,700	1,991,977.00	0.03
336	301326	捷邦科技	14,200	1,979,054.00	0.03
337	000422	湖北宜化	140,800	1,978,240.00	0.03
338	600031	三一重工	113,900	1,968,192.00	0.03
339	600775	南京熊猫	205,000	1,959,800.00	0.03
340	300409	道氏技术	97,800	1,949,154.00	0.03
341	600352	浙江龙盛	160,200	1,940,022.00	0.03
342	000899	赣能股份	198,200	1,914,612.00	0.03
343	688239	航宇科技	31,900	1,908,577.00	0.03
344	300139	晓程科技	52,200	1,907,910.00	0.03
345	600879	航天电子	89,400	1,903,326.00	0.03
346	600497	驰宏锌锗	156,100	1,890,371.00	0.03
347	600988	赤峰黄金	71,500	1,881,880.00	0.03
348	300322	硕贝德	73,100	1,842,120.00	0.03
349	000880	潍柴重机	79,280	1,824,232.80	0.03
350	002768	国恩股份	34,896	1,816,685.76	0.03
351	688456	有研粉材	12,921	1,803,771.60	0.03
352	601717	中创智领	126,700	1,762,397.00	0.03
353	300655	晶瑞电材	81,580	1,747,443.60	0.03
354	300818	耐普矿机	91,850	1,735,965.00	0.03
355	603936	博敏电子	64,500	1,722,795.00	0.03
356	603556	海兴电力	78,100	1,718,200.00	0.03
357	002258	利尔化学	134,500	1,709,495.00	0.03
358	688295	中复神鹰	28,100	1,701,174.00	0.03
359	688795	摩尔线程	2,510	1,699,119.40	0.03
360	600795	国电电力	362,700	1,693,809.00	0.03
361	002484	江海股份	16,100	1,690,500.00	0.03
362	002436	兴森科技	33,100	1,686,445.00	0.03
363	601991	大唐发电	237,600	1,682,208.00	0.03
364	600362	江西铜业	38,600	1,671,380.00	0.03
365	688011	新光光电	23,800	1,662,906.00	0.03
366	000506	招金黄金	140,900	1,651,348.00	0.03
367	603267	鸿远电子	21,300	1,650,324.00	0.03
368	600025	华能水电	185,500	1,649,095.00	0.03
369	301248	杰创智能	19,600	1,645,028.00	0.03
370	301196	唯科科技	12,780	1,602,867.60	0.03
371	688023	安恒信息	43,633	1,602,203.76	0.03
372	688361	中科飞测	3,700	1,591,000.00	0.03
373	300428	立中集团	87,500	1,590,750.00	0.03
374	002912	中新赛克	85,400	1,574,776.00	0.03
375	600961	株冶集团	48,000	1,554,720.00	0.03
376	000807	云铝股份	69,400	1,536,516.00	0.03

377	002271	东方雨虹	129,000	1,531,230.00	0.03
378	600323	瀚蓝环境	55,700	1,529,522.00	0.02
379	688332	中科蓝讯	9,700	1,527,750.00	0.02
380	688682	霍莱沃	39,244	1,526,591.60	0.02
381	000811	冰轮环境	27,000	1,517,940.00	0.02
382	688719	爱科赛博	19,500	1,501,500.00	0.02
383	300846	首都在线	70,400	1,493,184.00	0.02
384	002997	瑞鹄模具	53,400	1,471,704.00	0.02
385	002758	浙农股份	185,200	1,463,080.00	0.02
386	601168	西部矿业	53,800	1,460,132.00	0.02
387	301172	君逸数码	55,900	1,450,605.00	0.02
388	688182	灿勤科技	33,600	1,447,152.00	0.02
389	688802	沐曦股份	1,864	1,433,210.96	0.02
390	688390	固德威	13,200	1,432,332.00	0.02
391	300553	集智股份	23,300	1,430,387.00	0.02
392	688308	欧科亿	7,800	1,418,118.00	0.02
393	600704	物产中大	300,300	1,417,416.00	0.02
394	300693	盛弘股份	28,900	1,408,875.00	0.02
395	600048	保利发展	300,900	1,393,167.00	0.02
396	300662	科锐国际	82,000	1,392,360.00	0.02
397	688535	华海诚科	7,432	1,389,784.00	0.02
398	603032	德新科技	51,200	1,377,280.00	0.02
399	603278	大业股份	126,000	1,369,620.00	0.02
400	002961	瑞达期货	68,600	1,343,188.00	0.02
401	300398	飞凯材料	21,700	1,339,975.00	0.02
402	600595	中孚实业	237,700	1,335,874.00	0.02
403	688516	奥特维	23,158	1,329,037.62	0.02
404	603901	永创智能	121,000	1,315,270.00	0.02
405	300045	华力创通	76,000	1,310,240.00	0.02
406	002611	东方精工	74,000	1,306,840.00	0.02
407	600801	华新建材	83,480	1,302,288.00	0.02
408	002886	沃特股份	46,200	1,297,758.00	0.02
409	603119	浙江荣泰	19,200	1,273,728.00	0.02
410	300634	彩讯股份	65,000	1,272,050.00	0.02
411	688150	莱特光电	18,200	1,248,884.00	0.02
412	601918	新集能源	144,600	1,242,114.00	0.02
413	300432	富临精工	61,700	1,239,553.00	0.02
414	002849	威星智能	72,500	1,226,700.00	0.02
415	000547	航天发展	63,800	1,221,770.00	0.02
416	301095	广立微	10,200	1,204,110.00	0.02
417	002980	华盛昌	10,300	1,200,362.00	0.02
418	601020	华钰矿业	49,900	1,197,101.00	0.02
419	002074	国轩高科	42,900	1,180,179.00	0.02

420	001965	招商公路	126,892	1,162,330.72	0.02
421	688200	华峰测控	2,204	1,157,320.40	0.02
422	688135	利扬芯片	27,300	1,148,784.00	0.02
423	300066	三川智慧	205,100	1,144,458.00	0.02
424	601777	千里科技	137,700	1,123,632.00	0.02
425	000425	徐工机械	136,200	1,101,858.00	0.02
426	601166	兴业银行	66,500	1,101,240.00	0.02
427	301607	富特科技	20,560	1,074,260.00	0.02
428	601058	赛轮轮胎	92,300	1,064,219.00	0.02
429	688081	兴图新科	26,000	1,062,880.00	0.02
430	600389	江山股份	53,800	1,050,176.00	0.02
431	300129	泰胜风能	120,500	1,030,275.00	0.02
432	603129	春风动力	4,000	1,023,200.00	0.02
433	000612	焦作万方	95,900	1,015,581.00	0.02
434	601208	东材科技	14,300	1,012,297.00	0.02
435	688499	利元亨	18,856	990,882.80	0.02
436	300596	利安隆	18,800	986,624.00	0.02
437	300802	矩子科技	42,300	980,514.00	0.02
438	601318	中国平安	20,400	973,896.00	0.02
439	603323	苏农银行	245,600	950,472.00	0.02
440	001203	大中矿业	31,200	934,440.00	0.02
441	300684	中石科技	15,200	927,200.00	0.02
442	002600	领益智造	52,700	913,818.00	0.01
443	603726	朗迪集团	26,600	911,050.00	0.01
444	300520	科大国创	33,800	910,572.00	0.01
445	600392	盛和资源	30,400	905,008.00	0.01
446	688291	金橙子	15,400	900,592.00	0.01
447	000338	潍柴动力	32,900	896,525.00	0.01
448	688320	禾川科技	21,500	891,175.00	0.01
449	600673	东阳光	26,500	889,870.00	0.01
450	000600	建投能源	101,200	885,500.00	0.01
451	601069	西部黄金	40,100	882,200.00	0.01
452	688386	泛亚微透	9,800	880,432.00	0.01
453	603093	南华期货	48,300	876,645.00	0.01
454	300471	厚普股份	101,400	873,054.00	0.01
455	605118	力鼎光电	24,700	861,783.00	0.01
456	603890	春秋电子	30,800	850,696.00	0.01
457	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.01
458	002448	中原内配	66,600	819,180.00	0.01
459	300415	伊之密	40,700	810,337.00	0.01
460	600761	安徽合力	48,900	800,004.00	0.01
461	002157	正邦科技	280,500	788,205.00	0.01
462	300304	云意电气	44,000	785,400.00	0.01

463	301232	飞沃科技	5,080	782,066.00	0.01
464	301176	逸豪新材	11,500	782,000.00	0.01
465	600266	城建发展	199,900	781,609.00	0.01
466	301021	英诺激光	6,400	780,160.00	0.01
467	605389	长龄液压	7,970	765,120.00	0.01
468	300816	艾可蓝	10,300	753,960.00	0.01
469	688229	博睿数据	9,600	736,320.00	0.01
470	605376	博迁新材	2,700	732,510.00	0.01
471	002272	川润股份	29,800	730,994.00	0.01
472	002850	科达利	3,800	719,340.00	0.01
473	002039	黔源电力	38,100	717,042.00	0.01
474	605117	德业股份	6,660	707,158.80	0.01
475	603039	泛微网络	19,140	690,379.80	0.01
476	002483	润邦股份	139,000	686,660.00	0.01
477	301117	佳缘科技	29,180	681,353.00	0.01
478	688225	亚信安全	54,600	678,132.00	0.01
479	605196	华通线缆	25,300	660,330.00	0.01
480	002733	雄韬股份	21,300	659,874.00	0.01
481	601128	常熟银行	112,940	657,310.80	0.01
482	000975	山金国际	38,600	656,200.00	0.01
483	688356	键凯科技	8,300	639,764.00	0.01
484	002532	天山铝业	59,500	638,435.00	0.01
485	600301	华锡有色	10,400	637,728.00	0.01
486	301489	思泉新材	3,840	631,987.20	0.01
487	000923	河钢资源	50,000	620,500.00	0.01
488	300101	振芯科技	38,300	619,311.00	0.01
489	300720	海川智能	6,400	615,680.00	0.01
490	603228	景旺电子	8,500	615,485.00	0.01
491	002624	完美世界	49,500	614,790.00	0.01
492	300765	石药创新	22,500	612,675.00	0.01
493	002636	金安国纪	5,100	611,847.00	0.01
494	002326	永太科技	25,800	610,170.00	0.01
495	600118	中国卫星	7,400	607,170.00	0.01
496	600971	恒源煤电	87,500	603,750.00	0.01
497	000758	中色股份	91,500	601,155.00	0.01
498	600096	云天化	19,400	589,760.00	0.01
499	601186	中国铁建	98,100	583,695.00	0.01
500	002255	海陆重工	59,200	581,344.00	0.01
501	688063	派能科技	10,900	580,643.00	0.01
502	301251	威尔高	10,880	579,686.40	0.01
503	600141	兴发集团	12,300	577,731.00	0.01
504	600330	天通股份	18,700	576,708.00	0.01
505	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.01

506	603527	众源新材	47,000	560,240.00	0.01
507	688207	格灵深瞳	27,200	546,720.00	0.01
508	000925	众合科技	58,200	543,588.00	0.01
509	300772	运达股份	44,000	541,200.00	0.01
510	688433	华曙高科	6,300	539,280.00	0.01
511	601818	光大银行	185,800	536,962.00	0.01
512	688711	宏微科技	11,800	536,310.00	0.01
513	301307	美利信	7,100	534,559.00	0.01
514	600578	京能电力	82,800	534,060.00	0.01
515	600674	川投能源	37,300	528,541.00	0.01
516	600742	富维股份	71,800	519,832.00	0.01
517	300421	力星股份	27,900	516,429.00	0.01
518	301526	国际复材	11,000	513,370.00	0.01
519	688539	高华科技	15,700	500,516.00	0.01
520	301580	爱迪特	7,780	500,487.40	0.01
521	300373	扬杰科技	3,100	487,413.00	0.01
522	300369	绿盟科技	88,600	481,984.00	0.01
523	600989	宝丰能源	23,100	469,623.00	0.01
524	002454	松芝股份	98,220	469,491.60	0.01
525	688699	明微电子	5,700	467,115.00	0.01
526	601360	三六零	53,300	463,177.00	0.01
527	600196	复星医药	20,600	462,882.00	0.01
528	301035	润丰股份	9,940	461,216.00	0.01
529	600089	特变电工	20,100	452,250.00	0.01
530	688733	壹石通	10,800	446,580.00	0.01
531	600885	宏发股份	12,900	444,921.00	0.01
532	601997	贵阳银行	86,700	444,771.00	0.01
533	002534	西子洁能	23,700	439,635.00	0.01
534	600415	小商品城	42,700	433,832.00	0.01
535	002169	智光电气	29,400	430,416.00	0.01
536	603897	长城科技	13,000	421,980.00	0.01
537	603052	可川科技	5,200	421,148.00	0.01
538	301358	湖南裕能	5,500	417,285.00	0.01
539	300711	广哈通信	25,300	414,920.00	0.01
540	300274	阳光电源	2,600	413,452.00	0.01
541	600998	九州通	87,400	409,906.00	0.01
542	600030	中信证券	14,100	405,093.00	0.01
543	000555	神州信息	39,200	403,760.00	0.01
544	688545	兴福电子	3,000	399,180.00	0.01
545	688037	芯源微	900	395,145.00	0.01
546	600546	山煤国际	36,100	394,573.00	0.01
547	301626	苏州天脉	1,000	383,960.00	0.01
548	000938	紫光股份	13,300	383,838.00	0.01

549	300672	国科微	1,300	383,500.00	0.01
550	300283	温州宏丰	18,500	380,175.00	0.01
551	600380	健康元	40,100	377,742.00	0.01
552	300739	明阳电路	10,600	372,484.00	0.01
553	688176	亚虹医药	37,300	370,016.00	0.01
554	605123	派克新材	3,800	368,638.00	0.01
555	688449	联芸科技	4,267	368,284.77	0.01
556	002378	章源钨业	11,000	368,280.00	0.01
557	600153	建发股份	45,500	360,815.00	0.01
558	301600	慧翰股份	3,900	356,460.00	0.01
559	301120	新特电气	21,400	355,882.00	0.01
560	688077	大地熊	13,300	352,317.00	0.01
561	688206	概伦电子	7,700	341,649.00	0.01
562	688008	澜起科技	1,100	340,890.00	0.01
563	688084	晶品特装	6,748	339,289.44	0.01
564	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.01
565	300014	亿纬锂能	5,200	338,156.00	0.01
566	600547	山东黄金	14,600	337,114.00	0.01
567	300497	富祥股份	15,100	334,616.00	0.01
568	300563	神宇股份	11,500	326,485.00	0.01
569	000708	中信特钢	25,800	325,596.00	0.01
570	688210	统联精密	7,900	320,029.00	0.01
571	300035	中科电气	21,700	312,914.00	0.01
572	300593	新雷能	10,100	303,606.00	0.00
573	688088	虹软科技	8,500	302,175.00	0.00
574	688233	神工股份	1,400	300,188.00	0.00
575	600064	南京高科	42,100	300,173.00	0.00
576	603681	永冠新材	13,100	299,335.00	0.00
577	600295	鄂尔多斯	27,900	299,088.00	0.00
578	603496	恒为科技	12,900	296,442.00	0.00
579	688181	八亿时空	4,700	294,220.00	0.00
580	300496	中科创达	4,700	290,413.00	0.00
581	300726	宏达电子	3,400	287,538.00	0.00
582	002708	光洋股份	21,700	286,223.00	0.00
583	688349	三一重能	18,628	282,773.04	0.00
584	300945	曼卡龙	25,500	276,165.00	0.00
585	003035	南网能源	47,126	274,273.32	0.00
586	301215	中汽股份	52,000	269,880.00	0.00
587	301282	金禄电子	9,140	269,538.60	0.00
588	300007	汉威科技	7,000	267,400.00	0.00
589	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.00
590	600511	国药股份	10,200	265,608.00	0.00
591	000803	山高环能	39,140	265,369.20	0.00

592	600066	宇通客车	9,800	262,738.00	0.00
593	300200	高盟新材	22,600	259,674.00	0.00
594	688080	映翰通	5,977	258,505.25	0.00
595	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.00
596	301182	凯旺科技	2,500	258,175.00	0.00
597	603386	骏亚科技	12,900	254,517.00	0.00
598	000534	万泽股份	9,200	251,712.00	0.00
599	002206	海利得	47,800	247,126.00	0.00
600	300606	金太阳	5,800	246,848.00	0.00
601	600325	华发股份	105,800	244,398.00	0.00
602	300790	宇瞳光学	9,120	238,123.20	0.00
603	300207	欣旺达	12,500	237,375.00	0.00
604	600853	龙建股份	77,500	235,600.00	0.00
605	688720	艾森股份	2,320	234,320.00	0.00
606	688577	浙海德曼	5,060	231,899.80	0.00
607	601628	中国人寿	6,500	229,775.00	0.00
608	688125	安达智能	1,400	228,900.00	0.00
609	002706	良信股份	20,800	226,928.00	0.00
610	002668	TCL 智家	20,200	223,816.00	0.00
611	002612	朗姿股份	19,600	219,716.00	0.00
612	600908	无锡银行	43,000	218,440.00	0.00
613	300748	金力永磁	7,000	215,950.00	0.00
614	603999	读者传媒	43,100	215,500.00	0.00
615	688335	复洁科技	8,848	212,705.92	0.00
616	301153	中科江南	13,000	211,770.00	0.00
617	300184	力源信息	12,000	210,600.00	0.00
618	300244	迪安诊断	11,100	208,014.00	0.00
619	688199	久日新材	6,000	207,180.00	0.00
620	600482	中国动力	6,300	206,640.00	0.00
621	301366	一博科技	3,300	201,861.00	0.00
622	603626	科森科技	10,900	201,650.00	0.00
623	688678	福立旺	8,257	199,571.69	0.00
624	300810	中科海讯	7,800	197,964.00	0.00
625	688353	华盛锂电	1,700	197,319.00	0.00
626	002340	格林美	29,700	196,317.00	0.00
627	001287	中电港	6,300	196,245.00	0.00
628	002320	海峡股份	30,800	193,116.00	0.00
629	000751	锌业股份	31,300	191,556.00	0.00
630	688108	赛诺医疗	10,300	190,859.00	0.00
631	002324	普利特	15,700	189,499.00	0.00
632	002911	佛燃能源	19,900	188,851.00	0.00
633	600111	北方稀土	3,900	187,395.00	0.00
634	603920	世运电路	3,900	187,356.00	0.00

635	688010	福光股份	3,800	184,794.00	0.00
636	688062	迈威生物	6,500	183,625.00	0.00
637	301101	明月镜片	6,700	182,508.00	0.00
638	300389	艾比森	14,100	180,762.00	0.00
639	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.00
640	002004	华邦健康	45,700	179,601.00	0.00
641	300257	开山股份	6,200	177,816.00	0.00
642	688208	道通科技	7,000	176,330.00	0.00
643	688102	斯瑞新材	3,700	174,566.00	0.00
644	300416	苏试试验	8,400	171,192.00	0.00
645	002829	星网宇达	9,600	168,576.00	0.00
646	000688	国城矿业	4,900	167,727.00	0.00
647	603085	天成自控	15,300	166,311.00	0.00
648	301066	万事利	14,300	166,023.00	0.00
649	000825	太钢不锈	48,100	164,021.00	0.00
650	688591	泰凌微	4,700	161,586.00	0.00
651	603966	法兰泰克	19,796	161,337.40	0.00
652	002578	闽发铝业	49,900	157,185.00	0.00
653	688702	盛科通信	400	155,996.00	0.00
654	603928	兴业股份	10,230	151,404.00	0.00
655	601995	中金公司	4,100	148,215.00	0.00
656	300170	汉得信息	9,700	147,828.00	0.00
657	002177	御银股份	25,900	146,594.00	0.00
658	688191	智洋创新	4,080	145,656.00	0.00
659	301257	普蕊斯	3,200	145,216.00	0.00
660	002863	今飞凯达	33,700	142,888.00	0.00
661	603817	海峡环保	27,900	142,569.00	0.00
662	000530	冰山冷热	27,000	139,860.00	0.00
663	301060	兰卫医学	17,000	138,890.00	0.00
664	603031	安孚科技	2,600	138,450.00	0.00
665	300747	锐科激光	2,600	138,034.00	0.00
666	300299	富春股份	27,800	136,220.00	0.00
667	301093	华兰股份	1,000	135,630.00	0.00
668	000969	安泰科技	5,500	134,970.00	0.00
669	002465	海格通信	10,300	131,531.00	0.00
670	600027	华电国际	29,500	131,275.00	0.00
671	002142	宁波银行	4,400	130,636.00	0.00
672	002839	张家港行	33,400	130,260.00	0.00
673	300446	航天智造	7,700	129,591.00	0.00
674	002151	北斗星通	4,000	127,000.00	0.00
675	301132	满坤科技	2,400	126,048.00	0.00
676	600282	南钢股份	27,200	124,848.00	0.00
677	000565	渝三峡 A	21,800	123,824.00	0.00

678	603090	宏盛股份	2,400	122,544.00	0.00
679	603712	七一二	9,500	122,455.00	0.00
680	688330	宏力达	3,600	121,788.00	0.00
681	300191	潜能恒信	4,400	121,660.00	0.00
682	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.00
683	688223	晶科能源	25,300	120,175.00	0.00
684	000031	大悦城	56,600	119,992.00	0.00
685	603766	隆鑫通用	10,000	119,300.00	0.00
686	688530	欧莱新材	1,200	116,280.00	0.00
687	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
688	301319	唯特偶	680	113,784.40	0.00
689	603126	中材节能	17,800	112,140.00	0.00
690	002405	四维图新	17,300	111,931.00	0.00
691	002906	华阳集团	4,300	107,328.00	0.00
692	002236	大华股份	6,400	105,536.00	0.00
693	002440	闰土股份	10,200	104,550.00	0.00
694	600410	华胜天成	6,500	102,895.00	0.00
695	002189	中光学	4,600	102,856.00	0.00
696	300602	飞荣达	2,000	102,400.00	0.00
697	002430	杭氧股份	3,200	99,072.00	0.00
698	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
699	688480	赛恩斯	1,100	96,349.00	0.00
700	688583	思看科技	1,120	96,062.40	0.00
701	600057	厦门象屿	17,300	93,766.00	0.00
702	001301	尚太科技	1,000	93,510.00	0.00
703	300196	长海股份	3,000	88,710.00	0.00
704	002335	科华数据	2,085	88,508.25	0.00
705	300206	理邦仪器	7,200	88,056.00	0.00
706	688767	博拓生物	2,700	87,777.00	0.00
707	688082	盛美上海	200	86,400.00	0.00
708	688455	科捷智能	4,600	85,836.00	0.00
709	300667	必创科技	5,000	85,250.00	0.00
710	688580	伟思医疗	1,600	85,232.00	0.00
711	300455	航天智装	3,900	84,006.00	0.00
712	688709	成都华微	2,200	83,798.00	0.00
713	688439	振华风光	1,800	83,160.00	0.00
714	600458	时代新材	5,000	82,750.00	0.00
715	603977	国泰集团	5,000	82,550.00	0.00
716	600592	龙溪股份	5,700	80,712.00	0.00
717	603876	鼎胜新材	3,100	80,631.00	0.00
718	300378	鼎捷数智	2,200	79,420.00	0.00
719	002474	榕基软件	13,900	79,230.00	0.00
720	300750	宁德时代	200	78,602.00	0.00

721	003029	吉大正元	4,700	75,294.00	0.00
722	601100	恒立液压	700	75,292.00	0.00
723	300666	江丰电子	200	73,720.00	0.00
724	688195	腾景科技	380	73,180.40	0.00
725	688091	上海谊众	1,800	72,360.00	0.00
726	300333	兆日科技	8,400	71,064.00	0.00
727	000932	华菱钢铁	20,400	70,788.00	0.00
728	300353	东土科技	3,300	68,574.00	0.00
729	002756	永兴材料	1,200	67,968.00	0.00
730	300033	同花顺	280	67,480.00	0.00
731	300328	宜安科技	4,800	67,392.00	0.00
732	300913	兆龙互连	1,400	67,074.00	0.00
733	603998	方盛制药	7,400	66,822.00	0.00
734	002683	广东宏大	2,200	64,438.00	0.00
735	000701	厦门信达	14,200	62,906.00	0.00
736	688428	诺诚健华	2,200	62,634.00	0.00
737	600406	国电南瑞	2,700	61,695.00	0.00
738	000411	英特集团	6,800	61,404.00	0.00
739	300964	本川智能	687	59,198.79	0.00
740	603859	能科科技	1,200	57,576.00	0.00
741	603713	密尔克卫	800	56,936.00	0.00
742	300278	华昌达	14,000	54,320.00	0.00
743	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
744	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
745	603105	芯能科技	7,800	53,118.00	0.00
746	002050	三花智控	1,200	52,596.00	0.00
747	688153	唯捷创芯	1,600	51,392.00	0.00
748	600210	紫江企业	7,900	48,980.00	0.00
749	600233	圆通速递	3,100	48,825.00	0.00
750	002195	岩山科技	7,200	47,088.00	0.00
751	001227	兰州银行	23,200	46,400.00	0.00
752	002795	永和智控	6,900	46,161.00	0.00
753	600938	中国海油	1,700	46,155.00	0.00
754	300626	华瑞股份	1,300	45,344.00	0.00
755	300695	兆丰股份	900	44,811.00	0.00
756	002298	中电鑫龙	5,800	44,196.00	0.00
757	601169	北京银行	9,000	44,100.00	0.00
758	002318	久立特材	1,800	43,020.00	0.00
759	002811	郑中设计	3,800	42,522.00	0.00
760	300456	赛微电子	1,000	42,470.00	0.00
761	603949	雪龙集团	2,400	42,048.00	0.00
762	688333	铂力特	400	40,960.00	0.00
763	000036	华联控股	9,300	40,641.00	0.00

764	000572	海马汽车	10,900	40,330.00	0.00
765	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
766	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
767	000421	南京公用	7,900	39,184.00	0.00
768	002203	海亮股份	1,700	38,845.00	0.00
769	688179	阿拉丁	1,400	38,794.00	0.00
770	301201	诚达药业	1,000	36,360.00	0.00
771	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
772	301611	珂玛科技	200	36,014.00	0.00
773	002049	紫光国微	400	35,500.00	0.00
774	301031	中熔电气	292	34,879.40	0.00
775	300062	中能电气	6,200	34,782.00	0.00
776	300397	天和防务	2,200	33,308.00	0.00
777	000063	中兴通讯	900	32,571.00	0.00
778	300611	美力科技	1,400	31,738.00	0.00
779	300681	英搏尔	1,100	31,482.00	0.00
780	000791	甘肃能源	4,000	30,400.00	0.00
781	688070	纵横股份	800	29,864.00	0.00
782	300654	世纪天鸿	3,000	29,160.00	0.00
783	688049	炬芯科技	600	28,146.00	0.00
784	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
785	301316	慧博云通	700	27,566.00	0.00
786	603040	新坐标	435	27,435.45	0.00
787	002415	海康威视	800	27,360.00	0.00
788	688472	阿特斯	2,500	27,050.00	0.00
789	300433	蓝思科技	500	26,830.00	0.00
790	300803	指南针	290	26,584.30	0.00
791	688309	恒誉科技	400	24,352.00	0.00
792	301137	哈焊华通	700	24,052.00	0.00
793	000400	许继电气	1,100	23,870.00	0.00
794	300061	旗天科技	3,400	23,766.00	0.00
795	688321	微芯生物	900	23,697.00	0.00
796	300652	雷迪克	700	23,457.00	0.00
797	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
798	300911	亿田智能	1,000	21,250.00	0.00
799	600050	中国联通	5,300	21,200.00	0.00
800	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
801	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
802	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
803	600741	华域汽车	1,000	15,520.00	0.00
804	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
805	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
806	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00

807	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
808	601111	中国国航	2,300	13,915.00	0.00
809	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
810	600886	国投电力	1,000	13,310.00	0.00
811	688626	翔宇医疗	300	13,278.00	0.00
812	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
813	001369	双欣材料	897	12,127.44	0.00
814	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
815	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
816	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
817	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
818	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
819	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
820	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
821	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
822	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
823	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	300394	天孚通信	76,382,574.35	5.57
2	002837	英维克	68,277,983.50	4.98
3	600105	永鼎股份	68,173,496.00	4.97
4	002384	东山精密	67,927,817.91	4.95
5	300475	香农芯创	62,423,788.00	4.55
6	002353	杰瑞股份	62,234,291.44	4.54
7	300548	长芯博创	61,705,034.00	4.50
8	300308	中际旭创	61,600,868.00	4.49
9	300502	新易盛	59,927,763.80	4.37
10	300490	华自科技	58,175,482.00	4.24
11	600183	生益科技	57,749,980.00	4.21
12	603083	剑桥科技	55,988,888.00	4.08
13	002460	赣锋锂业	54,247,530.73	3.96
14	688002	睿创微纳	54,037,929.05	3.94
15	688498	源杰科技	53,347,455.42	3.89
16	002916	深南电路	50,001,419.84	3.65
17	002028	思源电气	48,881,578.86	3.56
18	688503	聚和材料	47,515,981.92	3.46
19	688630	芯碁微装	47,253,037.51	3.45
20	688627	精智达	46,076,112.75	3.36
21	301191	菲菱科思	44,944,644.13	3.28
22	600487	亨通光电	44,727,041.50	3.26

23	688416	恒烁股份	44,177,617.39	3.22
24	300476	胜宏科技	43,586,931.00	3.18
25	688025	杰普特	43,159,416.36	3.15
26	688559	海目星	43,136,861.75	3.15
27	301377	鼎泰高科	42,856,834.06	3.12
28	002463	沪电股份	42,394,471.90	3.09
29	300842	帝科股份	41,345,763.00	3.01
30	300236	上海新阳	41,152,810.00	3.00
31	688337	普源精电	40,754,090.36	2.97
32	601869	长飞光纤	40,195,200.84	2.93
33	688787	海天瑞声	39,284,226.56	2.86
34	600875	东方电气	38,688,327.00	2.82
35	600601	方正科技	37,760,067.00	2.75
36	001309	德明利	37,654,883.00	2.75
37	688313	仕佳光子	37,638,530.76	2.74
38	300223	君正股份	37,051,068.00	2.70
39	300442	润泽科技	36,958,792.66	2.69
40	002008	大族激光	36,392,230.00	2.65
41	002281	光迅科技	36,258,582.67	2.64
42	300811	铂科新材	35,438,822.20	2.58
43	605060	联德股份	35,400,449.00	2.58
44	002240	盛新锂能	35,306,449.15	2.57
45	301219	腾远钴业	35,187,791.32	2.57
46	688045	必易微	35,002,919.83	2.55
47	601009	南京银行	32,711,845.00	2.38
48	300042	朗科科技	32,483,345.00	2.37
49	601658	邮储银行	32,176,936.90	2.35
50	688170	德龙激光	32,163,709.06	2.35
51	000988	华工科技	32,100,178.82	2.34
52	000657	中钨高新	32,011,793.76	2.33
53	600015	华夏银行	30,821,336.00	2.25
54	601138	工业富联	29,823,283.00	2.17
55	688525	佰维存储	29,784,334.34	2.17
56	301308	江波龙	29,558,673.96	2.16
57	600919	江苏银行	29,363,438.13	2.14
58	601939	建设银行	29,248,869.00	2.13
59	301099	雅创电子	29,214,548.66	2.13
60	601825	沪农商行	29,059,673.00	2.12
61	688147	微导纳米	29,036,441.93	2.12
62	603256	宏和科技	28,644,324.00	2.09
63	300620	光库科技	27,840,861.05	2.03
64	600900	长江电力	27,703,827.00	2.02
65	601872	招商轮船	27,578,856.60	2.01

66	000426	兴业银锡	27,518,547.00	2.01
67	002080	中材科技	27,474,344.00	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。

7.4.2 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	600183	生益科技	81,279,982.16	5.93
2	300394	天孚通信	55,431,453.00	4.04
3	688498	源杰科技	44,647,371.23	3.26
4	301377	鼎泰高科	44,503,348.00	3.24
5	600105	永鼎股份	43,452,135.00	3.17
6	300548	长芯博创	41,564,976.99	3.03
7	603083	剑桥科技	40,200,510.33	2.93
8	603186	华正新材	39,014,935.00	2.84
9	300308	中际旭创	38,426,819.00	2.80
10	002384	东山精密	38,037,054.00	2.77
11	688183	生益电子	34,834,792.62	2.54
12	300502	新易盛	34,404,476.00	2.51
13	001309	德明利	34,041,212.00	2.48
14	688313	仕佳光子	33,670,835.01	2.45
15	002281	光迅科技	32,652,495.20	2.38
16	002916	深南电路	32,637,877.00	2.38
17	300475	香农芯创	32,510,178.93	2.37
18	301308	江波龙	31,449,342.33	2.29
19	300975	商络电子	31,083,649.00	2.27
20	600601	方正科技	28,769,566.80	2.10
21	300042	朗科科技	28,698,514.00	2.09
22	002463	沪电股份	28,375,595.00	2.07

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。

7.4.3 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	6,448,986,274.04
卖出股票收入（成交）总额	3,660,679,115.60

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。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金将按照风险管理的原则，同时基于谨慎原则，以套期保值为主要目的，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。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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

7.12.3 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	1,164,745.08
2	应收清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	55,266,763.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	56,431,508.29

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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 (%)
万家元贞 量化选股 股票 A	15,396	92,415.11	849,280,041.34	59.69	573,543,025.43	40.31
万家元贞 量化选股 股票 C	229,105	7,498.05	1,123,633,578.44	65.41	594,208,300.42	34.59
合计	243,844	12,879.81	1,972,913,619.78	62.82	1,167,751,325.85	37.18

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）。

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	97.27

8.3 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	万家元贞量化选股股票 A	543,644.95	0.0382
	万家元贞量化选股股票 C	58,280.04	0.0034
	合计	601,924.99	0.0192

8.4 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	万家元贞量化选股股票 A	50~100
	万家元贞量化选股股票 C	0~10
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	万家元贞量化选股股票 A	50~100
	万家元贞量化选股股票 C	0
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家元贞量化选股股票 A	万家元贞量化选股股票 C
基金合同生效日 （2023 年 3 月 14 日） 基金份额总额	975,168,554.59	406,676,388.46
本报告期期初基金份额总额	428,991,705.99	592,433,927.82
本报告期基金总申购份额	1,653,400,668.31	2,411,895,611.72
减：本报告期基金总赎回份额	659,569,307.53	1,286,487,660.68
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,422,823,066.77	1,717,841,878.86

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

自 2026 年 4 月 16 日起，陈广益先生担任公司董事长，方一天先生不再担任公司董事长；莫海波先生担任公司总经理，陈广益先生不再担任公司总经理；

自 2026 年 5 月 25 日起，王焱女士担任公司首席信息官，陈广益先生不再担任公司首席信息官。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 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。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 (%)	
中信建投	1	2,287,867,568.60	22.64	1,020,177.31	22.64	-
华泰证券	2	1,662,251,454.72	16.45	741,205.12	16.45	-
国海证券	2	1,607,315,572.82	15.91	716,710.63	15.91	-
申万宏源证券	3	1,276,921,836.61	12.64	569,491.15	12.64	-
国联民生证券	2	1,040,977,021.95	10.30	464,173.93	10.30	-
广发证券	1	975,497,476.65	9.65	434,982.83	9.65	-
国泰海通证券	1	559,405,557.72	5.54	249,445.30	5.54	-
中泰证券	2	332,961,472.61	3.29	148,466.08	3.29	-
天风证券	1	192,586,817.58	1.91	85,877.75	1.91	-
民生证券	1	169,637,381.24	1.68	75,641.23	1.68	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
金融街证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
甬兴证券	1	-	-	-	-	-

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准

为加强证券投资基金交易费用管理，管理人特制定《证券投资基金交易费用管理办法》。依据该办法，管理人设立合作证券公司备选库，并按照业务类型进行分类管理。备选库具体分为被动股票型基金合作证券公司备选库和其他类型基金合作证券公司备选库。纳入备选库内的证券经营机构方可参与管理人基金产品的证券交易服务。

选择证券公司参与证券交易的标准如下：

- (1)财务状况稳健：证券公司应具备良好的财务状况，经营行为符合相关法律法规及行业规范；
- (2)内控与风控能力强：证券公司合规管理和风险控制能力较强；
- (3)技术支持完善：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求；
- (4)专业能力与服务水平：具有较强的研究能力及金融服务水平，或在交易服务、券商结算等业务方面具备较强能力。

2、选择证券公司参与证券交易的程序

- (1)管理人从财务状况、研究服务能力、风险管理能力、合规管理能力、交易服务水平、交易信息技术能力等方面对证券公司进行评估考察，经内部审批完成后，最终确定入选合作证券公司的备选库。
- (2)与入选备选库证券公司达成合作意向后，双方签订协议，明确双方的权利义务，包括服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式等。

3、基金专用交易席位的变更情况：

本报告期内，本基金新增国联民生证券交易单元 2 个、减少诚通证券交易单元 1 个。

10.7.2 基金租用或者通过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。

10.8 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基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	指定媒介	2026 年 1 月 21 日
2	万家元贞量化选股股票型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	指定媒介	2026 年 1 月 21 日
3	万家基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	指定媒介	2026 年 3 月 30 日
4	万家元贞量化选股股票型证券投资基金 2025 年年度报告	指定媒介	2026 年 3 月 30 日
5	万家基金管理有限公司关于董事长、高级管理人员变更的公告	指定媒介	2026 年 4 月 17 日
6	万家基金管理有限公司关于旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	指定媒介	2026 年 4 月 21 日
7	万家元贞量化选股股票型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	指定媒介	2026 年 4 月 21 日
8	万家基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	指定媒介	2026 年 5 月 27 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	20260101-20260301、20260327-20260331	306,446,365.77	38,315,861.32	535,048.82	344,227,178.27	10.96
产品特有风险							
报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。 未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

§ 12 备查文件目录

12.1 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、《万家元贞量化选股股票型证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家元贞量化选股股票型证券投资基金托管协议》。
- 4、万家元贞量化选股股票型证券投资基金 2026 年中期报告原文。
- 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。

12.2 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。

12.3 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

2026 年 8 月 29 日