

万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金

2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	24
§ 8 投资组合报告	57

8.1 期末基金资产组合情况	57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	57
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	96
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	97
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	97
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	97
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	97
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	97
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	97
8.12 投资组合报告附注	97
§ 9 基金份额持有人信息	98
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	98
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	99
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	99
§ 10 开放式基金份额变动	99
§ 11 重大事件揭示	100
11.1 基金份额持有人大会决议	100
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	100
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	100
11.4 基金投资策略的改变	100
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	100
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	100
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	100
11.8 其他重大事件	102
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	104
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	104
§ 13 备查文件目录	105
13.1 备查文件目录	105
13.2 存放地点	105
13.3 查阅方式	105

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	万家量化睿选	
基金主代码	004641	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 8 月 4 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,092,634,655.13 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	万家量化睿选 A	万家量化睿选 C
下属分级基金的交易代码	004641	016556
报告期末下属分级基金的份额总额	718,548,095.47 份	374,086,559.66 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在坚持风险收益合理定价的理念基础上，利用行业内领先的机器学习算法，并引入多维度数据，建立有效因子组合，在合理控制风险的基础上，寻求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、股票资产的量化投资策略（对于存托凭证的投资，本基金将根据投资目标，依照境内上市交易的股票投资策略执行，并最大限度避免由于存托凭证在交易规则、上市公司治理结构等方面的差异而或有的负面影响。）；2、债券资产投资策略；3、中小企业私募债券投资策略；4、股指期货投资策略；5、国债期货投资策略；6、股票期权投资策略；7、权证投资策略；8、融资交易策略。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*90%+一年期银行定期存款收益率（税后）*10%
风险收益特征	本基金是混合型基金，风险高于货币市场基金和债券型基金，属于较高风险、较高预期收益的证券投资基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	万家基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王小飞
	联系电话	021-60637103
	电子邮箱	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	4008880800	021-60637228
传真	021-38909627	021-60635778
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	北京市西城区金融大街 25 号

办公地址	中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200122	100033
法定代表人	方一天	田国立

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市南京东路 61 号 4 楼新黄浦金融大厦
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年	2022 年 8 月 25 日 -2022 年 12 月 31 日	2021 年	2020 年
	万家量化睿选 A	万家量化睿选 C	万家量化睿选 A	万家量化睿选 A
本期已实现收益	-55,638,951.56	-26,239,841.74	1,490,748.52	8,836,289.70
本期利润	-66,305,051.99	-32,357,498.33	-273,090.44	6,481,557.28
加权平均基金份额本期利润	-0.3242	-0.1463	-0.0197	0.2130
本期加权平均净值利润率	-23.59%	-10.75%	-1.40%	17.99%
本期基金份额净值增长率	-7.89%	-11.32%	-1.59%	30.62%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	226,196,030.35	116,839,738.50	5,089,454.40	7,818,320.34
期末可供分配基金份额利润	0.3148	0.3123	0.4275	0.4505
期末基金资产净值	944,744,125.82	490,926,298.16	16,993,294.44	25,173,793.76
期末基金份额净值	1.3148	1.3123	1.4275	1.4505
3.1.3 累计期	2022 年末		2021 年末	2020 年末

末指标				
基金份额累计净值增长率	31.48%	-11.32%	42.75%	45.05%

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）。

4、自 2022 年 8 月 25 日起，增设本基金 C 类份额，详情请参阅相关公告。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家量化睿选 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.84%	1.21%	2.43%	0.92%	-3.27%	0.29%
过去六个月	-8.91%	1.25%	-8.13%	0.99%	-0.78%	0.26%
过去一年	-7.89%	1.41%	-18.19%	1.24%	10.30%	0.17%
过去三年	18.40%	1.45%	11.31%	1.21%	7.09%	0.24%
过去五年	26.98%	1.39%	3.84%	1.10%	23.14%	0.29%
自基金合同生效起至今	31.48%	1.35%	7.21%	1.07%	24.27%	0.28%

万家量化睿选 C

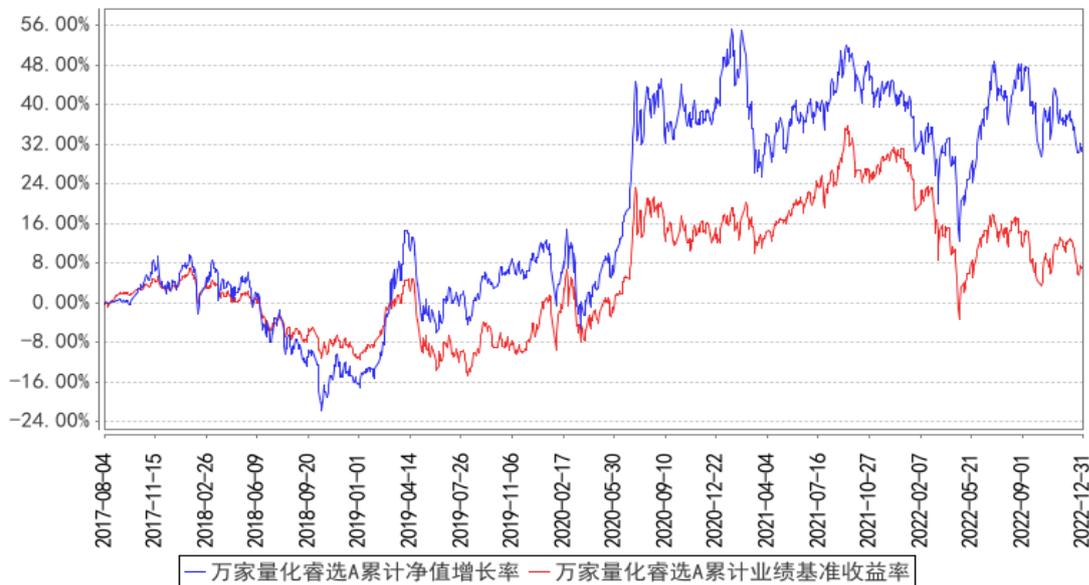
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.99%	1.21%	2.43%	0.92%	-3.42%	0.29%
自基金合同生效起至今	-11.32%	1.26%	-6.46%	0.98%	-4.86%	0.28%

注：万家量化睿选 C 上述“自基金合同生效起至今”实际为“自基金份额类别首次确认起至今”，

下同。

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

万家量化睿选A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



万家量化睿选C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

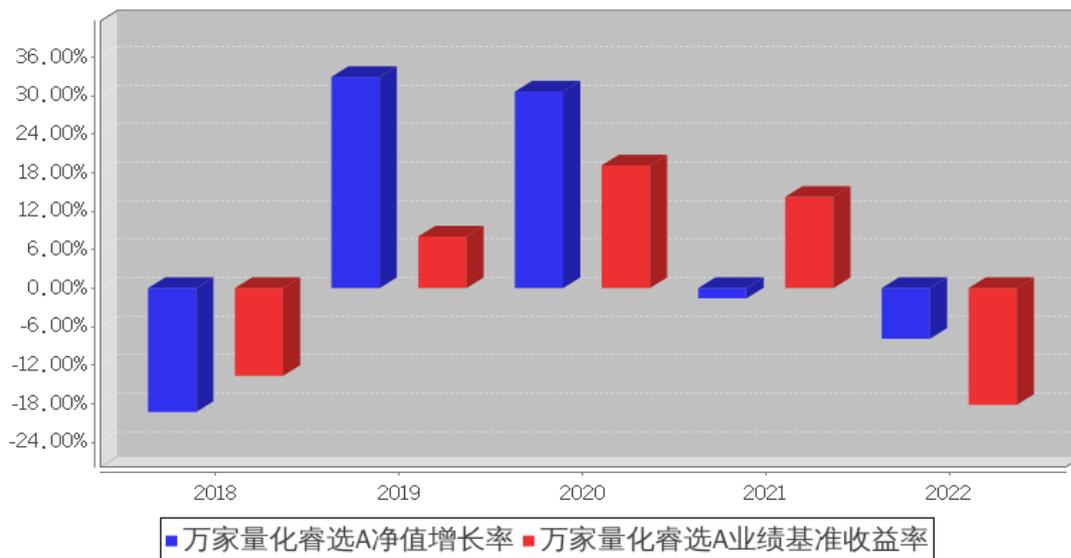


注：1、本基金于 2017 年 8 月 4 日成立，根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

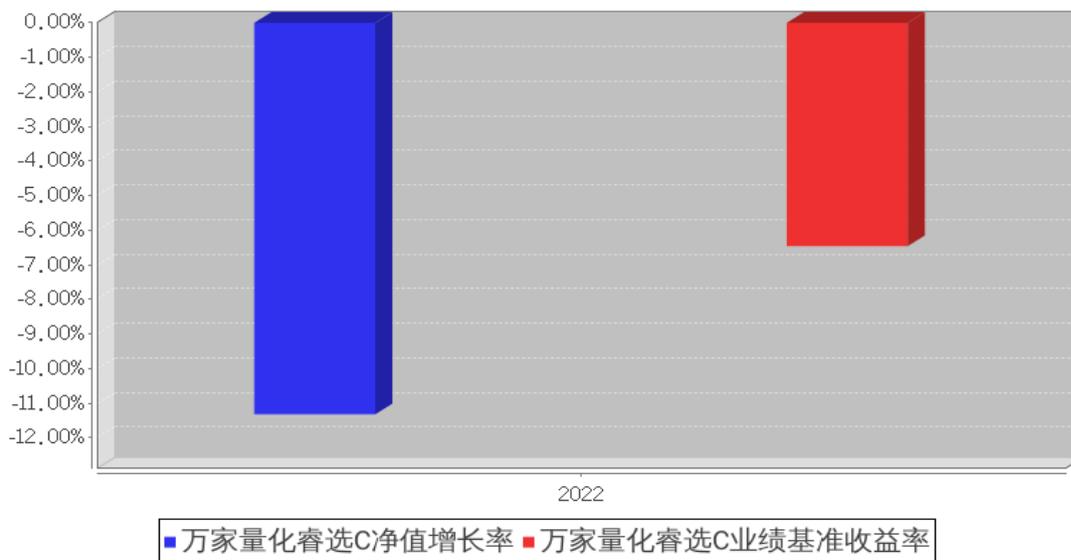
2、本基金自 2022 年 8 月 25 日起增设 C 类份额，2022 年 8 月 26 日起确认有 C 类基金份额登记在册。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家量化睿选A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



万家量化睿选C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未分配利润。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44号文批准设立。截至报告期末，公司的股东为中泰证券股份有限公司、山东省新动能基金管理有限公司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。截至报告期末，公司共管理一百二十只开放式基金，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、万家家年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家 1-3 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家瑞隆混合型证券投资基金、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家现金增利货币市场基金、万家消费成长股票型证券投资基金、万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家玖盛纯债 9 个月定期开放债券型证券投资基金、万家天添宝货币市场基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、万家家瑞债券型证券投资基金、万家臻选混合型证券投资基金、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金、万家成长优选灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金、万家经济新动能混合型证券投资基金、万家潜力价值灵活配置混合型证券投资基金、万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家新机遇龙头企业灵活配置混合型证券投资基金、万家智造优势混合型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型证券投资基金、万家人工智能混合型证券投资基金、万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金（LOF）、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、万家平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、万家中证 500

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

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	公司总经理助理、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、万家互联互通核心资产量化策略混合型证券投资基金、万家创业板指数增强型证券投资基金、万家中证500指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。	2019年8月21日	-	16年	国籍：中国；学历：美国斯坦福大学工商管理博士；相关业务资格：证券投资基金从业资格；过往从业经历：2019年7月入职万家基金管理有限公司，现任公司总经理助理、基金经理，历任量化投资部总监。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量化投资部基金经理，通联数据股份有限公司联合创始人、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《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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金

运作管理办法》等法律、法规和监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金持有人谋取最大利益,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较

少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 13 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，有关基金经理按规定履行了审批程序。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

自 2021 年 7 月份以来，本产品开始以偏股混合型基金指数作为投资希望战胜的目标，通过我们的量化选股和行业配置策略，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（相对于偏股混合型基金指数）能获得长期稳定的超额收益。万家量化睿选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量化睿选 A 的基金份额净值为 1.3148 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.89%，同期业绩比较基准收益率为-18.19%，截至本报告期末万家量化睿选 C 的基金份额净值为 1.3123 元，本报告期基金份额净值增长率为-11.32%，同期业绩比较基准收益率为-6.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年，随着防疫政策优化调整后的第一轮疫情快速达峰后回落，中国经济呈现出快速修复的势头，2023 年 1 月制造业 PMI 和服务业 PMI 均回升至景气水平，分别为 50.1%、54.4%。与此同时，春运旅客发送量明显走强，春节期间电影票房、旅游人次等也回升，指向消费恢复节奏或加快，使得服务业 PMI 回升较为明显。

2023 年是复苏之年，整体有利于风险资产；首先美联储加息接近尾声，预期后续美联储货币政策边际转松，在中美利差收窄之下，人民币升值将是大势所趋，以人民币计价的 A 股吸引力提升，外资配置中国资产意愿回升；其次，各项政策宽松措施也在加速落地，2023 年 1 月 28 日，国常会明确要求持续抓实当前经济社会发展工作，推动经济运行在年初稳步回升，后续随着宽松政策发力见效，内需潜力持续释放，复苏动能将进一步强化。综合来看，随着外资流入，稳增长政策预期拐点逐渐清晰明朗，经济处于复苏的轨道，A 股市场整体或呈现震荡向上格局。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

（一）加强风控文化建设

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

（二）制度流程建设

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

（三）定期和临时稽核工作

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

（四）绩效评估和风险管理工作

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

（五）员工行为管理与防控内幕交易

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

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

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不介入基金日常估值业务。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金自 2022 年 1 月 4 日至 2022 年 6 月 28 日，连续 115 个工作日基金资产净值低于五千万元。我司已经将该基金情况向监管部门报告并提出解决方案。

本报告期内，本基金基金份额持有人数量不存在低于二百人的情况。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	信会师报字[2023]第 ZA30324 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“万家量化睿选”）财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反

	<p>映了万家量化睿选 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于万家量化睿选，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>万家量化睿选的基金管理人万家基金管理有限公司管理层（以下简称管理层）负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估万家量化睿选的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督万家量化睿选的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对万家量化睿选持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我</p>

	<p>们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致万家量化睿选不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	朱颖	杨利敏
会计师事务所的地址	中国·上海	
审计报告日期	2023 年 03 月 29 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	149,221,003.63	1,439,510.22
结算备付金		14,848,448.31	143,041.04
存出保证金		496,062.21	5,026.91
交易性金融资产	7.4.7.2	1,301,148,016.55	15,607,263.31
其中：股票投资		1,281,304,834.23	15,607,263.31
基金投资		-	-
债券投资		19,843,182.32	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		23,303,770.60	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,839,278.42	238.32
递延所得税资产		-	-

其他资产	7.4.7.5	-	2,242.53
资产总计		1,490,856,579.72	17,197,322.33
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	0.05
应付赎回款		45,119,135.98	19.87
应付管理人报酬		1,895,861.42	21,745.67
应付托管费		315,976.90	3,624.31
应付销售服务费		269,171.91	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	7,586,009.53	178,637.99
负债合计		55,186,155.74	204,027.89
净资产:			
实收基金	7.4.7.7	1,092,634,655.13	11,903,840.04
其他综合收益	7.4.7.8	-	-
未分配利润	7.4.7.9	343,035,768.85	5,089,454.40
净资产合计		1,435,670,423.98	16,993,294.44
负债和净资产总计		1,490,856,579.72	17,197,322.33

注：1、报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 1,092,634,655.13 份，其中万家量化睿选 A 基金份额净值 1.3148 元，基金份额总额 718,548,095.47 份；万家量化睿选 C 基金份额净值 1.3123 元，基金份额总额 374,086,559.66 份。

2、比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

7.2 利润表

会计主体：万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
-----	-----	----	---------

		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-91,401,460.51	586,209.53
1. 利息收入		193,576.94	18,170.33
其中：存款利息收入	7.4.7.10	193,576.94	9,115.30
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		-	9,055.03
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-75,853,133.66	2,326,658.86
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-77,359,044.70	2,174,562.78
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	49,965.75	-
资产支持证券投资	7.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	1,455,945.29	152,096.08
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-16,783,757.02	-1,763,838.96
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,041,853.23	5,219.30
减：二、营业总支出		7,261,089.81	859,299.97
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,556,341.24	294,762.44
2. 托管费	7.4.10.2.2	926,056.84	49,127.13
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	595,231.73	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.20	183,460.00	515,410.40
三、利润总额（亏损总额		-98,662,550.32	-273,090.44

以“-”号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		-98,662,550.32	-273,090.44
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-98,662,550.32	-273,090.44

注：比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	11,903,840.04	-	5,089,454.40	16,993,294.44
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	11,903,840.04	-	5,089,454.40	16,993,294.44
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,080,730,815.09	-	337,946,314.45	1,418,677,129.54
(一)、综合收益总额	-	-	-98,662,550.32	-98,662,550.32

(二)、 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)	1,080,730,815.09	-	436,608,864.77	1,517,339,679.86
其中:1. 基金申购款	1,465,188,539.95	-	572,663,645.24	2,037,852,185.19
2. 基金赎回款	-384,457,724.86	-	-136,054,780.47	-520,512,505.33
(三)、 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)	-	-	-	-
(四)、 其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,092,634,655.13	-	343,035,768.85	1,435,670,423.98
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	17,355,473.42	-	7,818,320.34	25,173,793.76

加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	17,355,473.42	-	7,818,320.34	25,173,793.76
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-5,451,633.38	-	-2,728,865.94	-8,180,499.32
(一)、综合收益总额	-	-	-273,090.44	-273,090.44
(二)、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)	-5,451,633.38	-	-2,455,775.50	-7,907,408.88
其中:1.基金申购款	1,373,379.51	-	568,524.87	1,941,904.38
2.基金赎回款	-6,825,012.89	-	-3,024,300.37	-9,849,313.26
(三)、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)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	11,903,840.04	-	5,089,454.40	16,993,294.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2017]569 号文）批准，由万家基金管理有限公司作为基金管理人于 2017 年 7 月 3 日至 2017 年 7 月 28 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资并出具安永华明(2017)验字第 60778298_B03 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 2017 年 8 月 4 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定期。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 937,133,525.86 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 315,926.82 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 937,449,452.68 元，折合 937,449,452.68 份基金份额。本基金的基金管理人为万家基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，经与本基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，2022 年 8 月 25 日起，本基金增设 C 类基金份额。

本基金主要投资具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包含主板、中小板、

创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、股指期货、国债期货、股票期权、权证以及债券等金融工具(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可交换公司债券、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可参与融资业务。本基金为混合型基金,股票资产占基金资产的 0%-95%;每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的保证金以后,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%;权证投资占基金资产净值的 0-3%。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率*90%+一年期银行定期存款收益率(税后)*10%。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

1、金融资产的分类

自 2022 年 1 月 1 日起适用

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

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

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

2022 年 1 月 1 日前适用

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

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

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

2、金融负债的分类

自 2022 年 1 月 1 日起适用

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

2022 年 1 月 1 日前适用

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金

融负债。本基金无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

自 2022 年 1 月 1 日起适用

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

或者（3）该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

2022 年 1 月 1 日前适用

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（2）不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在

无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

自 2022 年 1 月 1 日起适用

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

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

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

2022 年 1 月 1 日前适用

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

自 2022 年 1 月 1 日起适用

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

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

2022 年 1 月 1 日前适用

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提；

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

(2) 本基金收益分配方式分两种: 现金分红与红利再投资, 投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资; 若投资者不选择, 本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值, 即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(4) 每一基金份额享有同等分配权;

(5) 法律法规或监管机构另有规定的, 从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定, 并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下, 基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整, 不需召开基金份额持有人大会。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

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

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票, 根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》, 按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数

有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》(财会〔2017〕7号)、《企业会计准则第23号——金融资产转移》(财会〔2017〕8号)、《企业会计准则第24号——套期会计》(财会〔2017〕9号)、《企业会计准则第37号——金融工具列报》(财会〔2017〕14号)(以下简称新金融工具相关会计准则)和《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》(财会〔2020〕22号),自2022年1月1日起,本基金开始执行新金融工具相关会计准则,根据衔接规定,对可比期间信息不予调整,首日执行新准则与现行准则的差异追溯调整报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式,确定了三个主要的计量类别:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。本基金需考虑自身业务模式以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”,适用于以摊余成本计量的金融资产和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

2022年1月1日各项资产和负债按照修订前后金融工具确认计量准则的规定进行分类和计量结果对比如下:

金融资产/负债类别	修订前的金融工具确认计量准则		修订后的金融工具确认计量准则	
	计量类别	账面价值	计量类别	账面价值
金融资产				
银行存款	摊余成本(应收款项)	1,439,510.22	摊余成本	1,439,679.18
结算备付金	摊余成本(应收款项)	143,041.04	摊余成本	145,112.19

存出保证金	摊余成本（应收款项）	5,026.91	摊余成本	5,029.33
交易性金融资产	以公允价值计量且其变动计入当期损益	15,607,263.31	以公允价值计量且其变动计入当期损益	15,607,263.31
应收利息	摊余成本（应收款项）	2,242.53	—	—
应收申购款	摊余成本（应收款项）	238.32	摊余成本	238.32
金融负债				
应付清算款	摊余成本	0.05	摊余成本	0.05
应付赎回款	摊余成本	19.87	摊余成本	19.87
应付管理人报酬	摊余成本	21,745.67	摊余成本	21,745.67
应付托管费	摊余成本	3,624.31	摊余成本	3,624.31
应付交易费用	摊余成本	84,137.94	—	—
其他负债	摊余成本	94,500.05	摊余成本	178,637.99

于 2021 年 12 月 31 日，“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

（一）印花税

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

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

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

暂免征收印花税；

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

(二) 增值税

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

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

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

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

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

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

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

（三）企业所得税

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

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

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

（四）个人所得税

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

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

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

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	149,221,003.63	1,439,510.22
等于：本金	149,203,155.53	1,439,510.22
加：应计利息	17,848.10	-
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	149,221,003.63	1,439,510.22

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	1,298,116,537.60	-	1,281,304,834.23	-16,811,703.37	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	19,771,040.00	55,182.32	19,843,182.32	16,960.00
	合计	19,771,040.00	55,182.32	19,843,182.32	16,960.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	

其他	-	-	-	-
合计	1,317,887,577.60	55,182.32	1,301,148,016.55	-16,794,743.37
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	15,618,249.66	-	15,607,263.31	-10,986.35
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	15,618,249.66	-	15,607,263.31	-10,986.35

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有各项买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	-
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
应计利息	-	2,242.53
合计	-	2,242.53

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	7,041.05	0.05

应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	7,329,468.48	84,137.94
其中：交易所市场	7,329,268.48	84,137.94
银行间市场	200.00	-
应付利息	-	-
预提费用	249,500.00	94,500.00
合计	7,586,009.53	178,637.99

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

万家量化睿选 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,903,840.04	11,903,840.04
本期申购	876,232,498.20	876,232,498.20
本期赎回（以“-”号填列）	-169,588,242.77	-169,588,242.77
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	718,548,095.47	718,548,095.47

万家量化睿选 C

项目	本期 2022 年 8 月 25 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	588,956,041.75	588,956,041.75
本期赎回（以“-”号填列）	-214,869,482.09	-214,869,482.09
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	374,086,559.66	374,086,559.66

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

万家量化睿选 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	8,288,925.37	-3,199,470.97	5,089,454.40

本期利润	-55,638,951.56	-10,666,100.43	-66,305,051.99
本期基金份额交易产生的变动数	420,053,489.02	-132,641,861.08	287,411,627.94
其中：基金申购款	517,778,072.74	-166,424,230.44	351,353,842.30
基金赎回款	-97,724,583.72	33,782,369.36	-63,942,214.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	372,703,462.83	-146,507,432.48	226,196,030.35

万家量化睿选 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	-26,239,841.74	-6,117,656.59	-32,357,498.33
本期基金份额交易产生的变动数	219,353,042.80	-70,155,805.97	149,197,236.83
其中：基金申购款	335,953,122.33	-114,643,319.39	221,309,802.94
基金赎回款	-116,600,079.53	44,487,513.42	-72,112,566.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	193,113,201.06	-76,273,462.56	116,839,738.50

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	147,624.06	6,697.50
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	44,326.31	2,359.76
其他	1,626.57	58.04
合计	193,576.94	9,115.30

7.4.7.11 股票投资收益

7.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-77,359,044.70	2,174,562.78
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	-77,359,044.70	2,174,562.78

7.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	4,337,434,767.00	134,815,559.32
减：卖出股票成本总额	4,400,320,943.32	132,640,996.54
减：交易费用	14,472,868.38	-
买卖股票差价收入	-77,359,044.70	2,174,562.78

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	50,165.75	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-200.00	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	49,965.75	-

7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	-
减：应计利息总额	-	-

减：交易费用	200.00	-
买卖债券差价收入	-200.00	-

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,455,945.29	152,096.08
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,455,945.29	152,096.08

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	-16,783,757.02	-1,763,838.96
股票投资	-16,800,717.02	-1,763,838.96
债券投资	16,960.00	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-16,783,757.02	-1,763,838.96

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	1,034,030.62	5,176.65
基金转换费收入	7,822.61	42.65
合计	1,041,853.23	5,219.30

7.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	45,000.00	10,000.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	460.00	1,490.00
账户维护费	18,000.00	22,500.00
交易费用	-	401,060.40
其他	-	360.00
合计	183,460.00	515,410.40

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据中国证券监督管理委员会《关于核准万家基金管理有限公司变更实际控制人的批复》（证监许可[2023]215号），齐河众鑫投资有限公司将其持有的万家基金 11%股权转让给中泰证券股份有限公司，股权变更后，中泰证券股份有限公司持股比例变更为 60%，山东能源集团有限公司为万家基金实际控制人。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司（“万家基金”）	基金管理人，基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	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
齐河众鑫投资有限公司	基金管理人的股东
新疆国际实业股份有限公司	基金管理人的股东
山东省新动能基金管理有限公司	基金管理人的股东

万家共赢资产管理有限公司（“万家共赢”）	基金管理人的子公司
万家财富基金销售（天津）有限公司（“万家财富”）	基金管理人的子公司、基金销售机构
上海万家朴智投资管理有限公司（“万家朴智”）	基金管理人控制的公司

注：1、2022 年 4 月，中国证监会下发《关于核准万家基金管理有限公司变更股权的批复》（证监许可[2022]795 号），核准新疆国际实业股份有限公司将持有的万家基金 40%股权转让给山东省新动能基金管理有限公司。2022 年 6 月，万家基金完成工商变更登记手续，万家基金股东变更为中泰证券、山东省新动能基金管理有限公司、齐河众鑫投资有限公司。

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

3、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
中泰证券	4,797,374,126.83	47.92	-	-

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中泰证券	4,467,831.82	47.92	3,095,194.66	42.23
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中泰证券	-	-	-	-

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,556,341.24	294,762.44
其中：支付销售机构的客户维护费	330,944.61	136,384.76

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	926,056.84	49,127.13

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人

无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家量化睿选 A	万家量化睿选 C	合计
万家基金	-	416,964.95	416,964.95
合计	-	416,964.95	416,964.95
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家量化睿选 A	万家量化睿选 C	合计
合计	-	-	-

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 0.60%。

销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	本期 2022年8月25日至2022年 12月31日
	万家量化睿选 A	万家量化睿选 C
基金合同生效日（2017年8月4日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	11,071,972.32	-
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	11,071,972.32	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.5409%	-
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 -
	万家量化睿选 A	万家量化睿选 C
基金合同生效日（2017年8月4日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
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	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
建设银行	149,221,003.63	147,624.06	1,439,510.22	6,697.50

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方所承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间没有需作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
301161	唯万密封	2022年9月6日	6个月	新股流通受限	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-
301176	逸豪新材	2022年9月21日	6个月	新股流通受限	23.88	16.89	544	12,990.72	9,188.16	-
301223	中荣股份	2022年10月13日	6个月	新股流通受限	26.28	18.13	617	16,214.76	11,186.21	-
301227	森鹰窗业	2022年9月16日	6个月	新股流通受限	38.25	29.49	284	10,863.00	8,375.16	-
301230	泓博医药	2022年10月21日	6个月	新股流通受限	40.00	48.32	269	10,760.00	12,998.08	-
301231	荣信文化	2022年8月31日	6个月	新股流通受限	25.49	20.38	275	7,009.75	5,604.50	-
301265	华新	2022年	6个月	新股流	13.28	11.40	819	10,876.32	9,336.60	-

	环保	12月8日		通受限							
301267	华夏眼科	2022年10月26日	6个月	新股流通受限	50.88	66.20	455	23,150.40	30,121.00		-
301273	瑞晨环保	2022年10月11日	6个月	新股流通受限	37.89	37.79	277	10,495.53	10,467.83		-
301277	新天地	2022年11月9日	6个月	新股流通受限	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42		-
301280	珠城科技	2022年12月19日	6个月	新股流通受限	67.40	44.80	279	18,804.60	12,499.20		-
301285	鸿日达	2022年9月21日	6个月	新股流通受限	14.60	12.60	565	8,249.00	7,119.00		-
301290	东星医疗	2022年11月23日	6个月	新股流通受限	44.09	35.13	330	14,549.70	11,592.90		-
301297	富乐德	2022年12月23日	6个月	新股流通受限	8.48	12.99	1,015	8,607.20	13,184.85		-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股流通受限	5.00	7.53	3,574	17,870.00	26,912.22		-
301309	万得凯	2022年9月8日	6个月	新股流通受限	39.00	24.46	187	7,293.00	4,574.02		-
301311	昆船智能	2022年11月23日	6个月	新股流通受限	13.88	15.86	832	11,548.16	13,195.52		-
301313	凡拓数创	2022年9月22日	6个月	新股流通受限	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58		-
301316	慧博云通	2022年9月29日	6个月	新股流通受限	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88		-
301319	唯特偶	2022年9月22日	6个月	新股流通受限	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05		-
301339	通行宝	2022年9月2日	6个月	新股流通受限	18.78	15.59	501	9,408.78	7,810.59		-

301356	天振股份	2022年11月3日	6个月	新股流通受限	63.00	43.33	601	37,863.00	26,041.33	-
301363	美好医疗	2022年9月28日	6个月	新股流通受限	30.66	37.85	393	12,049.38	14,875.05	-
301366	一博科技	2022年9月19日	6个月	新股流通受限	65.35	45.09	202	13,200.70	9,108.18	-
301367	怡和嘉业	2022年10月21日	6个月	新股流通受限	119.88	175.78	181	21,698.28	31,816.18	-
301368	丰立智能	2022年12月7日	6个月	新股流通受限	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24	-
301379	天山电子	2022年10月19日	6个月	新股流通受限	31.51	24.63	449	14,147.99	11,058.87	-
301389	隆扬电子	2022年10月18日	6个月	新股流通受限	22.50	17.16	810	18,225.00	13,899.60	-
301391	卡莱特	2022年11月24日	6个月	新股流通受限	96.00	80.97	247	23,712.00	19,999.59	-
688031	星环科技	2022年10月11日	6个月	新股流通受限	47.34	78.80	6,850	324,279.00	539,780.00	-
688392	骄成超声	2022年9月19日	6个月	新股流通受限	71.18	134.27	1,830	130,259.40	245,714.10	-
688475	萤石网络	2022年12月20日	6个月	新股流通受限	28.77	24.65	20,526	590,533.02	505,965.90	-
688503	聚和材料	2022年12月2日	6个月	新股流通受限	110.00	136.39	3,277	360,470.00	446,950.03	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止, 本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖

出回购金融资产款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止, 本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	19,843,182.32	-
合计	19,843,182.32	-

注：未评级债券包括政策性金融债。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持有的的证券大部分具有良好的流动性，部分证券流通暂时受限的情况参见附注 7.4.12 “期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券”，本报告期内本基金未出现因投资品种变现困难或投资集中而无法以合理价格及时变现基金资产以支付赎回款的情况。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年12 月31日	1个月以内	1-3个 月	3个月-1年	1-5 年	5年 以上	不计息	合计
资产							
银行存款	149,221,003.63	-	-	-	-	-	149,221,003.63
结算备付金	14,848,448.31	-	-	-	-	-	14,848,448.31
存出保证金	496,062.21	-	-	-	-	-	496,062.21
交易性金融资产	-	-	19,843,182.32	-	-	1,281,304,834.23	1,301,148,016.55
应收申购款	-	-	-	-	-	1,839,278.42	1,839,278.42
应收清算款	-	-	-	-	-	23,303,770.60	23,303,770.60
资产总计	164,565,514.15	-	19,843,182.32	-	-	1,306,447,883.25	1,490,856,579.72
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	45,119,135.98	45,119,135.98
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,895,861.42	1,895,861.42
应付托管费	-	-	-	-	-	315,976.90	315,976.90
应付销售服务费	-	-	-	-	-	269,171.91	269,171.91
其他负债	-	-	-	-	-	7,586,009.53	7,586,009.53
负债总计	-	-	-	-	-	55,186,155.74	55,186,155.74
利率敏感度缺口	164,565,514.15	-	19,843,182.32	-	-	1,251,261,727.51	1,435,670,423.98
上年度末 2021年12 月31日							
资产							
银行存款	1,439,510.22	-	-	-	-	-	1,439,510.22
结算备付金	143,041.04	-	-	-	-	-	143,041.04
存出保证金	5,026.91	-	-	-	-	-	5,026.91
交易性金融资产	-	-	-	-	-	15,607,263.31	15,607,263.31
应收申购款	-	-	-	-	-	238.32	238.32
其他资产	-	-	-	-	-	2,242.53	2,242.53
资产总计	1,587,578.17	-	-	-	-	15,609,744.16	17,197,322.33
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	0.05	0.05
应付赎回款	-	-	-	-	-	19.87	19.87
应付管理人	-	-	-	-	-	21,745.67	21,745.67

报酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	3,624.31	3,624.31
其他负债	-	-	-	-	-	178,637.99	178,637.99
负债总计	-	-	-	-	-	204,027.89	204,027.89
利率敏感度缺口	1,587,578.17	-	-	-	-	15,405,716.27	16,993,294.44

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	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（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	1. 市场利率下降 25 个基点	18,707.42	-
	2. 市场利率上升 25 个基点	-18,672.11	-

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日		上年度末 2021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	1,281,304,834.23	89.25	15,607,263.31	91.84
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	1,281,304,834.23	89.25	15,607,263.31	91.84

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除股票基准指数以外的其他市场变量保持不变		
	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（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	1. 股票基准指数下降100个基点	-11,776,211.56	-91,143.49
	2. 股票基准指数上升100个基点	11,776,211.56	91,143.49

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	1,279,201,917.81	15,607,263.31

第二层次	19,843,182.32	-
第三层次	2,102,916.42	-
合计	1,301,148,016.55	15,607,263.31

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	1,785,419.66	1,785,419.66
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	317,496.76	317,496.76
其中：计入损益的利得或损失	-	317,496.76	317,496.76
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	2,102,916.42	2,102,916.42
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	317,496.76	317,496.76
项目	上年度可比同期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-

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

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	2,102,916.42	亚式期权模型	预期波动率	0.2127-2.4756	预期波动率越大公允价值越低
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,281,304,834.23	85.94
	其中：股票	1,281,304,834.23	85.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	19,843,182.32	1.33
	其中：债券	19,843,182.32	1.33
	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	164,069,451.94	11.01
8	其他各项资产	25,639,111.23	1.72
9	合计	1,490,856,579.72	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	21,700,672.00	1.51
B	采矿业	127,967,126.84	8.91
C	制造业	790,000,208.53	55.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	39,433,675.20	2.75
E	建筑业	17,139,490.12	1.19
F	批发和零售业	41,500,347.07	2.89
G	交通运输、仓储和邮政业	48,335,130.50	3.37
H	住宿和餐饮业	15,987,900.00	1.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	41,881,397.67	2.92
J	金融业	61,135,695.27	4.26
K	房地产业	24,186,408.00	1.68
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	9,886,726.93	0.69
N	水利、环境和公共设施管理业	14,707,056.00	1.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	30,121.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	27,412,879.10	1.91
S	综合	-	-
	合计	1,281,304,834.23	89.25

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600795	国电电力	4,728,500	20,190,695.00	1.41
2	600926	杭州银行	1,504,700	19,681,476.00	1.37
3	002938	鹏鼎控股	714,978	19,618,996.32	1.37
4	601009	南京银行	1,882,256	19,613,107.52	1.37
5	300274	阳光电源	175,400	19,609,720.00	1.37
6	600919	江苏银行	2,674,353	19,496,033.37	1.36
7	601808	中海油服	1,174,337	19,470,507.46	1.36
8	601225	陕西煤业	1,045,200	19,419,816.00	1.35
9	601111	中国国航	1,829,545	19,393,177.00	1.35
10	000651	格力电器	599,770	19,384,566.40	1.35
11	600028	中国石化	4,418,960	19,266,665.60	1.34
12	605090	九丰能源	931,300	19,231,345.00	1.34
13	601857	中国石油	3,868,800	19,227,936.00	1.34
14	600583	海油工程	3,170,463	19,213,005.78	1.34
15	600690	海尔智家	782,800	19,147,288.00	1.33
16	002299	圣农发展	796,800	18,876,192.00	1.31
17	301035	润丰股份	215,031	18,729,200.10	1.30
18	000568	泸州老窖	81,800	18,346,104.00	1.28
19	000425	徐工机械	3,618,100	18,343,767.00	1.28
20	600519	贵州茅台	10,600	18,306,200.00	1.28
21	000860	顺鑫农业	612,812	18,274,053.84	1.27
22	603369	今世缘	358,400	18,242,560.00	1.27
23	601138	工业富联	1,982,000	18,194,760.00	1.27
24	002304	洋河股份	113,200	18,168,600.00	1.27
25	600809	山西汾酒	63,700	18,153,863.00	1.26
26	000596	古井贡酒	67,905	18,123,844.50	1.26
27	002594	比亚迪	70,300	18,064,991.00	1.26
28	600600	青岛啤酒	167,800	18,038,500.00	1.26
29	601231	环旭电子	1,102,900	17,900,067.00	1.25
30	603589	口子窖	309,481	17,847,769.27	1.24
31	600132	重庆啤酒	139,509	17,770,656.42	1.24
32	000858	五粮液	94,600	17,093,274.00	1.19

33	600559	老白干酒	620,000	17,068,600.00	1.19
34	002372	伟星新材	787,200	16,798,848.00	1.17
35	000729	燕京啤酒	1,577,809	16,756,331.58	1.17
36	600197	伊力特	680,519	16,699,936.26	1.16
37	688777	中控技术	182,468	16,573,568.44	1.15
38	600871	石化油服	8,257,200	16,349,256.00	1.14
39	600754	锦江酒店	274,000	15,987,900.00	1.11
40	002353	杰瑞股份	563,500	15,727,285.00	1.10
41	000921	海信家电	1,164,300	15,333,831.00	1.07
42	600158	中体产业	1,744,900	15,232,977.00	1.06
43	002085	万丰奥威	2,531,200	15,060,640.00	1.05
44	600054	黄山旅游	1,154,400	14,707,056.00	1.02
45	601699	潞安环能	808,400	13,621,540.00	0.95
46	000913	钱江摩托	735,664	13,595,070.72	0.95
47	601728	中国电信	3,145,422	13,179,318.18	0.92
48	002461	珠江啤酒	1,630,669	13,061,658.69	0.91
49	603658	安图生物	200,120	12,377,422.00	0.86
50	300144	宋城演艺	833,856	12,174,297.60	0.85
51	600115	中国东航	2,197,700	12,153,281.00	0.85
52	600170	上海建工	4,669,700	12,141,220.00	0.85
53	605499	东鹏饮料	67,300	11,972,670.00	0.83
54	300596	利安隆	210,500	11,486,985.00	0.80
55	603833	欧派家居	93,372	11,347,499.16	0.79
56	002746	仙坛股份	1,152,804	10,559,684.64	0.74
57	600064	南京高科	1,551,600	10,256,076.00	0.71
58	600827	百联股份	832,500	10,089,900.00	0.70
59	601965	中国汽研	508,800	9,860,544.00	0.69
60	300043	星辉娱乐	3,292,900	9,779,913.00	0.68
61	001979	招商蛇口	746,400	9,427,032.00	0.66
62	000906	浙商中拓	1,017,600	9,168,576.00	0.64
63	600153	建发股份	657,256	8,971,544.40	0.62
64	000869	张裕 A	289,800	8,763,552.00	0.61
65	603118	共进股份	1,088,815	8,656,079.25	0.60
66	000401	冀东水泥	1,030,378	8,480,010.94	0.59
67	002697	红旗连锁	1,488,201	8,378,571.63	0.58
68	600573	惠泉啤酒	762,000	8,359,140.00	0.58
69	601816	京沪高铁	1,663,800	8,185,896.00	0.57
70	688819	天能股份	222,734	8,183,247.16	0.57
71	002045	国光电器	660,000	8,177,400.00	0.57
72	600346	恒力石化	521,400	8,097,342.00	0.56
73	002242	九阳股份	460,600	7,590,688.00	0.53
74	603730	岱美股份	469,910	7,556,152.80	0.53
75	600688	上海石化	2,395,300	7,449,383.00	0.52

76	002032	苏泊尔	150,000	7,419,000.00	0.52
77	688520	神州细胞	121,079	7,337,387.40	0.51
78	605117	德业股份	21,100	6,988,320.00	0.49
79	600732	爱旭股份	176,900	6,690,358.00	0.47
80	002536	飞龙股份	871,000	6,523,790.00	0.45
81	000717	中南股份	2,274,900	6,483,465.00	0.45
82	300427	红相股份	376,300	6,329,366.00	0.44
83	600612	老凤祥	135,700	5,807,960.00	0.40
84	000521	长虹美菱	1,367,600	5,757,596.00	0.40
85	002493	荣盛石化	459,424	5,650,915.20	0.39
86	600887	伊利股份	181,000	5,611,000.00	0.39
87	600026	中远海能	434,200	5,232,110.00	0.36
88	002384	东山精密	205,300	5,077,069.00	0.35
89	600667	太极实业	968,657	4,998,270.12	0.35
90	603939	益丰药房	76,400	4,877,376.00	0.34
91	002244	滨江集团	510,000	4,503,300.00	0.31
92	600199	金种子酒	155,499	4,154,933.28	0.29
93	002429	兆驰股份	1,022,800	3,569,572.00	0.25
94	603527	众源新材	247,000	3,477,760.00	0.24
95	600377	宁沪高速	406,800	3,343,896.00	0.23
96	603639	海利尔	127,600	3,258,904.00	0.23
97	002180	纳思达	58,000	3,009,620.00	0.21
98	603787	新日股份	164,400	2,975,640.00	0.21
99	002444	巨星科技	152,800	2,900,144.00	0.20
100	002458	益生股份	203,200	2,824,480.00	0.20
101	300607	拓斯达	190,200	2,767,410.00	0.19
102	603313	梦百合	258,800	2,743,280.00	0.19
103	603529	爱玛科技	54,860	2,516,428.20	0.18
104	600367	红星发展	162,526	2,504,525.66	0.17
105	688377	迪威尔	55,312	2,432,621.76	0.17
106	603528	多伦科技	359,179	2,316,704.55	0.16
107	002831	裕同科技	68,487	2,264,865.09	0.16
108	601288	农业银行	777,500	2,262,525.00	0.16
109	600616	金枫酒业	312,900	2,177,784.00	0.15
110	000048	京基智农	121,500	2,168,775.00	0.15
111	600408	安泰集团	745,900	1,991,553.00	0.14
112	601163	三角轮胎	162,800	1,987,788.00	0.14
113	002674	兴业科技	169,900	1,836,619.00	0.13
114	002571	德力股份	288,700	1,801,488.00	0.13
115	603421	鼎信通讯	213,700	1,788,669.00	0.12
116	002632	道明光学	252,600	1,611,588.00	0.11
117	300125	聆达股份	76,800	1,523,712.00	0.11
118	600938	中国海油	92,000	1,398,400.00	0.10

119	688501	青达环保	52,105	1,346,914.25	0.09
120	300258	精锻科技	114,200	1,328,146.00	0.09
121	600839	四川长虹	431,900	1,140,216.00	0.08
122	000541	佛山照明	181,500	892,980.00	0.06
123	600160	巨化股份	46,900	727,419.00	0.05
124	600438	通威股份	18,700	721,446.00	0.05
125	603826	坤彩科技	12,100	634,161.00	0.04
126	002952	亚世光电	41,000	614,180.00	0.04
127	688031	星环科技	6,850	539,780.00	0.04
128	688475	萤石网络	20,526	505,965.90	0.04
129	002110	三钢闽光	103,350	485,745.00	0.03
130	688503	聚和材料	3,277	446,950.03	0.03
131	002572	索菲亚	23,300	423,128.00	0.03
132	002698	博实股份	28,508	399,397.08	0.03
133	002925	盈趣科技	23,100	381,612.00	0.03
134	605208	永茂泰	24,900	332,166.00	0.02
135	300894	火星人	12,200	308,416.00	0.02
136	601689	拓普集团	4,700	275,326.00	0.02
137	688392	骄成超声	1,830	245,714.10	0.02
138	001269	欧晶科技	946	93,881.04	0.01
139	601136	首创证券	4,739	82,553.38	0.01
140	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.00
141	001338	永顺泰	1,649	34,826.88	0.00
142	301367	怡和嘉业	181	31,816.18	0.00
143	301267	华夏眼科	455	30,121.00	0.00
144	002853	皮阿诺	1,500	29,220.00	0.00
145	301301	川宁生物	3,574	26,912.22	0.00
146	601022	宁波远洋	1,983	26,770.50	0.00
147	301356	天振股份	601	26,041.33	0.00
148	001322	箭牌家居	1,595	24,244.00	0.00
149	301391	卡莱特	247	19,999.59	0.00
150	603057	紫燕食品	549	17,277.03	0.00
151	301363	美好医疗	393	14,875.05	0.00
152	001298	好上好	403	14,379.04	0.00
153	301389	隆扬电子	810	13,899.60	0.00
154	301311	昆船智能	832	13,195.52	0.00
155	301297	富乐德	1,015	13,184.85	0.00
156	603130	云中马	480	13,176.00	0.00
157	301230	泓博医药	269	12,998.08	0.00
158	301280	珠城科技	279	12,499.20	0.00
159	001256	炜冈科技	474	12,390.36	0.00
160	001333	光华股份	426	12,332.70	0.00
161	001299	美能能源	576	11,635.20	0.00

162	301290	东星医疗	330	11,592.90	0.00
163	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
164	301223	中荣股份	617	11,186.21	0.00
165	301379	天山电子	449	11,058.87	0.00
166	301273	瑞晨环保	277	10,467.83	0.00
167	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00
168	301176	逸豪新材	544	9,188.16	0.00
169	301366	一博科技	202	9,108.18	0.00
170	603280	南方路机	363	8,893.50	0.00
171	301227	森鹰窗业	284	8,375.16	0.00
172	301339	通行宝	501	7,810.59	0.00
173	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
174	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
175	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
176	603868	飞科电器	100	6,733.00	0.00
177	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
178	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
179	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
180	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00
181	301309	万得凯	187	4,574.02	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600600	青岛啤酒	42,765,257.86	251.66
2	000596	古井贡酒	40,193,547.80	236.53
3	002594	比亚迪	36,557,441.00	215.13
4	600919	江苏银行	35,076,508.36	206.41
5	300274	阳光电源	34,173,892.10	201.10
6	600549	厦门钨业	33,351,258.46	196.26
7	002466	天齐锂业	32,601,179.45	191.85
8	002460	赣锋锂业	32,337,105.60	190.29
9	601668	中国建筑	31,183,591.20	183.51
10	002459	晶澳科技	30,732,313.80	180.85
11	688599	天合光能	30,150,438.32	177.43
12	601225	陕西煤业	29,233,805.00	172.03
13	002371	北方华创	28,914,220.44	170.15
14	601857	中国石油	28,845,623.00	169.75
15	601808	中海油服	28,684,339.80	168.80
16	600028	中国石化	28,601,887.20	168.31
17	002176	江特电机	28,368,257.00	166.94
18	600690	海尔智家	27,972,329.00	164.61

19	600026	中远海能	27,945,396.00	164.45
20	600985	淮北矿业	27,803,068.28	163.61
21	601699	潞安环能	27,115,982.42	159.57
22	000651	格力电器	26,781,921.80	157.60
23	601669	中国电建	26,470,673.42	155.77
24	301035	润丰股份	26,262,690.92	154.55
25	601088	中国神华	25,636,809.00	150.86
26	002050	三花智控	25,498,342.00	150.05
27	000933	神火股份	25,278,750.00	148.76
28	601898	中煤能源	25,244,448.43	148.56
29	000762	西藏矿业	25,207,838.00	148.34
30	002756	永兴材料	25,139,139.39	147.94
31	600938	中国海油	25,007,937.65	147.16
32	600795	国电电力	24,971,171.00	146.95
33	601009	南京银行	24,921,911.40	146.66
34	601288	农业银行	24,862,292.00	146.31
35	600508	上海能源	24,536,876.92	144.39
36	002920	德赛西威	24,453,469.56	143.90
37	605090	九丰能源	24,417,591.38	143.69
38	300724	捷佳伟创	24,379,626.85	143.47
39	601186	中国铁建	24,243,211.00	142.66
40	000983	山西焦煤	24,219,321.50	142.52
41	600256	广汇能源	24,029,444.00	141.41
42	601138	工业富联	23,937,943.40	140.87
43	603259	药明康德	23,864,335.40	140.43
44	002056	横店东磁	23,846,096.00	140.33
45	600754	锦江酒店	23,797,799.00	140.04
46	002938	鹏鼎控股	23,532,290.08	138.48
47	000860	顺鑫农业	23,519,356.56	138.40
48	600348	华阳股份	23,511,276.00	138.36
49	002304	洋河股份	23,238,672.00	136.75
50	600160	巨化股份	23,147,168.00	136.21
51	002240	盛新锂能	22,996,047.40	135.32
52	601919	中远海控	22,969,453.40	135.17
53	600519	贵州茅台	22,893,109.00	134.72
54	603345	安井食品	22,874,712.27	134.61
55	000568	泸州老窖	22,234,306.00	130.84
56	600926	杭州银行	22,141,282.00	130.29
57	600809	山西汾酒	21,847,225.68	128.56
58	001979	招商蛇口	21,745,963.00	127.97
59	601975	招商南油	21,658,319.00	127.45
60	600968	海油发展	21,650,302.00	127.40
61	603658	安图生物	21,606,279.10	127.15

62	603589	口子窖	21,582,033.14	127.00
63	600132	重庆啤酒	21,539,570.64	126.75
64	601689	拓普集团	21,511,943.00	126.59
65	600546	山煤国际	21,450,861.37	126.23
66	600027	华电国际	21,390,280.00	125.87
67	603369	今世缘	21,373,835.53	125.78
68	002493	荣盛石化	20,907,080.46	123.03
69	300331	苏大维格	20,825,406.00	122.55
70	600997	开滦股份	20,800,855.00	122.41
71	600199	金种子酒	20,674,138.80	121.66
72	300014	亿纬锂能	20,476,020.00	120.49
73	300760	迈瑞医疗	20,469,578.00	120.46
74	605117	德业股份	20,459,589.90	120.40
75	000729	燕京啤酒	20,389,901.75	119.99
76	300438	鹏辉能源	20,305,198.00	119.49
77	601111	中国国航	20,262,659.50	119.24
78	002353	杰瑞股份	19,983,329.30	117.60
79	600502	安徽建工	19,854,316.00	116.84
80	600197	伊力特	19,683,621.84	115.83
81	000425	徐工机械	19,201,282.00	112.99
82	601231	环旭电子	19,069,756.00	112.22
83	000521	长虹美菱	19,056,573.00	112.14
84	000401	冀东水泥	19,020,605.44	111.93
85	300763	锦浪科技	18,934,106.85	111.42
86	300144	宋城演艺	18,878,116.48	111.09
87	600559	老白干酒	18,665,001.00	109.84
88	000858	五粮液	18,582,392.13	109.35
89	002299	圣农发展	18,454,408.68	108.60
90	002155	湖南黄金	18,410,891.00	108.34
91	600732	爱旭股份	18,401,805.00	108.29
92	600583	海油工程	18,226,980.69	107.26
93	002461	珠江啤酒	17,547,395.90	103.26
94	300346	南大光电	17,233,608.20	101.41
95	002372	伟星新材	17,076,208.60	100.49
96	600096	云天化	16,882,639.00	99.35
97	688777	中控技术	16,790,402.06	98.81
98	601607	上海医药	16,775,536.00	98.72
99	601006	大秦铁路	16,770,594.86	98.69
100	600346	恒力石化	16,708,694.00	98.33
101	600054	黄山旅游	16,611,094.00	97.75
102	300666	江丰电子	16,533,765.32	97.30
103	600064	南京高科	16,470,708.00	96.92
104	600871	石化油服	16,416,989.60	96.61

105	002664	信质集团	16,395,196.00	96.48
106	603612	索通发展	16,282,135.00	95.82
107	002085	万丰奥威	16,046,768.00	94.43
108	600367	红星发展	16,010,243.40	94.22
109	000921	海信家电	16,000,567.00	94.16
110	600971	恒源煤电	15,712,108.20	92.46
111	000913	钱江摩托	15,577,582.16	91.67
112	002675	东诚药业	15,059,553.52	88.62
113	600158	中体产业	14,947,107.40	87.96
114	601001	晋控煤业	14,822,307.00	87.22
115	600161	天坛生物	14,638,077.40	86.14
116	300699	光威复材	14,595,299.52	85.89
117	603227	雪峰科技	14,501,673.00	85.34
118	601800	中国交建	14,486,474.12	85.25
119	688390	固德威	14,349,098.91	84.44
120	600153	建发股份	14,237,369.84	83.78
121	002032	苏泊尔	14,095,271.00	82.95
122	002560	通达股份	14,092,827.00	82.93
123	688126	沪硅产业	14,051,851.45	82.69
124	002533	金杯电工	14,033,771.50	82.58
125	000063	中兴通讯	13,992,301.00	82.34
126	603085	天成自控	13,831,704.74	81.40
127	600893	航发动力	13,828,623.00	81.38
128	300194	福安药业	13,816,352.00	81.30
129	002738	中矿资源	13,743,432.58	80.88
130	002851	麦格米特	13,689,945.73	80.56
131	600129	太极集团	13,595,993.00	80.01
132	002068	黑猫股份	13,435,117.00	79.06
133	000738	航发控制	13,423,567.82	78.99
134	688123	聚辰股份	13,394,989.36	78.83
135	000821	京山轻机	13,373,701.00	78.70
136	000906	浙商中拓	13,251,109.00	77.98
137	601666	平煤股份	13,235,253.60	77.89
138	601728	中国电信	13,149,766.96	77.38
139	600577	精达股份	13,122,256.00	77.22
140	002123	梦网科技	13,024,640.55	76.65
141	605499	东鹏饮料	12,943,760.00	76.17
142	002536	飞龙股份	12,924,325.05	76.06
143	002338	奥普光电	12,838,737.00	75.55
144	603086	先达股份	12,771,860.60	75.16
145	600521	华海药业	12,755,495.77	75.06
146	600789	鲁抗医药	12,721,451.00	74.86
147	600309	万华化学	12,521,911.00	73.69

148	600170	上海建工	12,336,649.00	72.60
149	600115	中国东航	12,267,014.00	72.19
150	603688	石英股份	12,180,799.00	71.68
151	688063	派能科技	12,142,921.66	71.46
152	002422	科伦药业	12,007,946.00	70.66
153	603517	绝味食品	11,954,759.60	70.35
154	603613	国联股份	11,915,272.90	70.12
155	300777	中简科技	11,855,854.00	69.77
156	600325	华发股份	11,829,075.52	69.61
157	600211	西藏药业	11,680,848.00	68.74
158	002865	钧达股份	11,660,162.00	68.62
159	000902	新洋丰	11,488,294.73	67.60
160	603456	九洲药业	11,319,200.02	66.61
161	603833	欧派家居	11,285,661.75	66.41
162	300596	利安隆	11,279,602.20	66.38
163	000768	中航西飞	11,263,131.00	66.28
164	603527	众源新材	11,017,061.00	64.83
165	002497	雅化集团	10,975,715.00	64.59
166	300397	天和防务	10,961,418.00	64.50
167	600522	中天科技	10,832,622.00	63.75
168	002131	利欧股份	10,801,710.00	63.56
169	300657	弘信电子	10,774,101.00	63.40
170	000028	国药一致	10,657,713.64	62.72
171	002746	仙坛股份	10,637,451.82	62.60
172	605507	国邦医药	10,565,250.00	62.17
173	002297	博云新材	10,531,019.00	61.97
174	002413	雷科防务	10,494,212.00	61.76
175	603505	金石资源	10,448,188.00	61.48
176	600667	太极实业	10,232,624.04	60.22
177	300639	凯普生物	10,127,621.00	59.60
178	600118	中国卫星	10,120,169.00	59.55
179	601567	三星医疗	10,083,038.36	59.34
180	603897	长城科技	10,076,599.00	59.30
181	000541	佛山照明	10,064,836.00	59.23
182	002468	申通快递	10,010,574.00	58.91
183	300328	宜安科技	9,974,591.00	58.70
184	002655	共达电声	9,973,332.00	58.69
185	300115	长盈精密	9,969,391.00	58.67
186	600827	百联股份	9,959,319.50	58.61
187	300238	冠昊生物	9,854,107.00	57.99
188	002399	海普瑞	9,803,826.00	57.69
189	300068	南都电源	9,779,695.00	57.55
190	600481	双良节能	9,761,743.00	57.44

191	000792	盐湖股份	9,744,930.00	57.35
192	688556	高测股份	9,695,850.87	57.06
193	603787	新日股份	9,587,624.00	56.42
194	300043	星辉娱乐	9,585,179.00	56.41
195	601965	中国汽研	9,583,119.00	56.39
196	300487	蓝晓科技	9,580,963.58	56.38
197	300647	超频三	9,559,604.00	56.26
198	000869	张裕 A	9,532,005.20	56.09
199	600098	广州发展	9,514,096.00	55.99
200	000717	中南股份	9,478,093.00	55.78
201	300427	红相股份	9,452,528.20	55.63
202	300751	迈为股份	9,365,977.96	55.12
203	002697	红旗连锁	9,323,424.11	54.87
204	603396	金辰股份	9,313,449.00	54.81
205	605366	宏柏新材	9,312,790.40	54.80
206	603118	共进股份	9,308,006.20	54.77
207	688678	福立旺	9,306,967.42	54.77
208	600048	保利发展	9,302,076.00	54.74
209	688377	迪威尔	9,290,948.78	54.67
210	300395	菲利华	9,287,784.20	54.66
211	002244	滨江集团	9,243,312.00	54.39
212	688520	神州细胞	9,237,393.30	54.36
213	002030	达安基因	9,208,888.00	54.19
214	600573	惠泉啤酒	9,151,716.00	53.85
215	002906	华阳集团	9,150,843.87	53.85
216	603078	江化微	9,134,179.00	53.75
217	000710	贝瑞基因	9,118,462.00	53.66
218	605208	永茂泰	9,104,805.50	53.58
219	003022	联泓新科	9,018,066.00	53.07
220	000733	振华科技	8,965,263.00	52.76
221	000810	创维数字	8,953,978.00	52.69
222	300842	帝科股份	8,924,006.94	52.51
223	688072	拓荆科技	8,921,920.98	52.50
224	300041	回天新材	8,906,392.00	52.41
225	002046	国机精工	8,863,730.00	52.16
226	688819	天能股份	8,858,990.17	52.13
227	002101	广东鸿图	8,824,625.00	51.93
228	300298	三诺生物	8,697,651.00	51.18
229	603868	飞科电器	8,665,084.00	50.99
230	002003	伟星股份	8,632,452.70	50.80
231	600879	航天电子	8,497,351.00	50.00
232	600207	安彩高科	8,409,434.00	49.49
233	688019	安集科技	8,275,820.52	48.70

234	603997	继峰股份	8,265,584.50	48.64
235	002782	可立克	8,243,909.00	48.51
236	603596	伯特利	8,226,675.00	48.41
237	600887	伊利股份	8,223,788.05	48.39
238	601816	京沪高铁	8,220,589.00	48.38
239	688668	鼎通科技	8,208,575.00	48.30
240	603858	步长制药	8,199,992.00	48.25
241	603528	多伦科技	8,164,265.50	48.04
242	603327	福蓉科技	8,161,052.50	48.03
243	000400	许继电气	8,103,559.00	47.69
244	600660	福耀玻璃	8,078,561.00	47.54
245	002045	国光电器	8,041,364.93	47.32
246	300776	帝尔激光	8,020,609.20	47.20
247	601390	中国中铁	8,018,451.74	47.19
248	300607	拓斯达	8,005,869.00	47.11
249	600511	国药股份	7,996,641.00	47.06
250	600688	上海石化	7,830,600.00	46.08
251	000009	中国宝安	7,734,161.13	45.51
252	603730	岱美股份	7,660,782.62	45.08
253	002242	九阳股份	7,646,153.00	45.00
254	600449	宁夏建材	7,558,505.44	44.48
255	000825	太钢不锈	7,537,891.00	44.36
256	301050	雷电微力	7,485,489.88	44.05
257	300428	立中集团	7,470,567.60	43.96
258	688586	江航装备	7,462,746.08	43.92
259	603328	依顿电子	7,439,567.00	43.78
260	002192	融捷股份	7,387,452.00	43.47
261	600578	京能电力	7,381,138.00	43.44
262	600987	航民股份	7,343,640.00	43.21
263	600839	四川长虹	7,336,928.00	43.18
264	002733	雄韬股份	7,335,894.32	43.17
265	601618	中国中冶	7,328,114.00	43.12
266	600408	安泰集团	7,302,297.00	42.97
267	002051	中工国际	7,294,295.00	42.92
268	002409	雅克科技	7,232,453.00	42.56
269	600025	华能水电	7,216,112.00	42.46
270	688139	海尔生物	7,189,852.87	42.31
271	688070	纵横股份	7,173,111.77	42.21
272	600196	复星医药	7,168,456.00	42.18
273	603619	中曼石油	7,159,484.00	42.13
274	000519	中兵红箭	7,036,134.00	41.41
275	600403	大有能源	7,003,819.00	41.22
276	300856	科思股份	6,957,222.50	40.94

277	603606	东方电缆	6,921,895.00	40.73
278	003009	中天火箭	6,903,944.00	40.63
279	002081	金螳螂	6,901,627.00	40.61
280	002805	丰元股份	6,889,381.00	40.54
281	603185	上机数控	6,874,425.00	40.45
282	002334	英威腾	6,870,248.00	40.43
283	600307	酒钢宏兴	6,863,974.00	40.39
284	000970	中科三环	6,837,106.94	40.23
285	600039	四川路桥	6,822,681.00	40.15
286	301071	力量钻石	6,805,147.00	40.05
287	002273	水晶光电	6,798,951.00	40.01
288	601328	交通银行	6,774,714.00	39.87
289	000625	长安汽车	6,761,711.00	39.79
290	002169	智光电气	6,739,736.10	39.66
291	601988	中国银行	6,692,626.00	39.38
292	600535	天士力	6,594,530.00	38.81
293	300481	濮阳惠成	6,482,695.00	38.15
294	300705	九典制药	6,472,127.52	38.09
295	600810	神马股份	6,459,543.80	38.01
296	000778	新兴铸管	6,457,415.00	38.00
297	002897	意华股份	6,449,906.00	37.96
298	688268	华特气体	6,438,641.42	37.89
299	300236	上海新阳	6,419,338.00	37.78
300	300855	图南股份	6,416,525.00	37.76
301	688032	禾迈股份	6,401,125.33	37.67
302	600820	隧道股份	6,398,435.00	37.65
303	300719	安达维尔	6,334,926.00	37.28
304	002121	科陆电子	6,326,735.00	37.23
305	300873	海晨股份	6,273,039.00	36.91
306	688559	海目星	6,242,507.11	36.74
307	300586	美联新材	6,219,986.00	36.60
308	605128	上海沿浦	6,205,089.00	36.51
309	002275	桂林三金	6,154,024.00	36.21
310	600330	天通股份	6,114,023.00	35.98
311	300604	长川科技	6,089,179.07	35.83
312	688385	复旦微电	6,076,756.84	35.76
313	300684	中石科技	6,041,251.00	35.55
314	601702	华峰铝业	6,020,792.00	35.43
315	688567	孚能科技	5,957,522.96	35.06
316	300048	合康新能	5,955,863.00	35.05
317	002957	科瑞技术	5,938,317.00	34.95
318	301015	百洋医药	5,903,078.00	34.74
319	300660	江苏雷利	5,887,286.00	34.64

320	600565	迪马股份	5,887,219.00	34.64
321	000950	重药控股	5,823,664.00	34.27
322	002025	航天电器	5,808,084.00	34.18
323	600612	老凤祥	5,774,705.00	33.98
324	002698	博实股份	5,770,262.40	33.96
325	002788	鹭燕医药	5,738,549.00	33.77
326	603297	永新光学	5,732,856.00	33.74
327	300498	温氏股份	5,721,005.00	33.67
328	688161	威高骨科	5,670,944.62	33.37
329	603477	巨星农牧	5,643,720.00	33.21
330	002110	三钢闽光	5,640,088.50	33.19
331	601098	中南传媒	5,637,158.00	33.17
332	600236	桂冠电力	5,617,562.00	33.06
333	603386	骏亚科技	5,599,540.60	32.95
334	601298	青岛港	5,558,606.00	32.71
335	600016	民生银行	5,553,771.00	32.68
336	002078	太阳纸业	5,536,357.00	32.58
337	600900	长江电力	5,529,143.00	32.54
338	603826	坤彩科技	5,527,553.00	32.53
339	300149	睿智医药	5,513,812.00	32.45
340	002324	普利特	5,504,558.25	32.39
341	002182	云海金属	5,493,229.80	32.33
342	600391	航发科技	5,492,013.00	32.32
343	688239	航宇科技	5,485,242.63	32.28
344	603439	贵州三力	5,471,377.00	32.20
345	603681	永冠新材	5,471,034.00	32.20
346	600282	南钢股份	5,467,121.00	32.17
347	603158	腾龙股份	5,456,016.56	32.11
348	002952	亚世光电	5,432,805.00	31.97
349	300691	联合光电	5,430,977.00	31.96
350	601126	四方股份	5,423,645.24	31.92
351	601818	光大银行	5,407,518.00	31.82
352	002462	嘉事堂	5,403,519.00	31.80
353	600397	安源煤业	5,393,249.00	31.74
354	600617	国新能源	5,392,745.00	31.73
355	600131	国网信通	5,357,513.00	31.53
356	001201	东瑞股份	5,345,315.00	31.46
357	301060	兰卫医学	5,244,998.15	30.87
358	688501	青达环保	5,243,420.64	30.86
359	000822	山东海化	5,242,797.00	30.85
360	300542	新晨科技	5,187,987.00	30.53
361	000887	中鼎股份	5,149,133.00	30.30
362	002384	东山精密	5,144,011.32	30.27

363	300142	沃森生物	5,140,978.00	30.25
364	600764	中国海防	5,038,434.00	29.65
365	600710	苏美达	5,002,782.00	29.44
366	300648	星云股份	5,000,741.00	29.43
367	688333	铂力特	4,984,555.91	29.33
368	600073	上海梅林	4,969,291.00	29.24
369	300662	科锐国际	4,951,631.00	29.14
370	600237	铜峰电子	4,928,468.00	29.00
371	601238	广汽集团	4,925,711.00	28.99
372	600438	通威股份	4,916,027.00	28.93
373	300890	翔丰华	4,898,747.00	28.83
374	000048	京基智农	4,882,983.00	28.73
375	603882	金域医学	4,856,641.00	28.58
376	600998	九州通	4,845,953.00	28.52
377	603348	文灿股份	4,825,390.00	28.40
378	300009	安科生物	4,776,381.22	28.11
379	002925	盈趣科技	4,732,722.02	27.85
380	601908	京运通	4,715,670.00	27.75
381	603611	诺力股份	4,711,814.00	27.73
382	300203	聚光科技	4,669,877.00	27.48
383	002139	拓邦股份	4,660,314.00	27.42
384	600062	华润双鹤	4,629,652.00	27.24
385	600528	中铁工业	4,622,116.00	27.20
386	601319	中国人保	4,588,694.00	27.00
387	600015	华夏银行	4,580,430.00	26.95
388	003816	中国广核	4,566,215.00	26.87
389	002705	新宝股份	4,539,351.00	26.71
390	002225	濮耐股份	4,526,607.00	26.64
391	603659	璞泰来	4,467,368.00	26.29
392	603939	益丰药房	4,453,843.00	26.21
393	601038	一拖股份	4,425,321.00	26.04
394	688499	利元亨	4,409,773.24	25.95
395	688399	硕世生物	4,371,343.27	25.72
396	002674	兴业科技	4,347,841.00	25.59
397	601872	招商轮船	4,338,251.00	25.53
398	300045	华力创通	4,337,155.00	25.52
399	600378	昊华科技	4,336,250.00	25.52
400	603050	科林电气	4,316,954.00	25.40
401	000726	鲁泰 A	4,307,687.00	25.35
402	300572	安车检测	4,305,852.00	25.34
403	002623	亚玛顿	4,294,677.00	25.27
404	300318	博晖创新	4,290,777.00	25.25
405	688711	宏微科技	4,236,728.52	24.93

406	002057	中钢天源	4,233,213.00	24.91
407	000553	安道麦 A	4,222,001.00	24.85
408	600956	新天绿能	4,220,169.00	24.83
409	000830	鲁西化工	4,202,312.00	24.73
410	601958	金钼股份	4,194,765.00	24.68
411	002099	海翔药业	4,186,762.00	24.64
412	002840	华统股份	4,172,411.00	24.55
413	002556	辉隆股份	4,155,491.00	24.45
414	600141	兴发集团	4,154,086.00	24.45
415	600713	南京医药	4,152,162.00	24.43
416	600179	安通控股	4,150,516.00	24.42
417	002423	中粮资本	4,148,368.11	24.41
418	300239	东宝生物	4,138,462.00	24.35
419	603223	恒通股份	4,133,559.60	24.32
420	300491	通合科技	4,132,743.42	24.32
421	300706	阿石创	4,105,089.00	24.16
422	002088	鲁阳节能	4,104,379.80	24.15
423	002876	三利谱	4,099,823.00	24.13
424	002669	康达新材	4,090,846.00	24.07
425	601928	凤凰传媒	4,089,752.30	24.07
426	600123	兰花科创	4,087,475.00	24.05
427	688028	沃尔德	4,069,864.57	23.95
428	002180	纳思达	4,048,331.90	23.82
429	688560	明冠新材	4,044,190.56	23.80
430	002810	山东赫达	4,010,120.00	23.60
431	300696	爱乐达	3,986,485.00	23.46
432	603906	龙蟠科技	3,971,428.00	23.37
433	000937	冀中能源	3,968,352.00	23.35
434	300765	新诺威	3,967,932.00	23.35
435	300003	乐普医疗	3,961,774.12	23.31
436	000045	深纺织 A	3,943,354.00	23.21
437	002311	海大集团	3,871,816.17	22.78
438	688261	东微半导	3,851,035.73	22.66
439	002487	大金重工	3,846,975.00	22.64
440	600500	中化国际	3,843,299.00	22.62
441	300676	华大基因	3,836,798.00	22.58
442	300396	迪瑞医疗	3,831,974.00	22.55
443	300290	荣科科技	3,830,030.00	22.54
444	000898	鞍钢股份	3,825,632.00	22.51
445	688020	方邦股份	3,775,789.69	22.22
446	300134	大富科技	3,771,345.00	22.19
447	600802	福建水泥	3,749,890.00	22.07
448	605108	同庆楼	3,684,988.40	21.68

449	002429	兆驰股份	3,674,039.00	21.62
450	603516	淳中科技	3,664,541.00	21.56
451	002518	科士达	3,654,540.00	21.51
452	000922	佳电股份	3,651,596.00	21.49
453	603979	金诚信	3,643,717.00	21.44
454	688609	九联科技	3,634,205.07	21.39
455	600699	均胜电子	3,612,586.00	21.26
456	600420	国药现代	3,587,315.00	21.11
457	600089	特变电工	3,580,519.29	21.07
458	603330	天洋新材	3,562,866.00	20.97
459	002128	电投能源	3,555,156.00	20.92
460	600395	盘江股份	3,539,907.00	20.83
461	300900	广联航空	3,532,716.00	20.79
462	601992	金隅集团	3,511,528.00	20.66
463	002302	西部建设	3,445,659.00	20.28
464	601899	紫金矿业	3,416,463.00	20.10
465	002270	华明装备	3,396,115.00	19.99
466	603800	道森股份	3,394,841.00	19.98
467	603305	旭升集团	3,385,056.00	19.92
468	688778	厦钨新能	3,371,372.92	19.84
469	600328	中盐化工	3,362,115.00	19.78
470	300520	科大国创	3,332,559.00	19.61
471	002562	兄弟科技	3,323,541.00	19.56
472	002312	川发龙蟒	3,314,217.00	19.50
473	600377	宁沪高速	3,310,367.00	19.48
474	300181	佐力药业	3,275,956.00	19.28
475	603197	保隆科技	3,266,737.00	19.22
476	600496	精工钢构	3,259,777.00	19.18
477	002116	中国海诚	3,241,691.00	19.08
478	603192	汇得科技	3,240,633.60	19.07
479	603639	海利尔	3,234,592.41	19.03
480	300894	火星号	3,226,196.00	18.99
481	600571	信雅达	3,221,060.00	18.95
482	000751	锌业股份	3,202,939.00	18.85
483	300305	裕兴股份	3,201,441.00	18.84
484	300479	神思电子	3,198,962.00	18.82
485	002132	恒星科技	3,185,401.00	18.75
486	300761	立华股份	3,162,453.00	18.61
487	002100	天康生物	3,141,501.00	18.49
488	603968	醋化股份	3,137,892.00	18.47
489	002783	凯龙股份	3,113,412.00	18.32
490	600114	东睦股份	3,109,900.00	18.30
491	300143	盈康生命	3,095,019.00	18.21

492	002444	巨星科技	3,038,736.00	17.88
493	002869	金溢科技	3,008,320.00	17.70
494	688099	晶晨股份	3,008,274.55	17.70
495	601998	中信银行	2,987,343.00	17.58
496	300565	科信技术	2,939,556.00	17.30
497	002458	益生股份	2,937,227.00	17.28
498	002340	格林美	2,917,748.00	17.17
499	603076	乐惠国际	2,913,399.00	17.14
500	300578	会畅通讯	2,908,008.00	17.11
501	600673	东阳光	2,889,875.00	17.01
502	002653	海思科	2,875,632.00	16.92
503	300212	易华录	2,867,938.00	16.88
504	688408	中信博	2,836,349.72	16.69
505	603313	梦百合	2,810,442.00	16.54
506	688366	昊海生科	2,803,714.94	16.50
507	688195	腾景科技	2,800,859.18	16.48
508	603421	鼎信通讯	2,792,304.00	16.43
509	600392	盛和资源	2,770,379.00	16.30
510	300624	万兴科技	2,767,383.40	16.29
511	000819	岳阳兴长	2,753,008.00	16.20
512	300602	飞荣达	2,749,876.00	16.18
513	688166	博瑞医药	2,739,468.93	16.12
514	601766	中国中车	2,735,106.00	16.10
515	300690	双一科技	2,683,467.00	15.79
516	605399	晨光新材	2,666,667.00	15.69
517	601658	邮储银行	2,625,193.00	15.45
518	300337	银邦股份	2,619,883.00	15.42
519	002714	牧原股份	2,604,894.00	15.33
520	600019	宝钢股份	2,596,812.00	15.28
521	603716	塞力医疗	2,579,605.00	15.18
522	000893	亚钾国际	2,552,761.00	15.02
523	603083	剑桥科技	2,548,540.00	15.00
524	300643	万通智控	2,538,764.00	14.94
525	002013	中航机电	2,497,029.00	14.69
526	300787	海能实业	2,484,805.00	14.62
527	603799	华友钴业	2,474,974.00	14.56
528	603529	爱玛科技	2,461,303.80	14.48
529	688700	东威科技	2,444,329.35	14.38
530	603993	洛阳钼业	2,427,986.00	14.29
531	300378	鼎捷软件	2,408,861.00	14.18
532	300568	星源材质	2,393,284.00	14.08
533	601003	柳钢股份	2,372,843.00	13.96
534	603595	东尼电子	2,372,775.00	13.96

535	688788	科思科技	2,357,783.45	13.87
536	600248	陕西建工	2,352,429.00	13.84
537	603599	广信股份	2,339,339.40	13.77
538	000090	天健集团	2,322,698.00	13.67
539	301030	仕净科技	2,317,386.00	13.64
540	002885	京泉华	2,316,186.00	13.63
541	688630	芯碁微装	2,316,058.12	13.63
542	603127	昭衍新药	2,310,198.00	13.59
543	300534	陇神戎发	2,308,568.00	13.59
544	600188	兖矿能源	2,266,599.82	13.34
545	300608	思特奇	2,262,153.58	13.31
546	002709	天赐材料	2,239,622.00	13.18
547	603938	三孚股份	2,229,869.00	13.12
548	000878	云南铜业	2,225,805.00	13.10
549	600939	重庆建工	2,222,409.00	13.08
550	002831	裕同科技	2,215,285.20	13.04
551	600616	金枫酒业	2,159,137.00	12.71
552	605123	派克新材	2,143,459.00	12.61
553	002611	东方精工	2,141,431.00	12.60
554	002472	双环传动	2,120,603.00	12.48
555	603558	健盛集团	2,065,767.00	12.16
556	300712	永福股份	2,040,287.00	12.01
557	603466	风语筑	2,027,279.06	11.93
558	688223	晶科能源	2,015,362.69	11.86
559	603856	东宏股份	2,009,254.00	11.82
560	601163	三角轮胎	2,003,351.00	11.79
561	603368	柳药集团	2,002,359.36	11.78
562	002421	达实智能	1,979,882.00	11.65
563	300432	富临精工	1,970,536.00	11.60
564	688022	瀚川智能	1,952,585.42	11.49
565	000657	中钨高新	1,934,944.00	11.39
566	300179	四方达	1,928,810.00	11.35
567	000498	山东路桥	1,881,524.00	11.07
568	601609	金田股份	1,865,322.00	10.98
569	002753	永东股份	1,853,660.00	10.91
570	002571	德力股份	1,847,543.00	10.87
571	600057	厦门象屿	1,840,049.00	10.83
572	300093	金刚光伏	1,839,356.00	10.82
573	600269	赣粤高速	1,829,667.00	10.77
574	600284	浦东建设	1,827,901.00	10.76
575	001205	盛航股份	1,823,632.00	10.73
576	000065	北方国际	1,819,471.00	10.71
577	600970	中材国际	1,815,609.43	10.68

578	688617	惠泰医疗	1,805,136.14	10.62
579	601512	中新集团	1,790,444.00	10.54
580	300750	宁德时代	1,781,223.00	10.48
581	002545	东方铁塔	1,766,986.00	10.40
582	300444	双杰电气	1,757,244.00	10.34
583	601137	博威合金	1,756,913.00	10.34
584	688589	力合微	1,751,044.40	10.30
585	002060	粤水电	1,677,634.00	9.87
586	601886	江河集团	1,662,204.00	9.78
587	002632	道明光学	1,650,876.00	9.71
588	002838	道恩股份	1,628,850.00	9.59
589	603728	鸣志电器	1,623,004.00	9.55
590	300373	扬杰科技	1,617,289.00	9.52
591	000552	靖远煤电	1,581,729.00	9.31
592	688017	绿的谐波	1,580,081.66	9.30
593	300125	聆达股份	1,570,723.00	9.24
594	603179	新泉股份	1,563,051.00	9.20
595	601339	百隆东方	1,557,787.00	9.17
596	603628	清源股份	1,551,048.00	9.13
597	600489	中金黄金	1,545,076.00	9.09
598	600383	金地集团	1,515,712.00	8.92
599	002855	捷荣技术	1,476,330.00	8.69
600	688516	奥特维	1,451,530.17	8.54
601	003043	华亚智能	1,449,849.00	8.53
602	000707	双环科技	1,430,609.99	8.42
603	002895	川恒股份	1,410,602.00	8.30
604	002346	柘中股份	1,405,318.00	8.27
605	603089	正裕工业	1,405,132.00	8.27
606	688196	卓越新能	1,397,980.44	8.23
607	002937	兴瑞科技	1,377,150.00	8.10
608	300870	欧陆通	1,374,802.56	8.09
609	600184	光电股份	1,366,956.00	8.04
610	688138	清溢光电	1,360,495.29	8.01
611	002036	联创电子	1,358,856.00	8.00
612	002825	纳尔股份	1,353,304.00	7.96
613	300769	德方纳米	1,346,896.00	7.93
614	000877	天山股份	1,340,537.00	7.89
615	000883	湖北能源	1,340,447.00	7.89
616	002434	万里扬	1,320,661.00	7.77
617	300258	精锻科技	1,318,325.00	7.76
618	603335	迪生力	1,312,913.00	7.73
619	002768	国恩股份	1,279,170.00	7.53
620	605296	神农集团	1,263,031.00	7.43

621	603815	交建股份	1,260,916.00	7.42
622	300347	泰格医药	1,260,080.00	7.42
623	300286	安科瑞	1,240,308.00	7.30
624	002643	万润股份	1,234,523.00	7.26
625	300700	岱勒新材	1,222,876.00	7.20
626	300452	山河药辅	1,221,811.50	7.19
627	002597	金禾实业	1,203,249.00	7.08
628	300131	英唐智控	1,203,097.00	7.08
629	603605	珀莱雅	1,200,578.00	7.07
630	600486	扬农化工	1,196,610.00	7.04
631	002376	新北洋	1,195,277.00	7.03
632	600499	科达制造	1,184,678.00	6.97
633	603920	世运电路	1,179,212.00	6.94
634	688301	奕瑞科技	1,159,849.96	6.83
635	000517	荣安地产	1,154,832.00	6.80
636	300382	斯莱克	1,139,930.00	6.71
637	600111	北方稀土	1,133,165.00	6.67
638	002866	传艺科技	1,128,722.00	6.64
639	300464	星徽股份	1,126,961.00	6.63
640	601166	兴业银行	1,126,725.00	6.63
641	002902	铭普光磁	1,108,189.00	6.52
642	000831	中国稀土	1,094,640.00	6.44
643	603315	福鞍股份	1,092,042.00	6.43
644	600933	爱柯迪	1,091,055.00	6.42
645	002922	伊戈尔	1,089,939.00	6.41
646	600487	亨通光电	1,082,210.00	6.37
647	688981	中芯国际	1,080,454.00	6.36
648	002120	韵达股份	1,073,365.66	6.32
649	600929	雪天盐业	1,072,203.00	6.31
650	688091	上海谊众	1,058,833.05	6.23
651	300681	英搏尔	1,044,046.00	6.14
652	601877	正泰电器	1,043,950.00	6.14
653	000709	河钢股份	1,035,853.00	6.10
654	688005	容百科技	1,034,957.46	6.09
655	002812	恩捷股份	1,034,934.00	6.09
656	603108	润达医疗	997,080.00	5.87
657	002250	联化科技	969,613.00	5.71
658	300219	鸿利智汇	953,171.00	5.61
659	603806	福斯特	950,102.20	5.59
660	605183	确成股份	948,962.00	5.58
661	600063	皖维高新	946,769.00	5.57
662	300902	国安达	944,054.00	5.56
663	300725	药石科技	940,732.00	5.54

664	300928	华安鑫创	932,588.00	5.49
665	002041	登海种业	924,478.00	5.44
666	002042	华孚时尚	908,438.00	5.35
667	688033	天宜上佳	888,325.30	5.23
668	688103	国力股份	888,172.95	5.23
669	688258	卓易信息	876,512.62	5.16
670	600853	龙建股份	867,144.00	5.10
671	600071	凤凰光学	855,797.00	5.04
672	000301	东方盛虹	845,322.00	4.97
673	688303	大全能源	832,208.62	4.90
674	002475	立讯精密	810,882.00	4.77
675	000629	钒钛股份	785,833.00	4.62
676	688800	瑞可达	781,848.22	4.60
677	688550	瑞联新材	779,320.74	4.59
678	600702	舍得酒业	767,254.00	4.52
679	300661	圣邦股份	765,481.00	4.50
680	688578	艾力斯	754,557.94	4.44
681	600389	江山股份	746,219.00	4.39
682	002731	萃华珠宝	744,771.00	4.38
683	002074	国轩高科	741,315.00	4.36
684	688008	澜起科技	740,505.51	4.36
685	600225	卓朗科技	734,243.00	4.32
686	002170	芭田股份	727,042.00	4.28
687	002258	利尔化学	716,234.00	4.21
688	002055	得润电子	700,438.00	4.12
689	300581	晨曦航空	699,564.00	4.12
690	002821	凯莱英	696,826.00	4.10
691	000567	海德股份	692,496.00	4.08
692	300332	天壕环境	686,406.00	4.04
693	002761	浙江建投	683,979.00	4.02
694	000703	恒逸石化	682,574.00	4.02
695	600463	空港股份	663,730.00	3.91
696	300861	美畅股份	653,908.00	3.85
697	600259	广晟有色	648,697.00	3.82
698	002446	盛路通信	641,224.00	3.77
699	300316	晶盛机电	633,981.00	3.73
700	600448	华纺股份	624,043.00	3.67
701	002271	东方雨虹	617,637.00	3.63
702	600313	农发种业	604,926.00	3.56
703	603768	常青股份	604,009.00	3.55
704	688475	萤石网络	590,533.02	3.48
705	601718	际华集团	584,563.00	3.44
706	688598	金博股份	580,005.93	3.41

707	002850	科达利	579,543.00	3.41
708	300085	银之杰	578,470.00	3.40
709	688388	嘉元科技	575,717.30	3.39
710	002407	多氟多	557,489.00	3.28
711	600233	圆通速递	550,764.00	3.24
712	603737	三棵树	547,781.00	3.22
713	002986	宇新股份	537,447.60	3.16
714	002959	小熊电器	536,270.00	3.16
715	002291	遥望科技	533,723.00	3.14
716	000895	双汇发展	517,464.00	3.05
717	600989	宝丰能源	499,699.00	2.94
718	002011	盾安环境	496,498.00	2.92
719	002996	顺博合金	473,326.00	2.79
720	002909	集泰股份	466,998.00	2.75
721	002971	和远气体	456,497.00	2.69
722	600869	远东股份	445,139.00	2.62
723	603299	苏盐井神	444,597.00	2.62
724	300802	矩子科技	443,080.00	2.61
725	002572	索菲亚	441,315.00	2.60
726	002578	闽发铝业	438,348.00	2.58
727	688266	泽璟制药	437,567.45	2.57
728	002829	星网宇达	436,920.00	2.57
729	688298	东方生物	430,102.44	2.53
730	002807	江阴银行	429,834.00	2.53
731	601933	永辉超市	429,236.00	2.53
732	603609	禾丰股份	424,835.50	2.50
733	300745	欣锐科技	422,196.00	2.48
734	688521	芯原股份	420,327.34	2.47
735	688116	天奈科技	416,302.28	2.45
736	688680	海优新材	411,621.52	2.42
737	603359	东珠生态	388,814.58	2.29
738	603508	思维列控	387,124.00	2.28
739	688141	杰华特	380,533.96	2.24
740	300118	东方日升	379,804.00	2.24
741	301356	天振股份	378,567.00	2.23
742	002241	歌尔股份	368,693.00	2.17
743	002344	海宁皮城	363,522.00	2.14
744	688503	聚和材料	360,470.00	2.12
745	603236	移远通信	358,985.88	2.11
746	300820	英杰电气	355,668.00	2.09

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601668	中国建筑	33,991,527.00	200.03
2	002460	赣锋锂业	30,630,361.25	180.25
3	600549	厦门钨业	30,382,125.60	178.79
4	002466	天齐锂业	29,287,819.35	172.35
5	688599	天合光能	28,353,423.71	166.85
6	002459	晶澳科技	28,221,539.00	166.07
7	601186	中国铁建	27,226,753.00	160.22
8	600985	淮北矿业	26,943,730.00	158.56
9	002176	江特电机	26,606,309.55	156.57
10	601669	中国电建	26,485,521.04	155.86
11	002371	北方华创	26,185,383.00	154.09
12	601898	中煤能源	25,855,207.52	152.15
13	601088	中国神华	25,828,810.10	151.99
14	000933	神火股份	25,332,735.00	149.07
15	600600	青岛啤酒	24,773,231.33	145.78
16	600508	上海能源	24,593,162.20	144.72
17	000983	山西焦煤	24,432,263.00	143.78
18	600256	广汇能源	24,148,837.00	142.11
19	000596	古井贡酒	23,469,070.64	138.11
20	601919	中远海控	23,279,834.20	136.99
21	300724	捷佳伟创	23,196,629.66	136.50
22	600938	中国海油	23,014,142.34	135.43
23	601288	农业银行	22,967,544.00	135.16
24	002050	三花智控	22,838,344.80	134.40
25	002920	德赛西威	22,828,494.93	134.34
26	600968	海油发展	22,797,649.00	134.16
27	000762	西藏矿业	22,789,532.64	134.11
28	603259	药明康德	22,783,972.96	134.08
29	002056	横店东磁	22,511,456.00	132.47
30	603345	安井食品	22,467,987.26	132.22
31	600348	华阳股份	22,169,041.00	130.46
32	600502	安徽建工	22,130,368.00	130.23
33	300331	苏大维格	22,034,615.33	129.67
34	002756	永兴材料	21,440,698.32	126.17
35	600546	山煤国际	21,413,303.00	126.01
36	600160	巨化股份	21,115,888.11	124.26
37	601975	招商南油	21,052,732.00	123.89
38	600027	华电国际	20,807,124.00	122.44
39	002240	盛新锂能	20,791,451.35	122.35
40	601689	拓普集团	20,553,057.62	120.95
41	300760	迈瑞医疗	20,403,555.00	120.07
42	600997	开滦股份	20,115,966.00	118.38

43	300014	亿纬锂能	19,135,854.00	112.61
44	600026	中远海能	19,122,813.00	112.53
45	300346	南大光电	18,462,963.65	108.65
46	300438	鹏辉能源	18,098,311.10	106.50
47	002594	比亚迪	17,788,109.34	104.68
48	002155	湖南黄金	17,670,027.00	103.98
49	600096	云天化	17,531,211.00	103.17
50	688123	聚辰股份	17,126,649.03	100.78
51	300763	锦浪科技	17,088,327.79	100.56
52	601607	上海医药	16,991,959.01	99.99
53	601006	大秦铁路	16,938,256.47	99.68
54	002664	信质集团	16,926,368.00	99.61
55	600919	江苏银行	16,472,539.00	96.94
56	600199	金种子酒	16,395,826.00	96.48
57	601800	中国交建	16,199,950.94	95.33
58	600161	天坛生物	15,940,826.00	93.81
59	603612	索通发展	15,754,184.53	92.71
60	600971	恒源煤电	15,391,590.80	90.57
61	300666	江丰电子	15,346,165.18	90.31
62	601001	晋控煤业	15,335,328.00	90.24
63	300194	福安药业	14,908,540.58	87.73
64	002493	荣盛石化	14,891,406.00	87.63
65	000063	中兴通讯	14,701,640.00	86.51
66	601699	潞安环能	14,701,586.39	86.51
67	688126	沪硅产业	14,657,084.87	86.25
68	000821	京山轻机	14,591,300.00	85.87
69	002675	东诚药业	14,465,708.64	85.13
70	603085	天成自控	14,380,833.50	84.63
71	600893	航发动力	14,378,793.28	84.61
72	300274	阳光电源	14,174,353.28	83.41
73	688390	固德威	14,140,121.82	83.21
74	603227	雪峰科技	13,986,715.00	82.31
75	002533	金杯电工	13,641,706.50	80.28
76	601666	平煤股份	13,525,048.27	79.59
77	600789	鲁抗医药	13,419,079.98	78.97
78	002123	梦网科技	13,393,487.14	78.82
79	300699	光威复材	13,391,818.40	78.81
80	000738	航发控制	13,312,954.28	78.34
81	002560	通达股份	13,274,416.00	78.12
82	605117	德业股份	13,020,089.00	76.62
83	002068	黑猫股份	12,958,185.85	76.25
84	002738	中矿资源	12,916,020.81	76.01
85	600577	精达股份	12,809,975.00	75.38

86	603688	石英股份	12,737,640.12	74.96
87	600309	万华化学	12,532,549.89	73.75
88	603517	绝味食品	12,487,436.15	73.48
89	000521	长虹美菱	12,464,826.00	73.35
90	600521	华海药业	12,417,739.74	73.07
91	603086	先达股份	12,359,987.22	72.73
92	600732	爱旭股份	12,355,882.25	72.71
93	002338	奥普光电	12,296,880.00	72.36
94	600129	太极集团	12,142,335.00	71.45
95	002851	麦格米特	12,042,343.41	70.87
96	000028	国药一致	11,710,177.02	68.91
97	002422	科伦药业	11,681,847.28	68.74
98	600211	西藏药业	11,678,772.12	68.73
99	300777	中简科技	11,650,871.00	68.56
100	600367	红星发展	11,630,314.51	68.44
101	002865	钧达股份	11,468,106.96	67.49
102	600522	中天科技	11,360,611.00	66.85
103	300657	弘信电子	11,207,748.00	65.95
104	300397	天和防务	11,141,867.00	65.57
105	002468	申通快递	11,056,683.00	65.06
106	600325	华发股份	11,034,825.88	64.94
107	000768	中航西飞	10,960,754.83	64.50
108	603456	九洲药业	10,861,138.40	63.91
109	603613	国联股份	10,796,857.33	63.54
110	000902	新洋丰	10,743,831.08	63.22
111	002297	博云新材	10,699,161.00	62.96
112	688063	派能科技	10,671,659.81	62.80
113	002497	雅化集团	10,622,996.00	62.51
114	002413	雷科防务	10,541,965.00	62.04
115	600481	双良节能	10,465,908.52	61.59
116	000401	冀东水泥	10,397,715.00	61.19
117	002655	共达电声	10,309,903.00	60.67
118	002131	利欧股份	10,241,126.00	60.27
119	600118	中国卫星	10,135,572.00	59.64
120	603078	江化微	9,922,628.70	58.39
121	300647	超频三	9,861,030.00	58.03
122	600028	中国石化	9,818,671.00	57.78
123	605507	国邦医药	9,689,084.00	57.02
124	605366	宏柏新材	9,679,332.00	56.96
125	603858	步长制药	9,642,845.67	56.75
126	601567	三星医疗	9,610,278.82	56.55
127	600048	保利发展	9,565,526.00	56.29
128	688556	高测股份	9,537,757.56	56.13

129	000400	许继电气	9,535,177.00	56.11
130	001979	招商蛇口	9,494,937.00	55.87
131	300115	长盈精密	9,441,079.00	55.56
132	000651	格力电器	9,439,046.00	55.55
133	300328	宜安科技	9,413,239.00	55.39
134	600098	广州发展	9,366,752.00	55.12
135	300068	南都电源	9,358,622.10	55.07
136	603505	金石资源	9,355,043.00	55.05
137	000792	盐湖股份	9,351,546.07	55.03
138	688678	福立旺	9,346,186.36	55.00
139	002399	海普瑞	9,343,199.00	54.98
140	601857	中国石油	9,315,150.00	54.82
141	000710	贝瑞基因	9,300,436.00	54.73
142	300395	菲利华	9,296,652.30	54.71
143	300238	冠昊生物	9,264,410.00	54.52
144	603897	长城科技	9,122,468.00	53.68
145	600754	锦江酒店	9,112,970.00	53.63
146	300487	蓝晓科技	9,047,253.98	53.24
147	300639	凯普生物	9,035,276.10	53.17
148	300842	帝科股份	9,029,431.00	53.14
149	603396	金辰股份	8,939,477.61	52.61
150	603868	飞科电器	8,929,664.81	52.55
151	600879	航天电子	8,874,817.00	52.23
152	002101	广东鸿图	8,870,440.00	52.20
153	603658	安图生物	8,860,444.00	52.14
154	002003	伟星股份	8,851,272.40	52.09
155	002046	国机精工	8,824,505.00	51.93
156	603997	继峰股份	8,790,379.00	51.73
157	002782	可立克	8,768,669.00	51.60
158	600690	海尔智家	8,669,529.42	51.02
159	603327	福蓉科技	8,518,897.70	50.13
160	002030	达安基因	8,471,703.40	49.85
161	000009	中国宝安	8,462,893.49	49.80
162	300751	迈为股份	8,415,491.36	49.52
163	600660	福耀玻璃	8,391,926.50	49.38
164	600207	安彩高科	8,276,556.00	48.70
165	000810	创维数字	8,230,841.60	48.44
166	300298	三诺生物	8,221,002.00	48.38
167	601808	中海油服	8,212,817.00	48.33
168	603596	伯特利	8,181,972.77	48.15
169	000733	振华科技	8,159,975.00	48.02
170	300041	回天新材	8,148,620.00	47.95
171	600511	国药股份	8,045,162.00	47.34

172	301050	雷电微力	8,032,917.40	47.27
173	688072	拓荆科技	7,971,578.28	46.91
174	300428	立中集团	7,935,672.00	46.70
175	601225	陕西煤业	7,904,042.11	46.51
176	688586	江航装备	7,868,787.79	46.31
177	600346	恒力石化	7,838,788.60	46.13
178	688019	安集科技	7,810,028.05	45.96
179	605208	永茂泰	7,802,907.00	45.92
180	601390	中国中铁	7,684,790.09	45.22
181	002906	华阳集团	7,672,389.66	45.15
182	000541	佛山照明	7,606,982.00	44.76
183	688668	鼎通科技	7,594,372.67	44.69
184	000825	太钢不锈	7,583,369.00	44.63
185	603606	东方电缆	7,536,005.00	44.35
186	600196	复星医药	7,532,211.00	44.32
187	600449	宁夏建材	7,498,240.14	44.12
188	003022	联泓新科	7,405,991.74	43.58
189	600987	航民股份	7,396,677.00	43.53
190	601618	中国中冶	7,347,933.00	43.24
191	688377	迪威尔	7,283,954.68	42.86
192	603619	中曼石油	7,216,619.00	42.47
193	003009	中天火箭	7,142,218.00	42.03
194	600025	华能水电	7,135,408.00	41.99
195	002733	雄韬股份	7,033,971.36	41.39
196	002334	英威腾	7,028,207.06	41.36
197	600403	大有能源	6,992,572.00	41.15
198	002273	水晶光电	6,934,006.00	40.80
199	301035	润丰股份	6,914,468.00	40.69
200	002192	融捷股份	6,907,637.00	40.65
201	300144	宋城演艺	6,820,253.00	40.13
202	002051	中工国际	6,816,793.00	40.11
203	600535	天士力	6,814,118.00	40.10
204	603328	依顿电子	6,812,839.50	40.09
205	601328	交通银行	6,800,504.00	40.02
206	000970	中科三环	6,783,320.21	39.92
207	600039	四川路桥	6,756,164.00	39.76
208	603185	上机数控	6,746,934.00	39.70
209	600330	天通股份	6,743,228.00	39.68
210	000625	长安汽车	6,736,651.00	39.64
211	002805	丰元股份	6,731,832.00	39.61
212	600307	酒钢宏兴	6,729,110.00	39.60
213	601988	中国银行	6,711,061.00	39.49
214	603527	众源新材	6,706,194.00	39.46

215	002121	科陆电子	6,699,958.00	39.43
216	000519	中兵红箭	6,650,254.88	39.13
217	300236	上海新阳	6,623,758.00	38.98
218	002081	金螳螂	6,618,600.75	38.95
219	000778	新兴铸管	6,544,212.00	38.51
220	600578	京能电力	6,502,322.00	38.26
221	300586	美联新材	6,502,020.00	38.26
222	600810	神马股份	6,476,191.20	38.11
223	600131	国网信通	6,453,414.00	37.98
224	002275	桂林三金	6,446,991.00	37.94
225	688559	海目星	6,403,212.03	37.68
226	300873	海晨股份	6,387,988.80	37.59
227	002032	苏泊尔	6,372,398.00	37.50
228	300719	安达维尔	6,328,543.04	37.24
229	600820	隧道股份	6,326,341.00	37.23
230	300705	九典制药	6,285,655.00	36.99
231	300604	长川科技	6,276,808.29	36.94
232	603439	贵州三力	6,207,859.10	36.53
233	002409	雅克科技	6,207,401.00	36.53
234	300776	帝尔激光	6,206,558.00	36.52
235	688139	海尔生物	6,198,477.67	36.48
236	002462	嘉事堂	6,193,812.00	36.45
237	688385	复旦微电	6,187,024.51	36.41
238	300855	图南股份	6,172,196.50	36.32
239	002788	鹭燕医药	6,167,581.48	36.29
240	300684	中石科技	6,133,584.00	36.09
241	688070	纵横股份	6,122,633.70	36.03
242	605128	上海沿浦	6,118,052.00	36.00
243	601702	华峰铝业	6,107,978.00	35.94
244	002025	航天电器	6,101,835.00	35.91
245	002169	智光电气	6,088,333.05	35.83
246	300856	科思股份	6,026,664.40	35.46
247	000950	重药控股	6,012,061.00	35.38
248	603787	新日股份	5,998,768.00	35.30
249	600839	四川长虹	5,987,612.00	35.24
250	688032	禾迈股份	5,963,102.18	35.09
251	300542	新晨科技	5,908,523.20	34.77
252	688268	华特气体	5,901,268.70	34.73
253	301071	力量钻石	5,873,868.00	34.57
254	601126	四方股份	5,784,354.64	34.04
255	603528	多伦科技	5,778,469.00	34.00
256	601098	中南传媒	5,765,499.00	33.93
257	301015	百洋医药	5,748,089.00	33.83

258	688161	威高骨科	5,735,380.71	33.75
259	601009	南京银行	5,725,032.00	33.69
260	600391	航发科技	5,700,791.00	33.55
261	603386	骏亚科技	5,691,621.80	33.49
262	002957	科瑞技术	5,681,232.30	33.43
263	600795	国电电力	5,670,716.00	33.37
264	300481	濮阳惠成	5,669,586.00	33.36
265	300660	江苏雷利	5,668,594.00	33.36
266	300149	睿智医药	5,652,248.00	33.26
267	601298	青岛港	5,645,706.00	33.22
268	603681	永冠新材	5,641,585.68	33.20
269	601818	光大银行	5,621,212.00	33.08
270	600617	国新能源	5,621,112.00	33.08
271	300691	联合光电	5,582,321.00	32.85
272	600565	迪马股份	5,575,950.00	32.81
273	300048	合康新能	5,558,255.00	32.71
274	000822	山东海化	5,531,221.00	32.55
275	688239	航宇科技	5,528,309.32	32.53
276	600900	长江电力	5,526,125.00	32.52
277	688567	孚能科技	5,504,636.28	32.39
278	002182	云海金属	5,488,394.68	32.30
279	600064	南京高科	5,470,882.00	32.19
280	002536	飞龙股份	5,445,911.00	32.05
281	603297	永新光学	5,438,592.75	32.00
282	600016	民生银行	5,426,935.00	31.94
283	002897	意华股份	5,368,028.84	31.59
284	600282	南钢股份	5,354,181.00	31.51
285	301060	兰卫医学	5,324,476.20	31.33
286	600236	桂冠电力	5,315,163.00	31.28
287	600062	华润双鹤	5,301,674.72	31.20
288	300142	沃森生物	5,298,478.00	31.18
289	688711	宏微科技	5,294,732.77	31.16
290	600153	建发股份	5,283,893.00	31.09
291	002078	太阳纸业	5,282,931.00	31.09
292	300498	温氏股份	5,246,239.00	30.87
293	001201	东瑞股份	5,242,931.00	30.85
294	600408	安泰集团	5,222,056.00	30.73
295	002324	普利特	5,188,382.51	30.53
296	600397	安源煤业	5,170,819.00	30.43
297	603158	腾龙股份	5,167,757.68	30.41
298	000887	中鼎股份	5,107,623.00	30.06
299	600073	上海梅林	5,098,747.00	30.00
300	600710	苏美达	5,088,829.00	29.95

301	002304	洋河股份	5,085,951.00	29.93
302	600764	中国海防	5,084,559.00	29.92
303	300662	科锐国际	5,064,783.00	29.80
304	600998	九州通	5,062,024.77	29.79
305	002698	博实股份	4,998,932.50	29.42
306	000568	泸州老窖	4,994,417.00	29.39
307	002110	三钢闽光	4,981,740.00	29.32
308	600237	铜峰电子	4,970,675.00	29.25
309	300491	通合科技	4,968,031.34	29.24
310	601138	工业富联	4,951,986.66	29.14
311	603477	巨星农牧	4,931,003.26	29.02
312	300203	聚光科技	4,903,981.95	28.86
313	002139	拓邦股份	4,879,953.00	28.72
314	601238	广汽集团	4,811,390.00	28.31
315	300607	拓斯达	4,806,412.20	28.28
316	300648	星云股份	4,748,701.00	27.94
317	300009	安科生物	4,741,784.30	27.90
318	603611	诺力股份	4,723,168.00	27.79
319	688333	铂力特	4,701,888.55	27.67
320	002487	大金重工	4,680,625.00	27.54
321	003816	中国广核	4,670,234.00	27.48
322	002244	滨江集团	4,634,721.00	27.27
323	603882	金域医学	4,630,620.00	27.25
324	601872	招商轮船	4,605,532.68	27.10
325	600528	中铁工业	4,572,964.00	26.91
326	300045	华力创通	4,569,675.00	26.89
327	605090	九丰能源	4,540,989.00	26.72
328	600015	华夏银行	4,535,810.00	26.69
329	601319	中国人保	4,533,888.00	26.68
330	601928	凤凰传媒	4,510,763.70	26.54
331	600123	兰花科创	4,505,343.00	26.51
332	000045	深纺织 A	4,490,790.00	26.43
333	002952	亚世光电	4,459,182.00	26.24
334	300572	安车检测	4,431,951.00	26.08
335	600519	贵州茅台	4,413,654.00	25.97
336	002461	珠江啤酒	4,363,001.00	25.67
337	601908	京运通	4,344,736.00	25.57
338	600141	兴发集团	4,328,097.00	25.47
339	300706	阿石创	4,322,160.00	25.43
340	603826	坤彩科技	4,310,624.00	25.37
341	600378	昊华科技	4,307,737.00	25.35
342	600713	南京医药	4,305,416.00	25.34
343	002925	盈趣科技	4,297,870.88	25.29

344	002623	亚玛顿	4,296,973.00	25.29
345	300318	博晖创新	4,291,666.00	25.26
346	002423	中粮资本	4,285,083.00	25.22
347	002840	华统股份	4,279,056.00	25.18
348	000830	鲁西化工	4,272,449.00	25.14
349	603223	恒通股份	4,267,039.00	25.11
350	000726	鲁泰 A	4,261,660.00	25.08
351	600667	太极实业	4,246,164.14	24.99
352	002705	新宝股份	4,231,720.00	24.90
353	688399	硕世生物	4,226,427.26	24.87
354	002518	科士达	4,219,800.00	24.83
355	603369	今世缘	4,210,153.00	24.78
356	300239	东宝生物	4,189,359.00	24.65
357	000937	冀中能源	4,184,652.00	24.63
358	603050	科林电气	4,183,033.00	24.62
359	300890	翔丰华	4,179,259.00	24.59
360	600179	安通控股	4,175,230.00	24.57
361	600809	山西汾酒	4,174,568.62	24.57
362	603659	璞泰来	4,149,705.00	24.42
363	002225	濮耐股份	4,134,893.00	24.33
364	688560	明冠新材	4,110,111.37	24.19
365	300765	新诺威	4,109,816.00	24.18
366	603348	文灿股份	4,088,623.72	24.06
367	600438	通威股份	4,075,879.00	23.99
368	002057	中钢天源	4,048,491.00	23.82
369	300134	大富科技	4,041,111.00	23.78
370	300696	爱乐达	4,031,386.00	23.72
371	000906	浙商中拓	4,031,133.00	23.72
372	601958	金钼股份	4,027,636.00	23.70
373	600956	新天绿能	4,000,457.00	23.54
374	601038	一拖股份	3,973,343.00	23.38
375	300396	迪瑞医疗	3,941,768.00	23.20
376	688499	利元亨	3,934,045.29	23.15
377	688020	方邦股份	3,926,138.97	23.10
378	002088	鲁阳节能	3,924,838.00	23.10
379	002128	电投能源	3,896,721.00	22.93
380	300676	华大基因	3,895,554.00	22.92
381	300900	广联航空	3,883,922.00	22.86
382	002669	康达新材	3,864,774.00	22.74
383	002099	海翔药业	3,863,426.00	22.74
384	000898	鞍钢股份	3,862,539.00	22.73
385	600802	福建水泥	3,844,571.00	22.62
386	002810	山东赫达	3,836,441.00	22.58

387	603516	淳中科技	3,829,693.00	22.54
388	300212	易华录	3,810,649.80	22.42
389	300290	荣科科技	3,806,754.00	22.40
390	000922	佳电股份	3,803,871.00	22.38
391	600395	盘江股份	3,802,971.00	22.38
392	000553	安道麦 A	3,799,780.00	22.36
393	600132	重庆啤酒	3,787,144.00	22.29
394	603906	龙蟠科技	3,784,024.00	22.27
395	002311	海大集团	3,771,242.00	22.19
396	000860	顺鑫农业	3,765,094.00	22.16
397	600500	中化国际	3,718,744.00	21.88
398	002562	兄弟科技	3,687,263.00	21.70
399	688609	九联科技	3,673,492.26	21.62
400	600089	特变电工	3,639,908.88	21.42
401	600420	国药现代	3,619,456.00	21.30
402	603979	金诚信	3,616,044.46	21.28
403	300003	乐普医疗	3,599,318.76	21.18
404	605108	同庆楼	3,564,563.10	20.98
405	300181	佐力药业	3,546,575.00	20.87
406	600699	均胜电子	3,531,491.00	20.78
407	688261	东微半导	3,526,484.01	20.75
408	000729	燕京啤酒	3,522,600.00	20.73
409	002556	辉隆股份	3,515,452.00	20.69
410	601992	金隅集团	3,506,953.00	20.64
411	002302	西部建设	3,495,776.00	20.57
412	688501	青达环保	3,485,665.94	20.51
413	603305	旭升集团	3,435,244.38	20.22
414	688028	沃尔德	3,427,938.83	20.17
415	601899	紫金矿业	3,410,692.00	20.07
416	603800	道森股份	3,392,751.00	19.97
417	002270	华明装备	3,380,534.00	19.89
418	002116	中国海诚	3,377,358.00	19.87
419	300479	神思电子	3,371,186.34	19.84
420	300520	科大国创	3,336,495.00	19.63
421	600496	精工钢构	3,327,328.00	19.58
422	600571	信雅达	3,315,859.00	19.51
423	603192	汇得科技	3,300,653.00	19.42
424	300305	裕兴股份	3,238,702.00	19.06
425	603330	天洋新材	3,230,606.00	19.01
426	300143	盈康生命	3,220,317.00	18.95
427	600114	东睦股份	3,208,739.00	18.88
428	600328	中盐化工	3,169,158.00	18.65
429	603197	保隆科技	3,121,654.00	18.37

430	002876	三利谱	3,084,608.91	18.15
431	000751	锌业股份	3,052,342.00	17.96
432	002132	恒星科技	3,045,268.00	17.92
433	300578	会畅通讯	3,037,013.00	17.87
434	002783	凯龙股份	3,027,067.00	17.81
435	300427	红相股份	3,019,577.00	17.77
436	603968	醋化股份	3,001,590.00	17.66
437	603076	乐惠国际	2,965,351.00	17.45
438	002312	川发龙蟒	2,963,859.00	17.44
439	002869	金溢科技	2,937,748.00	17.29
440	300894	火星人	2,902,706.00	17.08
441	000819	岳阳兴长	2,893,754.00	17.03
442	600926	杭州银行	2,879,840.56	16.95
443	600673	东阳光	2,876,068.00	16.92
444	300624	万兴科技	2,855,345.00	16.80
445	601658	邮储银行	2,850,350.00	16.77
446	603589	口子窖	2,834,771.24	16.68
447	688195	腾景科技	2,834,217.41	16.68
448	601998	中信银行	2,823,260.00	16.61
449	002340	格林美	2,784,431.00	16.39
450	002674	兴业科技	2,764,790.00	16.27
451	002714	牧原股份	2,744,061.20	16.15
452	688778	厦钨新能	2,737,421.98	16.11
453	000048	京基智农	2,735,640.00	16.10
454	300761	立华股份	2,730,558.00	16.07
455	002653	海思科	2,716,700.00	15.99
456	600197	伊力特	2,715,737.00	15.98
457	601766	中国中车	2,706,222.00	15.93
458	688166	博瑞医药	2,696,739.37	15.87
459	688366	昊海生科	2,663,716.02	15.68
460	600019	宝钢股份	2,662,105.00	15.67
461	000893	亚钾国际	2,659,686.00	15.65
462	688700	东威科技	2,657,824.82	15.64
463	600887	伊利股份	2,613,460.00	15.38
464	300602	飞荣达	2,596,901.74	15.28
465	603716	塞力医疗	2,593,335.00	15.26
466	300643	万通智控	2,592,093.00	15.25
467	688788	科思科技	2,581,618.67	15.19
468	601003	柳钢股份	2,555,040.00	15.04
469	002353	杰瑞股份	2,549,659.00	15.00
470	300690	双一科技	2,548,060.00	14.99
471	605399	晨光新材	2,529,994.20	14.89
472	002100	天康生物	2,508,659.00	14.76

473	600392	盛和资源	2,507,475.82	14.76
474	301030	仕净科技	2,493,910.00	14.68
475	688099	晶晨股份	2,492,529.88	14.67
476	603938	三孚股份	2,451,501.00	14.43
477	002013	中航机电	2,445,249.00	14.39
478	603599	广信股份	2,425,309.00	14.27
479	603083	剑桥科技	2,414,354.00	14.21
480	600188	兖矿能源	2,397,380.53	14.11
481	603799	华友钴业	2,390,076.00	14.06
482	300378	鼎捷软件	2,382,141.00	14.02
483	300787	海能实业	2,371,324.00	13.95
484	600248	陕西建工	2,370,375.00	13.95
485	688223	晶科能源	2,332,327.91	13.72
486	600054	黄山旅游	2,331,992.00	13.72
487	688520	神州细胞	2,331,921.43	13.72
488	000717	中南股份	2,325,622.00	13.69
489	300534	陇神戎发	2,324,679.00	13.68
490	603368	柳药集团	2,316,145.55	13.63
491	603595	东尼电子	2,314,860.00	13.62
492	600939	重庆建工	2,299,029.00	13.53
493	603127	昭衍新药	2,298,980.00	13.53
494	300337	银邦股份	2,296,960.00	13.52
495	688630	芯碁微装	2,272,355.49	13.37
496	002938	鹏鼎控股	2,257,976.00	13.29
497	603993	洛阳钼业	2,256,283.00	13.28
498	688408	中信博	2,250,390.21	13.24
499	300608	思特奇	2,246,417.78	13.22
500	002885	京泉华	2,229,724.00	13.12
501	300565	科信技术	2,225,902.00	13.10
502	300568	星源材质	2,213,608.00	13.03
503	000090	天健集团	2,207,102.00	12.99
504	000878	云南铜业	2,200,824.00	12.95
505	603466	风语筑	2,119,394.92	12.47
506	002709	天赐材料	2,104,016.00	12.38
507	002611	东方精工	2,082,207.00	12.25
508	600057	厦门象屿	2,075,140.00	12.21
509	605123	派克新材	2,071,931.00	12.19
510	300432	富临精工	2,063,829.50	12.14
511	002472	双环传动	2,041,693.00	12.01
512	002421	达实智能	1,988,811.00	11.70
513	601137	博威合金	1,965,672.00	11.57
514	000657	中钨高新	1,942,573.60	11.43
515	002753	永东股份	1,937,666.00	11.40

516	300712	永福股份	1,933,210.00	11.38
517	603558	健盛集团	1,921,653.00	11.31
518	603628	清源股份	1,906,212.00	11.22
519	688022	瀚川智能	1,868,182.89	10.99
520	603856	东宏股份	1,850,147.00	10.89
521	300093	金刚光伏	1,821,351.00	10.72
522	300750	宁德时代	1,811,133.00	10.66
523	688589	力合微	1,808,945.38	10.65
524	300179	四方达	1,807,849.00	10.64
525	300444	双杰电气	1,804,208.00	10.62
526	002060	粤水电	1,788,633.00	10.53
527	000065	北方国际	1,777,754.00	10.46
528	601609	金田股份	1,766,598.00	10.40
529	002838	道恩股份	1,761,160.00	10.36
530	000498	山东路桥	1,757,412.00	10.34
531	600970	中材国际	1,746,797.57	10.28
532	601512	中新集团	1,739,306.00	10.24
533	001205	盛航股份	1,736,473.00	10.22
534	600269	赣粤高速	1,722,455.00	10.14
535	300373	扬杰科技	1,715,221.00	10.09
536	600559	老白干酒	1,709,915.00	10.06
537	600284	浦东建设	1,703,088.00	10.02
538	002545	东方铁塔	1,700,339.00	10.01
539	688017	绿的谐波	1,689,966.34	9.94
540	002697	红旗连锁	1,659,157.00	9.76
541	003043	华亚智能	1,636,270.00	9.63
542	002855	捷荣技术	1,630,324.00	9.59
543	000552	靖远煤电	1,597,534.00	9.40
544	000858	五粮液	1,574,350.00	9.26
545	600489	中金黄金	1,556,220.00	9.16
546	688617	惠泰医疗	1,552,126.23	9.13
547	601886	江河集团	1,551,926.54	9.13
548	601339	百隆东方	1,537,166.00	9.05
549	603335	迪生力	1,536,618.00	9.04
550	300870	欧陆通	1,532,465.00	9.02
551	603179	新泉股份	1,530,076.00	9.00
552	000877	天山股份	1,498,716.00	8.82
553	300700	岱勒新材	1,480,191.00	8.71
554	000707	双环科技	1,476,636.00	8.69
555	688138	清溢光电	1,470,410.43	8.65
556	688516	奥特维	1,454,657.48	8.56
557	600184	光电股份	1,402,032.00	8.25
558	603089	正裕工业	1,401,574.00	8.25

559	600383	金地集团	1,401,546.00	8.25
560	002346	柘中股份	1,401,139.00	8.25
561	002376	新北洋	1,354,237.00	7.97
562	603728	鸣志电器	1,352,444.00	7.96
563	002036	联创电子	1,345,224.00	7.92
564	300347	泰格医药	1,332,496.00	7.84
565	002937	兴瑞科技	1,329,332.00	7.82
566	002895	川恒股份	1,328,335.00	7.82
567	002768	国恩股份	1,325,265.00	7.80
568	300382	斯莱克	1,302,676.00	7.67
569	300131	英唐智控	1,284,154.00	7.56
570	688196	卓越新能	1,283,701.77	7.55
571	300286	安科瑞	1,281,968.00	7.54
572	300769	德方纳米	1,277,894.00	7.52
573	000709	河钢股份	1,276,555.00	7.51
574	002434	万里扬	1,270,058.00	7.47
575	603605	珀莱雅	1,233,918.00	7.26
576	002643	万润股份	1,223,875.00	7.20
577	605296	神农集团	1,216,414.00	7.16
578	688005	容百科技	1,206,085.21	7.10
579	002597	金禾实业	1,203,384.00	7.08
580	600499	科达制造	1,203,342.00	7.08
581	603920	世运电路	1,190,399.00	7.01
582	002120	韵达股份	1,180,871.00	6.95
583	002866	传艺科技	1,177,134.00	6.93
584	688301	奕瑞科技	1,174,907.39	6.91
585	002922	伊戈尔	1,174,685.00	6.91
586	000883	湖北能源	1,166,378.00	6.86
587	002825	纳尔股份	1,162,257.00	6.84
588	300452	山河药辅	1,160,259.70	6.83
589	603815	交建股份	1,147,842.00	6.75
590	000517	荣安地产	1,128,676.00	6.64
591	601877	正泰电器	1,117,468.00	6.58
592	688550	瑞联新材	1,110,769.33	6.54
593	601166	兴业银行	1,103,510.00	6.49
594	600933	爱柯迪	1,093,126.00	6.43
595	002180	纳思达	1,080,343.00	6.36
596	600929	雪天盐业	1,072,836.00	6.31
597	300464	星徽股份	1,052,832.00	6.20
598	605499	东鹏饮料	1,045,055.00	6.15
599	600111	北方稀土	1,036,370.00	6.10
600	605183	确成股份	1,033,647.00	6.08
601	600487	亨通光电	1,031,942.00	6.07

602	000831	中国稀土	1,029,259.00	6.06
603	002902	铭普光磁	1,028,402.00	6.05
604	600486	扬农化工	1,009,742.00	5.94
605	300681	英搏尔	966,456.80	5.69
606	603108	润达医疗	962,344.58	5.66
607	603421	鼎信通讯	940,744.00	5.54
608	002812	恩捷股份	939,122.00	5.53
609	300219	鸿利智汇	939,029.00	5.53
610	688303	大全能源	936,387.80	5.51
611	688981	中芯国际	934,732.23	5.50
612	603315	福鞍股份	933,661.00	5.49
613	600071	凤凰光学	930,826.00	5.48
614	300902	国安达	921,589.00	5.42
615	688033	天宜上佳	921,373.12	5.42
616	688258	卓易信息	917,549.77	5.40
617	300928	华安鑫创	916,963.00	5.40
618	002041	登海种业	910,701.00	5.36
619	688091	上海谊众	910,310.51	5.36
620	603806	福斯特	891,406.00	5.25
621	002821	凯莱英	882,182.86	5.19
622	600063	皖维高新	867,741.00	5.11
623	002250	联化科技	854,699.00	5.03
624	002042	华孚时尚	851,143.00	5.01
625	688103	国力股份	848,223.71	4.99
626	002475	立讯精密	847,243.00	4.99
627	000301	东方盛虹	835,281.00	4.92
628	300725	药石科技	830,165.00	4.89
629	000629	钒钛股份	828,608.00	4.88
630	600853	龙建股份	803,287.00	4.73
631	000965	天保基建	790,281.00	4.65
632	002731	萃华珠宝	783,966.00	4.61
633	688578	艾力斯	783,722.76	4.61
634	002055	得润电子	755,305.00	4.44
635	000567	海德股份	749,508.45	4.41
636	600702	舍得酒业	746,218.00	4.39
637	300581	晨曦航空	725,676.00	4.27
638	600225	卓朗科技	721,734.00	4.25
639	600573	惠泉啤酒	721,410.00	4.25
640	000869	张裕 A	715,877.00	4.21
641	002170	芭田股份	712,623.00	4.19
642	002074	国轩高科	703,937.00	4.14
643	300661	圣邦股份	702,813.00	4.14
644	688008	澜起科技	700,338.56	4.12

645	600389	江山股份	699,588.00	4.12
646	000703	恒逸石化	691,680.00	4.07
647	002258	利尔化学	689,220.00	4.06
648	600463	空港股份	686,227.00	4.04
649	300316	晶盛机电	668,546.00	3.93
650	601111	中国国航	668,334.00	3.93
651	300332	天壕环境	667,375.00	3.93
652	600313	农发种业	656,467.00	3.86
653	300861	美畅股份	647,823.20	3.81
654	002446	盛路通信	638,798.00	3.76
655	688800	瑞可达	609,814.90	3.59
656	002850	科达利	607,893.00	3.58
657	000913	钱江摩托	597,310.00	3.51
658	002271	东方雨虹	596,122.00	3.51
659	600233	圆通速递	590,784.00	3.48
660	300085	银之杰	585,685.00	3.45
661	002407	多氟多	582,467.00	3.43
662	688598	金博股份	578,471.04	3.40
663	002986	宇新股份	578,219.80	3.40
664	600259	广晟有色	577,488.00	3.40
665	002761	浙江建投	571,980.00	3.37
666	600448	华纺股份	560,375.00	3.30
667	688388	嘉元科技	546,376.69	3.22
668	603768	常青股份	539,903.00	3.18
669	601718	际华集团	534,044.00	3.14
670	002959	小熊电器	529,352.00	3.12
671	000895	双汇发展	519,965.00	3.06
672	603737	三棵树	504,843.00	2.97
673	002909	集泰股份	496,584.00	2.92
674	600989	宝丰能源	488,866.00	2.88
675	002291	遥望科技	483,716.00	2.85
676	603299	苏盐井神	465,802.00	2.74
677	002996	顺博合金	460,345.00	2.71
678	688313	仕佳光子	448,717.93	2.64
679	688085	三友医疗	448,385.79	2.64
680	300802	矩子科技	447,677.00	2.63
681	688141	杰华特	443,094.30	2.61
682	688819	天能股份	439,813.64	2.59
683	002829	星网宇达	439,233.00	2.58
684	300363	博腾股份	434,004.00	2.55
685	688298	东方生物	430,591.56	2.53
686	688432	有研硅	426,937.20	2.51
687	601933	永辉超市	425,599.00	2.50

688	002011	盾安环境	424,001.00	2.50
689	002807	江阴银行	419,122.00	2.47
690	600360	华微电子	413,723.00	2.43
691	002971	和远气体	411,715.00	2.42
692	300745	欣锐科技	411,290.00	2.42
693	603609	禾丰股份	410,229.00	2.41
694	603236	移远通信	407,561.00	2.40
695	688116	天奈科技	404,062.34	2.38
696	603359	东珠生态	403,119.00	2.37
697	603959	百利科技	401,198.00	2.36
698	301367	怡和嘉业	397,355.39	2.34
699	688202	美迪西	396,176.02	2.33
700	688521	芯原股份	392,560.46	2.31
701	002129	TCL 中环	389,270.00	2.29
702	300073	当升科技	387,448.00	2.28
703	688680	海优新材	387,290.77	2.28
704	600869	远东股份	386,327.00	2.27
705	300118	东方日升	385,570.00	2.27
706	600223	鲁商发展	379,482.34	2.23
707	002578	闽发铝业	376,488.00	2.22
708	603508	思维列控	375,293.00	2.21
709	600456	宝钛股份	367,932.00	2.17
710	002344	海宁皮城	367,413.00	2.16
711	688266	泽璟制药	351,929.12	2.07
712	002241	歌尔股份	351,525.00	2.07
713	600319	亚星化学	347,208.00	2.04
714	601231	环旭电子	344,243.00	2.03

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,682,819,231.26
卖出股票收入（成交）总额	4,337,434,767.00

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

本项卖出金额均按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,843,182.32	1.38
	其中：政策性金融债	19,843,182.32	1.38

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	19,843,182.32	1.38

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	2204110	22 农发贴现 10	200,000	19,843,182.32	1.38

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

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

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，杭州银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受

到中国银行保险监督管理委员会深圳监管局的处罚，中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚，本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	496,062.21
2	应收清算款	23,303,770.60
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,839,278.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,639,111.23

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	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 (%)

万家量化睿选 A	1,723	417,033.14	680,757,995.42	94.74	37,790,100.05	5.26
万家量化睿选 C	1,599	233,950.32	323,338,482.53	86.43	50,748,077.13	13.57
合计	3,257	335,472.72	1,004,096,477.95	91.90	88,538,177.18	8.10

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

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	万家量化睿选 A	1,293,950.16	0.1801
	万家量化睿选 C	53,385.75	0.0143
	合计	1,347,335.91	0.1233

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	万家量化睿选 A	50~100
	万家量化睿选 C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	万家量化睿选 A	10~50
	万家量化睿选 C	0
	合计	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家量化睿选 A	万家量化睿选 C
基金合同生效日 （2017 年 8 月 4 日） 基金份额总额	937,449,452.68	-
本报告期期初基金份额总额	11,903,840.04	-
本报告期基金总申购份额	876,232,498.20	588,956,041.75
减：本报告期基金总赎回份额	169,588,242.77	214,869,482.09
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	718,548,095.47	374,086,559.66
-------------	----------------	----------------

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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：

2022 年 8 月 24 日，公司聘任莫海波先生担任公司副总经理。

基金托管人：

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所未发生变更。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中泰证券	2	4,797,374,126.83	47.92	4,467,831.82	47.92	-
海通证券	1	1,269,491,384.25	12.68	1,182,259.18	12.68	-

广发证券	1	1,061,865,506.83	10.61	988,927.93	10.61	-
东北证券	2	842,676,264.34	8.42	784,797.94	8.42	-
民生证券	1	798,182,706.24	7.97	743,353.10	7.97	-
天风证券	2	789,828,398.53	7.89	735,568.63	7.89	-
东方财富 证券	2	259,146,854.20	2.59	241,343.47	2.59	-
申万宏源 证券	1	116,080,950.00	1.16	108,107.22	1.16	-
东吴证券	1	49,586,478.81	0.50	46,180.59	0.50	-
东兴证券	1	18,392,422.00	0.18	17,128.66	0.18	-
兴业证券	3	9,043,147.69	0.09	8,422.10	0.09	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
中银国际 证券	3	-	-	-	-	-

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,本基金新增海通证券交易单元 1 个、东吴证券交易单元 1 个、华西证券交易单元 2 个、西南证券交易单元 1 个和中信建投证券交易单元 1 个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	指定媒介	2022-01-21
2	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在招商证券开通定投的公告	指定媒介	2022-03-14
3	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在华龙证券开通定投的公告	指定媒介	2022-03-15
4	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金调整最低申购金额的公告	指定媒介	2022-03-22
5	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宜信普泽为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-03-24
6	万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金 2021 年年度报告	指定媒介	2022-03-30
7	万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	指定媒介	2022-04-21
8	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中欧财富为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-05-26
9	万家基金管理有限公司关于旗下基金在泰信财富证券开通申购、转换、定	指定媒介	2022-06-21

	投及参与其费率优惠活动的公告		
10	万家基金管理有限公司关于旗下万家量化睿选在西部证券及渤海证券等机构开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-06-29
11	万家基金管理有限公司关于旗下基金在东北证券等机构开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-06-30
12	万家基金管理有限公司关于旗下万家量化睿选在华安证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-07-01
13	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增苏宁基金为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-07-12
14	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在东莞证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-07-13
15	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增万得基金为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-07-15
16	万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	指定媒介	2022-07-20
17	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在九州证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-08-01
18	万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金托管协议（更新）	指定媒介	2022-08-23
19	万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金基金合同（更新）	指定媒介	2022-08-23
20	万家基金管理有限公司关于万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金新增 C 类基金份额并修改基金合同与托管协议的公告	指定媒介	2022-08-23
21	万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新(2022 年第 1 号)	指定媒介	2022-08-25
22	万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	指定媒介	2022-08-25
23	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江苏银行为销售机构并开通转换、基金定投业务的公告	指定媒介	2022-08-29
24	万家量化睿选灵活配置混合型证券投资	指定媒介	2022-08-30

	资基金 2022 年中期报告		
25	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商银行招赢通平台为销售机构并开通相关业务的公告	指定媒介	2022-08-30
26	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在国联证券开通定投业务的公告	指定媒介	2022-09-27
27	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在广发证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-10-11
28	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在浙商证券开通定投业务的公告	指定媒介	2022-10-14
29	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增汇成基金为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-10-19
30	万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	指定媒介	2022-10-25

§ 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	20220629 - 20220809、20220829 - 20220905	-	84,706,416.09	50,353,706.36	34,352,709.73	3.14
	2	20220725 - 20220828	-	45,023,729.67	-	45,023,729.67	4.12
	3	20220629 - 20220629、20220701 - 20220705	-	11,071,972.32	-	11,071,972.32	1.01
	4	20220810 - 20220810	-	71,325,175.43	-	71,325,175.43	6.53
	5	20220929 - 20221121、20221219 - 20221219、20221222 - 20221231	-	346,251,488.05	57,886,396.53	288,365,091.52	26.39

	6	20220906 - 20220906、 20220927 - 20220927	-	161,124, 756.01	-	161,124,756.0 1	14.75
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；若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件
- 2、《万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程
- 4、本报告期内在中国证监会指定媒介公开披露的基金净值、更新招募说明书及其他临时公告
- 5、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告原文
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议
- 7、《万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司

2023 年 3 月 30 日