

万家中证 500 指数增强型发起式证券投资 基金 2025 年中期报告

2025 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：2025 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，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 2025 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	54

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	54
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	54
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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
8.3 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	56
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	56
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 其他重大事件	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
§ 12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	万家中证 500 指数增强发起式	
基金主代码	006729	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 5 月 23 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	433,371,304.18 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	万家中证 500 指数增强发起式 A	万家中证 500 指数增强发起式 C
下属分级基金的交 易代码	006729	006730
报告期末下属分级 基金的份额总额	310,364,702.27 份	123,006,601.91 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金，采取量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，在力求有效跟踪标的指数基础上，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型指数产品，在标的指数成份股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。具体策略包括：1、股票投资策略；2、债券投资策略；3、中小企业私募债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、可转换债券投资策略；6、证券公司短期公司债券投资策略；7、衍生产品投资策略：（1）权证投资策略；（2）股指期货投资策略；（3）国债期货投资策略；（4）股票期权投资策略；（5）其他金融衍生产品；8、融资及转融通证券出借业务投资策略；9、其他。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+一年期人民币定期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		万家基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	兰剑	郭明
	联系电话	021-38909626	010-66105799

	电子邮箱	lanj@wjasset.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008880800	95588
传真		021-38909627	010-66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市浦东新区浦电路 360 号陆家嘴投资大厦 9 楼、15 楼、16 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200122	100140
法定代表人		方一天	廖林

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	基金管理人办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	万家基金管理有限公司	上海市浦东新区浦电路 360 号陆家嘴投资大厦 9 楼、15 楼、16 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)	
	万家中证 500 指数增强发起式 A	万家中证 500 指数增强发起式 C
本期已实现收益	27,477,477.56	11,334,042.89
本期利润	42,441,475.08	18,910,072.29
加权平均基金份 额本期利润	0.0941	0.1203
本期加权平均净 值利润率	8.01%	10.48%
本期基金份额净 值增长率	8.62%	8.40%
3.1.2 期 末 数 据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	78,096,158.86	27,359,410.18
期末可供分配利		

润		
期末可供分配基金份额利润	0.2516	0.2224
期末基金资产净值	388,460,861.13	150,366,012.09
期末基金份额净值	1.2516	1.2224
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	86.86%	81.79%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家中证 500 指数增强发起式 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	5.43%	0.72%	4.10%	0.75%	1.33%	-0.03%
过去三个月	4.44%	1.54%	0.99%	1.43%	3.45%	0.11%
过去六个月	8.62%	1.33%	3.24%	1.29%	5.38%	0.04%
过去一年	20.85%	1.61%	18.90%	1.64%	1.95%	-0.03%
过去三年	3.57%	1.25%	-7.45%	1.29%	11.02%	-0.04%
自基金合同生效起至今	86.86%	1.26%	19.15%	1.28%	67.71%	-0.02%

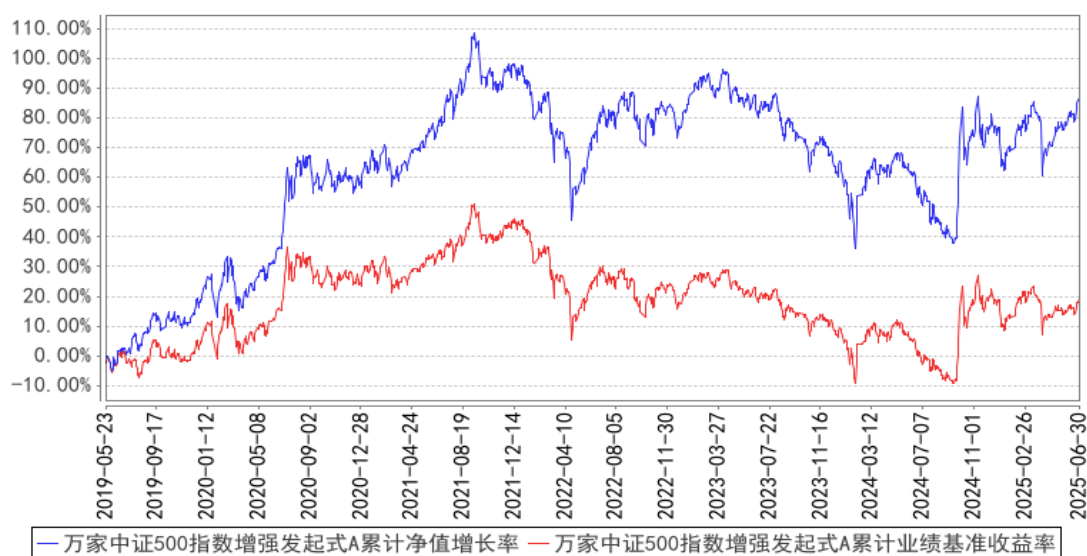
万家中证 500 指数增强发起式 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	5.40%	0.72%	4.10%	0.75%	1.30%	-0.03%

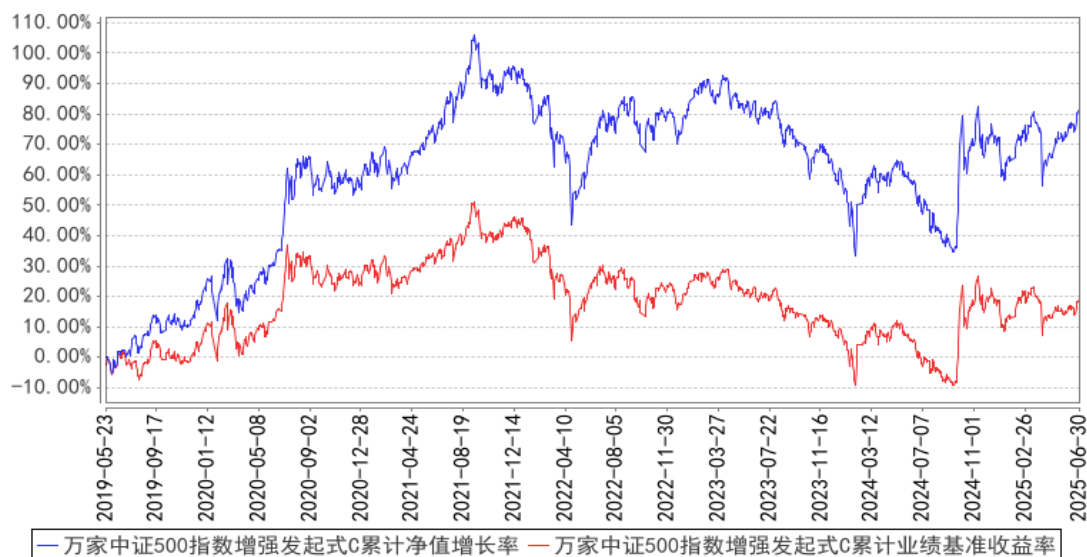
过去三个月	4.34%	1.54%	0.99%	1.43%	3.35%	0.11%
过去六个月	8.40%	1.33%	3.24%	1.29%	5.16%	0.04%
过去一年	20.35%	1.61%	18.90%	1.64%	1.45%	-0.03%
过去三年	2.32%	1.25%	-7.45%	1.29%	9.77%	-0.04%
自基金合同生效起 至今	81.79%	1.26%	19.15%	1.28%	62.64%	-0.02%

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

万家中证500指数增强发起式A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



万家中证500指数增强发起式C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2019 年 5 月 23 日成立，根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。

建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44 号文批准设立。公司的股东为中泰证券股份有限公司、山东省新动能基金管理有限公司，住所：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 楼（名义楼层 9 层）。截至 2025 年 6 月 30 日，公司共管理 173 只开放式基金，其中包括 42 只股票型基金、73 只混合型基金、41 只债券型基金、5 只货币市场基金、4 只 QDII 基金、8 只基金中基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
乔亮	公司领导，首席量化投资官；万家上证科创板 100 指数增强型发起式证券投资基金、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家中证 2000 指数增强型证券投资基金、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资	2019 年 9 月 6 日	-	18.5 年	国籍：中国；学历：美国斯坦福大学工商管理博士，2019 年 7 月入职万家基金管理有限公司，现任公司首席量化投资官、基金经理，历任公司总经理助理、量化投资部总监（兼）、副总经理。曾任美国巴克莱国际投资管理公司投资部基金经理，加拿大退休基金国际投资管理公司量化投资部基金经理，南方基金管理有限公司数量化投资部投资经理，通联数据股份公司联合创始人、首席投资官，上海寻乾资产管理有限公司投资总监、总经理，巨杉（上海）资产管理有限公司量化投资部投资总监等职。

基金、万 家元贞量 化选股股 票型证券 投 资 基 金、万家 创业板指 数增强型 证券投资 基金、万 家 国 证 2000 指数 增强型证 券投资基 金、万家 家瑞债券 型证券投资 基金、 万家沪深 300 指数 增强型证 券投资基 金、万家 量化睿选 灵活配置 混合型证 券投资基 金、万家 颐达灵活 配置混合 型证券投资 基金的 基 金 经 理。				
--	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 1 次，为量化投资组合或不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金在保持相对中证 500 指数较小跟踪误差情况下，控制行业权重偏离度、个股集中度，通过量化多因子选股的方式选取一篮子股票组合。在组合的行业和风格上相对于中证 500 指数保持了均衡的配置，在量化选股方面精选行业内质优个股，持股较为分散。本基金采用量化风险模型来合理控制组合风险，保证较小的跟踪误差，投资目标是获取在既定跟踪误差下的超额收益最大化。本基金股票组合中 80% 以上权重为中证 500 成分股，保持了跟标的指数的风格基本一致。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家中证 500 指数增强发起式 A 的基金份额净值为 1.2516 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.62%，同期业绩比较基准收益率为 3.24%；截至本报告期末万家中证 500 指数

增强发起式 C 的基金份额净值为 1.2224 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.40%，同期业绩比较基准收益率为 3.24%。基金报告期内 A 份额、C 份额日均跟踪偏离度分别为 0.1728%、0.1727%，年跟踪误差分别为 3.3969%、3.3969%，符合基金合同中日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%的规定。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年上半年，A 股市场虽有波折，但整体呈现震荡上行走势，年初至 1 月中旬受风险情绪压制快速下跌，春节之后至 3 月中旬，以 Deepseek 引领 TMT 板块走出“中国资产价值重估”行情；四月上旬受美国“对等关税”政策影响，A 股单日大幅下挫，但随后得益于政策维稳以及中美大幅调降关税，市场风险偏好提升，主要宽基指数稳步上涨，6 月末在金融股带动下进一步走强，上证指数创出年内新高。

展望后市，7 月政治局会议更加强调存量政策的落地，弱化增量预期，落实与细化存量的确定性更高，会议指出，“当前我国经济运行依然面临不少风险挑战，要正确把握形势，增强忧患意识，坚持底线思维，用好发展机遇、潜力和优势，巩固拓展经济回升向好势头”，因此对于下半年的经济工作，会议强调要“保持政策连续性稳定性，增强灵活性预见性，着力稳就业、稳企业、稳市场、稳预期，有力促进国内国际双循环。从 5 月份关税纠纷缓和以来，A 股各板块“轮动上涨、低位补涨”的特征明显，赚钱效应的持续性更好，同时市场增量资金来源较为广泛，在低利率市场环境下以及资产配置荒格局下，后续“居民配置资金入市与股市慢涨”的正反馈效应也有望加强，A 股市场有望震荡上行。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

2025 年 1 月 10 日万家中证 500 指数增强发起式 A 类每 10 份基金份额分红 0.171 元，万家中证 500 指数增强发起式 C 类每 10 份基金份额分红 0.143 元。万家中证 500 指数增强发起式 A 共计分配利润 8,810,867.67 元，万家中证 500 指数增强发起式 C 共计分配利润 3,196,490.20 元。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 2025 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：万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	42,580,262.32	49,584,896.31
结算备付金		4,332,555.16	5,015,353.91

存出保证金		200,079.16	427,211.74
交易性金融资产	6.4.7.2	505,484,755.81	809,620,583.93
其中：股票投资		505,484,755.81	809,620,583.93
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		31,929,458.40	262,618.74
应收股利		-	-
应收申购款		128,300.14	345,969.38
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		584,655,410.99	865,256,634.01
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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		40,904,018.85	-
应付赎回款		3,438,008.55	4,591,544.56
应付管理人报酬		458,261.48	822,465.78
应付托管费		91,652.28	164,493.16
应付销售服务费		43,021.32	147,987.08
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	893,575.29	1,145,895.65
负债合计		45,828,537.77	6,872,386.23
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	433,371,304.18	738,805,855.63
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	105,455,569.04	119,578,392.15

净资产合计		538,826,873.22	858,384,247.78
负债和净资产总计		584,655,410.99	865,256,634.01

注： 报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额总额 433,371,304.18 份，其中万家中证 500 指数增强发起式 A 基金份额净值 1.2516 元，基金份额总额 310,364,702.27 份；万家中证 500 指数增强发起式 C 基金份额净值 1.2224 元，基金份额总额 123,006,601.91 份。

6.2 利润表

会计主体：万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		66,073,646.92	-105,292,438.02
1. 利息收入		85,941.81	297,172.57
其中：存款利息收入	6.4.7.10	85,941.81	297,172.57
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		42,876,527.53	-133,710,960.92
其中：股票投资收益	6.4.7.11	37,223,230.95	-151,453,664.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	2,385.06	-
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	5,650,911.52	17,742,703.77
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	22,540,026.92	27,530,630.78
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	571,150.66	590,719.55

减：二、营业总支出		4,722,099.55	11,396,044.27
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,529,423.32	8,317,331.44
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	705,884.63	1,663,466.35
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	359,959.84	1,191,670.14
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.20	126,831.76	223,576.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		61,351,547.37	-116,688,482.29
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		61,351,547.37	-116,688,482.29
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		61,351,547.37	-116,688,482.29

6.3 净资产变动表

会计主体：万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	738,805,855.63	-	119,578,392.15	858,384,247.78
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	738,805,855.63	-	119,578,392.15	858,384,247.78
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-305,434,551.45	-	-14,122,823.11	-319,557,374.56
（一）、综合收益总额	-	-	61,351,547.37	61,351,547.37
（二）、本期基金	-305,434,551.4	-	-63,467,012.61	-368,901,564.06

份额交易产生的 净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)	5			
其中：1. 基金申 购款	70,087,943.94	-	11,917,315.25	82,005,259.19
2. 基金赎 回款	-375,522,495.3 9	-	-75,384,327.86	-450,906,823.25
(三)、本期向基 金份额持有人分 配利润产生的净 资产变动(净资 产减少以“-”号 填列)	-	-	-12,007,357.87	-12,007,357.87
(四)、其他综合 收益结转留存收 益	-	-	-	-
四、本期期末净 资产	433,371,304.18	-	105,455,569.04	538,826,873.22
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	2,262,777,455. 77	-	262,789,934.68	2,525,567,390.4 5
加：会计政策变 更	-	-	-	-
前期差错更 正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净 资产	2,262,777,455. 77	-	262,789,934.68	2,525,567,390.4 5
三、本期增减变 动额(减少以“-” 号填列)	-982,814,714.0 5	-	-209,005,704.2 8	-1,191,820,418. 33
(一)、综合收益 总额	-	-	-116,688,482.2 9	-116,688,482.29
(二)、本期基金 份额交易产生的 净资产变动数 (净资产减少以	-982,814,714.0 5	-	-92,317,221.99	-1,075,131,936. 04

“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	283,889,032.80	-	8,403,604.76	292,292,637.56
2. 基金赎回款	-1,266,703,746.85	-	-100,720,826.75	-1,367,424,573.60
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,279,962,741.72	-	53,784,230.40	1,333,746,972.12

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：

方一天

陈广益

尹超

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]1931 号文《关于准予万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》的批准，由万家基金管理有限公司作为基金管理人于 2019 年 5 月 6 日至 2019 年 5 月 17 日向社会公开募集，募集期结束经立信会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具信会师报字[2019]第 ZA30669 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2019 年 5 月 23 日生效，本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 215,969,733.39 元，有效认购资金在募集期间内产生的利息为人民币 31,846.50 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 216,001,579.89 元，折合 216,001,579.89 份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为万家基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股、备选成份股、其他股票（包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中小企业私募债券、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、债券回购、银行存款、同业存单、资产支持证券、金融衍生品（包括权证、股指期货、国债期货、股票期权等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可参与融资业务和转融通证券出借交易。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*95%+一年期人民币定期存款利率（税后）*5%。

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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日至 2025 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；

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

(二) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

根据财政部、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。

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

（三）企业所得税

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

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

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

（四）个人所得税

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

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

收个人所得税；

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》的规定，对基金通过深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	42,580,262.32
等于：本金	42,577,599.66
加：应计利息	2,662.66
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	42,580,262.32

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		498,710,672.68	-	505,484,755.81	6,774,083.13
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		498,710,672.68	-	505,484,755.81	6,774,083.13

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	504.69
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	689,759.92
其中：交易所市场	689,759.92
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	203,310.68

合计	893,575.29
----	------------

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

万家中证 500 指数增强发起式 A

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	515,731,375.75	515,731,375.75
本期申购	17,618,417.19	17,618,417.19
本期赎回（以“-”号填列）	-222,985,090.67	-222,985,090.67
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	310,364,702.27	310,364,702.27

万家中证 500 指数增强发起式 C

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	223,074,479.88	223,074,479.88
本期申购	52,469,526.75	52,469,526.75
本期赎回（以“-”号填列）	-152,537,404.72	-152,537,404.72
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	123,006,601.91	123,006,601.91

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

万家中证 500 指数增强发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	205,175,424.69	-117,403,186.86	87,772,237.83
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	205,175,424.69	-117,403,186.86	87,772,237.83
本期利润	27,477,477.56	14,963,997.52	42,441,475.08
本期基金份额交易产	-86,030,386.88	42,723,700.50	-43,306,686.38

生的变动数			
其中：基金申购款	7,036,213.54	-4,296,957.21	2,739,256.33
基金赎回款	-93,066,600.42	47,020,657.71	-46,045,942.71
本期已分配利润	-8,810,867.67	-	-8,810,867.67
本期末	137,811,647.70	-59,715,488.84	78,096,158.86

万家中证 500 指数增强发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	81,870,394.08	-50,064,239.76	31,806,154.32
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	81,870,394.08	-50,064,239.76	31,806,154.32
本期利润	11,334,042.89	7,576,029.40	18,910,072.29
本期基金份额交易产生的变动数	-39,292,931.69	19,132,605.46	-20,160,326.23
其中：基金申购款	20,069,962.98	-10,891,904.06	9,178,058.92
基金赎回款	-59,362,894.67	30,024,509.52	-29,338,385.15
本期已分配利润	-3,196,490.20	-	-3,196,490.20
本期末	50,715,015.08	-23,355,604.90	27,359,410.18

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	77,314.61
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	7,965.64
其他	661.56
合计	85,941.81

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	37,223,230.95
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	37,223,230.95

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	3,771,721,874.13
减：卖出股票成本总额	3,730,747,267.95
减：交易费用	3,751,375.23
买卖股票差价收入	37,223,230.95

6.4.7.12 债券投资收益**6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	2,052.06
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	333.00
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	2,385.06

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,912,206.77
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,896,165.00
减：应计利息总额	15,708.77
减：交易费用	—
买卖债券差价收入	333.00

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,650,911.52
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	5,650,911.52

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	22,540,026.92
股票投资	22,540,026.92
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	22,540,026.92

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	570,367.21
基金转换费收入	783.45
合计	571,150.66

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	23,803.31
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行费用	499.00

账户维护费	13,800.00
指数使用费	29,222.08
合计	126,831.76

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

本报告期内，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司（“万家基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
中泰证券股份有限公司（“中泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
万家财富基金销售（天津）有限公司（“万家财富”）	基金管理人的子公司、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	-	2,016,628,138.06	11.97

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 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	1,836,954.22	11.93	1,183,636.75	15.96

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,529,423.32	8,317,331.44
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,202,699.63	1,972,252.62
应支付基金管理人的净管理费	2,326,723.69	6,345,078.82

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

$$H=E\times 1.00\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	705,884.63	1,663,466.35

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

$$H=E\times 0.20\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家中证 500 指数增强发起式 A	万家中证 500 指数增强发起式 C	合计
工商银行	-	7,986.31	7,986.31
万家基金	-	110,027.16	110,027.16
中泰证券	-	6,319.80	6,319.80
合计	-	124,333.27	124,333.27
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家中证 500 指数增强发起式 A	万家中证 500 指数增强发起式 C	合计
工商银行	-	10,369.36	10,369.36
万家财富	-	4.74	4.74
万家基金	-	128,485.43	128,485.43
中泰证券	-	6,790.47	6,790.47
合计	-	145,650.00	145,650.00

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

$$H=E\times 0.40\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据相关协议支付给各销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	42,580,262.32	77,314.61	79,186,237.25	202,347.87

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

单位：人民币元

万家中证 500 指数增强发起式 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2025 年 1 月 10 日	-	2025 年 1 月 10 日	0.1710	6,190,012 .89	2,620,854. 78	8,810,867 .67	-
合计	-	-	-	0.1710	6,190,012 .89	2,620,854. 78	8,810,867 .67	-
万家中证 500 指数增强发起式 C								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2025 年 1 月 10 日	-	2025 年 1 月 10 日	0.1430	2,925,414 .38	271,075.82	3,196,490 .20	-
合计	-	-	-	0.1430	2,925,414 .38	271,075.82	3,196,490 .20	-

6.4.12 期末（2025 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
001335	信凯科技	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股 流通 受限	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001356	富岭股份	2025 年 1 月 16 日	6 个月	新股 流通 受限	5.30	14.44	709	3,757.70	10,237.96	-
001382	新	2025	6 个月	新股	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-

	亚电 缆	年 3 月 13 日		流通 受限						
001388	信通 电子	2025 年 6 月 24 日	1 个月 内 (含)	新股 未上 市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通 电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001390	古麒 绒材	2025 年 5 月 21 日	6 个月	新股 流通 受限	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
001395	亚联 机械	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股 流通 受限	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301173	毓恬 冠佳	2025 年 2 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
301275	汉朔 科技	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股 流通 受限	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-
301458	钧崴 电子	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股 流通 受限	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
301479	弘景 光电	2025 年 3 月 6 日	6 个月	新股 流通 受限	29.93	77.87	182	5,447.00	14,172.34	含转 增股
301501	恒鑫 生活	2025 年 3 月 11 日	6 个月	新股 流通 受限	27.49	45.22	350	9,620.72	15,827.00	含转 增股
301535	浙江 华远	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股 流通 受限	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301560	众	2025	6 个月	新股	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-

	捷汽车	年4月17日		流通受限						
301590	优优绿能	2025年5月28日	6个月	新股流通受限	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	—
301595	太力科技	2025年5月12日	6个月	新股流通受限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	—
301601	惠通科技	2025年1月8日	6个月	新股流通受限	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	—
301602	超研股份	2025年1月15日	6个月	新股流通受限	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	—
301636	泽润新能	2025年4月30日	6个月	新股流通受限	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	—
301658	首航新能	2025年3月26日	6个月	新股流通受限	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	—
301662	宏工科技	2025年4月10日	6个月	新股流通受限	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	—
301665	泰禾股份	2025年4月2日	6个月	新股流通受限	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	—
301678	新恒汇	2025年6月13日	6个月	新股流通受限	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	—
603014	威高血净	2025年5月12日	6个月	新股流通受限	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	—
603049	中策	2025年5月	6个月	新股流通	46.50	42.85	302	14,043.00	12,940.70	—

	橡胶	27 日		受限						
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	—
603120	肯特催化	2025 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	—
603124	江南新材	2025 年 3 月 12 日	6 个月	新股流通受限	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	—
603202	天有为	2025 年 4 月 16 日	6 个月	新股流通受限	93.50	90.66	98	9,163.00	8,884.68	—
603210	泰鸿万立	2025 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	—
603257	中国瑞林	2025 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	—
603271	永杰新材	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股流通受限	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	—
603382	海阳科技	2025 年 6 月 5 日	6 个月	新股流通受限	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	—
603400	华之杰	2025 年 6 月 12 日	6 个月	新股流通受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	—
603409	汇通控股	2025 年 2 月 25 日	6 个月	新股流通受限	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	—
688545	兴福电子	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新股流通受限	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	—

688583	思看科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	25.80	79.68	227	5,855.50	18,087.36	含转增股
688755	汉邦科技	2025 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
688757	胜科纳米	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
688758	赛分科技	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股流通受限	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
688775	影石创新	2025 年 6 月 4 日	6 个月	新股流通受限	47.27	124.16	511	24,154.97	63,445.76	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000633	合金投资	2025 年 6 月 24 日	重大事项停牌	6.15	2025 年 7 月 1 日	6.77	36,100	211,855.02	222,015.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 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 2025 年 6 月 30 日止，本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人将风险管理融入各业务层面，建立了四道防线：以各岗位目标责任制为基础，形成第一道防线；合规风控部门通过完善的风险控制制度和手段对各一线部门的风险管理工作进行指导、管理和监督，形成第二道防线；独立的监察稽核部门对公司内部控制制度的总体执行情况和有效性进行监督、检查、评估和反馈，形成第三道防线；董事会及其风险管理委员会听取公司管理层对公司整体运营情况的报告，并提出指导性意见，形成第四道防线。

6.4.13.2 信用风险

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

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

于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。(2024 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（2025 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 2025 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	42,580,262.32	-	-	-	-	-	42,580,262.32
结算备付金	4,332,555.16	-	-	-	-	-	4,332,555.16
存出保证金	200,079.16	-	-	-	-	-	200,079.16
交易性金融资产	-	-	-	-	-	505,484,755.81	505,484,755.81
应收申购款	1,009.54	-	-	-	-	127,290.60	128,300.14
应收清算款	-	-	-	-	-	31,929,458.40	31,929,458.40
资产总计	47,113,906.18	-	-	-	-	537,541,504.81	584,655,410.99
负债							

应付赎回款	-	-	-	-	-	3,438,008.55	3,438,008.55
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	458,261.48	458,261.48
应付托管费	-	-	-	-	-	91,652.28	91,652.28
应付清算款	-	-	-	-	-	40,904,018.85	40,904,018.85
应付销售服务费	-	-	-	-	-	43,021.32	43,021.32
其他负债	-	-	-	-	-	893,575.29	893,575.29
负债总计	-	-	-	-	-	45,828,537.77	45,828,537.77
利率敏感度缺口	47,113,906.18	-	-	-	-	-491,712,967.04	538,826,873.22
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	49,584,896.31	-	-	-	-	-	49,584,896.31
结算备付金	5,015,353.91	-	-	-	-	-	5,015,353.91
存出保证金	427,211.74	-	-	-	-	-	427,211.74
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-809,620,583.93	809,620,583.93
应收申购款	644.97	-	-	-	-	345,324.41	345,969.38
应收清算款	-	-	-	-	-	262,618.74	262,618.74
资产总计	55,028,106.93	-	-	-	-	-810,228,527.08	865,256,634.01
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,591,544.56	4,591,544.56
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	822,465.78	822,465.78
应付托管费	-	-	-	-	-	164,493.16	164,493.16
应付销售服务费	-	-	-	-	-	147,987.08	147,987.08
其他负债	-	-	-	-	-	1,145,895.65	1,145,895.65
负债总计	-	-	-	-	-	6,872,386.23	6,872,386.23
利率敏感度缺口	55,028,106.93	-	-	-	-	-803,356,140.85	858,384,247.78

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 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2024 年 12 月 31 日：同），货币资金、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2024 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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024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	505,484,755.81	93.81	809,620,583.93	94.32
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	505,484,755.81	93.81	809,620,583.93	94.32

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除股票基准指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	股票基准指数上升 100 个基点	4,992,004.85	8,237,125.53
	股票基准指数下降 100 个基点	-4,992,004.85	-8,237,125.53

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	504,809,347.61	809,035,700.08
第二层次	237,400.54	27,736.50
第三层次	438,007.66	557,147.35
合计	505,484,755.81	809,620,583.93

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
----	----	----	--------------

1	权益投资	505,484,755.81	86.46
	其中：股票	505,484,755.81	86.46
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	46,912,817.48	8.02
8	其他各项资产	32,257,837.70	5.52
9	合计	584,655,410.99	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	2,804,690.00	0.52
B	采矿业	20,728,167.00	3.85
C	制造业	253,966,442.96	47.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,591,672.00	2.34
E	建筑业	1,989,556.00	0.37
F	批发和零售业	10,807,923.52	2.01
G	交通运输、仓储和邮政业	8,139,594.88	1.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,471,846.94	5.66
J	金融业	47,594,717.16	8.83
K	房地产业	5,702,262.00	1.06
L	租赁和商务服务业	3,786,880.00	0.70
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,314,544.00	0.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,621,213.00	0.67
R	文化、体育和娱乐	10,110,539.50	1.88

	业		
S	综合	224,459.00	0.04
	合计	413,854,507.96	76.81

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	1,152,232.00	0.21
C	制造业	58,590,913.65	10.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,054,476.00	0.20
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	6,699,426.00	1.24
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	9,945,466.00	1.85
J	金融业	7,829,839.00	1.45
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	84,987.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	3,077,833.20	0.57
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	198,000.00	0.04
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,997,075.00	0.56
S	综合	-	-
	合计	91,630,247.85	17.01

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。

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	000988	华工科技	145,200	6,825,852.00	1.27

2	002340	格林美	885,900	5,625,465.00	1.04
3	601168	西部矿业	325,100	5,406,413.00	1.00
4	300017	网宿科技	501,500	5,376,080.00	1.00
5	688608	恒玄科技	14,900	5,184,902.00	0.96
6	600487	亨通光电	326,100	4,989,330.00	0.93
7	000878	云南铜业	374,600	4,764,912.00	0.88
8	000932	华菱钢铁	1,072,300	4,718,120.00	0.88
9	688469	芯联集成	973,900	4,645,503.00	0.86
10	601717	郑煤机	276,100	4,588,782.00	0.85
11	300476	胜宏科技	33,100	4,447,978.00	0.83
12	002841	视源股份	127,200	4,401,120.00	0.82
13	300496	中科创达	76,600	4,383,052.00	0.81
14	300888	稳健医疗	104,100	4,278,510.00	0.79
15	600380	健康元	386,200	4,259,786.00	0.79
16	002155	湖南黄金	236,240	4,216,884.00	0.78
17	000783	长江证券	608,212	4,214,909.16	0.78
18	603379	三美股份	87,500	4,210,500.00	0.78
19	601991	大唐发电	1,324,800	4,199,616.00	0.78
20	002673	西部证券	522,500	4,117,300.00	0.76
21	600517	国网英大	801,500	4,087,650.00	0.76
22	600685	中船防务	148,800	4,045,872.00	0.75
23	600988	赤峰黄金	162,600	4,045,488.00	0.75
24	600062	华润双鹤	213,772	3,988,985.52	0.74
25	000528	柳工	407,300	3,914,153.00	0.73
26	300573	兴齐眼药	74,740	3,870,784.60	0.72
27	601568	北元集团	927,000	3,847,050.00	0.71
28	600118	中国卫星	134,200	3,834,094.00	0.71
29	000709	河钢股份	1,758,900	3,799,224.00	0.71
30	603087	甘李药业	69,300	3,796,254.00	0.70
31	000785	居然智家	1,241,600	3,786,880.00	0.70
32	600299	安迪苏	389,900	3,762,535.00	0.70
33	601921	浙版传媒	466,400	3,759,184.00	0.70
34	688153	唯捷创芯	121,200	3,758,412.00	0.70
35	600498	烽火通信	175,300	3,686,559.00	0.68
36	600398	海澜之家	521,800	3,631,728.00	0.67
37	301267	华夏眼科	188,900	3,621,213.00	0.67
38	300207	欣旺达	180,500	3,620,830.00	0.67
39	002138	顺络电子	128,700	3,619,044.00	0.67
40	600535	天士力	229,800	3,596,370.00	0.67
41	688235	百济神州	15,200	3,551,328.00	0.66
42	688122	西部超导	67,800	3,517,464.00	0.65
43	600956	新天绿能	451,100	3,482,492.00	0.65
44	002430	杭氧股份	179,200	3,480,064.00	0.65

45	300458	全志科技	87,630	3,478,034.70	0.65
46	603565	中谷物流	363,000	3,466,650.00	0.64
47	003022	联泓新科	218,100	3,452,523.00	0.64
48	601577	长沙银行	346,800	3,447,192.00	0.64
49	002410	广联达	254,000	3,406,140.00	0.63
50	002624	完美世界	219,200	3,325,264.00	0.62
51	601933	永辉超市	666,000	3,263,400.00	0.61
52	600959	江苏有线	934,800	3,215,712.00	0.60
53	600312	平高电气	206,500	3,178,035.00	0.59
54	603486	科沃斯	53,674	3,125,437.02	0.58
55	601233	桐昆股份	294,400	3,120,640.00	0.58
56	600369	西南证券	717,100	3,119,385.00	0.58
57	600998	九州通	604,318	3,106,194.52	0.58
58	601990	南京证券	382,400	3,089,792.00	0.57
59	000623	吉林敖东	180,821	3,064,915.95	0.57
60	002739	万达电影	267,150	3,053,524.50	0.57
61	601615	明阳智能	265,700	3,052,893.00	0.57
62	601665	齐鲁银行	476,900	3,014,008.00	0.56
63	002926	华西证券	331,900	2,967,186.00	0.55
64	600166	福田汽车	1,091,800	2,958,778.00	0.55
65	002244	滨江集团	301,600	2,940,600.00	0.55
66	000039	中集集团	373,100	2,932,566.00	0.54
67	002500	山西证券	500,200	2,921,168.00	0.54
68	002603	以岭药业	200,700	2,829,870.00	0.53
69	688220	翱捷科技	36,000	2,818,800.00	0.52
70	000513	丽珠集团	78,100	2,814,724.00	0.52
71	002202	金风科技	274,000	2,808,500.00	0.52
72	600598	北大荒	194,500	2,804,690.00	0.52
73	688387	信科移动	494,300	2,792,795.00	0.52
74	002939	长城证券	332,300	2,784,674.00	0.52
75	600348	华阳股份	418,000	2,783,880.00	0.52
76	603650	彤程新材	86,200	2,771,330.00	0.51
77	600663	陆家嘴	311,700	2,761,662.00	0.51
78	600906	财达证券	401,900	2,740,958.00	0.51
79	000825	太钢不锈	760,026	2,728,493.34	0.51
80	600578	京能电力	601,600	2,701,184.00	0.50
81	603225	新凤鸣	252,250	2,686,462.50	0.50
82	002223	鱼跃医疗	74,400	2,648,640.00	0.49
83	603290	斯达半导	32,401	2,633,229.27	0.49
84	000898	鞍钢股份	1,116,400	2,590,048.00	0.48
85	600707	彩虹股份	382,800	2,472,888.00	0.46
86	688052	纳芯微	13,000	2,268,370.00	0.42
87	002299	圣农发展	154,900	2,213,521.00	0.41

88	601231	环旭电子	150,800	2,206,204.00	0.41
89	600859	王府井	157,300	2,184,897.00	0.41
90	688538	和辉光电	924,800	2,164,032.00	0.40
91	300146	汤臣倍健	191,700	2,154,708.00	0.40
92	601333	广深铁路	738,700	2,134,843.00	0.40
93	002966	苏州银行	225,600	1,980,768.00	0.37
94	600927	永安期货	128,600	1,904,566.00	0.35
95	605589	圣泉集团	67,100	1,862,025.00	0.35
96	001696	宗申动力	82,000	1,840,900.00	0.34
97	300212	易华录	82,700	1,799,552.00	0.33
98	002294	信立泰	37,400	1,770,142.00	0.33
99	688180	君实生物	51,700	1,756,766.00	0.33
100	600352	浙江龙盛	172,100	1,748,536.00	0.32
101	601108	财通证券	220,300	1,742,573.00	0.32
102	600096	云天化	78,500	1,724,645.00	0.32
103	600298	安琪酵母	48,600	1,709,262.00	0.32
104	603596	伯特利	31,300	1,649,197.00	0.31
105	002595	豪迈科技	27,000	1,598,940.00	0.30
106	002409	雅克科技	29,100	1,591,479.00	0.30
107	002078	太阳纸业	118,100	1,589,626.00	0.30
108	300001	特锐德	66,100	1,584,417.00	0.29
109	600155	华创云信	221,700	1,543,032.00	0.29
110	002273	水晶光电	75,500	1,507,735.00	0.28
111	600637	东方明珠	198,302	1,481,315.94	0.27
112	600909	华安证券	249,600	1,455,168.00	0.27
113	002064	华峰化学	219,600	1,451,556.00	0.27
114	600511	国药股份	49,500	1,443,420.00	0.27
115	601918	新集能源	221,700	1,432,182.00	0.27
116	600131	国网信通	79,500	1,407,150.00	0.26
117	601958	金钼股份	126,200	1,380,628.00	0.26
118	002429	兆驰股份	305,600	1,338,528.00	0.25
119	600977	中国电影	123,200	1,320,704.00	0.25
120	002266	浙富控股	426,800	1,314,544.00	0.24
121	300115	长盈精密	61,400	1,313,960.00	0.24
122	603885	吉祥航空	97,300	1,310,631.00	0.24
123	601019	山东出版	137,400	1,301,178.00	0.24
124	000739	普洛药业	91,300	1,278,200.00	0.24
125	001286	陕西能源	139,300	1,211,910.00	0.22
126	600970	中材国际	140,400	1,204,632.00	0.22
127	600521	华海药业	64,300	1,197,909.00	0.22
128	600928	西安银行	300,700	1,178,744.00	0.22
129	300002	神州泰岳	97,100	1,145,780.00	0.21
130	300558	贝达药业	19,700	1,141,615.00	0.21

131	601608	中信重工	257,200	1,123,964.00	0.21
132	688772	珠海冠宇	77,800	1,111,762.00	0.21
133	300383	光环新网	74,900	1,071,070.00	0.20
134	688475	萤石网络	32,900	1,037,008.00	0.19
135	000426	兴业银锡	65,100	1,028,580.00	0.19
136	300957	贝泰妮	22,500	994,950.00	0.18
137	601179	中国西电	160,200	983,628.00	0.18
138	002568	百润股份	37,400	957,814.00	0.18
139	600688	上海石化	327,000	931,950.00	0.17
140	002432	九安医疗	24,800	903,464.00	0.17
141	000423	东阿阿胶	16,486	862,217.80	0.16
142	002851	麦格米特	16,900	847,366.00	0.16
143	601212	白银有色	266,500	834,145.00	0.15
144	002945	华林证券	57,900	832,023.00	0.15
145	603868	飞科电器	22,600	810,662.00	0.15
146	301301	川宁生物	65,600	789,824.00	0.15
147	000733	振华科技	15,700	785,785.00	0.15
148	000032	深桑达 A	38,800	784,924.00	0.15
149	000997	新大陆	22,200	718,836.00	0.13
150	600060	海信视像	31,000	713,620.00	0.13
151	600483	福能股份	73,900	712,396.00	0.13
152	600316	洪都航空	18,600	701,220.00	0.13
153	300623	捷捷微电	21,900	652,620.00	0.12
154	002461	珠江啤酒	57,200	645,788.00	0.12
155	002262	恩华药业	29,100	604,698.00	0.11
156	002653	海思科	14,100	595,302.00	0.11
157	688213	思特威	5,800	592,876.00	0.11
158	601098	中南传媒	41,900	549,728.00	0.10
159	601228	广州港	167,000	539,410.00	0.10
160	600056	中国医药	51,400	531,476.00	0.10
161	603605	珀莱雅	6,200	513,298.00	0.10
162	300395	菲利华	10,000	511,000.00	0.09
163	000959	首钢股份	149,600	508,640.00	0.09
164	600329	达仁堂	15,000	500,400.00	0.09
165	000429	粤高速 A	35,100	467,883.00	0.09
166	002572	索菲亚	32,200	451,122.00	0.08
167	688002	睿创微纳	6,000	418,320.00	0.08
168	002797	第一创业	57,200	404,976.00	0.08
169	600580	卧龙电驱	18,520	366,140.40	0.07
170	600699	均胜电子	20,752	361,914.88	0.07
171	688172	燕东微	16,700	328,322.00	0.06
172	688234	天岳先进	5,600	327,880.00	0.06
173	603979	金诚信	6,800	315,792.00	0.06

174	300677	英科医疗	12,600	298,368.00	0.06
175	000598	兴蓉环境	39,400	284,074.00	0.05
176	000034	神州数码	7,400	278,536.00	0.05
177	688702	盛科通信	4,300	262,644.00	0.05
178	002507	涪陵榨菜	19,126	244,621.54	0.05
179	300054	鼎龙股份	7,900	226,572.00	0.04
180	600673	东阳光	19,300	224,459.00	0.04
181	603556	海兴电力	8,100	206,307.00	0.04
182	601598	中国外运	39,616	195,306.88	0.04
183	002281	光迅科技	3,917	193,186.44	0.04
184	688278	特宝生物	2,600	187,486.00	0.03
185	002472	双环传动	5,500	184,195.00	0.03
186	300699	光威复材	5,600	177,352.00	0.03
187	600867	通化东宝	18,535	151,987.00	0.03
188	600171	上海贝岭	4,400	150,700.00	0.03
189	002056	横店东磁	9,800	138,670.00	0.03
190	000738	航发控制	6,600	136,950.00	0.03
191	000921	海信家电	5,300	136,210.00	0.03
192	002821	凯莱英	1,500	132,375.00	0.02
193	601928	凤凰传媒	11,300	126,221.00	0.02
194	603826	坤彩科技	6,400	125,248.00	0.02
195	000559	万向钱潮	15,500	118,575.00	0.02
196	600968	海油发展	29,000	118,320.00	0.02
197	603606	东方电缆	1,900	98,249.00	0.02
198	600563	法拉电子	800	87,272.00	0.02
199	603707	健友股份	7,800	86,970.00	0.02
200	600497	驰宏锌锗	14,700	77,763.00	0.01
201	601456	国联民生	4,700	48,645.00	0.01
202	601156	东航物流	1,900	24,871.00	0.00
203	688568	中科星图	500	18,005.00	0.00
204	688425	铁建重工	4,300	17,544.00	0.00

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	300241	瑞丰光电	417,700	2,380,890.00	0.44
2	002284	亚太股份	215,097	2,376,821.85	0.44
3	002362	汉王科技	105,900	2,374,278.00	0.44
4	603500	祥和实业	258,900	2,371,524.00	0.44
5	002876	三利谱	93,900	2,365,341.00	0.44
6	601077	渝农商行	326,800	2,333,352.00	0.43
7	002999	天禾股份	333,700	2,329,226.00	0.43
8	600262	北方股份	100,900	2,300,520.00	0.43
9	000938	紫光股份	95,500	2,291,045.00	0.43

10	600036	招商银行	48,900	2,246,955.00	0.42
11	000100	TCL 科技	518,700	2,245,971.00	0.42
12	002905	金逸影视	241,500	2,241,120.00	0.42
13	601878	浙商证券	178,800	1,950,708.00	0.36
14	300369	绿盟科技	246,700	1,916,859.00	0.36
15	000818	航锦科技	68,800	1,548,000.00	0.29
16	603617	君禾股份	208,300	1,493,511.00	0.28
17	002885	京泉华	103,900	1,470,185.00	0.27
18	300365	恒华科技	185,500	1,222,445.00	0.23
19	688039	当虹科技	36,700	1,204,494.00	0.22
20	688280	精进电动	164,500	1,195,915.00	0.22
21	688327	云从科技	86,700	1,195,593.00	0.22
22	601288	农业银行	202,100	1,188,348.00	0.22
23	300825	阿尔特	109,600	1,184,776.00	0.22
24	688288	鸿泉物联	40,700	1,180,707.00	0.22
25	600668	尖峰集团	83,300	1,178,695.00	0.22
26	300279	和晶科技	168,600	1,168,398.00	0.22
27	002625	光启技术	29,200	1,167,416.00	0.22
28	000725	京东方 A	283,400	1,130,766.00	0.21
29	000975	山金国际	59,600	1,128,824.00	0.21
30	603739	蔚蓝生物	83,400	1,110,888.00	0.21
31	002646	天佑德酒	119,100	1,105,248.00	0.21
32	600866	星湖科技	159,800	1,104,218.00	0.20
33	603299	苏盐井神	114,600	1,085,262.00	0.20
34	002230	科大讯飞	22,600	1,082,088.00	0.20
35	000534	万泽股份	71,100	1,060,812.00	0.20
36	600628	新世界	138,000	1,010,160.00	0.19
37	600010	包钢股份	561,600	1,005,264.00	0.19
38	603138	海量数据	68,100	982,002.00	0.18
39	603267	鸿远电子	19,400	975,238.00	0.18
40	688432	有研硅	84,800	936,192.00	0.17
41	688352	颀中科技	82,300	924,229.00	0.17
42	300980	祥源新材	38,500	901,670.00	0.17
43	688981	中芯国际	10,200	899,334.00	0.17
44	600785	新华百货	76,200	893,826.00	0.17
45	002384	东山精密	23,200	876,264.00	0.16
46	002454	松芝股份	109,100	842,252.00	0.16
47	002587	奥拓电子	128,500	828,825.00	0.15
48	002863	今飞凯达	152,600	773,682.00	0.14
49	603103	横店影视	47,100	755,955.00	0.14
50	000779	甘咨询	79,200	734,184.00	0.14
51	603019	中科曙光	10,300	725,120.00	0.13
52	300666	江丰电子	9,400	696,540.00	0.13

53	603259	药明康德	9,800	681,590.00	0.13
54	601116	三江购物	62,100	676,269.00	0.13
55	601728	中国电信	85,300	661,075.00	0.12
56	600410	华胜天成	67,800	650,202.00	0.12
57	002475	立讯精密	18,300	634,827.00	0.12
58	600827	百联股份	65,000	594,100.00	0.11
59	601038	一拖股份	44,800	585,536.00	0.11
60	300441	鲍斯股份	67,200	548,352.00	0.10
61	603313	梦百合	62,900	534,650.00	0.10
62	600746	江苏索普	65,700	513,117.00	0.10
63	002728	特一药业	55,700	468,437.00	0.09
64	600163	中闽能源	88,700	454,144.00	0.08
65	301215	中汽股份	72,400	448,880.00	0.08
66	600226	亨通股份	156,600	436,914.00	0.08
67	000957	中通客车	36,800	402,224.00	0.07
68	300322	硕贝德	25,900	387,205.00	0.07
69	300288	朗玛信息	25,400	383,794.00	0.07
70	603192	汇得科技	18,200	380,380.00	0.07
71	300534	陇神戎发	39,200	378,672.00	0.07
72	300154	瑞凌股份	41,300	371,700.00	0.07
73	301013	利和兴	21,700	367,815.00	0.07
74	002758	浙农股份	39,200	350,056.00	0.06
75	601126	四方股份	20,600	335,162.00	0.06
76	002419	天虹股份	62,500	335,000.00	0.06
77	300821	东岳硅材	42,400	333,264.00	0.06
78	003025	思进智能	24,180	327,397.20	0.06
79	000063	中兴通讯	9,900	321,651.00	0.06
80	603221	爱丽家居	29,300	321,128.00	0.06
81	603067	振华股份	20,640	314,553.60	0.06
82	600335	国机汽车	46,900	302,505.00	0.06
83	603566	普莱柯	20,300	276,283.00	0.05
84	000651	格力电器	5,800	260,536.00	0.05
85	002881	美格智能	5,600	259,840.00	0.05
86	300119	瑞普生物	12,800	248,576.00	0.05
87	002979	雷赛智能	5,200	230,256.00	0.04
88	300232	洲明科技	31,500	228,060.00	0.04
89	000633	合金投资	36,100	222,015.00	0.04
90	002322	理工能科	18,300	221,430.00	0.04
91	002245	蔚蓝锂芯	17,200	220,676.00	0.04
92	600887	伊利股份	7,700	214,676.00	0.04
93	603116	红蜻蜓	36,200	212,856.00	0.04
94	605166	聚合顺	18,600	208,134.00	0.04
95	300871	回盛生物	9,900	206,910.00	0.04

96	603708	家家悦	20,200	206,040.00	0.04
97	300150	世纪瑞尔	40,700	204,314.00	0.04
98	600237	铜峰电子	27,600	200,100.00	0.04
99	300192	科德教育	13,200	198,000.00	0.04
100	003006	百亚股份	6,400	175,232.00	0.03
101	002042	华孚时尚	37,100	169,176.00	0.03
102	001289	龙源电力	10,100	163,418.00	0.03
103	003033	征和工业	3,700	156,843.00	0.03
104	601096	宏盛华源	33,700	139,518.00	0.03
105	300762	上海瀚讯	6,000	135,780.00	0.03
106	603667	五洲新春	3,500	117,285.00	0.02
107	600104	上汽集团	6,100	97,905.00	0.02
108	600030	中信证券	3,300	91,146.00	0.02
109	301256	华融化学	8,600	91,074.00	0.02
110	603881	数据港	3,400	86,870.00	0.02
111	605218	伟时电子	3,800	85,044.00	0.02
112	000061	农产品	13,300	84,987.00	0.02
113	000823	超声电子	6,900	81,765.00	0.02
114	300249	依米康	5,500	75,020.00	0.01
115	688381	帝奥微	3,200	69,312.00	0.01
116	688775	影石创新	511	63,445.76	0.01
117	601600	中国铝业	8,500	59,840.00	0.01
118	601579	会稽山	3,000	59,730.00	0.01
119	002970	锐明技术	1,200	59,280.00	0.01
120	002953	日丰股份	5,000	51,900.00	0.01
121	688009	中国通号	8,500	43,690.00	0.01
122	600418	江淮汽车	700	28,063.00	0.01
123	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
124	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.00
125	600489	中金黄金	1,600	23,408.00	0.00
126	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
127	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
128	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
129	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
130	301501	恒鑫生活	350	15,827.00	0.00
131	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
132	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
133	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
134	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
135	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
136	603049	中策橡胶	302	12,940.70	0.00
137	601788	光大证券	700	12,586.00	0.00
138	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00

139	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
140	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
141	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
142	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
143	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
144	603202	天有为	98	8,884.68	0.00
145	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
146	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
147	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
148	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
149	601988	中国银行	1,200	6,744.00	0.00
150	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
151	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
152	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
153	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
154	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
155	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
156	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
157	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
158	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
159	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
160	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
161	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
162	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
163	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
164	603120	肯特催化	65	2,172.95	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	300476	胜宏科技	25,288,303.00	2.95
2	000988	华工科技	17,539,889.00	2.04
3	002797	第一创业	17,319,157.00	2.02
4	002340	格林美	17,122,584.00	1.99
5	600988	赤峰黄金	16,973,338.00	1.98
6	300207	欣旺达	16,683,841.00	1.94
7	002202	金风科技	15,772,372.00	1.84
8	688469	芯联集成	15,729,013.60	1.83
9	603660	苏州科达	15,539,284.00	1.81
10	000021	深科技	15,352,121.74	1.79
11	002673	西部证券	14,861,535.00	1.73
12	300803	指南针	14,770,164.45	1.72
13	600118	中国卫星	14,760,996.00	1.72

14	600312	平高电气	14,685,279.70	1.71
15	000960	锡业股份	14,523,615.00	1.69
16	603596	伯特利	14,175,852.00	1.65
17	002444	巨星科技	14,153,508.00	1.65
18	601615	明阳智能	14,061,006.00	1.64
19	002532	天山铝业	14,038,908.20	1.64
20	600096	云天化	14,023,327.60	1.63

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300476	胜宏科技	27,444,376.00	3.20
2	000021	深科技	20,576,462.42	2.40
3	300207	欣旺达	20,576,333.00	2.40
4	002797	第一创业	19,332,342.00	2.25
5	600988	赤峰黄金	18,260,295.00	2.13
6	002368	太极股份	17,667,060.00	2.06
7	601555	东吴证券	17,471,370.36	2.04
8	603087	甘李药业	17,351,519.00	2.02
9	603979	金诚信	17,138,116.80	2.00
10	300373	扬杰科技	17,134,304.00	2.00
11	603660	苏州科达	16,834,727.00	1.96
12	601608	中信重工	16,821,286.00	1.96
13	002281	光迅科技	16,787,299.00	1.96
14	000960	锡业股份	16,663,812.00	1.94
15	002202	金风科技	16,655,624.38	1.94
16	002532	天山铝业	16,445,416.80	1.92
17	601168	西部矿业	16,368,641.04	1.91
18	601615	明阳智能	16,130,361.00	1.88
19	002673	西部证券	15,950,975.00	1.86
20	688469	芯联集成	15,908,311.05	1.85

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	3,404,071,412.91
卖出股票收入（成交）总额	3,771,721,874.13

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

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	200,079.16
2	应收清算款	31,929,458.40
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	128,300.14
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,257,837.70

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
万家中证 500 指 数 增 强 发 起 式 A	87,427	3,549.99	73,950,987.95	23.83	236,413,714.32	76.17
万家中证 500 指 数 增 强 发 起 式 C	7,249	16,968.77	48,174,207.00	39.16	74,832,394.91	60.84
合计	94,199	4,600.59	122,125,194.95	28.18	311,246,109.23	71.82

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
----	------	-----------	-------------

基金管理人所有从业人员持有本基金	万家中证 500 指数增强发起式 A	267,072.37	0.0861
	万家中证 500 指数增强发起式 C	43,581.87	0.0354
	合计	310,654.24	0.0717

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

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家中证 500 指数增强发起式 A	万家中证 500 指数增强发起式 C
基金合同生效日 （2019 年 5 月 23 日） 基金份额总额	193,620,037.68	22,381,542.21
本报告期期初基金份 额总额	515,731,375.75	223,074,479.88
本报告期基金总申购 份额	17,618,417.19	52,469,526.75
减：本报告期基金总 赎回份额	222,985,090.67	152,537,404.72
本报告期基金拆分变 动份额	—	—
本报告期期末基金份 额总额	310,364,702.27	123,006,601.91

§ 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

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

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 (%)	
东方财富证券	2	3,402,765,601.00	47.43	666,685.29	47.44	—
甬兴证券	2	2,449,348,637.07	34.14	479,831.76	34.14	—
恒泰证券	2	1,321,737,173.72	18.42	258,938.52	18.42	—
财通证券	3	—	—	—	—	—
德邦证券	2	—	—	—	—	—
第一创业	2	—	—	—	—	—

证券						
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海 证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	3	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华源证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	4	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准

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

选择证券公司参与证券交易的标准如下：

(1) 财务状况稳健：证券公司应具备良好的财务状况，经营行为符合相关法律法规及行业规范；
(2) 内控与风控能力强：证券公司具备完善的内部控制制度，合规管理和风险控制能力较强；
(3) 技术支持完善：具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需求；

(4) 专业能力与服务水平：具有较强的研究能力及金融服务水平，或在交易服务、券商结算等业务方面具备较强能力。

2、选择证券公司参与证券交易的程序

(1) 管理人从财务状况、研究服务能力、风险管理能力、合规管理能力、交易服务水平、交易信息技术能力等方面对证券公司进行评估考察，经内部审批完成后，最终确定入选合作证券公司

的备选库。

(2)与入选备选库证券公司达成合作意向后，双方签订协议，明确双方的权利义务，包括服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式等。

3、基金专用交易席位的变更情况：

本报告期内，本基金新增华源证券交易单元 2 个，新增山西证券交易单元 2 个，新增甬兴证券交易单元 2 个、减少财达证券交易单元 1 个，减少国投证券交易单元 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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
东方财富证券	2,197,502.00	37.94	-	-	-	-
甬兴证券	2,896,001.00	49.99	-	-	-	-
恒泰证券	699,160.00	12.07	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华源证	-	-	-	-	-	-

券						
开源证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
银泰证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
中邮证 券	-	-	-	-	-	-

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	关于万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	指定媒介	2025 年 1 月 3 日
2	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金分红公告	指定媒介	2025 年 1 月 8 日
3	关于万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金恢复大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	指定媒介	2025 年 1 月 10 日
4	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	指定媒介	2025 年 1 月 21 日
5	万家基金管理有限公司旗下基金季度报告提示性公告	指定媒介	2025 年 1 月 21 日
6	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金产品资料概要（更新）	指定媒介	2025 年 3 月 20 日
7	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同（更新）	指定媒介	2025 年 3 月 20 日

8	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议（更新）	指定媒介	2025 年 3 月 20 日
9	关于万家基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	指定媒介	2025 年 3 月 20 日
10	万家基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金更新招募说明书和基金产品资料概要的提示性公告	指定媒介	2025 年 3 月 20 日
11	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书（2025 年第 1 号）	指定媒介	2025 年 3 月 20 日
12	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年年度报告	指定媒介	2025 年 3 月 29 日
13	万家基金管理有限公司旗下基金年度报告提示性公告	指定媒介	2025 年 3 月 29 日
14	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	指定媒介	2025 年 4 月 21 日
15	万家基金管理有限公司旗下基金季度报告提示性公告	指定媒介	2025 年 4 月 21 日
16	万家基金管理有限公司关于增加财达证券为旗下部分基金销售机构并开通定投及参与费率优惠活动的公告	指定媒介	2025 年 4 月 25 日
17	万家基金管理有限公司关于增加广发银行为旗下部分基金销售机构并开通定投业务及参加其费率优惠活动的公告	指定媒介	2025 年 5 月 6 日
18	万家基金管理有限公司关于增加邮储银行为旗下部分基金销售机构并开通定投业务的公告	指定媒介	2025 年 5 月 17 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	20250101-20250611	191,158,346.05	-	161,158,346.05	30,000,000.00	6.92
产品特有风险							
报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。 未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付							

赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》。
- 4、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2025 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

2025 年 8 月 29 日