万家国证新能源车电池指数型发起式证券 投资基金 2025 年第 3 季度报告

2025年9月30日

基金管理人: 万家基金管理有限公司

基金托管人: 恒丰银行股份有限公司

报告送出日期: 2025年10月25日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人恒丰银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2025 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2025年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家国证新能源车电池指数	少 与子			
	7 , ,				
基金主代码	018379				
基金运作方式	契约型开放式				
基金合同生效日	2023年4月27日				
报告期末基金份额总额	106, 569, 420. 73 份				
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟 化。	踪偏离度和跟踪误差的最小			
投资策略	1、股票投资策略; 2、存托凭证投资策略; 3、债券投资策略; 4、资产支持证券投资策略; 5、可转换债券与可交换债券投资策略; 6、参与股指期货交易策略; 7、参与国债期货交易策略; 8、股票期权投资策略; 9、参与融资与转融通证券出借业务策略; 10、其他。				
业绩比较基准	国证新能源车电池指数收益 (税后)×5%	率×95%+银行活期存款利率			
风险收益特征	论上高于混合型基金、债券型基金为指数型基金,主要采	本基金为股票型基金,其长期平均风险和预期收益率理 论上高于混合型基金。债券型基金和货币市场基金。 本 基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪国证新能 源车电池指数,其风险收益特征与标的指数所表征的市 场组合的风险收益特征相似			
基金管理人	万家基金管理有限公司	万家基金管理有限公司			
基金托管人	恒丰银行股份有限公司	恒丰银行股份有限公司			
下属分级基金的基金简称	万家国证新能源车电池指数 万家国证新能源车电池指发起式 A 发起式 C				
下属分级基金的交易代码	018379	018380			

报告期末下属分级基金的份额总额 28,596,337.46 份 77,973,083.27 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位: 人民币元

	报告期(2025年7月1	日-2025年9月30日)
主要财务指标	万家国证新能源车电池指数发起式	万家国证新能源车电池指数发起式
	A	С
1. 本期已实现收益	758, 425. 79	801, 117. 70
2. 本期利润	10, 746, 312. 40	18, 675, 293. 59
3. 加权平均基金份额本期利	0. 4693	0. 6418
润	0. 4093	0.0416
4. 期末基金资产净值	36, 632, 608. 70	99, 544, 058. 49
5. 期末基金份额净值	1. 2810	1. 2766

- 注: 1、上述基金业绩指标不包括持有人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。
- 2、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。

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

万家国证新能源车电池指数发起式 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标 准差②	业绩比较基准	业绩比较基准 收益率标准差 ④		2-4
过去三个月	52. 19%	1.69%	54. 37%	1.74%	-2.18%	-0.05%
过去六个月	53. 12%	1.81%	54. 30%	1.84%	-1.18%	-0.03%
过去一年	59. 07%	1.98%	61. 46%	2. 10%	-2.39%	-0.12%
自基金合同	28. 10%	1.86%	29. 83%	1.95%	-1.73%	-0.09%
生效起至今		1.00%	29.03%	1.95%	1.73%	0.09%

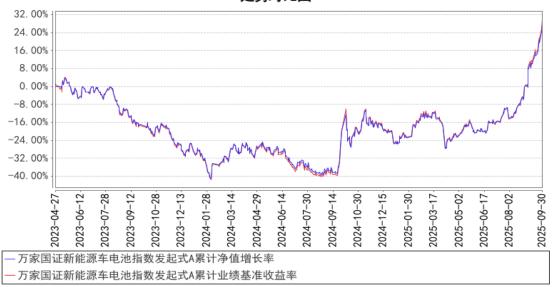
万家国证新能源车电池指数发起式C

		净值增长率标	业绩比较基准	业绩比较基准		
阶段	净值增长率①	准差②	收益率③	收益率标准差	1)-3	2-4

				4		
过去三个月	52. 12%	1.69%	54. 37%	1.74%	-2.25%	-0.05%
过去六个月	52. 96%	1.81%	54. 30%	1.84%	-1.34%	-0.03%
过去一年	58. 76%	1.98%	61.46%	2. 10%	-2.70%	-0.12%
自基金合同	27. 66%	1.86%	29. 83%	1.95%	9 170	0.000
生效起至今	27.00%	1.80%	29. 83%	1.95%	-2. 17%	-0. 09%

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

万家国证新能源车电池指数发起式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



万家国证新能源车电池指数发起式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



- 万家国证新能源车电池指数发起式C累计业绩基准收益率

注:本基金于 2023 年 4 月 27 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基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金	金经理期限	证券从业	说明
姓石	い 分	任职日期	离任日期	年限	<u> </u>
	万量混起投金周股起投金国源指起投金数股起投金沪成型指投发接万灵混券金家化合式资、期票式资、证车数式资、字票式资、深长开数资起基家活合投的元选型证基万视型证基万新电型证基万经型证基万3交放证基式金瑞配型资基晟股发券。家野发券。家能池发券。家济发券。家0易式券金联、盈置证基金	2025年7月23日		8.5年	国籍:中国;学历:复旦大学理论物理专业博士,2020年4月入职万家基金管理有限公司,现任量化投资部基金经理,历任量化投资部投资经理助理、投资经理。曾任通联数据股份公司金融工程部量化研究员,上海鹤骑鹰投资管理有限公司投资研究部量化研究员,东兴期货有限责任公司投资咨询部研究员等职。

	经理。			
	万家 180 指数基 投、万家 上证 50 交对式指数 证券投资			
贺方舟	证基家创成型指投金上板易式券全投、证50交放证基万科长开数资、证成型指投资,证成型指投资。	2024年6月3日	2025年7月 23日	国籍:中国;学历:复旦大学工商管理硕士,2022年6月入职万家基金管理有限公司,现任量化投资部基金经理,历任量化投资部基金经理助理。曾任汇添富基金管理股份有限公司基金营运部营运经理,大成基金管理有限公司指数与期货投资部研究员等职。
	智能主题 交易式指数 证券 太 证券 家 中证全			

业交放武券金 平面			
数证基金。证用是企业的	业交易型		
受基金中还用	开放式指		
万家指业产品	数证券投		
全指坐开数弦表 野型开数弦差 方半科题开数资 方半科题开数资 方半科题开数资 方半科题开数资 方半科题开数资 方半科题开数资 之中体格主型开数资 之中,还会是一种。 一种。 全型开数资、证是是一种。 一种。 是型开数资、证是是一种。 是型开数资、证据, 中的。 是型开数资、证据, 中的。 是型开数资、或养金、 中的。 是型开数资、或养金、 是型开数资、或养金、 中的。 是型开数资、或养金、 中的。 是型开数资、或养金、 中的。 是型开数资、或养金、 是型开数资、或养金、 是型开数资、或养金、 是型开数资。 是型开数资。 是型开数资。 是型开数资。 是型开数资。 是型开数资。 是型开数资。 是型开数资。 是型开数资。 是型开数资。 是型开数资。 是型开数资。 是型开数资。 是型开数资。 是型开数资。 是型开数资。 是型开数资。 是型开数资。 是型开数资。 是型开数资。 是型开数资。 是型开数资。 是型开数资。 是型开数资。 是型开数资。 是型开数资。 是型开数资。 是型开数资。 是型开数资。 是型开数。 是一种。 是型开数。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一种。 是一	资基金、		
事业开教资技、证材主型指投、证材主型指投、证相题开教资技、证色题开教资和工作。 一个体系。 一个体系。 一个体系。 一个体系。 一个体系。 一个体系。 一个体系。 一个体系。 一个体系。 一个体系。 一个体系。 一个体系。 一个体系。 一个有一种, 一个, 一个, 一个, 一个, 一个, 一个, 一个, 一个, 一个, 一个	万家中证		
事业开教资技、证材主型指投、证材主型指投、证相题开教资技、证色题开教资和工作。 一个体系。 一个体系。 一个体系。 一个体系。 一个体系。 一个体系。 一个体系。 一个体系。 一个体系。 一个体系。 一个体系。 一个体系。 一个体系。 一个有一种, 一个, 一个, 一个, 一个, 一个, 一个, 一个, 一个, 一个, 一个	全指公用		
型开放资金基家。中体对主型指数资产。证对主要的发展,实际,是是一个体对主型指数资产。证对主要的发展,对对对方的,是是一个体对主型指数。如此,是是一个体对主型指数资产。这个,是一个人,是一个人,是一个人,是一个人,是一个人,是一个人,是一个人,是一个			
指致诉基金 联接基金 下等导体体备型升数变数家中体各型升数变量。 中体全型升数变量。 中体全型升数变量。 中体全型升数变量。 市位题对放证基本。 中有全型升数变量。 中有全型升数变量。 中有全型升数变量。 中有全型升数变量。 中有全型升数变量。 中有全型升数变量。 中有全型升数或量量。 中有全型升数或量量。 中有全型升数或量量。 中有全型升数或量量。 中有全型升数或量量。 中有全型升数或量量。 中有全型升数或量量。 中有全型升数或量量。 中有全型升数或量量。 中有全型升数或量量。 中有全型升数或量。 中有全型升数或量。 中有全型升数或量。 中有全型升数或量。 中有全型升数或量。 中有全型升数或量。 中有全型升数或量。 中有全型升数或量。 中有全型升数或量。 中有全型升数或量。 中有全型升数或量。 中有全型升数或量。 中有全型升数或量。 中有全型升数或量。 中有全型升数或量。 中有全型升数或量。 中有全型升数或量。 中有全型升数或量。 中有全型升数或量。 中有全型升数或量。 中有全型升数或量。 中有全型升数或量。 中有全型升数或量。 中有全型升数或量。 中有全型升数或量。 中有全型升数或量。 中有全型升数或量。 中有全型升数或量。 于成型, 大数型, 大数型, 大数型, 大数型, 大数型, 大数型, 大数型, 大数型, 大数型, 大数数量。 大数数量。 大数数量。 大数数量。 大数数量。 大数数量。 大数数量。 大数数量。 大数数量。 大数数量。 大数数量。 大数数量。 大数数量。 大数数量。 大数数量。 大数数量。 大数数量。 大数数量。 大数数量。 大数数量。 大数数量。 大数数量。 大数数量。 大数数量。 大数数量。 大数数量。 大数数量。 大数数量。 大数数量。 大数数量。 大数数数量。 大数数量。 大数数量。 大数数数量。 大数数数量。 大数数数量。 大数数数量。 大数数数量。 大数数数量。 大数数数量。 大数数数量。 大数数数量。 大数数数量。 大数数数量。 大数数数量。 大数数数量。 大数数数量。 大数数数量。 大数数数量。 大数数数量。 大数数数量。 大数数数量。 大数数数数数量。 大数数数数数数数量。 大数数数数数数数数数数数数数数数数数数数数数数数数数数数数数数数数数数数数			
投资基金 联接基了。 中体科型现效 对于,是一个人工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工			
联接基 金、中证半导 体主型形效 体型型形数 基型形数 基型形数 基型形数 基型形数 基型形数 基型形数 基基 中一种色 题 更 放武 持数 、证工色 题 更 放武 持数 、证工色 题 更 放武 持数 、证工 是 题 更 数 是 数 是 数 是 数 是 数 是 数 是 数 是 数 是			
金、万家中体材料设备主题交放 式指投资家家中体对料型交易型开致证券金、万等中体有关型交换 对于证券金、万等中体各主型开致证券金、万等中体各主型开放证券,从市场上,从市场上,从市场上,从市场上,从市场上,从市场上,从市场上,从市场上			
中体体的大型性的大型性的大型性的大型性的大型性的大型性的大型性的大型性的大型性的大型性			
体材型			
备主型指数资本证券。 基型指数资本中体生型指数资本中体生型指数资本, 体生型指数资本。 体生型指数资本。 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有多数, 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有数。 一种有一种有。 一种有一种有一种一种一种一种一种一种一种一种一种一种一种一种一种一种一种一种一			
易型指投资基。 一种大型 经 发达基本的 一种大型 在 全时,一种大型 在 是一种大型 是一种大型 是一种一种一种一种一种一种一种一种一种一种一种一种一种一种一种一种一种一种一种			
式指数证 券投资基 金、近半导体对主型型型的			
券投资基金、			
金、万家中证半导体材料设备主题交易型开放式指数基金发起式联接基金、下工业有色题交易型开放式指数多基金易型开放证券投资、万工业有色题交对式指数多基金、正正金属主题开放证券投资基金。以正元属主题开放证券投资基金。发起式联接基金、发起式联接基金、发起式联接基金、发起式联接基金、发起式联接基金、			
中证半导体材料设备主题交易型开放式指数登基金发起式联接基金、证证金属主题对业有色整交放证券投资基本企业有色整交放证券投资基本。证金金易型开发证券投资基本。中有色变动式指数基金。一种有色变动式指数基金。			
体材料设备主题交易型数数基金 联系 立正金 交 放 证 基 多 次 起 基 金 下 正 金 交 放 证 基 多 元 工 金 经 发 无 不 正 在 色 交 放 证 基 万 工 金 全 交 放 证 基 万 工 金 全 交 放 证 基 有 是 题 对 放 证 寿 投 资 本 中 有 色 应 交 放 式 指 数 多 生 五 素 数 多 发 起 式 联 接 基 金 、 接 基 金 、 接 基 金 、			
备主题交易型开放 式指数证 券投基基金联接上面 金联接上面 金联方式工工。全型的工工。 有题对式, 指数资、证证参与 全型开放证券, 投资、下工业。 有色更交易, 工业。 有色更交易, 工业。 有色更交易, 工业。 有色更交易, 工业。 有色更交易, 型型数量。 中有色更交易, 工业。 有是更对,证券, 投资、工业。 有是更对,或 指数资。 工业。 有是更对,或 指数资。 发达,证券, 发达, 发达, 发达, 发达, 发达, 发达, 发达, 发达, 发达, 发达			
易型开放 式指数证 券投基 金发基 金、证接基 金、证证金属 主题开放证券 投资、为证证券 投资、为证证金 中,在色题交对式 指数资基。 中,在色题交对式 指数资基金 发起式联 投资基金 发起式联 接基金、			
式指数证 券投资基 金发基 金发基 家。证工 一有色题交放式 指数资基 金、证工 属 主型开数证基 分。不可 中有色题交放式 中有色题交流式 特投资基实 中有色题交流式 指数资基金 平均资基金 发起式 发起式 发起式 发起式 发起式 发起式 发起式 发起或 大量, 大量, 大量, 大量, 大量, 大量, 大量, 大量, 大量, 大量,			
券投资基 金发起式 联接基 金、万家 中证工本 有色应交易 型开放式 指数证券 投资、万下 中在色金属 主题交易 型开放式 指数。 中还金属 主题交易 型开放式 指数。 上述属 主题交易			
金发起式 联接基 金、万家 中证工业 有色金属 主题交易 型开放式 指数证券 投资基 金、万家 中证工业 有色金属 主题交易 型开放式 指数正为 投资基金 发起式联 接基金、			
联接基金、万家中证工业有色金属 主题交易 型开放证券 投资基金、下工业有色愈交易 型开业有色愈交 对 中 在 色 题 交 放 式 特 数 证 券 投资基金 发起式联接基金、			
金、万家中证工业有色金属主题交易型开放式指数基金、万工业有色金属主题交易。			
中证工业有色金属主题交易型开放式指数基金、下工业有色金属主题交易型开放式指数或式指数基金交易型开放式指数基金发起式联接基金、发起式联接基金、			
有色金属 主题交易 型开放式 指数证券 投资基 金、万家 中证工业 有色金属 主题交易 型开放式 指数证券 投资基金 发起式联 接基金、			
主题交易型开放式 指数证券 投资基金、万家 中证工业 有色金属 主题交易 型开放式 指数证券 投资基金 发起式联 接基金、			
型开放式 指数证券 投资基 金、万家 中证工业 有色金属 主题交易 型开放式 指数证券 投资基金 发起式联 接基金、			
指数证券 投资基 金、万家 中证工业 有色金属 主题交易 型开放式 指数证券 投资基金 发起式联 接基金、			
投资基金、万家中证工业 有色金属 主题交易 型开放式 指数证券 投资基金 发起式联 接基金、			
金、万家 中证工业 有色金属 主题交易 型开放式 指数证券 投资基金 发起式联 接基金、			
中证工业 有色金属 主题交易 型开放式 指数证券 投资基金 发起式联 接基金、			
有色金属 主题交易 型开放式 指数证券 投资基金 发起式联 接基金、	金、万家		
主题交易 型开放式 指数证券 投资基金 发起式联 接基金、	中证工业		
型开放式 指数证券 投资基金 发起式联 接基金、	有色金属		
指数证券 投资基金 发起式联 接基金、	主题交易		
投资基金 发起式联 接基金、	型开放式		
发起式联 接基金、	指数证券		
接基金、			
接基金、	发起式联		
万家中证			
	万家中证		
机器人交			

	Т			
易型开放				
式指数证				
券投资基				
金、万家				
中证港股				
通创新药				
交易型开				
放式指数				
证券投资				
基金、万				
家中证软				
件服务交				
易型开放				
式指数证				
为投资基 参投资基				
金、万家				
中证软件				
服务交易				
型开放式				
指数证券				
投资基金				
发起式联				
接基金、				
万家国证				
航天航空				
行业交易				
型开放式				
指数证券				
投资基				
金、万家				
沪深 300				
成长交易				
型开放式				
指数证券				
投资基				
金、万家				
深证 AAA				
科技创新				
公司债交				
易型开放				
式指数证				
券投资基				
金、万家				
沪深 300				
成长交易				
以人义勿				

型开放式			
指数证券			
投资基金			
发起式联			
接基金、			
万家国证			
新能源车			
电池指数			
型发起式			
证券投资			
基金的基			
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。

4.1.1 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 公平交易专项说明

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,执行交易系统中的公平交易程序;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易,原则上按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;对于银行间交易,按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。为保证公平交易原则的实现,通过制度规范、流程审批、系统风控参数设置等进行事前控制,通过对投资交易系统的实时监控进行事中控制,通过对异常交易的监控和分析实

现事后控制。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 0 次。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2025年三季度,A股市场呈现稳扎稳打、积极上涨的走势,整体表现比较积极,上证指数时隔多年再次站上3800点,在季度末收盘时接近3900点。在经历了年初市场快速下跌、4月初关税事件扰动冲击之后,政策积极托底和科技创新动能持续释放使得市场在后续的走势中呈现稳健积极的特点。三季度,在以人工智能AI、新能源等科技方向为代表的成长板块的带领下,市场情绪积极回暖,各大指数稳健上攻,最终上证指数、沪深300指数三季度分别上涨12.73%和17.90%。风格上,中大盘成长总体占优,沪深300成长指数累计上涨30.96%。展望未来,随着市场对中国科技产业投资逻辑的积极重塑、政策宽松持续、流动性持续改善,市场或延续稳扎稳打的行情,成长板块在此背景下更具弹性,需关注国内经济复苏力度,若盈利预期进一步修复,A股有望保持稳步上升动能。

本基金作为被动投资的指数基金,其投资目标是通过跟踪、复制国证新能源车电池指数,为 投资者获取市场长期的平均收益。报告期内我们严格按照基金合同规定,原则上采取完全复制的 方法进行投资管理,努力拟合标的指数,减小跟踪误差,将基金跟踪误差控制在较低范围之内, 导致跟踪误差的主要原因是基金申购赎回、标的指数成分股调整、成分股分红和基金费用等因素。 同时,本基金采用有效的量化跟踪技术,降低管理成本。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家国证新能源车电池指数发起式 A 的基金份额净值为 1. 2810 元,本报告期基金份额净值增长率为 52. 19%,同期业绩比较基准收益率为 54. 37%;截至本报告期末万家国证新能源车电池指数发起式 C 的基金份额净值为 1. 2766 元,本报告期基金份额净值增长率为 52. 12%,同期业绩比较基准收益率为 54. 37%。

基金报告期内 A 份额、C 份额日均跟踪偏离度分别为 0.0421%、0.0424%,年跟踪误差分别为 1.4010%、1.4037%,符合基金合同中日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%、年跟踪误差不超过 4%的规定。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金, 存续期未满三年, 不适用本项说明。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	122, 938, 851. 72	84. 45
	其中: 股票	122, 938, 851. 72	84. 45
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	9, 584, 070. 37	6. 58
8	其他资产	13, 060, 584. 80	8. 97
9	合计	145, 583, 506. 89	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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		_
В	采矿业		_
С	制造业	121, 012, 535. 72	88. 86
D	电力、热力、燃气及水生产和 供应业	_	_
Е	建筑业	_	-
F	批发和零售业	_	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
Н	住宿和餐饮业	`-	_
Ι	信息传输、软件和信息技术服 务业	_	_
J	金融业	1, 926, 316. 00	1.41
K	房地产业	-	_
L	租赁和商务服务业	-	_
M	科学研究和技术服务业		-
N	水利、环境和公共设施管理业	_	_
0	居民服务、修理和其他服务业		
Р	教育	_	_

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	_	_
S	综合	-	_
	合计	122, 938, 851. 72	90. 28

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资境内股票。

5.2.3 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	300750	宁德时代	45,000	18, 090, 000. 00	13. 28
2	002594	比亚迪	95, 200	10, 396, 792. 00	7. 63
3	300014	亿纬锂能	113,000	10, 283, 000. 00	7. 55
4	002050	三花智控	189, 100	9, 158, 113. 00	6. 73
5	603799	华友钴业	134, 433	8, 859, 134. 70	6. 51
6	300450	先导智能	98, 700	6, 141, 114. 00	4. 51
7	002460	赣锋锂业	100, 300	6, 106, 264. 00	4. 48
8	002074	国轩高科	96, 400	4, 499, 952. 00	3. 30
9	300207	欣旺达	122, 100	4, 125, 759. 00	3. 03
10	002709	天赐材料	107, 100	4, 088, 007. 00	3.00

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 报告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。

- 5.5 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债券投资明细本基金本报告期末未持有债券。
- 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

- 5.7 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。
- 5.8 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权证投资明细 本基金本报告期末未持有权证。
- 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
- 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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,在报告编制目前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	30, 606. 91
2	应收证券清算款	_
3	应收股利	_
4	应收利息	_
5	应收申购款	13, 029, 977. 89
6	其他应收款	_
7	其他	_
8	合计	13, 060, 584. 80

5.11.4 报告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。

- 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
- 5.11.5.1 报告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。
- 5.11.5.2 报告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未持有积极投资股票。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位: 份

项目	万家国证新能源车电池指 数发起式 A	万家国证新能源车电池指 数发起式 C
报告期期初基金份额总额	24, 326, 612. 43	19, 403, 862. 35
报告期期间基金总申购份额	19, 929, 200. 87	132, 601, 491. 98
减:报告期期间基金总赎回份额	15, 659, 475. 84	74, 032, 271. 06
报告期期间基金拆分变动份额(份额减		
少以"-"填列)		
报告期期末基金份额总额	28, 596, 337. 46	77, 973, 083. 27

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位: 份

项目	万家国证新能源车电池指 数发起式 A	万家国证新能源车电池指 数发起式 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10, 000, 000. 00	-
报告期期间买入/申购总份额	_	_
报告期期间卖出/赎回总份额	_	_
报告期期末管理人持有的本基金份额	10, 000, 000. 00	_
报告期期末持有的本基金份额占基金总 份额比例(%)	34. 97	_

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申赎及买卖本基金的情况。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金 总份额比例(%)	发起份额承诺持 有期限
基金管理人	10, 000, 000. 00	9.38	10, 000, 000. 00	9.38	自基金合同生效
固有资金					日起不少于3年
基金管理人	_	_	_	_	_
高级管理人					
员					
基金经理等	-	_	-	_	_
人员					
基金管理人	-	_	-	_	_
股东					
其他	_	_	_	_	_
合计	10, 000, 000. 00	9.38	10, 000, 000. 00	9. 38	自基金合同生效
					日起不少于3年

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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		报告期内持	报告期末持有基金情况				
资者类别	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	20250701-20250901	10, 000, 000. 00	_	_	10, 000, 000. 00	9. 38

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。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金托管协议》。
- 4、万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金 2025 年第3季度报告原文。
- 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。

10.2 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。

10.3 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10月25日