

万家元贞量化选股股票型证券投资基金 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52

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	52
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	52
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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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	54
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
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	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
§ 12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家元贞量化选股股票型证券投资基金	
基金简称	万家元贞量化选股股票	
基金主代码	012350	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 3 月 14 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	370,016,611.20 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	万家元贞量化选股股票 A	万家元贞量化选股股票 C
下属分级基金的交 易代码	012350	012351
报告期末下属分级 基金的份额总额	247,166,641.69 份	122,849,969.51 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

客户服务电话	4008880800	95599
传真	021-38909627	010-68121816
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区浦 电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	上海市浦东新区浦电路 360 号陆 家嘴投资大厦 9 楼、15 楼、16 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	200122	100031
法定代表人	方一天	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告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)	
	万家元贞量化选股股票 A	万家元贞量化选股股票 C
本期已实现收益	20,243,167.15	9,630,642.93
本期利润	21,991,665.21	10,749,754.63
加权平均基金份额本期利润	0.0784	0.0770
本期加权平均净值利润率	8.33%	8.26%
本期基金份额净值增长率	8.87%	8.61%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-5,186,643.15	-3,947,541.17
期末可供分配基金份额利润	-0.0210	-0.0321
期末基金资产净值	246,385,575.32	121,062,524.06
期末基金份额净值	0.9968	0.9855
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	-0.32%	-1.45%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家元贞量化选股股票 A

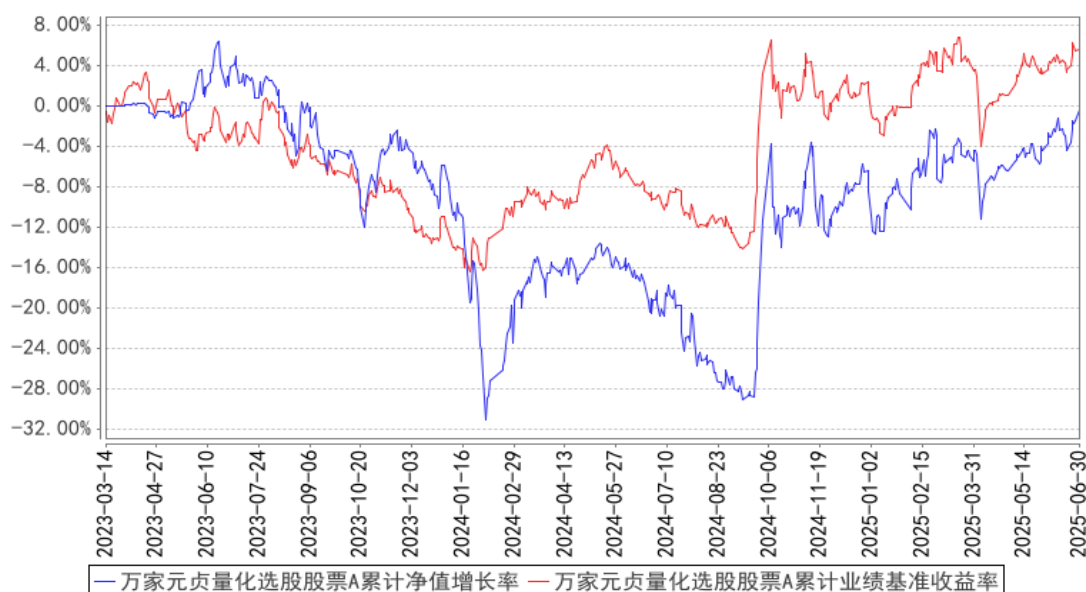
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	4.17%	0.74%	2.24%	0.52%	1.93%	0.22%
过去三个月	5.40%	1.12%	1.96%	1.04%	3.44%	0.08%
过去六个月	8.87%	1.21%	4.00%	0.93%	4.87%	0.28%
过去一年	23.43%	1.66%	16.18%	1.06%	7.25%	0.60%
自基金合同生效起至今	-0.32%	1.41%	5.58%	0.88%	-5.90%	0.53%

万家元贞量化选股股票 C

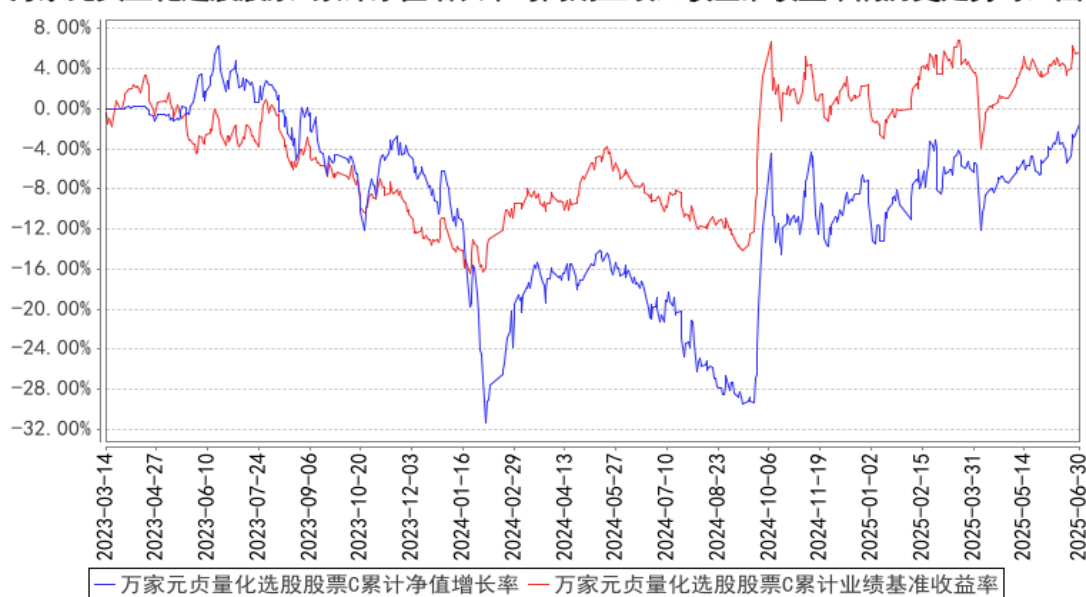
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	4.14%	0.74%	2.24%	0.52%	1.90%	0.22%
过去三个月	5.28%	1.12%	1.96%	1.04%	3.32%	0.08%
过去六个月	8.61%	1.21%	4.00%	0.93%	4.61%	0.28%
过去一年	22.83%	1.66%	16.18%	1.06%	6.65%	0.60%
自基金合同生效起至今	-1.45%	1.41%	5.58%	0.88%	-7.03%	0.53%

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

万家元贞量化选股股票A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



万家元贞量化选股股票C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2023 年 3 月 14 日成立，根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44 号文批准设立。公司的股东为中泰

证券股份有限公司、山东省新动能基金管理有限公司，住所：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 楼（名义楼层 9 层）。截至 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基金、万家元贞量化选股股票型证券投资基金、万家创业板指数增强型证券投资基金、万家国证 2000 指数增强型证券投资基金、万家家瑞债券型证券投资基金、万家沪深 300 指数增强型证券投资基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家颐达灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。	2023 年 3 月 14 日	-	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。

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

第 9 页 共 58 页

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

本产品为主动量化选股策略，运用量化选股模型和行业配置策略，主动适应不同的市场风格，前瞻性选股，提高选股胜率，以追求能获得长期稳定的超额收益。万家元贞量化在风格上配置相对均衡，行业配置偏向于行业景气度高的行业。在量化选股方面精选行业内质优个股组合，持股较为分散。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家元贞量化选股股票 A 的基金份额净值为 0.9968 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.87%，同期业绩比较基准收益率为 4.00%；截至本报告期末万家元贞量化选股股票 C

的基金份额净值为 0.9855 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.61%，同期业绩比较基准收益率为 4.00%。

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

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—万家基金管理有限公司报告期内基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，万家基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，万家基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：万家元贞量化选股股票型证券投资基金

报告截止日：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	24,285,409.39	28,014,558.79
结算备付金		2,186,133.41	1,762,274.99
存出保证金		157,177.17	194,852.12
交易性金融资产	6.4.7.2	343,154,091.82	393,008,677.24
其中：股票投资		343,154,091.82	393,008,677.24

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		21,248.82	501,333.78
应收股利		-	-
应收申购款		256,104.70	63,961.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		370,060,165.31	423,545,658.05
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		3.14	-
应付赎回款		1,267,034.87	4,112,889.21
应付管理人报酬		363,850.50	435,861.49
应付托管费		60,641.76	72,643.55
应付销售服务费		50,010.96	60,475.88
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	870,524.70	897,630.94
负债合计		2,612,065.93	5,579,501.07
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	370,016,611.20	457,845,994.87
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	-2,568,511.82	-39,879,837.89
净资产合计		367,448,099.38	417,966,156.98
负债和净资产总计		370,060,165.31	423,545,658.05

注： 报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额总额 370,016,611.20 份，其中万家元贞量化选股股票 A 基金份额净值 0.9968 元，基金份额总额 247,166,641.69 份；万家元贞量化选股股票 C 基金份额净值 0.9855 元，基金份额总额 122,849,969.51 份。

6.2 利润表

会计主体： 万家元贞量化选股股票型证券投资基金

本报告期： 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		35,892,606.33	-89,799,334.90
1. 利息收入		63,023.63	164,924.60
其中：存款利息收入	6.4.7.10	63,023.63	164,924.60
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）		32,952,030.13	-77,253,958.39
其中：股票投资收益	6.4.7.11	28,589,319.32	-82,566,745.98
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	660.79
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	4,362,710.81	5,312,126.80
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	2,867,609.76	-12,763,656.06
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	9,942.81	53,354.95
减：二、营业总支出		3,151,186.49	4,058,847.06
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,346,557.01	3,030,021.59

其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	391, 092. 85	505, 003. 56
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	322, 732. 98	442, 566. 49
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	90, 803. 65	81, 255. 42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		32, 741, 419. 84	-93, 858, 181. 96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		32, 741, 419. 84	-93, 858, 181. 96
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		32, 741, 419. 84	-93, 858, 181. 96

6.3 净资产变动表

会计主体：万家元贞量化选股股票型证券投资基金

本报告期：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	457, 845, 994. 87	-	-39, 879, 837. 89	417, 966, 156. 98
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	457, 845, 994. 87	-	-39, 879, 837. 89	417, 966, 156. 98
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-87, 829, 383. 67	-	37, 311, 326. 07	-50, 518, 057. 60
（一）、综合收益总额	-	-	32, 741, 419. 84	32, 741, 419. 84
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-87, 829, 383. 67	-	4, 569, 906. 23	-83, 259, 477. 44
其中：1. 基金申购款	9, 000, 530. 06	-	-700, 436. 61	8, 300, 093. 45

2. 基金赎回款	-96,829,913.73	-	5,270,342.84	-91,559,570.89
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	370,016,611.20	-	-2,568,511.82	367,448,099.38
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	668,322,371.66	-	-40,150,709.76	628,171,661.90
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	668,322,371.66	-	-40,150,709.76	628,171,661.90
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-119,017,444.92	-	-66,523,888.31	-185,541,333.23
(一)、综合收益总额	-	-	-93,858,181.96	-93,858,181.96
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-119,017,444.92	-	27,334,293.65	-91,683,151.27
其中：1. 基金申购款	62,361,609.48	-	-8,222,440.87	54,139,168.61
2. 基金赎回款	-181,379,054.40	-	35,556,734.52	-145,822,319.88
(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	549,304,926.74	-	-106,674,598.07	442,630,328.67

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

万家元贞量化选股股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2023]232 号文《关于准予万家元贞量化选股股票型证券投资基金注册的批复》的核准，由万家基金管理有限公司作为基金管理人于 2023 年 2 月 20 日至 2023 年 3 月 10 日向社会公开募集，募集期结束经立信会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具信会师报字[2023]第 ZA30067 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2023 年 3 月 14 日生效，本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 1,381,361,850.89 元，有效认购资金在基金验资确认日之前产生的利息为人民币 483,092.16 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,381,844,943.05 元，折合 1,381,844,943.05 份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为万家基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》中国证监会制定的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《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	24,285,409.39
等于：本金	24,282,963.84
加：应计利息	2,445.55
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	24,285,409.39

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		333,165,770.72	-	343,154,091.82	9,988,321.10
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		333,165,770.72	-	343,154,091.82	9,988,321.10

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	0.03
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	796,140.91
其中：交易所市场	796,140.91
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	74,383.76
合计	870,524.70

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

万家元贞量化选股股票 A

项目	本期 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	306,034,141.08	306,034,141.08
本期申购	2,773,252.61	2,773,252.61
本期赎回（以“-”号填列）	-61,640,752.00	-61,640,752.00
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	247,166,641.69	247,166,641.69

万家元贞量化选股股票 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	151,811,853.79	151,811,853.79
本期申购	6,227,277.45	6,227,277.45

本期赎回（以“-”号填列）	-35,189,161.73	-35,189,161.73
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	122,849,969.51	122,849,969.51

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

万家元贞量化选股股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-28,879,395.50	3,056,213.64	-25,823,181.86
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-28,879,395.50	3,056,213.64	-25,823,181.86
本期利润	20,243,167.15	1,748,498.06	21,991,665.21
本期基金份额交易产生的变动数	3,449,585.20	-399,134.92	3,050,450.28
其中：基金申购款	-194,054.20	47,422.41	-146,631.79
基金赎回款	3,643,639.40	-446,557.33	3,197,082.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,186,643.15	4,405,576.78	-781,066.37

万家元贞量化选股股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-15,551,849.96	1,495,193.93	-14,056,656.03
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-15,551,849.96	1,495,193.93	-14,056,656.03
本期利润	9,630,642.93	1,119,111.70	10,749,754.63
本期基金份额交易产生的变动数	1,973,665.86	-454,209.91	1,519,455.95
其中：基金申购款	-458,634.09	-95,170.73	-553,804.82
基金赎回款	2,432,299.95	-359,039.18	2,073,260.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,947,541.17	2,160,095.72	-1,787,445.45

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	59,153.80
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	3,504.53
其他	365.30
合计	63,023.63

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	28,589,319.32
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	28,589,319.32

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	1,707,169,412.95
减：卖出股票成本总额	1,676,028,443.45
减：交易费用	2,551,650.18
买卖股票差价收入	28,589,319.32

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
----	----

	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,362,710.81
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	4,362,710.81

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	2,867,609.76
股票投资	2,867,609.76
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	2,867,609.76

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	9,820.64
基金转换费收入	122.17
合计	9,942.81

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	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	7,419.89
账户维护费	9,000.00

合计	90,803.65
----	-----------

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
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
中泰证券股份有限公司（“中泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

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	1,248,041,286.24	37.49	2,075,787,732.74	35.67

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（%）
中泰证券	556,596.83	37.49	483,003.83	60.67
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	1,963,504.03	35.82	343,438.68	13.85

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	2,346,557.01	3,030,021.59
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,012,545.76	1,184,020.33
应支付基金管理人的净管理费	1,334,011.25	1,846,001.26

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

$$H=E\times 1.20\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	391,092.85	505,003.56

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

$$H=E\times 0.20\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家元贞量化选股股票 A	万家元贞量化选股股票 C	合计
农业银行	-	73,173.95	73,173.95
万家基金	-	161.57	161.57
中泰证券	-	25,397.19	25,397.19
合计	-	98,732.71	98,732.71
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		
	万家元贞量化选股股票 A	万家元贞量化选股股票 C	合计
农业银行	-	77,096.53	77,096.53
万家基金	-	12,158.04	12,158.04
中泰证券	-	27,228.38	27,228.38
合计	-	116,482.95	116,482.95

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

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据相关协议支付给各销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	万家元贞量化选股股票 A	万家元贞量化选股股票 C
基金合同生效日（2023 年 3 月 14 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-
项目	上年度可比期间	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	万家元贞量化选股股票 A	万家元贞量化选股股票 C
基金合同生效日（2023 年 3 月 14 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	19,450,496.01	-
报告期间申购/买入总份额	-	-

报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份 额	19,450,496.01	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

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
农业银行	24,285,409.39	59,153.80	34,110,264.01	130,995.53

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方所承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间没有需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（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	新亚电缆	2025 年 3 月 13 日	6 个月	新股流 通受限	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
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	钧崑电子	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	27.57	45.22	349	9,620.72	15,781.78	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	众捷汽车	2025 年 4 月 17 日	6 个月	新股流 通受限	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
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	6 个月	新股流 通受限	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-

		8 日								
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	199	5,273.50	6,503.32	-
603049	中策橡胶	2025 年 5 月 27 日	6 个月	新股流 通受限	46.50	42.85	181	8,416.50	7,755.85	-
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	65	6,077.50	5,892.90	-
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	309	14,606.43	38,365.44	-

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
688313	仕佳光子	2025 年 6 月 30 日	重大 事项 停牌	38.05	2025 年 7 月 11 日	39.98	9,300	336,331.75	353,865.00	-
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	6,900	41,219.61	42,435.00	-

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	24,285,409.39	-	-	-	-	-	24,285,409.39
结算备付金	2,186,133.41	-	-	-	-	-	2,186,133.41
存出保证金	157,177.17	-	-	-	-	-	157,177.17
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-343,154,091.82	-343,154,091.82
应收申购款	0.56	-	-	-	-	256,104.14	256,104.70
应收清算款	-	-	-	-	-	21,248.82	21,248.82
资产总计	26,628,720.53	-	-	-	-	-343,431,444.78	370,060,165.31
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,267,034.87	1,267,034.87
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	363,850.50	363,850.50
应付托管费	-	-	-	-	-	60,641.76	60,641.76
应付清算款	-	-	-	-	-	3.14	3.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-	50,010.96	50,010.96
其他负债	-	-	-	-	-	870,524.70	870,524.70
负债总计	-	-	-	-	-	2,612,065.93	2,612,065.93
利率敏感度缺口	26,628,720.53	-	-	-	-	-340,819,378.85	367,448,099.38
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	28,014,558.79	-	-	-	-	-	28,014,558.79
结算备付金	1,762,274.99	-	-	-	-	-	1,762,274.99
存出保证金	194,852.12	-	-	-	-	-	194,852.12
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-393,008,677.24	-393,008,677.24
应收申购款	0.39	-	-	-	-	63,960.74	63,961.13
应收清算款	-	-	-	-	-	501,333.78	501,333.78
资产总计	29,971,686.29	-	-	-	-	-393,573,971.76	423,545,658.05
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,112,889.21	4,112,889.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	435,861.49	435,861.49
应付托管费	-	-	-	-	-	72,643.55	72,643.55
应付销售服务费	-	-	-	-	-	60,475.88	60,475.88
其他负债	-	-	-	-	-	897,630.94	897,630.94
负债总计	-	-	-	-	-	5,579,501.07	5,579,501.07
利率敏感度缺口	29,971,686.29	-	-	-	-	-387,994,470.69	417,966,156.98

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。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	343,154,091.82	93.39	393,008,677.24	94.03
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	343,154,091.82	93.39	393,008,677.24	94.03

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	3, 949, 179. 52	4, 736, 135. 03
	股票基准指数下降 100 个基点	-3, 949, 179. 52	-4, 736, 135. 03

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	342, 337, 896. 87	392, 441, 461. 21
第二层次	411, 685. 54	27, 736. 50
第三层次	404, 509. 41	539, 479. 53
合计	343, 154, 091. 82	393, 008, 677. 24

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	343,154,091.82	92.73
	其中：股票	343,154,091.82	92.73
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	26,471,542.80	7.15
8	其他各项资产	434,530.69	0.12
9	合计	370,060,165.31	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	692,888.20	0.19
B	采矿业	15,596,963.00	4.24
C	制造业	237,974,276.62	64.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,792,456.00	1.30
E	建筑业	3,517,723.00	0.96
F	批发和零售业	12,559,365.00	3.42
G	交通运输、仓储和邮政业	5,043,359.00	1.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,062,611.20	3.83

J	金融业	26,263,236.90	7.15
K	房地产业	1,050,647.00	0.29
L	租赁和商务服务业	8,535,666.00	2.32
M	科学研究和技术服务业	7,905,214.70	2.15
N	水利、环境和公共设施管理业	1,282,620.00	0.35
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	114,652.00	0.03
Q	卫生和社会工作	478,856.00	0.13
R	文化、体育和娱乐业	2,388,047.20	0.65
S	综合	895,510.00	0.24
	合计	343,154,091.82	93.39

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300502	新易盛	46,340	5,886,106.80	1.60
2	600685	中船防务	192,100	5,223,199.00	1.42
3	603236	移远通信	60,680	5,206,344.00	1.42
4	600183	生益科技	170,100	5,128,515.00	1.40
5	603259	药明康德	72,300	5,028,465.00	1.37
6	600262	北方股份	200,800	4,578,240.00	1.25
7	002624	完美世界	298,200	4,523,694.00	1.23
8	688235	百济神州	19,200	4,485,888.00	1.22
9	300888	稳健医疗	105,631	4,341,434.10	1.18
10	002728	特一药业	487,500	4,099,875.00	1.12
11	002284	亚太股份	358,500	3,961,425.00	1.08
12	688035	德邦科技	96,100	3,903,582.00	1.06
13	688428	诺诚健华	157,100	3,837,953.00	1.04
14	603500	祥和实业	401,900	3,681,404.00	1.00
15	600668	尖峰集团	257,900	3,649,285.00	0.99
16	002155	湖南黄金	197,240	3,520,734.00	0.96
17	002885	京泉华	228,860	3,238,369.00	0.88
18	301018	申菱环境	84,500	3,205,930.00	0.87
19	600031	三一重工	174,800	3,137,660.00	0.85
20	603612	索通发展	169,700	3,119,086.00	0.85
21	002246	北化股份	213,200	3,116,984.00	0.85
22	688162	巨一科技	113,700	3,097,188.00	0.84
23	002876	三利谱	121,800	3,068,142.00	0.83
24	601009	南京银行	263,300	3,059,546.00	0.83
25	601668	中国建筑	528,700	3,050,599.00	0.83

26	300471	厚普股份	281,300	2,993,032.00	0.81
27	600166	福田汽车	1,088,400	2,949,564.00	0.80
28	002999	天禾股份	403,400	2,815,732.00	0.77
29	600489	中金黄金	191,200	2,797,256.00	0.76
30	603379	三美股份	57,800	2,781,336.00	0.76
31	000878	云南铜业	216,000	2,747,520.00	0.75
32	000333	美的集团	37,200	2,685,840.00	0.73
33	002469	三维化学	318,300	2,645,073.00	0.72
34	002128	电投能源	131,800	2,607,004.00	0.71
35	002758	浙农股份	291,900	2,606,667.00	0.71
36	300363	博腾股份	152,400	2,602,992.00	0.71
37	000783	长江证券	374,300	2,593,899.00	0.71
38	600919	江苏银行	216,400	2,583,816.00	0.70
39	601398	工商银行	339,400	2,576,046.00	0.70
40	000975	山金国际	136,000	2,575,840.00	0.70
41	601818	光大银行	615,600	2,554,740.00	0.70
42	601328	交通银行	314,500	2,516,000.00	0.68
43	601665	齐鲁银行	392,500	2,480,600.00	0.68
44	000906	浙商中拓	379,600	2,418,052.00	0.66
45	688578	艾力斯	25,900	2,409,736.00	0.66
46	600160	巨化股份	82,600	2,368,968.00	0.64
47	600153	建发股份	222,000	2,302,140.00	0.63
48	600219	南山铝业	595,600	2,281,148.00	0.62
49	689009	九号公司	38,200	2,260,294.00	0.62
50	600179	安通控股	800,200	2,208,552.00	0.60
51	000423	东阿阿胶	41,200	2,154,760.00	0.59
52	600585	海螺水泥	99,600	2,138,412.00	0.58
53	603087	甘李药业	38,300	2,098,074.00	0.57
54	688266	泽璟制药	19,500	2,096,445.00	0.57
55	002582	好想你	208,000	2,063,360.00	0.56
56	000061	农产品	319,000	2,038,410.00	0.55
57	002588	史丹利	231,000	2,035,110.00	0.55
58	000651	格力电器	45,200	2,030,384.00	0.55
59	600276	恒瑞医药	38,600	2,003,340.00	0.55
60	002267	陕天然气	263,400	1,993,938.00	0.54
61	600866	星湖科技	284,700	1,967,277.00	0.54
62	002454	松芝股份	254,600	1,965,512.00	0.53
63	688636	智明达	55,517	1,875,919.43	0.51
64	688256	寒武纪	3,100	1,864,650.00	0.51
65	002223	鱼跃医疗	51,500	1,833,400.00	0.50
66	300940	南极光	71,800	1,812,950.00	0.49
67	000513	丽珠集团	45,600	1,643,424.00	0.45
68	603101	汇嘉时代	215,500	1,616,250.00	0.44

69	000902	新洋丰	116,800	1,615,344.00	0.44
70	603881	数据港	62,380	1,593,809.00	0.43
71	300871	回盛生物	76,100	1,590,490.00	0.43
72	300609	汇纳科技	47,400	1,584,108.00	0.43
73	600873	梅花生物	147,700	1,578,913.00	0.43
74	600201	生物股份	191,300	1,534,226.00	0.42
75	000915	华特达因	43,200	1,527,120.00	0.42
76	600793	宜宾纸业	57,400	1,479,198.00	0.40
77	601128	常熟银行	200,270	1,475,989.90	0.40
78	001207	联科科技	57,274	1,405,503.96	0.38
79	002001	新 和 成	65,700	1,397,439.00	0.38
80	688041	海光信息	9,800	1,384,642.00	0.38
81	688608	恒玄科技	3,900	1,357,122.00	0.37
82	000408	藏格矿业	31,700	1,352,639.00	0.37
83	600285	羚锐制药	58,700	1,330,729.00	0.36
84	688488	艾迪药业	93,600	1,296,360.00	0.35
85	300119	瑞普生物	64,400	1,250,648.00	0.34
86	603979	金诚信	26,600	1,235,304.00	0.34
87	002625	光启技术	30,700	1,227,386.00	0.33
88	600269	赣粤高速	238,500	1,206,810.00	0.33
89	300274	阳光电源	17,400	1,179,198.00	0.32
90	603766	隆鑫通用	92,000	1,173,920.00	0.32
91	301080	百普赛斯	16,350	1,169,515.50	0.32
92	600710	苏美达	121,300	1,165,693.00	0.32
93	000962	东方钽业	70,400	1,155,264.00	0.31
94	603659	璞泰来	61,500	1,154,970.00	0.31
95	603466	风语筑	110,680	1,116,761.20	0.30
96	603983	丸美生物	26,300	1,108,019.00	0.30
97	000001	平安银行	90,800	1,095,956.00	0.30
98	600195	中牧股份	148,440	1,088,065.20	0.30
99	000039	中集集团	136,000	1,068,960.00	0.29
100	600547	山东黄金	33,100	1,056,883.00	0.29
101	603089	正裕工业	80,800	1,056,056.00	0.29
102	601939	建设银行	110,500	1,043,120.00	0.28
103	688008	澜起科技	12,700	1,041,400.00	0.28
104	600460	士兰微	41,700	1,034,994.00	0.28
105	002206	海 利 得	201,900	1,031,709.00	0.28
106	600018	上港集团	177,700	1,014,667.00	0.28
107	002225	濮耐股份	199,369	986,876.55	0.27
108	600989	宝丰能源	60,500	976,470.00	0.27
109	301248	杰创智能	38,800	965,344.00	0.26
110	003006	百亚股份	35,200	963,776.00	0.26
111	600875	东方电气	57,200	957,528.00	0.26

112	600062	华润双鹤	50,900	949,794.00	0.26
113	000977	浪潮信息	18,500	941,280.00	0.26
114	002676	顺威股份	129,900	939,177.00	0.26
115	002755	奥赛康	58,400	933,232.00	0.25
116	605507	国邦医药	47,000	929,190.00	0.25
117	300241	瑞丰光电	161,400	919,980.00	0.25
118	600673	东阳光	77,000	895,510.00	0.24
119	300641	正丹股份	38,900	886,531.00	0.24
120	605599	菜百股份	54,000	882,900.00	0.24
121	600750	江中药业	40,000	873,200.00	0.24
122	600780	通宝能源	147,000	871,710.00	0.24
123	000757	浩物股份	189,300	857,529.00	0.23
124	601658	邮储银行	154,000	842,380.00	0.23
125	000885	城发环境	63,100	840,492.00	0.23
126	601077	渝农商行	115,300	823,242.00	0.22
127	300048	合康新能	139,600	819,452.00	0.22
128	300708	聚灿光电	68,000	816,000.00	0.22
129	002371	北方华创	1,800	795,978.00	0.22
130	601066	中信建投	33,000	793,650.00	0.22
131	603214	爱婴室	41,300	792,547.00	0.22
132	688519	南亚新材	17,500	784,000.00	0.21
133	301031	中熔电气	9,840	783,756.00	0.21
134	605068	明新旭腾	43,600	783,492.00	0.21
135	600176	中国巨石	68,700	783,180.00	0.21
136	002905	金逸影视	84,100	780,448.00	0.21
137	002560	通达股份	98,400	777,360.00	0.21
138	688536	思瑞浦	5,600	776,832.00	0.21
139	688233	神工股份	24,000	762,480.00	0.21
140	300990	同飞股份	15,200	758,480.00	0.21
141	600482	中国动力	32,500	749,775.00	0.20
142	603868	飞科电器	20,800	746,096.00	0.20
143	600887	伊利股份	26,700	744,396.00	0.20
144	000063	中兴通讯	22,800	740,772.00	0.20
145	601857	中国石油	83,800	716,490.00	0.19
146	002769	普路通	72,200	698,896.00	0.19
147	002489	浙江永强	188,400	689,544.00	0.19
148	000551	创元科技	53,500	687,475.00	0.19
149	601600	中国铝业	97,400	685,696.00	0.19
150	603486	科沃斯	11,700	681,291.00	0.19
151	688401	路维光电	19,600	680,120.00	0.19
152	301220	亚香股份	14,780	663,622.00	0.18
153	600988	赤峰黄金	26,600	661,808.00	0.18
154	600728	佳都科技	121,300	661,085.00	0.18

155	002487	大金重工	19,700	648,130.00	0.18
156	688617	惠泰医疗	2,175	645,975.00	0.18
157	688722	同益中	30,000	638,100.00	0.17
158	603499	翔港科技	38,640	637,173.60	0.17
159	688202	美迪西	17,700	635,961.00	0.17
160	688192	迪哲医药	10,500	627,900.00	0.17
161	601963	重庆银行	57,800	627,708.00	0.17
162	301291	明阳电气	15,000	617,250.00	0.17
163	600163	中闽能源	119,200	610,304.00	0.17
164	300972	万辰集团	3,300	594,792.00	0.16
165	603193	润本股份	18,800	590,508.00	0.16
166	688288	鸿泉物联	20,300	588,903.00	0.16
167	002913	奥士康	19,900	585,259.00	0.16
168	300236	上海新阳	15,000	582,000.00	0.16
169	603129	春风动力	2,600	562,900.00	0.15
170	300662	科锐国际	18,900	561,519.00	0.15
171	002850	科达利	4,900	554,533.00	0.15
172	601995	中金公司	15,600	551,616.00	0.15
173	003020	立方制药	24,200	540,144.00	0.15
174	300685	艾德生物	25,000	538,250.00	0.15
175	600563	法拉电子	4,900	534,541.00	0.15
176	688506	百利天恒	1,800	533,016.00	0.15
177	605277	新亚电子	28,900	519,044.00	0.14
178	605090	九丰能源	20,000	516,200.00	0.14
179	688286	敏芯股份	7,300	516,037.00	0.14
180	300573	兴齐眼药	9,960	515,828.40	0.14
181	603566	普莱柯	37,800	514,458.00	0.14
182	002286	保龄宝	43,600	493,988.00	0.13
183	688270	臻镭科技	10,600	493,536.00	0.13
184	688591	泰凌微	10,200	488,580.00	0.13
185	301061	匠心家居	6,172	478,576.88	0.13
186	300788	中信出版	14,600	468,368.00	0.13
187	001267	汇绿生态	49,800	467,124.00	0.13
188	300320	海达股份	46,300	460,222.00	0.13
189	603596	伯特利	8,700	458,403.00	0.12
190	001339	智微智能	9,400	454,302.00	0.12
191	000862	银星能源	81,700	446,899.00	0.12
192	603326	我乐家居	53,700	444,636.00	0.12
193	603199	九华旅游	12,200	442,128.00	0.12
194	002661	克明食品	44,100	441,441.00	0.12
195	603520	司太立	44,900	440,020.00	0.12
196	600998	九州通	85,400	438,956.00	0.12
197	600268	国电南自	55,400	433,228.00	0.12

198	605118	力鼎光电	17,200	427,076.00	0.12
199	688029	南微医学	6,300	425,565.00	0.12
200	300637	扬帆新材	35,300	425,365.00	0.12
201	002299	圣农发展	29,600	422,984.00	0.12
202	002244	滨江集团	42,600	415,350.00	0.11
203	002595	豪迈科技	6,900	408,618.00	0.11
204	600030	中信证券	14,100	389,442.00	0.11
205	000100	TCL 科技	89,000	385,370.00	0.10
206	002475	立讯精密	11,100	385,059.00	0.10
207	000729	燕京啤酒	29,300	378,849.00	0.10
208	605296	神农集团	12,230	375,950.20	0.10
209	301183	东田微	7,300	373,979.00	0.10
210	600266	城建发展	81,600	370,464.00	0.10
211	603617	君禾股份	50,700	363,519.00	0.10
212	600299	安迪苏	37,500	361,875.00	0.10
213	688313	仕佳光子	9,300	353,865.00	0.10
214	603713	密尔克卫	6,600	351,912.00	0.10
215	300476	胜宏科技	2,500	335,950.00	0.09
216	601311	骆驼股份	37,100	335,013.00	0.09
217	301239	普瑞眼科	8,500	333,200.00	0.09
218	300019	硅宝科技	16,800	331,632.00	0.09
219	603816	顾家家居	12,900	329,208.00	0.09
220	688131	皓元医药	6,800	328,780.00	0.09
221	301498	乖宝宠物	3,000	328,110.00	0.09
222	605080	浙江自然	11,800	328,040.00	0.09
223	301367	瑞迈特	3,900	327,990.00	0.09
224	600578	京能电力	73,000	327,770.00	0.09
225	002344	海宁皮城	74,000	321,160.00	0.09
226	688277	天智航	23,000	319,700.00	0.09
227	600476	湘邮科技	16,900	319,072.00	0.09
228	688103	国力股份	5,200	316,368.00	0.09
229	002695	煌上煌	33,000	310,200.00	0.08
230	000819	岳阳兴长	19,600	306,740.00	0.08
231	301004	嘉益股份	4,620	305,982.60	0.08
232	300655	晶瑞电材	30,200	302,302.00	0.08
233	002747	埃斯顿	14,900	301,576.00	0.08
234	600758	辽宁能源	79,800	298,452.00	0.08
235	002046	国机精工	17,700	295,236.00	0.08
236	002138	顺络电子	10,400	292,448.00	0.08
237	002395	双象股份	16,500	292,050.00	0.08
238	600785	新华百货	24,300	285,039.00	0.08
239	603229	奥翔药业	32,000	279,040.00	0.08
240	688315	诺禾致源	19,700	278,164.00	0.08

241	000999	华润三九	8,770	274,325.60	0.07
242	002402	和而泰	11,800	273,406.00	0.07
243	600380	健康元	24,000	264,720.00	0.07
244	600050	中国联通	49,100	262,194.00	0.07
245	002170	芭田股份	25,100	257,275.00	0.07
246	002245	蔚蓝锂芯	19,900	255,317.00	0.07
247	603313	梦百合	29,900	254,150.00	0.07
248	688518	联赢激光	12,400	252,836.00	0.07
249	002463	沪电股份	5,900	251,222.00	0.07
250	002362	汉王科技	11,100	248,862.00	0.07
251	000659	珠海中富	83,700	247,752.00	0.07
252	688668	鼎通科技	3,955	247,029.30	0.07
253	002249	大洋电机	37,400	246,092.00	0.07
254	603586	金麒麟	13,400	245,488.00	0.07
255	002688	金河生物	39,500	245,295.00	0.07
256	688168	安博通	3,400	240,958.00	0.07
257	688372	伟测科技	3,900	235,560.00	0.06
258	300395	菲利华	4,500	229,950.00	0.06
259	600731	湖南海利	31,100	226,719.00	0.06
260	688661	和林微纳	5,700	226,689.00	0.06
261	603583	捷昌驱动	6,100	222,772.00	0.06
262	002483	润邦股份	35,600	222,500.00	0.06
263	002736	国信证券	19,300	222,336.00	0.06
264	603456	九洲药业	14,600	222,066.00	0.06
265	002562	兄弟科技	45,500	222,040.00	0.06
266	603079	圣达生物	11,800	202,370.00	0.06
267	688114	华大智造	3,000	194,490.00	0.05
268	603477	巨星农牧	9,400	193,452.00	0.05
269	003037	三和管桩	26,600	190,988.00	0.05
270	688486	龙迅股份	2,690	179,907.20	0.05
271	600867	通化东宝	21,900	179,580.00	0.05
272	002821	凯莱英	2,000	176,500.00	0.05
273	603219	富佳股份	12,100	175,571.00	0.05
274	605058	澳弘电子	5,700	174,192.00	0.05
275	603238	诺邦股份	9,800	171,892.00	0.05
276	300690	双一科技	7,000	169,470.00	0.05
277	600704	物产中大	31,900	168,113.00	0.05
278	000807	云铝股份	10,500	167,790.00	0.05
279	002825	纳尔股份	16,800	167,664.00	0.05
280	601777	千里科技	18,900	160,461.00	0.04
281	688173	希荻微	11,500	157,090.00	0.04
282	600012	皖通高速	9,100	154,518.00	0.04
283	300249	依米康	11,300	154,132.00	0.04

284	300181	佐力药业	8,800	152,504.00	0.04
285	002801	微光股份	4,700	152,139.00	0.04
286	603893	瑞芯微	1,000	151,860.00	0.04
287	300534	陇神戎发	15,600	150,696.00	0.04
288	688289	圣湘生物	7,300	149,504.00	0.04
289	688128	中国电研	6,000	147,000.00	0.04
290	603882	金域医学	5,100	145,656.00	0.04
291	603998	方盛制药	14,700	144,354.00	0.04
292	601216	君正集团	25,800	142,416.00	0.04
293	600729	重庆百货	4,600	137,218.00	0.04
294	688097	博众精工	4,900	136,759.00	0.04
295	600601	方正科技	25,500	136,170.00	0.04
296	300035	中科电气	8,000	135,040.00	0.04
297	300365	恒华科技	20,400	134,436.00	0.04
298	688155	先惠技术	2,600	134,212.00	0.04
299	688300	联瑞新材	2,883	134,203.65	0.04
300	688001	华兴源创	5,200	131,404.00	0.04
301	688739	成大生物	4,900	129,360.00	0.04
302	603278	大业股份	14,100	128,310.00	0.03
303	688381	帝奥微	5,900	127,794.00	0.03
304	688611	杭州柯林	3,900	127,257.00	0.03
305	001914	招商积余	10,200	126,174.00	0.03
306	603166	福达股份	8,000	123,760.00	0.03
307	603682	锦和商管	21,500	121,905.00	0.03
308	002282	博深股份	16,300	121,761.00	0.03
309	600055	万东医疗	7,000	120,960.00	0.03
310	688153	唯捷创芯	3,900	120,939.00	0.03
311	688280	精进电动	16,600	120,682.00	0.03
312	301363	美好医疗	6,780	119,599.20	0.03
313	002398	垒知集团	23,700	117,078.00	0.03
314	605286	同力日升	2,900	114,898.00	0.03
315	300231	银信科技	9,100	112,021.00	0.03
316	600628	新世界	15,000	109,800.00	0.03
317	603969	银龙股份	14,900	109,217.00	0.03
318	688180	君实生物	3,200	108,736.00	0.03
319	002468	申通快递	10,000	106,900.00	0.03
320	603296	华勤技术	1,300	104,884.00	0.03
321	688179	阿拉丁	8,240	104,812.80	0.03
322	688252	天德钰	4,200	102,396.00	0.03
323	300777	中简科技	2,800	101,500.00	0.03
324	603386	骏亚科技	8,000	101,200.00	0.03
325	688127	蓝特光学	3,900	100,269.00	0.03
326	300486	东杰智能	12,000	99,240.00	0.03

327	002396	星网锐捷	4,400	98,780.00	0.03
328	002706	良信股份	11,000	98,010.00	0.03
329	002895	川恒股份	4,300	97,008.00	0.03
330	300470	中密控股	2,600	95,602.00	0.03
331	000526	学大教育	2,000	95,500.00	0.03
332	002686	亿利达	13,800	89,838.00	0.02
333	601126	四方股份	5,500	89,485.00	0.02
334	688351	微电生理	4,500	88,650.00	0.02
335	002701	奥瑞金	14,700	87,465.00	0.02
336	301230	泓博医药	2,500	86,050.00	0.02
337	301060	兰卫医学	8,900	85,885.00	0.02
338	300939	秋田微	2,800	85,120.00	0.02
339	600968	海油发展	20,800	84,864.00	0.02
340	688138	清溢光电	3,100	84,289.00	0.02
341	600458	时代新材	6,100	83,692.00	0.02
342	600216	浙江医药	5,600	82,824.00	0.02
343	002772	众兴菌业	10,600	82,786.00	0.02
344	300770	新媒股份	2,000	79,980.00	0.02
345	688686	奥普特	800	76,496.00	0.02
346	600325	华发股份	15,600	75,972.00	0.02
347	002073	软控股份	8,500	75,565.00	0.02
348	300206	理邦仪器	6,200	74,524.00	0.02
349	002709	天赐材料	4,100	74,292.00	0.02
350	600662	外服控股	14,400	73,584.00	0.02
351	688117	圣诺生物	2,180	73,357.00	0.02
352	002262	恩华药业	3,500	72,730.00	0.02
353	002404	嘉欣丝绸	11,100	71,817.00	0.02
354	688052	纳芯微	400	69,796.00	0.02
355	003033	征和工业	1,600	67,824.00	0.02
356	301196	唯科科技	1,000	67,670.00	0.02
357	002909	集泰股份	10,600	66,144.00	0.02
358	603855	华荣股份	2,900	64,177.00	0.02
359	002346	柘中股份	4,600	62,560.00	0.02
360	301396	宏景科技	1,000	62,110.00	0.02
361	300647	超频三	9,200	59,524.00	0.02
362	600410	华胜天成	6,200	59,458.00	0.02
363	603138	海量数据	4,100	59,122.00	0.02
364	002675	东诚药业	4,000	57,560.00	0.02
365	688502	茂莱光学	200	57,532.00	0.02
366	603600	永艺股份	5,400	57,456.00	0.02
367	002815	崇达技术	5,000	56,650.00	0.02
368	002956	西麦食品	2,400	56,328.00	0.02
369	300245	天玑科技	2,900	56,173.00	0.02

370	000404	长虹华意	7,900	56,090.00	0.02
371	002782	可立克	4,100	53,218.00	0.01
372	300956	英力股份	2,900	47,038.00	0.01
373	301525	儒竞科技	600	46,338.00	0.01
374	603678	火炬电子	1,200	45,636.00	0.01
375	000031	大悦城	16,300	43,195.00	0.01
376	000521	长虹美菱	6,200	43,028.00	0.01
377	002563	森马服饰	8,100	42,606.00	0.01
378	000633	合金投资	6,900	42,435.00	0.01
379	601225	陕西煤业	2,200	42,328.00	0.01
380	300979	华利集团	800	42,056.00	0.01
381	002668	TCL 智家	4,300	42,011.00	0.01
382	002993	奥海科技	1,000	41,470.00	0.01
383	300967	晓鸣股份	2,200	40,700.00	0.01
384	002452	长高电新	5,800	40,310.00	0.01
385	688775	影石创新	309	38,365.44	0.01
386	002636	金安国纪	3,900	36,972.00	0.01
387	600517	国网英大	6,500	33,150.00	0.01
388	300715	凯伦股份	3,100	30,721.00	0.01
389	600478	科力远	4,900	30,625.00	0.01
390	600367	红星发展	1,900	29,811.00	0.01
391	600513	联环药业	2,800	28,084.00	0.01
392	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.01
393	688084	晶品特装	300	26,400.00	0.01
394	301127	武汉天源	1,500	25,635.00	0.01
395	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.01
396	300523	辰安科技	1,000	23,050.00	0.01
397	603103	横店影视	1,400	22,470.00	0.01
398	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.01
399	301101	明月镜片	400	19,580.00	0.01
400	600663	陆家嘴	2,200	19,492.00	0.01
401	002659	凯文教育	3,800	19,152.00	0.01
402	300702	天宇股份	800	18,608.00	0.01
403	002959	小熊电器	400	18,576.00	0.01
404	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
405	688627	精智达	200	17,602.00	0.00
406	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
407	688685	迈信林	300	16,755.00	0.00
408	002597	金禾实业	700	16,485.00	0.00
409	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
410	301501	恒鑫生活	349	15,781.78	0.00
411	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
412	600085	同仁堂	400	14,424.00	0.00

413	688522	纳睿雷达	280	14,341.60	0.00
414	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
415	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
416	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
417	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
418	003022	联泓新科	800	12,664.00	0.00
419	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
420	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
421	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
422	688023	安恒信息	200	11,348.00	0.00
423	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
424	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
425	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
426	688039	当虹科技	300	9,846.00	0.00
427	300492	华图山鼎	140	9,503.20	0.00
428	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
429	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
430	300420	五洋自控	2,300	7,912.00	0.00
431	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
432	603049	中策橡胶	181	7,755.85	0.00
433	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
434	002925	盈趣科技	400	7,192.00	0.00
435	600429	三元股份	1,500	6,765.00	0.00
436	603014	威高血净	199	6,503.32	0.00
437	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
438	603202	天有为	65	5,892.90	0.00
439	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
440	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
441	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
442	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
443	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
444	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
445	603628	清源股份	300	3,663.00	0.00
446	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
447	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
448	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
449	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
450	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
451	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
452	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
453	002953	日丰股份	200	2,076.00	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	605499	东鹏饮料	12,504,301.30	2.99
2	300750	宁德时代	10,782,011.00	2.58
3	601398	工商银行	9,873,326.00	2.36
4	600415	小商品城	9,178,976.00	2.20
5	300888	稳健医疗	9,060,671.69	2.17
6	688506	百利天恒	9,039,461.92	2.16
7	600276	恒瑞医药	9,036,165.40	2.16
8	300502	新易盛	8,920,904.16	2.13
9	688235	百济神州	8,868,029.56	2.12
10	002594	比亚迪	8,835,107.00	2.11
11	001207	联科科技	8,750,814.04	2.09
12	002714	牧原股份	8,225,485.00	1.97
13	600519	贵州茅台	8,037,081.00	1.92
14	600066	宇通客车	8,025,966.20	1.92
15	600585	海螺水泥	7,898,933.00	1.89
16	603259	药明康德	7,843,732.00	1.88
17	601668	中国建筑	7,722,057.00	1.85
18	601328	交通银行	7,702,053.00	1.84
19	000651	格力电器	7,686,120.00	1.84
20	601988	中国银行	7,663,880.00	1.83

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	300750	宁德时代	15,804,812.20	3.78
2	605499	东鹏饮料	13,634,068.30	3.26
3	000333	美的集团	10,094,566.00	2.42
4	002594	比亚迪	10,067,828.50	2.41
5	601088	中国神华	9,849,586.00	2.36
6	688256	寒武纪	9,718,286.47	2.33
7	600415	小商品城	9,576,126.00	2.29
8	601857	中国石油	9,322,929.00	2.23
9	600377	宁沪高速	9,026,318.00	2.16
10	688506	百利天恒	8,907,276.05	2.13
11	002714	牧原股份	8,804,936.00	2.11
12	601225	陕西煤业	8,291,362.00	1.98
13	600066	宇通客车	8,213,954.14	1.97
14	001207	联科科技	8,153,685.00	1.95

15	300502	新易盛	8,139,105.20	1.95
16	600519	贵州茅台	8,065,678.00	1.93
17	601919	中远海控	7,862,634.00	1.88
18	600276	恒瑞医药	7,826,415.76	1.87
19	601988	中国银行	7,763,588.00	1.86
20	601398	工商银行	7,718,178.00	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	1,623,306,248.27
卖出股票收入（成交）总额	1,707,169,412.95

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金将按照风险管理的原则，同时基于谨慎原则，以套期保值为主要目的，运用国债期货对基本投资组合进行管理，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，

通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	157,177.17
2	应收清算款	21,248.82
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	256,104.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	434,530.69

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数	户均持有 的基金份	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)	额	持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
万家元贞量化选 股股票 A	4, 572	54, 060. 95	6, 122, 198. 16	2. 48	241, 044, 443. 53	97. 52
万家元贞量化选 股股票 C	2, 144	57, 299. 43	2, 609, 890. 22	2. 12	120, 240, 079. 29	97. 88
合计	6, 648	55, 658. 34	8, 732, 088. 38	2. 36	361, 284, 522. 82	97. 64

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	万家元贞量化选股股票 A	521, 555. 13	0. 2110
	万家元贞量化选股股票 C	9, 552. 90	0. 0078
	合计	531, 108. 03	0. 1435

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	万家元贞量化选股股票 A	50~100
	万家元贞量化选股股票 C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有 本开放式基金	万家元贞量化选股股票 A	50~100
	万家元贞量化选股股票 C	0
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家元贞量化选股股票 A	万家元贞量化选股股票 C
基金合同生效日 （2023 年 3 月 14 日） 基金份额总额	975, 168, 554. 59	406, 676, 388. 46
本报告期期初基金份	306, 034, 141. 08	151, 811, 853. 79

额总额		
本报告期基金总申购份额	2, 773, 252. 61	6, 227, 277. 45
减：本报告期基金总赎回份额	61, 640, 752. 00	35, 189, 161. 73
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	247, 166, 641. 69	122, 849, 969. 51

§ 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

基金管理人：
报告期内, 本基金管理人无重大人事变动。

基金托管人：
2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。
2025 年 3 月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。
2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

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 (%)	
中泰证券	2	1,248,041,286.24	37.49	556,596.83	37.49	-
广发证券	1	551,496,752.19	16.57	245,917.82	16.57	-
银河证券	2	548,996,451.28	16.49	244,809.33	16.49	-
国盛证券	1	314,647,124.70	9.45	140,308.29	9.45	-
国泰海通证券	1	230,748,255.97	6.93	102,998.51	6.94	-
天风证券	1	228,657,918.03	6.87	101,966.55	6.87	-
华安证券	2	206,130,463.58	6.19	91,913.83	6.19	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	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，本基金减少长城证券交易单元 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	万家元贞量化选股股票型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	指定媒介	2025 年 1 月 21 日
2	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
3	万家元贞量化选股股票型证券投资基金 2024 年年度报告	指定媒介	2025 年 3 月 29 日
4	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
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 4 月 21 日
6	万家元贞量化选股股票型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	指定媒介	2025 年 4 月 21 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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《万家元贞量化选股股票型证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家元贞量化选股股票型证券投资基金托管协议》。
- 4、万家元贞量化选股股票型证券投资基金 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