

万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资
基金
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	60
7.1 期末基金资产组合情况	60
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	60
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	62
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	72
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	73

7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	73
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	73
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	74
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	74
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
7.12	投资组合报告附注	74
§ 8	基金份额持有人信息	75
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
8.2	期末上市基金前十名持有人	76
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	77
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	77
§ 9	开放式基金份额变动	77
§ 10	重大事件揭示	77
10.1	基金份额持有人大会决议	77
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	77
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	77
10.4	基金投资策略的改变	77
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	77
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	77
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	78
10.8	其他重大事件	79
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	80
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	80
§ 12	备查文件目录	81
12.1	备查文件目录	81
12.2	存放地点	81
12.3	查阅方式	81

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	万家国证 2000ETF
场内简称	国证 2000ETF
基金主代码	159628
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 6 月 29 日
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	758,283,250.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2022 年 7 月 18 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	1、股票投资策略；2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、可转换债券与可交换债券投资策略；6、股指期货投资策略；7、国债期货投资策略；8、股票期权投资策略；9、参与融资与转融通证券出借业务策略；10、其他。
业绩比较基准	国证 2000 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用最优化抽样复制策略，跟踪国证 2000 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	万家基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	兰剑
	联系电话	021-38909626
	电子邮箱	lanj@wjasset.com
客户服务电话	4008880800	95588
传真	021-38909627	010-66105798
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200122	100140
法定代表人	方一天	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.wjasset.com
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	11,525,042.84
本期利润	24,342,197.87
加权平均基金份额本期利润	0.0566
本期加权平均净值利润率	5.54%
本期基金份额净值增长率	10.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	21,922,218.49
期末可供分配基金份额利润	0.0289
期末基金资产净值	780,205,468.49
期末基金份额净值	1.0289
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	2.89%

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

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

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

3.2 基金净值表现

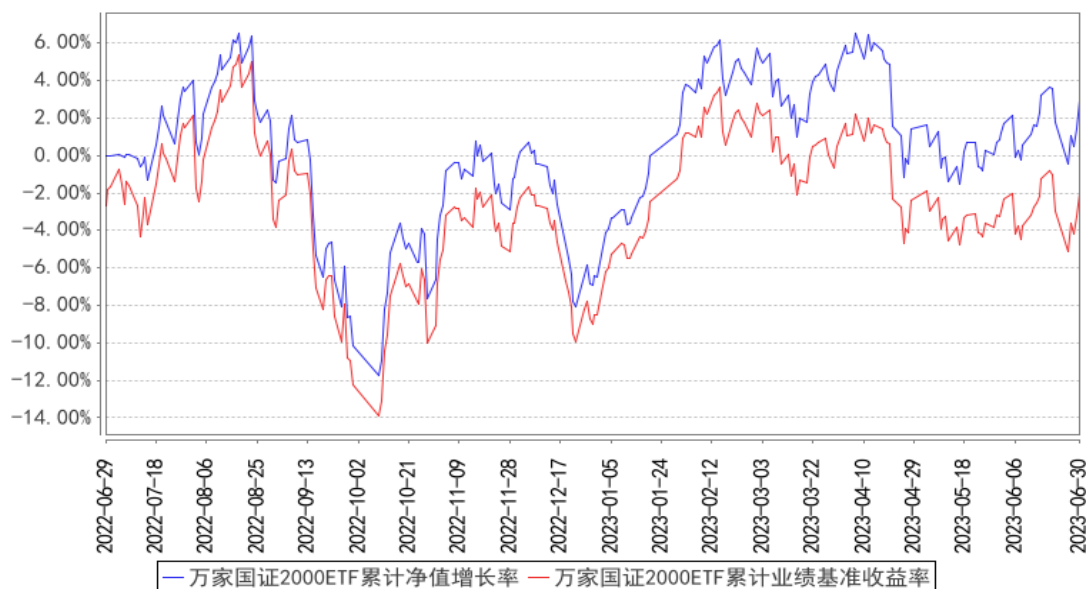
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	2.05%	1.07%	1.23%	1.10%	0.82%	-0.03%

过去三个月	-1.56%	1.04%	-2.56%	1.00%	1.00%	0.04%
过去六个月	10.00%	0.97%	7.08%	0.95%	2.92%	0.02%
过去一年	2.89%	1.11%	-0.26%	1.16%	3.15%	-0.05%
自基金合同生效起至今	2.89%	1.10%	-2.06%	1.17%	4.95%	-0.07%

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

万家国证2000ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2022 年 6 月 29 日成立，根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44 号文批准设立。截至报告期末，公司的股东为中泰证券股份有限公司、山东省新动能基金管理有限公司，住所：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 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，公司共管理一百三十一只开放式基金，分别为万家 180 指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选混合型证券投资基金(LOF)、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利

指数证券投资基金（LOF）、万家添利债券型证券投资基金（LOF）、万家新机遇价值驱动灵活配置混合型证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家上证 50 交易型开放式指数证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞和灵活配置混合型证券投资基金、万家颐达灵活配置混合型证券投资基金、万家颐和灵活配置混合型证券投资基金、万家恒瑞 18 个月定期开放债券型证券投资基金、万家鑫安纯债债券型证券投资基金、万家鑫璟纯债债券型证券投资基金、万家沪深 300 指数增强型证券投资基金、万家家享中短债债券型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家 1-3 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家瑞隆混合型证券投资基金、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家现金增利货币市场基金、万家消费成长股票型证券投资基金、万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家玖盛纯债 9 个月定期开放债券型证券投资基金、万家天添宝货币市场基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、万家家瑞债券型证券投资基金、万家臻选混合型证券投资基金、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金、万家成长优选灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金、万家经济新动能混合型证券投资基金、万家潜力价值灵活配置混合型证券投资基金、万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家新机遇龙头企业灵活配置混合型证券投资基金、万家智造优势混合型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型证券投资基金、万家人工智能混合型证券投资基金、万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金（LOF）、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、万家平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、万家科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、万家鑫盛纯债债券型证券投资基金、万家民安增利 12 个月定期开放债券型证券投资基金、万家汽车新趋势混合型证券投资基金、万家惠享 39 个月定期开放债券型证券投资基金、万家科技创新混合型证券投资基金、万家自主创新混合型证券投资基金、万家民丰回报一年持有期混合型证券投资基金、万家可转债债券型证券投资基金、万家民瑞祥和 6 个月持有期债券型证券投资基金、万家价值优势一年持有期混合型证券投资基金、万家养老目标日期 2035 三年持有期混合型发

起式基金中基金（FOF）、万家鑫动力月月购一年滚动持有混合型证券投资基金、万家科创板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家创业板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家周期优势企业混合型证券投资基金、万家健康产业混合型证券投资基金、万家互联互通中国优势量化策略混合型证券投资基金、万家战略发展产业混合型证券投资基金、万家创业板指数增强型证券投资基金、万家陆家嘴金融城金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家内需增长一年持有期混合型证券投资基金、万家互联互通核心资产量化策略混合型证券投资基金、万家民瑞祥明 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家瑞泽回报一年持有期混合型证券投资基金、万家惠裕回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家悦兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金、万家稳鑫 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、万家全球成长一年持有期混合型证券投资基金(QDII)、万家沪港深蓝筹混合型证券投资基金、万家北交所慧选两年定期开放混合型证券投资基金、万家鼎鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家新机遇成长一年持有期混合型发起式证券投资基金、万家港股通精选混合型证券投资基金、万家景气驱动混合型证券投资基金、万家安恒纯债 3 个月持有期债券型发起式证券投资基金、万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫橙纯债债券型证券投资基金、万家聚优稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、万家新能源主题混合型发起式证券投资基金、万家中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、万家匠心致远一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫融纯债债券型证券投资基金、万家颐远均衡一年持有期混合型发起式证券投资基金、万家鑫耀纯债债券型证券投资基金、万家欣远混合型证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家惠利债券型证券投资基金、万家鑫怡债券型证券投资基金、万家优享平衡混合型发起式证券投资基金、万家洞见进取混合型发起式证券投资基金、万家沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、万家中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金、万家沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家元贞量化选股股票型证券投资基金、万家 CFETS0-3 年期政策性金融债指数证券投资基金、万家中证软件服务指数型发起式证券投资基金、万家先进制造混合型发起式证券投资基金、万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金、万家颐德一年持有期混合型证券投资基金、万家北证 50 成份指数型发起式证券投资基金、万家恒生互联网科技业指数型发起式证券投资基金(QDII)、万家中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家欣优混合型证券投资基金、万家集利债券型发起式证券投资基金。

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		
杨坤	万家 180 指数证券投资基金、万家上证 50 交易型开放式指数证券投资基金、万家中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金、万家中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家中证红利指数证券投资基金 (LOF)、万家中证软件服务指数型发起式证券投资基金、万家北证 50 成份指数型发起式证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、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、万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金、万家恒生互联网科技业指数型发起式证券投资基金 (QDII)、万家沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、万家沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理	2022 年 6 月 29 日	-	9 年	国籍：中国；学历：法国南特国立高等矿业学校自动化及工业信息技术专业硕士，2015 年 6 月入职万家基金管理有限公司，现任量化投资部基金经理，历任量化投资部研究员。曾任 Fractable 量化 IT 工程师等职。

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《公平交易管理办法》和《异常交易监控及报告管理办法》等规章制度，涵盖了研究、授权、投资决策和交易执行等投资管理活动的各个环节，确保公平对待不同投资组合，防范导致不公平交易以及利益输送的异常交易发生。

公司制订了明确的投资授权制度，并建立了统一的投资管理平台，确保不同投资组合获得公平的投资决策机会。实行集中交易制度，对于交易所公开竞价交易，执行交易系统内的公平交易程序；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，原则上按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；对于银行间交易，按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。为保证公平交易原则的实现，通过制度规范、流程审批、系统风控参数设置等进行事前控制，通过对投资交易系统的实时监控进行事中控制，通过对异常交易的监控和分析实现事后控制。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，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 16 次，均为量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金作为被动投资的指数基金，其投资目标是通过跟踪、复制国证 2000 指数，为投资者获取市场长期的平均收益。报告期内我们严格按照基金合同规定，努力拟合标的指数，减小跟踪误差，将基金跟踪误差控制在较低范围之内。同时，本基金采用有效的量化跟踪技术，降低管理成本，并参与转融通证券出借。导致跟踪误差的主要原因是基金参与新股申购、申购现金替代、标的指数成分股调整、参与转融通证券出借、成分股分红、停牌等因素。

复盘 2023 年上半年，年初随着疫情防控放开，国内供给端复工扩产有序进行，需求端社零数据回暖，带动市场大幅上涨。春节后随着疫情期间积压的报复性需求释放进入尾声，高频数据修复斜率有所放缓，叠加海外金融风险逐渐暴露（俄乌冲突、硅谷银行风险事件），投资者对经济复苏的高度和持续性存在疑虑，市场开始演绎弱复苏。截至 2023 年 6 月 30 日，北向资金净流入 1833.24 亿，远超去年全年的 900 亿。上证综指上半年上涨 3.65%，深证成指上涨 0.10%，沪深 300

指数下跌 0.75%，中证 500 指数上涨 2.29%，创业板指数下跌 5.61%，中证 1000 指数上涨 5.10%。上半年本基金投资标的指数——国证 2000 指数收益率为 7.08%，在主流宽基指数中名列前茅。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家国证 2000ETF 的基金份额净值为 1.0289 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.00%，同期业绩比较基准收益率为 7.08%。基金报告期内日跟踪偏离度为 0.0933%，年化跟踪误差为 1.9253%，符合基金合同中日均跟踪偏离度低于 0.2%和年跟踪误差低于 2%的规定。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经过上半年的调整，总量经济相关资产的风险溢价已处于历史极值，悲观预期已在股价上充分反应，指数进一步深度调整的空间不高。同时，市场在向好的方向发展，国内方面，政治局会议后，各部门积极响应，根据会议指引出台相关政策，市场情绪获得较大提振。海外方面，美国核心 PCE 通胀数据降至低位，市场紧缩预期回落，美联储加息或接近尾声，来自外部的压力有所缓和。随着政策预期的回温以及海外紧缩预期影响的消退，A 股市场情绪及资金面均有望得到显著改善，市场有望走出阶段性底部。

本基金将继续贯彻被动投资理念，恪守基金合同规定的投资目标和投资策略，一如既往地规范、勤勉运作，将本基金打造为稳定有效的指数投资工具，为基金份额持有人谋求长期、稳定回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了估值委员会，定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。估值委员会由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》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对万家基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	22,438,213.33	6,872,467.06
结算备付金		2,159,308.15	121,143.23
存出保证金		145,688.51	287,157.78
交易性金融资产	6.4.7.2	761,401,890.64	247,776,315.65
其中：股票投资		761,401,890.64	247,776,315.65
基金投资		-	-

债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		4,167,662.84	694,721.66
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	1,111,455.43	-
资产总计		791,424,218.90	255,751,805.38
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		237,348.27	110,735.15
应付托管费		47,469.65	22,147.03
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,339.03	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	10,932,593.46	912,142.65
负债合计		11,218,750.41	1,045,024.83
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	758,283,250.00	272,283,250.00
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	21,922,218.49	-17,576,469.45
净资产合计		780,205,468.49	254,706,780.55
负债和净资产总计		791,424,218.90	255,751,805.38

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0289 元，基金份额总额 758,283,250.00

份。

6.2 利润表

会计主体：万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 6 月 29 日(基金 合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		25,806,227.54	17,320.95
1. 利息收入		233,253.17	16,435.40
其中：存款利息收入	6.4.7.10	20,675.79	16,435.40
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		-	-
证券出借利息收入		212,577.38	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		12,130,936.24	-8,484.60
其中：股票投资收益	6.4.7.11	8,211,940.72	-8,484.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	3,918,995.52	-
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）	6.4.7.17	12,817,155.03	9,370.15
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.18	624,883.10	-
减：二、营业总支出		1,464,029.67	15,131.76
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,086,839.59	11,579.33
2. 托管费	6.4.10.2.2	217,367.96	2,315.87

3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		765.61	-
8. 其他费用	6.4.7.20	159,056.51	1,236.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		24,342,197.87	2,189.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		24,342,197.87	2,189.19
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		24,342,197.87	2,189.19

注：本基金合同生效日为 2022 年 6 月 29 日，上年度可比期间为 2022 年 6 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	272,283,250.00	-	-17,576,469.45	254,706,780.55
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）	272,283,250.00	-	-17,576,469.45	254,706,780.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	486,000,000.00	-	39,498,687.94	525,498,687.94
（一）、综合收益总额	-	-	24,342,197.87	24,342,197.87
（二）、本期基金份额交易产生的	486,000,000.00	-	15,156,490.07	501,156,490.07

基金净值变动数 (净值减少以 “-”号填列)				
其中: 1. 基金申 购款	867,000,000.00	-	24,484,910.72	891,484,910.72
2. 基金赎 回款	-381,000,000.0 0	-	-9,328,420.65	-390,328,420.65
(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)	758,283,250.00	-	21,922,218.49	780,205,468.49
项目	上年度可比期间 2022年6月29日(基金合同生效日)至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净 资产(基金净值)	-	-	-	-
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)	845,283,250.00	-	-	845,283,250.00
三、本期增减变 动额(减少以“-” 号填列)	-	-	2,189.19	2,189.19
(一)、综合收益 总额	-	-	2,189.19	2,189.19
(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)	-	-	-	-
其中: 1. 基金申 购款	-	-	-	-

2. 基金赎回款	-	-	-	-
(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）	845,283,250.00	-	2,189.19	845,285,439.19

注：本基金合同生效日为 2022 年 6 月 29 日，上年度可比期间为 2022 年 6 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2022]473 号文《关于准予万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的核准，由万家基金管理有限公司作为基金管理人于 2022 年 6 月 14 日至 2022 年 6 月 24 日向社会公开募集，募集期结束经立信会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具信会师报字[2022]第 ZA31047 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 2022 年 6 月 29 日生效，本基金为交易型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 845,244,000.00 元（现金部分），有效认购资金在基金验资确认日之前产生的利息为人民币 39,250.00 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 845,283,250.00 元，折合 845,283,250.00 份基金份额。本基金目前暂不开通网下股票认购业务。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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投

资于非标的指数成份股（包括主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货、股票期权、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即国证 2000 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

本中期报告所采用的会计政策、会计估计与上年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

(一) 印花税

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

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

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

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

（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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	22,438,213.33
等于：本金	22,436,820.61
加：应计利息	1,392.72
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	22,438,213.33

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	760,931,677.43	-	761,401,890.64	470,213.21

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	760,931,677.43	-	761,401,890.64	470,213.21

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应收利息	-
其他应收款	1,035,839.19
待摊费用	75,616.24
合计	1,111,455.43

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	482,327.09
其中：交易所市场	482,327.09
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	94,300.75
其他应付款	10,355,965.62
合计	10,932,593.46

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	272,283,250.00	272,283,250.00
本期申购	867,000,000.00	867,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-381,000,000.00	-381,000,000.00
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	758,283,250.00	758,283,250.00

6.4.7.8 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,642,716.54	-24,219,185.99	-17,576,469.45
本期利润	11,525,042.84	12,817,155.03	24,342,197.87
本期基金份额交易产生的变动数	22,817,454.73	-7,660,964.66	15,156,490.07
其中：基金申购款	38,987,422.23	-14,502,511.51	24,484,910.72
基金赎回款	-16,169,967.50	6,841,546.85	-9,328,420.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	40,985,214.11	-19,062,995.62	21,922,218.49

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	活期存款利息收入	13,315.74
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	6,090.00	
其他	1,270.05	
合计	20,675.79	

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	

股票投资收益——买卖股票差价收入	6,197,349.24
股票投资收益——赎回差价收入	2,014,591.48
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	8,211,940.72

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	352,983,397.65
减：卖出股票成本总额	345,627,101.16
减：交易费用	1,158,947.25
买卖股票差价收入	6,197,349.24

6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	390,328,420.65
减：现金支付赎回款总额	162,536,033.65
减：赎回股票成本总额	225,777,795.52
减：交易费用	-
赎回差价收入	2,014,591.48

6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,918,995.52
其中：证券出借权益补偿收入	153,921.65

基金投资产生的股利收益	-
合计	3,918,995.52

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	12,817,155.03
股票投资	12,817,155.03
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	12,817,155.03

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	624,883.10
合计	624,883.10

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	372.00
中登登记结算服务费	74,383.76

IOPV 计算服务费	9,916.99
合计	159,056.51

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

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。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司（“万家基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人
中泰证券股份有限公司（“中泰证券”）	基金管理人的股东
中国工商银行股份有限公司-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（“万家国证 2000ETF 发起式联接”）	本基金的联接基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 6 月 29 日（基金合同生效日） 至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
中泰证券	223,430,887.22	24.79	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中泰证券	200,264.45	27.34	178,595.44	37.03
关联方名称	上年度可比期间 2022年6月29日（基金合同生效日）至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
-	-	-	-	-

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年6月29日（基金合 同生效日）至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,086,839.59	11,579.33
其中：支付销售机构的客户维护费	49,841.53	312.80

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

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，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 6 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	217,367.96	2,315.87

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
-------	------------------------	--------------------------

	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
万家国证 2000ETF 发起 式联接	128,143,106.00	16.8991	39,267,200.00	14.4215

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30 日		上年度可比期间 2022年6月29日(基金合同生效日)至2022 年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	22,438,213.33	13,315.74	845,265,618.16	16,435.40

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方所承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间没有需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2023年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	受 限 期	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 (单 位 : 股)	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
001282	三联锻造	2023年5月15日	6个月	新股 流通 受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	新股 流通 受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中	2023	6个月	新股	11.88	21.02	399	4,740.12	8,386.98	-

	电港	年 3 月 30 日		流通受限						
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	20.68	25.49	114	2,357.52	2,905.86	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	15.38	14.87	155	2,383.90	2,304.85	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
001380	华纬科技	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
300804	广康生化	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通受限	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301141	中科磁业	2023 年 3 月 27 日	6 个月	新股流通受限	41.20	42.69	258	10,629.60	11,014.02	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股流通受限	56.50	52.93	135	7,627.50	7,145.55	-
301170	锡南科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1 个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗	2023	6 个月	新股	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-

	威股份	年 06 月 28 日		流通受限						
301203	国泰环保	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	46.13	34.40	217	10,010.21	7,464.80	-
301210	金杨股份	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通受限	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
301225	恒勃股份	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股流通受限	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301232	飞沃科技	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股流通受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301260	格力博	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	30.85	23.63	512	15,795.20	12,098.56	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1 个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023 年 06 月 29 日	6 个月	新股流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301281	科源制药	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	31.56	25.10	301	9,498.70	7,555.10	含转增股
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	1 个月内(含)	新股未上市	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301292	海科新源	2023 年 06 月 29 日	6 个月	新股流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
301293	三	2023	6 个月	新股	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-

	博脑科	年 4 月 25 日		流通受限						
301301	川宁生物	2022 年 12 月 20 日	6 个月	新股流通受限	5.00	8.96	1,988	9,940.00	17,812.48	-
301305	朗坤环境	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	25.25	19.69	719	18,154.75	14,157.11	-
301307	美利信	2023 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	32.34	31.86	385	12,450.90	12,266.10	-
301310	鑫宏业	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股流通受限	67.28	65.43	365	24,557.20	23,881.95	-
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	6 个月	新股流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股流通受限	76.80	107.95	319	24,499.20	34,436.05	-
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	14.81	13.73	1,086	16,083.66	14,910.78	-
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛	2023	6 个月	新股	73.45	46.64	103	7,565.35	4,803.92	-

	涛车业	年 3 月 10 日		流通受限						
301355	南王科技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通受限	23.77	42.89	332	7,891.64	14,239.48	-
301360	荣旗科技	2023 年 4 月 17 日	6 个月	新股流通受限	71.88	92.60	124	8,913.12	11,482.40	-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	33.73	31.85	228	7,690.44	7,261.80	-
301376	致欧科技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301383	天键股份	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股流通受限	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96	-
301395	仁信新材	2023 年 6 月 21 日	1 个月内(含)	新股未上市	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
301395	仁信新材	2023 年 06 月 21 日	6 个月	新股流通受限	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-
301397	溯联股份	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301399	英	2023	6 个月	新股	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-

	特科技	年 5 月 16 日		流通受限						
301419	阿莱德	2023 年 2 月 2 日	6 个月	新股流通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	19.99	16.90	329	6,576.71	5,560.10	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月内(含)	新股未上市	57.66	57.66	3,194	184,166.04	184,166.04	-
301486	致尚科技	2023 年 06 月 30 日	6 个月	新股流通受限	57.66	57.66	355	20,469.30	20,469.30	-
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	6.58	7.58	893	5,875.94	6,768.94	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	10.36	11.84	292	3,025.12	3,457.28	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	11.66	12.26	278	3,241.48	3,408.28	-
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	25.98	24.53	91	2,364.18	2,232.23	-
603135	中重科技	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	17.80	17.89	302	5,375.60	5,402.78	-
603137	恒	2023	6 个月	新股	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-

	尚节能	年 4 月 10 日		流通受限						
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	36.15	38.13	279	10,085.85	10,638.27	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股流通受限	19.86	18.06	3,616	71,813.76	65,304.96	-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股流通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688352	顾中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通受限	12.10	12.07	846	10,236.60	10,211.22	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	23.60	64.67	529	12,484.40	34,210.43	-
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股流通受限	26.66	31.50	263	7,011.58	8,284.50	-
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	37.88	29.49	962	36,440.56	28,369.38	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	75.00	90.76	201	15,075.00	18,242.76	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通受限	5.69	5.41	6,693	38,083.17	36,209.13	-
688472	阿	2023	6 个月	新股	11.10	17.04	1,865	20,701.50	31,779.60	-

	特斯	年 6 月 2 日		流通受限							
688478	晶升股份	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	32.52	42.37	329	10,699.08	13,939.73	-	
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股流通受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-	
688484	南芯科技	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	39.99	36.71	284	11,357.16	10,425.64	-	
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-	
688515	裕太微	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通受限	92.00	162.75	1,434	131,928.00	233,383.50	-	
688523	航天环宇	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股流通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-	
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-	
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流通受限	43.67	53.05	376	16,419.92	19,946.80	-	
688552	航天南湖	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	21.17	23.50	779	16,491.43	18,306.50	-	
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-	
688576	西	2023	6 个月	新股	135.80	120.41	189	25,666.20	22,757.49	-	

	山科技	年 5 月 30 日		流通受限						
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通受限	26.74	40.68	604	16,150.96	24,570.72	-
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	新股流通受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月内(含)	新股未上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股流通受限	125.88	86.79	119	14,979.72	10,328.01	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	000034	神州数码	2023 年 7 月 7 日-2023 年 7 月 14 日	26.59	6,100	162,199.00
2	000049	德赛电池	2023 年 7 月 7 日-2023 年 7 月 14 日	35.28	3,100	109,368.00
3	000065	北方国际	2023 年 7 月 7 日-2023 年 7 月 14 日	15.02	6,700	100,634.00
4	000417	合肥百货	2023 年 7 月 7 日-2023 年 7 月 14 日	4.68	21,300	99,684.00
5	000422	湖北宜化	2023 年 7 月 7 日-2023 年 7 月 14 日	11.48	13,900	159,572.00
6	000426	兴业银锡	2023 年 7 月 7 日-2023 年 7 月 14 日	8.88	24,600	218,448.00
7	000503	国新健康	2023 年 7 月 7 日-2023 年 7 月 14 日	11.99	9,000	107,910.00
8	000531	穗恒运 A	2023 年 7 月 7 日-2023 年 7 月 14 日	7.23	26,000	187,980.00
9	000551	创元科技	2023 年 7 月 7 日-2023 年 7 月 14 日	11.11	11,000	122,210.00
10	000612	焦作万方	2023 年 7 月 7 日-2023 年 7 月 14 日	4.84	47,100	227,964.00
11	000650	仁和药业	2023 年 7 月 7 日-2023 年 7 月 14 日	6.14	17,700	108,678.00
12	000681	视觉中国	2023 年 7 月 7 日-2023 年 7 月 14 日	18.39	7,600	139,764.00
13	000735	罗牛山	2023 年 7 月 7 日-2023 年 7 月 14 日	6.54	38,300	250,482.00
14	000758	中色股份	2023 年 7 月 7 日-2023 年 7 月 14 日	4.72	52,500	247,800.00
15	000766	通化金马	2023 年 7 月 7 日-2023 年 7 月 14 日	4.80	20,000	96,000.00
16	000810	创维数字	2023 年 7 月 7 日-2023 年 7 月 14 日	16.17	8,000	129,360.00
17	000821	京山轻机	2023 年 7 月 7 日-2023 年 7 月 14 日	20.46	6,800	139,128.00
18	000851	高鸿股	2023 年 7 月 7 日-2023 年	5.44	37,900	206,176.00

		份	7月14日			0
19	000859	国风新材	2023年7月7日-2023年7月14日	4.95	44,600	220,770.00
20	000910	大亚圣象	2023年7月7日-2023年7月14日	7.81	31,400	245,234.00
21	000915	华特达因	2023年7月7日-2023年7月14日	35.29	3,200	112,928.00
22	000917	电广传媒	2023年7月7日-2023年7月14日	7.31	21,100	154,241.00
23	000921	海信家电	2023年7月7日-2023年7月14日	26.95	5,900	159,005.00
24	000973	佛塑科技	2023年7月7日-2023年7月14日	4.46	28,800	128,448.00
25	002003	伟星股份	2023年7月7日-2023年7月14日	9.36	17,800	166,608.00
26	002006	精工科技	2023年7月7日-2023年7月14日	21.57	7,500	161,775.00
27	002011	盾安环境	2023年7月7日-2023年7月14日	13.83	10,300	142,449.00
28	002015	协鑫能科	2023年7月7日-2023年7月14日	13.43	9,700	130,271.00
29	002020	京新药业	2023年7月7日-2023年7月14日	12.82	12,200	156,404.00
30	002023	海特高新	2023年7月7日-2023年7月14日	9.20	22,900	210,680.00
31	002026	山东威达	2023年7月7日-2023年7月14日	9.40	25,100	235,940.00
32	002035	华帝股份	2023年7月7日-2023年7月14日	7.10	31,000	220,100.00
33	002036	联创电子	2023年7月7日-2023年7月14日	9.71	20,700	200,997.00
34	002039	黔源电力	2023年7月7日-2023年7月14日	14.07	13,600	191,352.00
35	002054	德美化工	2023年7月7日-2023年7月14日	6.98	17,900	124,942.00
36	002061	浙江交科	2023年7月7日-2023年7月14日	4.46	43,400	193,564.00
37	002063	远光软件	2023年7月7日-2023年7月14日	8.68	9,200	79,856.00
38	002067	景兴纸业	2023年7月7日-2023年7月14日	3.45	36,100	124,545.00
39	002079	苏州固锝	2023年7月7日-2023年7月14日	14.60	12,200	178,120.00
40	002100	天康生	2023年7月7日-2023年7月14日	8.25	19,200	158,400.00

		物	7月14日			0
41	002121	科陆电子	2023年7月7日-2023年7月14日	7.33	17,400	127,542.00
42	002126	银轮股份	2023年7月7日-2023年7月14日	17.70	16,200	286,740.00
43	002130	沃尔核材	2023年7月7日-2023年7月14日	8.12	28,100	228,172.00
44	002139	拓邦股份	2023年7月7日-2023年7月14日	13.05	16,500	215,325.00
45	002154	报喜鸟	2023年7月7日-2023年7月14日	5.52	14,100	77,832.00
46	002163	海南发展	2023年7月7日-2023年7月14日	10.00	15,400	154,000.00
47	002182	云海金属	2023年7月7日-2023年7月14日	21.99	6,600	145,134.00
48	002206	海利得	2023年7月7日-2023年7月14日	5.36	29,800	159,728.00
49	002212	天融信	2023年7月7日-2023年7月14日	9.70	17,700	171,690.00
50	002214	大立科技	2023年7月7日-2023年7月14日	13.65	13,700	187,005.00
51	002215	诺普信	2023年7月7日-2023年7月14日	7.51	25,800	193,758.00
52	002222	福晶科技	2023年7月7日-2023年7月14日	27.74	5,900	163,666.00
53	002229	鸿博股份	2023年7月7日-2023年7月14日	35.08	3,300	115,764.00
54	002234	民和股份	2023年7月7日-2023年7月14日	18.21	10,400	189,384.00
55	002239	奥特佳	2023年7月7日-2023年7月14日	2.67	79,300	211,731.00
56	002240	盛新锂能	2023年7月7日-2023年7月14日	31.87	7,800	248,586.00
57	002261	拓维信息	2023年7月7日-2023年7月14日	19.31	13,000	251,030.00
58	002263	大东南	2023年7月7日-2023年7月14日	2.58	43,400	111,972.00
59	002277	友阿股份	2023年7月7日-2023年7月14日	3.16	31,400	99,224.00
60	002288	超华科技	2023年7月7日-2023年7月14日	4.22	48,100	202,982.00
61	002291	遥望科技	2023年7月7日-2023年7月14日	13.10	10,400	136,240.00
62	002292	奥飞娱	2023年7月7日-2023年7月14日	9.98	10,400	103,792.00

		乐	7月14日			0
63	002293	罗莱生活	2023年7月7日-2023年7月14日	11.50	24,800	285,200.00
64	002303	美盈森	2023年7月7日-2023年7月14日	3.23	76,700	247,741.00
65	002317	众生药业	2023年7月7日-2023年7月14日	16.99	8,500	144,415.00
66	002318	久立特材	2023年7月7日-2023年7月14日	17.03	11,100	189,033.00
67	002324	普利特	2023年7月7日-2023年7月14日	14.27	10,900	155,543.00
68	002326	永太科技	2023年7月7日-2023年7月14日	15.29	11,300	172,777.00
69	002332	仙琚制药	2023年7月7日-2023年7月14日	13.25	20,200	267,650.00
70	002334	英威腾	2023年7月7日-2023年7月14日	12.74	13,600	173,264.00
71	002335	科华数据	2023年7月7日-2023年7月14日	35.95	3,600	129,420.00
72	002351	漫步者	2023年7月7日-2023年7月14日	20.68	6,100	126,148.00
73	002354	天娱数科	2023年7月7日-2023年7月14日	7.01	17,700	124,077.00
74	002400	省广集团	2023年7月7日-2023年7月14日	4.81	43,600	209,716.00
75	002412	汉森制药	2023年7月7日-2023年7月14日	6.57	32,500	213,525.00
76	002413	雷科防务	2023年7月7日-2023年7月14日	5.23	41,200	215,476.00
77	002428	云南锗业	2023年7月7日-2023年7月14日	12.16	21,500	261,440.00
78	002432	九安医疗	2023年7月7日-2023年7月14日	35.21	2,900	102,109.00
79	002446	盛路通信	2023年7月7日-2023年7月14日	9.45	15,600	147,420.00
80	002452	长高电新	2023年7月7日-2023年7月14日	7.36	31,500	231,840.00
81	002458	益生股份	2023年7月7日-2023年7月14日	12.35	12,200	150,670.00
82	002476	宝莫股份	2023年7月7日-2023年7月14日	4.49	18,800	84,412.00
83	002481	双塔食品	2023年7月7日-2023年7月14日	4.46	41,200	183,752.00
84	002517	恺英网	2023年7月7日-2023年	15.74	17,400	273,876.00

		络	7月14日			0
85	002526	山东矿机	2023年7月7日-2023年7月14日	2.50	51,800	129,500.00
86	002527	新时达	2023年7月7日-2023年7月14日	13.60	25,700	349,520.00
87	002544	普天科技	2023年7月7日-2023年7月14日	22.90	6,500	148,850.00
88	002548	金新农	2023年7月7日-2023年7月14日	7.66	32,200	246,652.00
89	002567	唐人神	2023年7月7日-2023年7月14日	6.65	21,500	142,975.00
90	002577	雷柏科技	2023年7月7日-2023年7月14日	16.65	10,900	181,485.00
91	002662	京威股份	2023年7月7日-2023年7月14日	3.33	33,800	112,554.00
92	002675	东诚药业	2023年7月7日-2023年7月14日	14.71	13,600	200,056.00
93	002698	博实股份	2023年7月7日-2023年7月14日	17.49	6,700	117,183.00
94	002707	众信旅游	2023年7月7日-2023年7月14日	7.53	20,700	155,871.00
95	002807	江阴银行	2023年7月7日-2023年7月14日	3.69	61,000	225,090.00
96	002832	比音勒芬	2023年7月7日-2023年7月14日	35.41	6,400	226,624.00
97	002837	英维克	2023年7月7日-2023年7月14日	29.94	3,500	104,790.00
98	002851	麦格米特	2023年7月7日-2023年7月14日	36.47	6,900	251,643.00
99	002928	华夏航空	2023年7月7日-2023年7月14日	8.45	19,300	163,085.00
100	300002	神州泰岳	2023年7月7日-2023年7月14日	14.00	19,400	271,600.00
101	300031	宝通科技	2023年7月7日-2023年7月14日	24.72	3,100	76,632.00
102	300035	中科电气	2023年7月7日-2023年7月14日	12.02	11,100	133,422.00
103	300036	超图软件	2023年7月7日-2023年7月14日	23.71	9,600	227,616.00
104	300041	回天新材	2023年7月7日-2023年7月14日	11.80	13,400	158,120.00
105	300048	合康新能	2023年7月7日-2023年7月14日	5.98	19,000	113,620.00
106	300055	万邦达	2023年7月7日-2023年7月14日	7.20	20,900	150,480.00

			7月14日			0
107	300065	海兰信	2023年7月7日-2023年7月14日	12.39	10,500	130,095.00
108	300075	数字政通	2023年7月7日-2023年7月14日	24.88	3,700	92,056.00
109	300077	国民技术	2023年7月7日-2023年7月14日	13.30	10,000	133,000.00
110	300079	数码视讯	2023年7月7日-2023年7月14日	6.10	22,900	139,690.00
111	300083	创世纪	2023年7月7日-2023年7月14日	7.31	27,000	197,370.00
112	300087	荃银高科	2023年7月7日-2023年7月14日	10.34	15,400	159,236.00
113	300091	金通灵	2023年7月7日-2023年7月14日	2.98	77,000	229,460.00
114	300099	精准信息	2023年7月7日-2023年7月14日	6.36	39,400	250,584.00
115	300101	振芯科技	2023年7月7日-2023年7月14日	19.39	8,200	158,998.00
116	300109	新开源	2023年7月7日-2023年7月14日	24.87	5,800	144,246.00
117	300110	华仁药业	2023年7月7日-2023年7月14日	4.03	30,400	122,512.00
118	300113	顺网科技	2023年7月7日-2023年7月14日	17.21	6,400	110,144.00
119	300114	中航电测	2023年7月7日-2023年7月14日	49.15	2,300	113,045.00
120	300129	泰胜风能	2023年7月7日-2023年7月14日	9.59	12,600	120,834.00
121	300130	新国都	2023年7月7日-2023年7月14日	28.33	3,100	87,823.00
122	300131	英唐智控	2023年7月7日-2023年7月14日	5.25	19,500	102,375.00
123	300149	睿智医药	2023年7月7日-2023年7月14日	7.81	22,400	174,944.00
124	300166	东方国信	2023年7月7日-2023年7月14日	11.24	12,800	143,872.00
125	300168	万达信息	2023年7月7日-2023年7月14日	11.33	12,400	140,492.00
126	300170	汉得信息	2023年7月7日-2023年7月14日	11.54	20,600	237,724.00
127	300180	华峰超纤	2023年7月7日-2023年7月14日	3.61	26,800	96,748.00
128	300188	美亚柏	2023年7月7日-2023年7月14日	20.79	6,000	124,740.00

		科	7月14日			0
129	300189	神农科技	2023年7月7日-2023年7月14日	3.24	71,600	231,984.00
130	300191	潜能恒信	2023年7月7日-2023年7月14日	18.28	13,000	237,640.00
131	300194	福安药业	2023年7月7日-2023年7月14日	3.88	71,900	278,972.00
132	300199	翰宇药业	2023年7月7日-2023年7月14日	10.18	8,700	88,566.00
133	300203	聚光科技	2023年7月7日-2023年7月14日	20.27	6,100	123,647.00
134	300212	易华录	2023年7月7日-2023年7月14日	33.23	3,400	112,982.00
135	300222	科大智能	2023年7月7日-2023年7月14日	8.91	21,900	195,129.00
136	300226	上海钢联	2023年7月7日-2023年7月14日	32.40	3,000	97,200.00
137	300229	拓尔思	2023年7月7日-2023年7月14日	25.97	5,800	150,626.00
138	300232	洲明科技	2023年7月7日-2023年7月14日	9.14	19,100	174,574.00
139	300237	美晨生态	2023年7月7日-2023年7月14日	1.89	125,500	237,195.00
140	300258	精锻科技	2023年7月7日-2023年7月14日	14.49	19,200	278,208.00
141	300263	隆华科技	2023年7月7日-2023年7月14日	8.32	19,700	163,904.00
142	300284	苏交科	2023年7月7日-2023年7月14日	6.00	29,900	179,400.00
143	300287	飞利信	2023年7月7日-2023年7月14日	4.45	46,400	206,480.00
144	300315	掌趣科技	2023年7月7日-2023年7月14日	7.80	27,300	212,940.00
145	300322	硕贝德	2023年7月7日-2023年7月14日	8.46	23,500	198,810.00
146	300326	凯利泰	2023年7月7日-2023年7月14日	6.50	34,200	222,300.00
147	300327	中颖电子	2023年7月7日-2023年7月14日	27.96	3,800	106,248.00
148	300328	宜安科技	2023年7月7日-2023年7月14日	6.95	29,200	202,940.00
149	300332	天壕环境	2023年7月7日-2023年7月14日	11.47	14,600	167,462.00
150	300348	长亮科	2023年7月7日-2023年	10.44	19,000	198,360.00

		技	7月14日			0
151	300352	北信源	2023年7月7日-2023年7月14日	5.04	46,000	231,840.00
152	300353	东土科技	2023年7月7日-2023年7月14日	13.01	13,000	169,130.00
153	300364	中文在线	2023年7月7日-2023年7月14日	17.82	6,600	117,612.00
154	300379	东方通	2023年7月7日-2023年7月14日	20.57	7,800	160,446.00
155	300393	中来股份	2023年7月7日-2023年7月14日	14.04	10,200	143,208.00
156	300394	天孚通信	2023年7月7日-2023年7月14日	106.83	2,100	224,343.00
157	300398	飞凯材料	2023年7月7日-2023年7月14日	17.19	9,100	156,429.00
158	300409	道氏技术	2023年7月7日-2023年7月14日	12.57	15,200	191,064.00
159	300415	伊之密	2023年7月7日-2023年7月14日	19.20	8,400	161,280.00
160	300416	苏试试验	2023年7月7日-2023年7月14日	21.56	8,700	187,572.00
161	300443	金雷股份	2023年7月7日-2023年7月14日	35.45	2,800	99,260.00
162	300451	创业慧康	2023年7月7日-2023年7月14日	8.38	19,100	160,058.00
163	300456	赛微电子	2023年7月7日-2023年7月14日	24.48	6,500	159,120.00
164	300463	迈克生物	2023年7月7日-2023年7月14日	15.12	13,500	204,120.00
165	300477	合纵科技	2023年7月7日-2023年7月14日	4.67	43,800	204,546.00
166	300493	润欣科技	2023年7月7日-2023年7月14日	9.12	27,400	249,888.00
167	300573	兴齐眼药	2023年7月7日	213.80	1,000	213,800.00
168	300587	天铁股份	2023年7月7日-2023年7月14日	7.70	17,400	133,980.00
169	300593	新雷能	2023年7月7日-2023年7月14日	22.91	10,000	229,100.00
170	300596	利安隆	2023年7月7日-2023年7月14日	40.67	3,700	150,479.00
171	300613	富瀚微	2023年7月7日-2023年7月14日	56.74	2,100	119,154.00
172	300638	广和通	2023年7月7日-2023年	22.68	7,900	179,172.00

			7月14日			0
173	300655	晶瑞电材	2023年7月7日-2023年7月14日	19.91	7,800	155,298.00
174	300674	宇信科技	2023年7月7日-2023年7月14日	17.68	13,400	236,912.00
175	300679	电连技术	2023年7月7日-2023年7月14日	33.05	3,500	115,675.00
176	300685	艾德生物	2023年7月7日-2023年7月14日	24.26	7,900	191,654.00
177	300693	盛弘股份	2023年7月7日-2023年7月14日	36.92	2,700	99,684.00
178	300737	科顺股份	2023年7月7日-2023年7月14日	9.16	16,000	146,560.00
179	300739	明阳电路	2023年7月7日-2023年7月14日	14.89	15,100	224,839.00
180	300762	上海瀚讯	2023年7月7日-2023年7月14日	11.77	14,500	170,665.00
181	300767	震安科技	2023年7月7日-2023年7月14日	25.36	6,300	159,768.00
182	300770	新媒股份	2023年7月7日-2023年7月14日	45.86	3,500	160,510.00
183	300825	阿尔特	2023年7月7日-2023年7月14日	18.29	12,300	224,967.00
184	300855	图南股份	2023年7月7日-2023年7月14日	35.32	3,000	105,960.00
185	300867	圣元环保	2023年7月7日-2023年7月14日	17.43	13,100	228,333.00
186	300878	维康药业	2023年7月7日-2023年7月14日	22.70	7,200	163,440.00
187	300890	翔丰华	2023年7月7日-2023年7月14日	41.10	2,900	119,190.00
188	300891	惠云钛业	2023年7月7日-2023年7月14日	9.14	23,500	214,790.00
189	300908	仲景食品	2023年7月7日-2023年7月14日	45.35	3,100	140,585.00
190	300910	瑞丰新材	2023年7月7日-2023年7月14日	50.30	2,000	100,600.00
191	300975	商络电子	2023年7月7日-2023年7月14日	7.15	35,300	252,395.00
192	300994	久祺股份	2023年7月7日-2023年7月14日	15.44	10,200	157,488.00
193	301031	中熔电气	2023年7月7日	135.71	1,000	135,710.00
194	301050	雷电微	2023年7月7日-2023年	64.93	2,400	155,832.00

		力	7月14日			0
195	301080	百普赛斯	2023年7月7日-2023年7月14日	62.82	2,600	163,332.00
196	301109	军信股份	2023年7月7日-2023年7月14日	16.51	14,000	231,140.00
197	301149	隆华新材	2023年7月7日-2023年7月14日	10.44	18,300	191,052.00
198	301150	中一科技	2023年7月7日-2023年7月14日	50.01	2,500	125,025.00
199	301155	海力风电	2023年7月7日	77.08	1,000	77,080.00
200	301389	隆扬电子	2023年7月7日-2023年7月14日	18.18	11,700	212,706.00
201	600063	皖维高新	2023年7月7日-2023年7月14日	5.05	27,800	140,390.00
202	600072	中船科技	2023年7月7日-2023年7月14日	28.17	3,600	101,412.00
203	600094	大名城	2023年7月7日-2023年7月14日	3.09	30,400	93,936.00
204	600123	兰花科创	2023年7月7日-2023年7月14日	8.18	17,200	140,696.00
205	600125	铁龙物流	2023年7月7日-2023年7月14日	6.04	43,900	265,156.00
206	600129	太极集团	2023年7月7日-2023年7月14日	59.49	3,100	184,419.00
207	600135	乐凯胶片	2023年7月7日-2023年7月14日	7.54	16,000	120,640.00
208	600138	中青旅	2023年7月7日-2023年7月14日	12.51	16,200	202,662.00
209	600151	航天机电	2023年7月7日-2023年7月14日	8.91	21,700	193,347.00
210	600162	香江控股	2023年7月7日-2023年7月14日	1.99	57,800	115,022.00
211	600179	安通控股	2023年7月7日-2023年7月14日	2.79	67,000	186,930.00
212	600197	伊力特	2023年7月7日-2023年7月14日	27.17	7,300	198,341.00
213	600199	金种子酒	2023年7月7日-2023年7月14日	23.74	6,100	144,814.00
214	600201	生物股份	2023年7月7日-2023年7月14日	9.51	11,600	110,316.00
215	600266	城建发展	2023年7月7日-2023年7月14日	5.08	31,600	160,528.00
216	600284	浦东建	2023年7月7日-2023年	6.12	27,600	168,912.00

		设	7月14日			0
217	600285	羚锐制 药	2023年7月7日-2023年 7月14日	16.06	15,200	244,112.0 0
218	600293	三峡新 材	2023年7月7日-2023年 7月14日	2.64	96,000	253,440.0 0
219	600359	新农开 发	2023年7月7日-2023年 7月14日	7.77	24,400	189,588.0 0
220	600360	华微电 子	2023年7月7日-2023年 7月14日	6.88	29,400	202,272.0 0
221	600363	联创光 电	2023年7月7日-2023年 7月14日	37.10	6,700	248,570.0 0
222	600368	五洲交 通	2023年7月7日-2023年 7月14日	3.64	38,300	139,412.0 0
223	600391	航发科 技	2023年7月7日-2023年 7月14日	24.11	11,000	265,210.0 0
224	600422	昆药集 团	2023年7月7日-2023年 7月14日	20.72	7,100	147,112.0 0
225	600446	金证股 份	2023年7月7日-2023年 7月14日	14.54	8,200	119,228.0 0
226	600452	涪陵电 力	2023年7月7日-2023年 7月14日	21.28	9,700	206,416.0 0
227	600478	科力远	2023年7月7日-2023年 7月14日	7.14	23,600	168,504.0 0
228	600502	安徽建 工	2023年7月7日-2023年 7月14日	5.28	30,000	158,400.0 0
229	600503	华丽家 族	2023年7月7日-2023年 7月14日	2.83	60,000	169,800.0 0
230	600512	腾达建 设	2023年7月7日-2023年 7月14日	2.68	73,800	197,784.0 0
231	600531	豫光金 铅	2023年7月7日-2023年 7月14日	6.30	39,400	248,220.0 0
232	600533	栖霞建 设	2023年7月7日-2023年 7月14日	3.08	29,400	90,552.00
233	600552	凯盛科 技	2023年7月7日-2023年 7月14日	11.84	12,000	142,080.0 0
234	600557	康缘药 业	2023年7月7日-2023年 7月14日	27.46	6,400	175,744.0 0
235	600565	迪马股 份	2023年7月7日-2023年 7月14日	1.58	171,000	270,180.0 0
236	600572	康恩贝	2023年7月7日-2023年 7月14日	6.85	33,000	226,050.0 0
237	600577	精达股 份	2023年7月7日-2023年 7月14日	4.22	37,900	159,938.0 0
238	600587	新华医	2023年7月7日-2023年	35.33	3,300	116,589.0

		疗	7月14日			0
239	600594	益佰制 药	2023年7月7日-2023年 7月14日	5.27	38,500	202,895.0 0
240	600622	光大嘉 宝	2023年7月7日-2023年 7月14日	2.92	31,700	92,564.00
241	600633	浙数文 化	2023年7月7日-2023年 7月14日	16.21	10,200	165,342.0 0
242	600694	大商股 份	2023年7月7日-2023年 7月14日	17.73	12,800	226,944.0 0
243	600728	佳都科 技	2023年7月7日-2023年 7月14日	6.93	24,600	170,478.0 0
244	600750	江中药 业	2023年7月7日-2023年 7月14日	21.93	7,300	160,089.0 0
245	600756	浪潮软 件	2023年7月7日-2023年 7月14日	16.62	10,900	181,158.0 0
246	600761	安徽合 力	2023年7月7日-2023年 7月14日	19.93	9,100	181,363.0 0
247	600771	广誉远	2023年7月7日-2023年 7月14日	35.27	3,700	130,499.0 0
248	600789	鲁抗医 药	2023年7月7日-2023年 7月14日	6.42	18,800	120,696.0 0
249	600790	轻纺城	2023年7月7日-2023年 7月14日	4.33	22,000	95,260.00
250	600797	浙大网 新	2023年7月7日-2023年 7月14日	7.14	23,700	169,218.0 0
251	600831	广电网 络	2023年7月7日-2023年 7月14日	6.00	40,500	243,000.0 0
252	600850	电科数 字	2023年7月7日-2023年 7月14日	23.59	10,100	238,259.0 0
253	600868	梅雁吉 祥	2023年7月7日-2023年 7月14日	2.76	90,600	250,056.0 0
254	600877	电科芯 片	2023年7月7日-2023年 7月14日	14.94	10,000	149,400.0 0
255	600976	健民集 团	2023年7月7日-2023年 7月14日	77.09	2,100	161,889.0 0
256	600979	广安爱 众	2023年7月7日-2023年 7月14日	3.60	47,900	172,440.0 0
257	600986	浙文互 联	2023年7月7日-2023年 7月14日	6.40	31,200	199,680.0 0
258	600993	马应龙	2023年7月7日-2023年 7月14日	27.81	6,300	175,203.0 0
259	601011	宝泰隆	2023年7月7日-2023年 7月14日	3.59	29,800	106,982.0 0
260	601208	东材科	2023年7月7日-2023年	12.70	15,100	191,770.0

		技	7月14日			0
261	601858	中国科 传	2023年7月7日-2023年 7月14日	33.60	2,400	80,640.00
262	601890	亚星锚 链	2023年7月7日-2023年 7月14日	11.58	15,300	177,174.0 0
263	601900	南方传 媒	2023年7月7日-2023年 7月14日	20.51	3,100	63,581.00
264	601975	招商南 油	2023年7月7日-2023年 7月14日	2.86	52,100	149,006.0 0
265	603008	喜临门	2023年7月7日-2023年 7月14日	25.18	5,900	148,562.0 0
266	603012	创力集 团	2023年7月7日-2023年 7月14日	6.17	46,600	287,522.0 0
267	603018	华设集 团	2023年7月7日-2023年 7月14日	8.75	18,900	165,375.0 0
268	603035	常熟汽 饰	2023年7月7日-2023年 7月14日	19.43	7,600	147,668.0 0
269	603063	禾望电 气	2023年7月7日-2023年 7月14日	30.75	6,400	196,800.0 0
270	603083	剑桥科 技	2023年7月7日-2023年 7月14日	62.89	2,100	132,069.0 0
271	603100	川仪股 份	2023年7月7日-2023年 7月14日	38.86	2,600	101,036.0 0
272	603118	共进股 份	2023年7月7日-2023年 7月14日	13.29	20,900	277,761.0 0
273	603179	新泉股 份	2023年7月7日-2023年 7月14日	43.89	3,500	153,615.0 0
274	603197	保隆科 技	2023年7月7日-2023年 7月14日	54.25	2,700	146,475.0 0
275	603220	中贝通 信	2023年7月7日-2023年 7月14日	17.05	16,300	277,915.0 0
276	603279	景津装 备	2023年7月7日-2023年 7月14日	31.36	6,900	216,384.0 0
277	603300	华铁应 急	2023年7月7日-2023年 7月14日	5.45	14,600	79,570.00
278	603306	华懋科 技	2023年7月7日-2023年 7月14日	29.02	3,500	101,570.0 0
279	603308	应流股 份	2023年7月7日-2023年 7月14日	18.30	11,900	217,770.0 0
280	603323	苏农银 行	2023年7月7日-2023年 7月14日	4.21	47,100	198,291.0 0
281	603387	基蛋生 物	2023年7月7日-2023年 7月14日	12.89	14,800	190,772.0 0
282	603477	巨星农	2023年7月7日-2023年	33.35	3,200	106,720.0

		牧	7月14日			0
283	603566	普莱柯	2023年7月7日-2023年7月14日	23.25	5,900	137,175.00
284	603588	高能环境	2023年7月7日-2023年7月14日	9.37	23,000	215,510.00
285	603601	再升科技	2023年7月7日-2023年7月14日	4.27	29,600	126,392.00
286	603690	至纯科技	2023年7月7日-2023年7月14日	34.84	3,500	121,940.00
287	603708	家家悦	2023年7月7日-2023年7月14日	12.54	15,300	191,862.00
288	603881	数据港	2023年7月7日-2023年7月14日	22.59	7,600	171,684.00
289	603890	春秋电子	2023年7月7日-2023年7月14日	8.56	25,900	221,704.00
290	603959	百利科技	2023年7月7日-2023年7月14日	11.50	17,000	195,500.00
291	603960	克来机电	2023年7月7日-2023年7月14日	18.65	5,600	104,440.00
292	603979	金诚信	2023年7月7日-2023年7月14日	31.10	7,200	223,920.00
293	603995	甬金股份	2023年7月7日-2023年7月14日	23.91	5,800	138,678.00
294	603997	继峰股份	2023年7月7日-2023年7月14日	14.30	10,500	150,150.00
295	605208	永茂泰	2023年7月7日-2023年7月14日	10.02	19,400	194,388.00
296	605305	中际联合	2023年7月7日-2023年7月14日	34.86	3,000	104,580.00
297	688007	光峰科技	2023年7月7日-2023年7月14日	20.85	6,600	137,610.00
298	688018	乐鑫科技	2023年7月7日	129.82	1,000	129,820.00
299	688019	安集科技	2023年7月7日	164.83	1,000	164,830.00
300	688023	安恒信息	2023年7月7日	174.71	1,000	174,710.00
301	688027	国盾量子	2023年7月7日	158.32	1,000	158,320.00
302	688033	天宜上佳	2023年7月7日-2023年7月14日	19.12	9,100	173,992.00
303	688037	芯源微	2023年7月7日	170.95	1,000	170,950.00
304	688066	航天宏	2023年7月7日-2023年	60.90	2,700	164,430.00

		图	7月14日			0
305	688083	中望软件	2023年7月7日	144.89	1,000	144,890.00
306	688088	虹软科技	2023年7月7日-2023年7月14日	42.75	2,700	115,425.00
307	688095	福昕软件	2023年7月7日	126.38	1,000	126,380.00
308	688106	金宏气体	2023年7月7日-2023年7月14日	27.20	7,600	206,720.00
309	688110	东芯股份	2023年7月7日-2023年7月14日	36.10	3,100	111,910.00
310	688116	天奈科技	2023年7月7日-2023年7月14日	45.75	3,000	137,250.00
311	688133	泰坦科技	2023年7月7日	85.19	1,000	85,190.00
312	688148	芳源股份	2023年7月7日-2023年7月14日	12.20	15,400	187,880.00
313	688158	优刻得	2023年7月7日-2023年7月14日	18.88	7,300	137,824.00
314	688166	博瑞医药	2023年7月7日-2023年7月14日	21.99	4,900	107,751.00
315	688186	广大特材	2023年7月7日-2023年7月14日	32.53	3,100	100,843.00
316	688196	卓越新能	2023年7月7日-2023年7月14日	46.25	3,100	143,375.00
317	688208	道通科技	2023年7月7日-2023年7月14日	30.31	3,200	96,992.00
318	688232	新点软件	2023年7月7日-2023年7月14日	53.81	2,500	134,525.00
319	688239	航宇科技	2023年7月7日-2023年7月14日	69.95	2,400	167,880.00
320	688262	国芯科技	2023年7月7日-2023年7月14日	40.69	2,100	85,449.00
321	688266	泽璟制药	2023年7月7日-2023年7月14日	46.55	2,600	121,030.00
322	688269	凯立新材	2023年7月7日-2023年7月14日	63.79	2,600	165,854.00
323	688270	臻镭科技	2023年7月7日-2023年7月14日	64.93	2,100	136,353.00
324	688277	天智航	2023年7月7日-2023年7月14日	18.44	10,900	200,996.00
325	688278	特宝生物	2023年7月7日-2023年7月14日	43.91	2,600	114,166.00
326	688299	长阳科	2023年7月7日-2023年	15.67	13,100	205,277.00

		技	7月14日			0
327	688306	均普智能	2023年7月7日-2023年7月14日	5.39	43,200	232,848.00
328	688321	微芯生物	2023年7月7日-2023年7月14日	22.64	8,200	185,648.00
329	688326	经纬恒润	2023年7月7日	144.39	1,000	144,390.00
330	688333	铂力特	2023年7月7日-2023年7月14日	105.74	2,200	232,628.00
331	688339	亿华通	2023年7月7日-2023年7月14日	85.00	2,200	187,000.00
332	688345	博力威	2023年7月7日-2023年7月14日	37.11	3,200	118,752.00
333	688389	普门科技	2023年7月7日-2023年7月14日	23.49	6,700	157,383.00
334	688408	中信博	2023年7月7日	84.33	1,000	84,330.00
335	688508	芯朋微	2023年7月7日-2023年7月14日	57.99	2,200	127,578.00
336	688518	联赢激光	2023年7月7日-2023年7月14日	27.86	6,100	169,946.00
337	688556	高测股份	2023年7月7日-2023年7月14日	53.14	2,800	148,792.00
338	688559	海目星	2023年7月7日-2023年7月14日	47.01	2,600	122,226.00
339	688596	正帆科技	2023年7月7日-2023年7月14日	43.30	2,700	116,910.00
340	688608	恒玄科技	2023年7月7日	121.03	1,000	121,030.00
341	688639	华恒生物	2023年7月7日	90.48	1,000	90,480.00
342	688667	菱电电控	2023年7月7日-2023年7月14日	74.63	2,200	164,186.00
343	688680	海优新材	2023年7月7日	121.82	1,000	121,820.00
344	688696	极米科技	2023年7月7日	139.39	1,000	139,390.00
345	688700	东威科技	2023年7月7日	99.73	1,000	99,730.00
346	688711	宏微科技	2023年7月7日-2023年7月14日	58.34	2,100	122,514.00
347	688733	壹石通	2023年7月7日-2023年7月14日	30.96	5,900	182,664.00
348	688776	国光电气	2023年7月7日	82.88	1,000	82,880.00

349	688798	艾为电子	2023 年 7 月 7 日	59.15	1,000	59,150.00
350	688800	瑞可达	2023 年 7 月 7 日-2023 年 7 月 14 日	62.15	2,500	155,375.00
合计	-	-	-	-	6,080,900	58,092,879.00

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人将风险管理融入各业务层面，建立了三道防线：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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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，通过约定申报方式参与转融通证券出借业务的，基金管理人会对借券证券公司的偿付能力等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，借券证券公司最近 1 年的分类结果应为 A 类，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。(2022 年 12 月 31 日：同)

6.4.13.3 流动性风险

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金期末持有的流通受限证券外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持有的证券大部分具有良好的流动性，部分证券流通暂时受限的情况参见附注 6.4.12 “期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券”，本报告期内本基金未出现因投资品种变现困难或投资集中而无法以合理价格及时变现基金资产以支付赎回款的情况。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							

银行存款	22,438,213.33	-	-	-	-	-	22,438,213.33
结算备付金	2,159,308.15	-	-	-	-	-	2,159,308.15
存出保证金	145,688.51	-	-	-	-	-	145,688.51
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-761,401,890.64	761,401,890.64
应收清算款	-	-	-	-	-	4,167,662.84	4,167,662.84
其他资产	-	-	-	-	-	1,111,455.43	1,111,455.43
资产总计	24,743,209.99	-	-	-	-	-766,681,008.91	791,424,218.90
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	237,348.27	237,348.27
应付托管费	-	-	-	-	-	47,469.65	47,469.65
应付清算款	-	-	-	-	-	10,355,965.62	10,355,965.62
应交税费	-	-	-	-	-	1,339.03	1,339.03
其他负债	-	-	-	-	-	576,627.84	576,627.84
负债总计	-	-	-	-	-	11,218,750.41	11,218,750.41
利率敏感度缺口	24,743,209.99	-	-	-	-	-755,462,258.50	780,205,468.49
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	6,872,467.06	-	-	-	-	-	6,872,467.06
结算备付金	121,143.23	-	-	-	-	-	121,143.23
存出保证金	287,157.78	-	-	-	-	-	287,157.78
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-247,776,315.65	247,776,315.65
应收清算款	-	-	-	-	-	694,721.66	694,721.66
资产总计	7,280,768.07	-	-	-	-	-248,471,037.31	255,751,805.38
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	110,735.15	110,735.15
应付托管费	-	-	-	-	-	22,147.03	22,147.03
其他负债	-	-	-	-	-	912,142.65	912,142.65
负债总计	-	-	-	-	-	1,045,024.83	1,045,024.83
利率敏感度缺口	7,280,768.07	-	-	-	-	-247,426,012.48	254,706,780.55

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2022 年 12 月 31 日：同），银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2022 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	761,401,890.64	97.59	247,776,315.65	97.28
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	761,401,890.64	97.59	247,776,315.65	97.28

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除股票基准指数以外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）	
分析	1. 股票基准指数下降100个基点	-5,725,875.58	-2,281,246.34
	2. 股票基准指数上升100个基点	5,725,875.58	2,281,246.34

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	759,494,298.04	247,212,358.55
第二层次	688,004.28	-
第三层次	1,219,588.32	563,957.10
合计	761,401,890.64	247,776,315.65

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	761,401,890.64	96.21
	其中：股票	761,401,890.64	96.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	24,597,521.48	3.11
8	其他各项资产	5,424,806.78	0.69
9	合计	791,424,218.90	100.00

注：1、上述股票投资包括可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项中不含可退替代款估值增值。

2、本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 58,092,879.00 元，占净值比例 7.45%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	15,552,132.98	1.99
B	采矿业	12,923,318.00	1.66
C	制造业	491,246,174.62	62.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,471,612.40	2.24
E	建筑业	14,457,683.76	1.85
F	批发和零售业	27,534,723.85	3.53
G	交通运输、仓储和邮政业	12,541,650.40	1.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	102,282,599.25	13.11
J	金融业	5,025,374.40	0.64
K	房地产业	16,316,760.00	2.09
L	租赁和商务服务	12,465,516.53	1.60

	业		
M	科学研究和技术服务业	14,553,479.71	1.87
N	水利、环境和公共设施管理业	8,004,607.00	1.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	5,117,545.00	0.66
S	综合	2,828,606.00	0.36
	合计	758,321,783.90	97.20

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,617,377.87	0.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	5,783.79	0.00
F	批发和零售业	24,610.12	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	75,029.14	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	21,621.91	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	278,316.96	0.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,072,581.74	0.39

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600979	广安爱众	1,119,200	4,029,120.00	0.52
2	002527	新时达	280,600	3,816,160.00	0.49
3	688333	铂力特	34,907	3,691,066.18	0.47
4	600368	五洲交通	959,810	3,493,708.40	0.45
5	002126	银轮股份	193,100	3,417,870.00	0.44
6	603012	创力集团	551,300	3,401,521.00	0.44
7	002293	罗莱生活	295,100	3,393,650.00	0.43
8	603220	中贝通信	194,690	3,319,464.50	0.43
9	300194	福安药业	850,945	3,301,666.60	0.42
10	300258	精锻科技	226,500	3,281,985.00	0.42
11	600565	迪马股份	2,029,700	3,206,926.00	0.41
12	002517	恺英网络	203,700	3,206,238.00	0.41
13	002332	仙琚制药	241,800	3,203,850.00	0.41
14	300002	神州泰岳	227,800	3,189,200.00	0.41
15	600125	铁龙物流	520,100	3,141,404.00	0.40
16	600391	航发科技	127,600	3,076,436.00	0.39
17	002428	云南锗业	252,700	3,072,832.00	0.39
18	603118	共进股份	230,500	3,063,345.00	0.39
19	600293	三峡新材	1,151,300	3,039,432.00	0.39
20	002526	山东矿机	1,213,100	3,032,750.00	0.39
21	600129	太极集团	50,700	3,016,143.00	0.39
22	002240	盛新锂能	94,400	3,008,528.00	0.39
23	000973	佛塑科技	672,700	3,000,242.00	0.38
24	300975	高络电子	419,000	2,995,850.00	0.38
25	688339	亿华通	35,100	2,983,500.00	0.38
26	300099	精准信息	467,600	2,973,936.00	0.38
27	600868	梅雁吉祥	1,073,100	2,961,756.00	0.38
28	603601	再升科技	693,300	2,960,391.00	0.38
29	300493	润欣科技	324,100	2,955,792.00	0.38
30	000735	罗牛山	451,700	2,954,118.00	0.38
31	600531	豫光金铅	468,300	2,950,290.00	0.38
32	002303	美盈森	911,200	2,943,176.00	0.38
33	002261	拓维信息	152,200	2,938,982.00	0.38
34	000758	中色股份	621,700	2,934,424.00	0.38
35	002054	德美化工	419,200	2,926,016.00	0.38
36	002067	景兴纸业	843,100	2,908,695.00	0.37

37	000910	大亚圣象	372,100	2,906,101.00	0.37
38	002548	金新农	378,600	2,900,076.00	0.37
39	002851	麦格米特	79,100	2,884,777.00	0.37
40	600363	联创光电	77,409	2,871,873.90	0.37
41	600831	广电网络	477,000	2,862,000.00	0.37
42	600285	羚锐制药	177,600	2,852,256.00	0.37
43	600850	电科数字	120,200	2,835,518.00	0.36
44	600789	鲁抗医药	441,000	2,831,220.00	0.36
45	000551	创元科技	254,600	2,828,606.00	0.36
46	300170	汉得信息	244,800	2,824,992.00	0.36
47	300394	天孚通信	26,400	2,820,312.00	0.36
48	300110	华仁药业	697,400	2,810,522.00	0.36
49	600135	乐凯胶片	372,600	2,809,404.00	0.36
50	300191	潜能恒信	153,000	2,796,840.00	0.36
51	002026	山东威达	297,000	2,791,800.00	0.36
52	688306	均普智能	515,100	2,776,389.00	0.36
53	301109	军信股份	167,900	2,772,029.00	0.36
54	300596	利安隆	67,900	2,761,493.00	0.35
55	300036	超图软件	116,400	2,759,844.00	0.35
56	300237	美晨生态	1,456,100	2,752,029.00	0.35
57	300352	北信源	545,600	2,749,824.00	0.35
58	300189	神农科技	848,600	2,749,464.00	0.35
59	300674	宇信科技	155,300	2,745,704.00	0.35
60	002452	长高电新	373,000	2,745,280.00	0.35
61	300593	新雷能	119,700	2,742,327.00	0.35
62	300091	金通灵	914,900	2,726,402.00	0.35
63	688269	凯立新材	42,500	2,711,075.00	0.35
64	000612	焦作万方	559,800	2,709,432.00	0.35
65	002698	博实股份	154,600	2,703,954.00	0.35
66	600162	香江控股	1,356,900	2,700,231.00	0.35
67	688239	航宇科技	38,447	2,689,367.65	0.34
68	600572	康恩贝	391,900	2,684,515.00	0.34
69	002130	沃尔核材	330,600	2,684,472.00	0.34
70	300825	阿尔特	146,500	2,679,485.00	0.34
71	600694	大商股份	151,105	2,679,091.65	0.34
72	300867	圣元环保	153,500	2,675,505.00	0.34
73	002807	江阴银行	722,860	2,667,353.40	0.34
74	300048	合康新能	443,600	2,652,728.00	0.34
75	002832	比音勒芬	74,900	2,652,209.00	0.34
76	300739	明阳电路	178,000	2,650,420.00	0.34
77	002662	京威股份	790,300	2,631,699.00	0.34
78	002263	大东南	1,016,700	2,623,086.00	0.34
79	300326	凯利泰	403,500	2,622,750.00	0.34

80	002035	华帝股份	368,500	2,616,350.00	0.34
81	688066	航天宏图	42,904	2,612,853.60	0.33
82	301080	百普赛斯	41,550	2,610,171.00	0.33
83	000859	国风新材	526,800	2,607,660.00	0.33
84	603308	应流股份	142,400	2,605,920.00	0.33
85	603890	春秋电子	303,900	2,601,384.00	0.33
86	300770	新媒股份	56,722	2,601,270.92	0.33
87	000426	兴业银锡	292,900	2,600,952.00	0.33
88	301031	中熔电气	19,100	2,592,061.00	0.33
89	600201	生物股份	272,318	2,589,744.18	0.33
90	688667	菱电电控	34,680	2,588,168.40	0.33
91	688166	博瑞医药	117,273	2,578,833.27	0.33
92	002413	雷科防务	490,900	2,567,407.00	0.33
93	002412	汉森制药	390,500	2,565,585.00	0.33
94	603588	高能环境	272,900	2,557,073.00	0.33
95	000650	仁和药业	414,200	2,543,188.00	0.33
96	603979	金诚信	81,500	2,534,650.00	0.32
97	300891	惠云钛业	276,900	2,530,866.00	0.32
98	300315	掌趣科技	323,300	2,521,740.00	0.32
99	688106	金宏气体	92,500	2,516,000.00	0.32
100	301389	隆扬电子	137,877	2,506,603.86	0.32
101	603179	新泉股份	57,100	2,506,119.00	0.32
102	002023	海特高新	272,400	2,506,080.00	0.32
103	601011	宝泰隆	696,100	2,498,999.00	0.32
104	603279	景津装备	79,600	2,496,256.00	0.32
105	600452	涪陵电力	117,260	2,495,292.80	0.32
106	002400	省广集团	517,700	2,490,137.00	0.32
107	688800	瑞可达	39,783	2,472,513.45	0.32
108	002239	奥特佳	919,600	2,455,332.00	0.31
109	000851	高鸿股份	448,780	2,441,363.20	0.31
110	300287	飞利信	548,600	2,441,270.00	0.31
111	300477	合纵科技	518,800	2,422,796.00	0.31
112	600138	中青旅	193,200	2,416,932.00	0.31
113	300328	宜安科技	346,700	2,409,565.00	0.31
114	688556	高测股份	45,323	2,408,464.22	0.31
115	002335	科华数据	66,900	2,405,055.00	0.31
116	688299	长阳科技	153,119	2,399,374.73	0.31
117	600594	益佰制药	454,100	2,393,107.00	0.31
118	002036	联创电子	246,100	2,389,631.00	0.31
119	600360	华微电子	347,300	2,389,424.00	0.31
120	603960	克来机电	128,100	2,389,065.00	0.31
121	300131	英唐智控	452,400	2,375,100.00	0.30
122	600771	广誉远	67,200	2,370,144.00	0.30

123	600986	浙文互联	369,900	2,367,360.00	0.30
124	002288	超华科技	560,500	2,365,310.00	0.30
125	300463	迈克生物	156,300	2,363,256.00	0.30
126	603323	苏农银行	560,100	2,358,021.00	0.30
127	603197	保隆科技	43,200	2,343,600.00	0.30
128	002139	拓邦股份	179,500	2,342,475.00	0.30
129	300322	硕贝德	276,800	2,341,728.00	0.30
130	000417	合肥百货	500,200	2,340,936.00	0.30
131	688277	天智航	126,897	2,339,980.68	0.30
132	300348	长亮科技	224,100	2,339,604.00	0.30
133	600512	腾达建设	872,417	2,338,077.56	0.30
134	002277	友阿股份	737,000	2,328,920.00	0.30
135	002675	东诚药业	157,200	2,312,412.00	0.30
136	300685	艾德生物	95,300	2,311,978.00	0.30
137	300908	仲景食品	50,787	2,303,190.45	0.30
138	603063	禾望电气	74,900	2,303,175.00	0.30
139	301150	中一科技	46,040	2,302,460.40	0.30
140	603959	百利科技	200,100	2,301,150.00	0.29
141	002061	浙江交科	515,880	2,300,824.80	0.29
142	688196	卓越新能	49,700	2,298,625.00	0.29
143	300083	创世纪	314,300	2,297,533.00	0.29
144	300222	科大智能	256,600	2,286,306.00	0.29
145	605208	永茂泰	228,000	2,284,560.00	0.29
146	002215	诺普信	303,600	2,280,036.00	0.29
147	301149	隆华新材	218,200	2,278,008.00	0.29
148	600151	航天机电	254,500	2,267,595.00	0.29
149	000766	通化金马	471,100	2,261,280.00	0.29
150	600359	新农开发	291,000	2,261,070.00	0.29
151	002214	大立科技	165,600	2,260,440.00	0.29
152	300180	华峰超纤	626,100	2,260,221.00	0.29
153	002234	民和股份	123,758	2,253,633.18	0.29
154	603387	基蛋生物	174,800	2,253,172.00	0.29
155	601208	东材科技	177,360	2,252,472.00	0.29
156	688116	天奈科技	49,000	2,241,750.00	0.29
157	600197	伊力特	82,400	2,238,808.00	0.29
158	600790	轻纺城	516,941	2,238,354.53	0.29
159	603708	家家悦	178,300	2,235,882.00	0.29
160	300409	道氏技术	177,800	2,234,946.00	0.29
161	600179	安通控股	794,100	2,215,539.00	0.28
162	688321	微芯生物	97,800	2,214,192.00	0.28
163	300416	苏试试验	102,620	2,212,487.20	0.28
164	002039	黔源电力	157,180	2,211,522.60	0.28
165	000531	穗恒运 A	305,600	2,209,488.00	0.28

166	600094	大名城	713,600	2,205,024.00	0.28
167	688270	臻镭科技	33,900	2,201,127.00	0.28
168	002318	久立特材	129,000	2,196,870.00	0.28
169	688733	壹石通	70,900	2,195,064.00	0.28
170	688148	芳源股份	179,900	2,194,780.00	0.28
171	002481	双塔食品	490,400	2,187,184.00	0.28
172	300638	广和通	95,560	2,167,300.80	0.28
173	600622	光大嘉宝	742,000	2,166,640.00	0.28
174	688232	新点软件	39,700	2,136,257.00	0.27
175	600533	栖霞建设	689,100	2,122,428.00	0.27
176	300284	苏交科	352,700	2,116,200.00	0.27
177	002079	苏州固锝	144,854	2,114,868.40	0.27
178	002577	雷柏科技	127,000	2,114,550.00	0.27
179	600756	浪潮软件	127,100	2,112,402.00	0.27
180	603881	数据港	92,840	2,097,255.60	0.27
181	600761	安徽合力	105,100	2,094,643.00	0.27
182	300149	睿智医药	266,800	2,083,708.00	0.27
183	601890	亚星锚链	178,300	2,064,714.00	0.26
184	600993	马应龙	74,100	2,060,721.00	0.26
185	300232	洲明科技	225,300	2,059,242.00	0.26
186	600557	康缘药业	74,900	2,056,754.00	0.26
187	600123	兰花科创	251,400	2,056,452.00	0.26
188	688508	芯朋微	35,035	2,031,679.65	0.26
189	600728	佳都科技	292,800	2,029,104.00	0.26
190	300762	上海瀚讯	172,000	2,024,440.00	0.26
191	600503	华丽家族	713,300	2,018,639.00	0.26
192	002326	永太科技	131,800	2,015,222.00	0.26
193	688033	天宜上佳	104,803	2,003,833.36	0.26
194	688518	联赢激光	71,902	2,003,189.72	0.26
195	002212	天融信	206,200	2,000,140.00	0.26
196	002334	英威腾	156,700	1,996,358.00	0.26
197	301050	雷电微力	30,700	1,993,351.00	0.26
198	603690	至纯科技	57,200	1,992,848.00	0.26
199	688559	海目星	42,300	1,988,523.00	0.25
200	600797	浙大网新	278,500	1,988,490.00	0.25
201	300332	天壕环境	173,300	1,987,751.00	0.25
202	600284	浦东建设	324,700	1,987,164.00	0.25
203	600478	科力远	277,800	1,983,492.00	0.25
204	002476	宝莫股份	440,900	1,979,641.00	0.25
205	600633	浙数文化	121,000	1,961,410.00	0.25
206	688711	宏微科技	33,618	1,961,274.12	0.25
207	600976	健民集团	25,400	1,958,086.00	0.25
208	603018	华设集团	222,637	1,948,073.75	0.25

209	300353	东土科技	149,700	1,947,597.00	0.25
210	300379	东方通	94,474	1,943,330.18	0.25
211	002928	华夏航空	227,500	1,922,375.00	0.25
212	300327	中颖电子	68,664	1,919,845.44	0.25
213	000034	神州数码	72,200	1,919,798.00	0.25
214	600587	新华医疗	54,300	1,918,419.00	0.25
215	300263	隆华科技	229,900	1,912,768.00	0.25
216	000422	湖北宜化	166,400	1,910,272.00	0.24
217	688266	泽璟制药	41,036	1,910,225.80	0.24
218	300890	翔丰华	46,300	1,902,930.00	0.24
219	000921	海信家电	70,600	1,902,670.00	0.24
220	688345	博力威	51,200	1,900,032.00	0.24
221	688262	国芯科技	46,692	1,899,897.48	0.24
222	002003	伟星股份	202,901	1,899,153.36	0.24
223	600266	城建发展	373,400	1,896,872.00	0.24
224	300451	创业慧康	225,760	1,891,868.80	0.24
225	600577	精达股份	448,000	1,890,560.00	0.24
226	300101	振芯科技	97,400	1,888,586.00	0.24
227	002222	福晶科技	68,000	1,886,320.00	0.24
228	002206	海利得	351,100	1,881,896.00	0.24
229	002229	鸿博股份	53,600	1,880,288.00	0.24
230	300767	震安科技	74,100	1,879,176.00	0.24
231	300994	久祺股份	121,700	1,879,048.00	0.24
232	002006	精工科技	87,100	1,878,747.00	0.24
233	300655	晶瑞电材	94,282	1,877,154.62	0.24
234	002100	天康生物	226,608	1,869,516.00	0.24
235	002063	远光软件	215,300	1,868,804.00	0.24
236	002020	京新药业	145,700	1,867,874.00	0.24
237	600502	安徽建工	353,680	1,867,430.40	0.24
238	300415	伊之密	97,200	1,866,240.00	0.24
239	603300	华铁应急	341,900	1,863,355.00	0.24
240	600072	中船科技	66,100	1,862,037.00	0.24
241	300679	电连技术	56,300	1,860,715.00	0.24
242	300878	维康药业	81,900	1,859,130.00	0.24
243	688278	特宝生物	42,300	1,857,393.00	0.24
244	688596	正帆科技	42,865	1,856,054.50	0.24
245	300087	荃银高科	179,170	1,852,617.80	0.24
246	002707	众信旅游	245,600	1,849,368.00	0.24
247	300456	赛微电子	75,500	1,848,240.00	0.24
248	300041	回天新材	156,000	1,840,800.00	0.24
249	000917	电广传媒	250,700	1,832,617.00	0.23
250	688088	虹软科技	42,847	1,831,709.25	0.23
251	688389	普门科技	77,900	1,829,871.00	0.23

252	000915	华特达因	51,700	1,824,493.00	0.23
253	300212	易华录	54,800	1,821,004.00	0.23
254	002324	普利特	127,400	1,817,998.00	0.23
255	300229	拓尔思	70,000	1,817,900.00	0.23
256	600750	江中药业	82,500	1,809,225.00	0.23
257	002154	报喜鸟	326,800	1,803,936.00	0.23
258	300398	飞凯材料	104,900	1,803,231.00	0.23
259	002163	海南发展	180,100	1,801,000.00	0.23
260	603008	喜临门	71,400	1,797,852.00	0.23
261	688110	东芯股份	49,700	1,794,170.00	0.23
262	603035	常熟汽饰	92,100	1,789,503.00	0.23
263	300055	万邦达	247,200	1,779,840.00	0.23
264	600877	电科芯片	119,100	1,779,354.00	0.23
265	603997	继峰股份	124,200	1,776,060.00	0.23
266	601975	招商南油	618,400	1,768,624.00	0.23
267	000049	德赛电池	50,000	1,764,000.00	0.23
268	300737	科顺股份	192,300	1,761,468.00	0.23
269	002458	益生股份	142,000	1,753,700.00	0.22
270	300109	新开源	69,800	1,735,926.00	0.22
271	002544	普天科技	75,617	1,731,629.30	0.22
272	603477	巨星农牧	51,800	1,727,530.00	0.22
273	300855	图南股份	48,770	1,722,556.40	0.22
274	002446	盛路通信	181,700	1,717,065.00	0.22
275	600199	金种子酒	72,200	1,714,028.00	0.22
276	300393	中来股份	121,400	1,704,456.00	0.22
277	000681	视觉中国	92,400	1,699,236.00	0.22
278	600552	凯盛科技	143,400	1,697,856.00	0.22
279	002317	众生药业	99,814	1,695,839.86	0.22
280	002011	盾安环境	122,400	1,692,792.00	0.22
281	300166	东方国信	149,900	1,684,876.00	0.22
282	002837	英维克	56,270	1,684,723.80	0.22
283	002567	唐人神	253,000	1,682,450.00	0.22
284	300075	数字政通	67,600	1,681,888.00	0.22
285	002182	云海金属	76,300	1,677,837.00	0.22
286	605305	中际联合	48,100	1,676,766.00	0.21
287	600422	昆药集团	80,800	1,674,176.00	0.21
288	300168	万达信息	147,300	1,668,909.00	0.21
289	603995	甬金股份	69,700	1,666,527.00	0.21
290	002432	九安医疗	47,300	1,665,433.00	0.21
291	300079	数码视讯	272,300	1,661,030.00	0.21
292	603083	剑桥科技	26,400	1,660,296.00	0.21
293	603100	川仪股份	42,598	1,655,358.28	0.21
294	600063	皖维高新	327,400	1,653,370.00	0.21

295	603566	普莱柯	71,100	1,653,075.00	0.21
296	688186	广大特材	50,659	1,647,937.27	0.21
297	603306	华懋科技	56,700	1,645,434.00	0.21
298	301155	海力风电	21,100	1,626,388.00	0.21
299	300443	金雷股份	45,700	1,620,065.00	0.21
300	002291	遥望科技	122,700	1,607,370.00	0.21
301	300693	盛弘股份	43,398	1,602,254.16	0.21
302	000821	京山轻机	78,300	1,602,018.00	0.21
303	688007	光峰科技	76,436	1,593,690.60	0.20
304	688208	道通科技	52,200	1,582,182.00	0.20
305	002015	协鑫能科	117,400	1,576,682.00	0.20
306	300587	天铁股份	204,458	1,574,326.60	0.20
307	300226	上海钢联	48,352	1,566,604.80	0.20
308	300035	中科电气	129,663	1,558,549.26	0.20
309	000810	创维数字	96,000	1,552,320.00	0.20
310	300077	国民技术	116,400	1,548,120.00	0.20
311	300065	海兰信	124,700	1,545,033.00	0.20
312	688037	芯源微	8,988	1,536,498.60	0.20
313	688700	东威科技	15,298	1,525,669.54	0.20
314	002351	漫步者	73,200	1,513,776.00	0.19
315	300188	美亚柏科	71,800	1,492,722.00	0.19
316	002121	科陆电子	203,600	1,492,388.00	0.19
317	300203	聚光科技	73,000	1,479,710.00	0.19
318	002354	天娱数科	206,800	1,449,668.00	0.19
319	300114	中航电测	29,400	1,445,010.00	0.19
320	300613	富瀚微	25,400	1,441,196.00	0.18
321	300129	泰胜风能	148,900	1,427,951.00	0.18
322	300130	新国都	50,400	1,427,832.00	0.18
323	600446	金证股份	97,300	1,414,742.00	0.18
324	300364	中文在线	76,800	1,368,576.00	0.18
325	300113	顺网科技	74,800	1,287,308.00	0.16
326	300573	兴齐眼药	5,900	1,261,420.00	0.16
327	688027	国盾量子	7,962	1,260,543.84	0.16
328	000503	国新健康	104,000	1,246,960.00	0.16
329	688776	国光电气	14,980	1,241,542.40	0.16
330	300031	宝通科技	50,100	1,238,472.00	0.16
331	300910	瑞丰新材	24,600	1,237,380.00	0.16
332	688083	中望软件	8,540	1,237,360.60	0.16
333	002292	奥飞娱乐	123,580	1,233,328.40	0.16
334	688019	安集科技	7,349	1,211,335.67	0.16
335	688018	乐鑫科技	9,125	1,184,607.50	0.15
336	688023	安恒信息	6,755	1,180,166.05	0.15
337	688696	极米科技	8,455	1,178,542.45	0.15

338	688326	经纬恒润	8,100	1,169,559.00	0.15
339	000065	北方国际	77,200	1,159,544.00	0.15
340	688158	优刻得	61,403	1,159,288.64	0.15
341	688408	中信博	13,694	1,154,815.02	0.15
342	688680	海优新材	9,300	1,132,926.00	0.15
343	688639	华恒生物	12,506	1,131,542.88	0.15
344	688095	福昕软件	8,551	1,080,675.38	0.14
345	688798	艾为电子	17,640	1,043,406.00	0.13
346	300199	翰宇药业	101,500	1,033,270.00	0.13
347	601900	南方传媒	50,300	1,031,653.00	0.13
348	688608	恒玄科技	8,450	1,022,703.50	0.13
349	601858	中国科传	30,300	1,018,080.00	0.13
350	688133	泰坦科技	10,604	903,354.76	0.12

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688249	晶合集成	36,156	679,334.76	0.09
2	688443	智翔金泰	9,618	295,926.34	0.04
3	301293	三博脑科	3,324	278,316.96	0.04
4	688515	裕太微	1,434	233,383.50	0.03
5	301486	致尚科技	3,549	204,635.34	0.03
6	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.02
7	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
8	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
9	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
10	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
11	688469	中芯集成	6,693	36,209.13	0.00
12	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
13	301325	曼恩斯特	319	34,436.05	0.00
14	688361	中科飞测	529	34,210.43	0.00
15	688472	阿特斯	1,865	31,779.60	0.00
16	688582	芯动联科	604	24,570.72	0.00
17	301310	鑫宏业	365	23,881.95	0.00
18	688576	西山科技	189	22,757.49	0.00
19	688543	国科军工	376	19,946.80	0.00
20	688552	航天南湖	779	18,306.50	0.00
21	688458	美芯晟	201	18,242.76	0.00
22	301301	川宁生物	1,988	17,812.48	0.00
23	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
24	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
25	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
26	301332	德尔玛	1,086	14,910.78	0.00
27	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00

28	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
29	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
30	301358	湖南裕能	332	14,239.48	0.00
31	301305	朗坤环境	719	14,157.11	0.00
32	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
33	688478	晶升股份	329	13,939.73	0.00
34	301210	金杨股份	281	13,816.77	0.00
35	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
36	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
37	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
38	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
39	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
40	301307	美利信	385	12,266.10	0.00
41	301260	格力博	512	12,098.56	0.00
42	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
43	301360	荣旗科技	124	11,482.40	0.00
44	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
45	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
46	603073	彩蝶实业	530	11,055.80	0.00
47	301141	中科磁业	258	11,014.02	0.00
48	688146	中船特气	279	10,638.27	0.00
49	688484	南芯科技	284	10,425.64	0.00
50	688623	二元科技	119	10,328.01	0.00
51	688352	颀中科技	846	10,211.22	0.00
52	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
53	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
54	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
55	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
56	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
57	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
58	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
59	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
60	001287	中电港	399	8,386.98	0.00
61	688433	华曙高科	263	8,284.50	0.00
62	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
63	301281	科源制药	301	7,555.10	0.00
64	301203	国泰环保	217	7,464.80	0.00
65	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
66	301373	凌玮科技	228	7,261.80	0.00
67	301157	华塑科技	135	7,145.55	0.00
68	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
69	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
70	601061	中信金属	893	6,768.94	0.00

71	301439	泓淋电力	329	5,560.10	0.00
72	603135	中重科技	302	5,402.78	0.00
73	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
74	301345	涛涛车业	103	4,803.92	0.00
75	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
76	601065	江盐集团	292	3,457.28	0.00
77	601133	柏诚股份	278	3,408.28	0.00
78	001328	登康口腔	114	2,905.86	0.00
79	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
80	001360	南矿集团	155	2,304.85	0.00
81	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
82	603125	常青科技	91	2,232.23	0.00
83	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688027	国盾量子	6,613,943.51	2.60
2	688339	亿华通	5,332,917.50	2.09
3	688095	福昕软件	5,296,778.87	2.08
4	688066	航天宏图	5,258,211.73	2.06
5	600979	广安爱众	4,503,677.00	1.77
6	600129	太极集团	4,133,596.00	1.62
7	600452	涪陵电力	4,124,654.00	1.62
8	600368	五洲交通	4,103,938.00	1.61
9	600565	迪马股份	3,910,167.00	1.54
10	603012	创力集团	3,843,087.00	1.51
11	600850	电科数字	3,777,670.00	1.48
12	603979	金诚信	3,760,385.00	1.48
13	600125	铁龙物流	3,752,280.00	1.47
14	600831	广电网络	3,670,383.00	1.44
15	600363	联创光电	3,591,696.00	1.41
16	688556	高测股份	3,581,398.29	1.41
17	600557	康缘药业	3,576,882.76	1.40
18	600868	梅雁吉祥	3,568,282.00	1.40
19	600789	鲁抗医药	3,551,839.00	1.39
20	688333	铂力特	3,544,909.82	1.39

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

	码			
1	688027	国盾量子	7,115,941.27	2.79
2	688095	福昕软件	6,719,554.44	2.64
3	002229	鸿博股份	5,103,725.00	2.00
4	688580	伟思医疗	3,911,821.18	1.54
5	300002	神州泰岳	3,851,379.00	1.51
6	600129	太极集团	3,713,233.00	1.46
7	600802	福建水泥	3,512,806.00	1.38
8	600971	恒源煤电	3,503,884.00	1.38
9	688066	航天宏图	3,449,345.87	1.35
10	600626	申达股份	3,425,326.00	1.34
11	300302	同有科技	3,311,385.47	1.30
12	688339	亿华通	3,254,222.27	1.28
13	603108	润达医疗	3,250,173.60	1.28
14	600266	城建发展	3,223,094.00	1.27
15	688020	方邦股份	3,184,634.64	1.25
16	600452	涪陵电力	3,096,961.00	1.22
17	002912	中新赛克	3,028,649.00	1.19
18	600869	远东股份	2,926,062.00	1.15
19	600557	康缘药业	2,759,087.54	1.08
20	688158	优刻得	2,707,443.16	1.06

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	558,916,505.84
卖出股票收入（成交）总额	352,983,397.65

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	145,688.51
2	应收清算款	4,167,662.84
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	1,035,839.19
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	5,424,806.78

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002527	新时达	349,520.00	0.04	转融通流通受限
2	603012	创力集团	287,522.00	0.04	转融通流通受限
3	002126	银轮股份	286,740.00	0.04	转融通流通受限
4	002293	罗莱生活	285,200.00	0.04	转融通流通受限
5	300194	福安药业	278,972.00	0.04	转融通流通受限
6	300258	精锻科技	278,208.00	0.04	转融通流通受限
7	603220	中贝通信	277,915.00	0.04	转融通流通受限
8	688333	铂力特	232,628.00	0.03	转融通流通受限
9	600979	广安爱众	172,440.00	0.02	转融通流通受限
10	600368	五洲交通	139,412.00	0.02	转融通流通受限

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688515	裕太微	233,383.50	0.03	新股流通受限
2	301486	致尚科技	204,635.34	0.03	新股流通受限
3	688249	晶合集成	65,304.96	0.01	新股流通受限
4	688443	智翔金泰	28,369.38	0.00	新股流通受限
5	301293	三博脑科	23,782.86	0.00	新股流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构		
		机构投资者	个人投资者	万家国证 2000ETF 发起式联接

(户)		持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
4,447	170,515.68	515,522,413.00	67.99	114,617,731.00	15.12	128,143,106.00	16.90

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	华泰证券股份有限公司	96,047,239.00	12.67
2	财通证券股份有限公司	50,761,403.00	6.69
3	中信建投证券—中国华融资产管理股份有限公司—中信建投—先锋单一资产管理计划	29,550,000.00	3.90
4	平安资产—工商银行—平安资产如意 20 号保险资产管理产品	23,453,300.00	3.09
5	江海证券有限公司	20,000,000.00	2.64
6	长江养老保险股份有限公司—中国太平洋人寿权益基金型投资产品 (寿自营) 委托专户	19,662,200.00	2.59
7	财达证券股份有限公司	19,500,000.00	2.57
8	招商证券股份有限公司	18,865,964.00	2.49
9	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	18,275,400.00	2.41
10	国泰君安证券股份有限公司	17,118,410.00	2.26
11	中国工商银行股份有限公司—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	128,143,106.00	16.90

注：上述持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022年6月29日） 基金份额总额	845,283,250.00
本报告期期初基金份额总额	272,283,250.00
本报告期基金总申购份额	867,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	381,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	758,283,250.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 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。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 (%)	
民生证券	1	495,238,552.52	54.95	362,155.61	49.45	-
中泰证券	1	223,430,887.22	24.79	200,264.45	27.34	-
东方财富证券	1	182,543,070.97	20.26	170,009.83	23.21	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	3	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范,内控制度健全,在业内有良好的声誉;
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施满足基金进行证券交易的需要;
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于:有较好的研究能力和行业分析能

力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

3、基金专用交易席位的变更情况：

本报告期内，本基金减少大同证券交易单元 1 个。

10.7.2 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。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	指定媒介	2023 年 01 月 20 日
2	关于国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	指定媒介	2023 年 03 月 21 日
3	关于万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	指定媒介	2023 年 03 月 27 日
4	万家基金管理有限公司关于万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金增加国泰君安为申购赎回代办券商的公告	指定媒介	2023 年 03 月 28 日
5	万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告	指定媒介	2023 年 03 月 30 日
6	万家基金管理有限公司关于万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金增加东兴证券为申购赎回代办券商的公告	指定媒介	2023 年 04 月 13 日
7	万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	指定媒介	2023 年 04 月 21 日
8	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 2023 年第 1 季度报告	指定媒介	2023 年 04 月 21 日
9	万家基金管理有限公司关于万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金增加兴业证券为申购赎回代办券商的公告	指定媒介	2023 年 04 月 26 日

	公告		
10	万家基金管理有限公司关于万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金增加东海证券为申购赎回代办券商的公告	指定媒介	2023 年 05 月 09 日
11	关于国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	指定媒介	2023 年 05 月 11 日
12	万家基金管理有限公司关于万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金增加国金证券为申购赎回代办券商的公告	指定媒介	2023 年 05 月 16 日
13	关于万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	指定媒介	2023 年 06 月 01 日
14	万家基金管理有限公司关于万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金增加南京证券为申购赎回代办券商的公告	指定媒介	2023 年 06 月 08 日
15	万家基金管理有限公司关于万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金增加西部证券为申购赎回代办券商的公告	指定媒介	2023 年 06 月 14 日
16	关于万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	指定媒介	2023 年 06 月 19 日
17	万家基金管理有限公司关于万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金增加德邦证券为申购赎回代办券商的公告	指定媒介	2023 年 06 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
联接基金	1	20230207-20230323、20230327-20230615	39,267,200.00	219,880,106.00	131,004,200.00	128,143,106.00	16.90
产品特有风险							
报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。							

未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

注：上述申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》。
- 4、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年中期报告原文。
- 5、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。
- 7、本报告期内在中国证监会指定媒介公开披露的基金净值、更新招募说明书及其他临时公告。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日