

万家创业板综合交易型开放式指数证券投资
基金
2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46

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	46
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	46
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	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末上市基金前十名持有人	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	49
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	万家创业板综合 ETF
场内简称	创业板综 ETF 万家
基金主代码	159541
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 10 月 18 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	190,593,326.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2023 年 10 月 31 日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-2,734,474.62
本期利润	-18,161,419.78
加权平均基金份额本期利润	-0.1132
本期加权平均净值利润率	-12.42%
本期基金份额净值增长率	-15.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-27,990,623.56
期末可供分配基金份额利润	-0.1469
期末基金资产净值	162,602,702.44
期末基金份额净值	0.8531
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-14.69%

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

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

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

3.2 基金净值表现

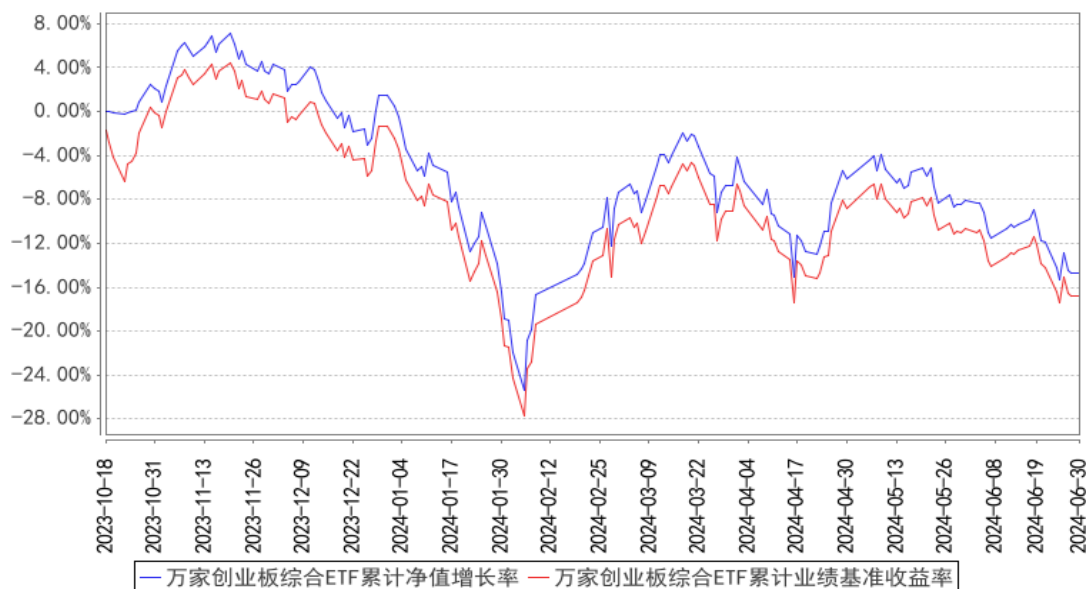
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去一个月	-7.13%	1.26%	-6.84%	1.25%	-0.29%	0.01%
过去三个月	-8.54%	1.57%	-8.50%	1.57%	-0.04%	0.00%
过去六个月	-15.90%	1.92%	-15.63%	1.94%	-0.27%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-14.69%	1.69%	-16.77%	1.74%	2.08%	-0.05%

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

万家创业板综合ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日期为 2023 年 10 月 18 日，基金合同生效未满一年。

2、根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44 号文批准设立。截至报告期末，公司的股东为中泰证券股份有限公司、山东省新动能基金管理有限公司，住所：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 楼（名义楼层 9 层），办公地点：上海市浦东新区浦电路 360 号 9 楼，注册资本 3 亿元人民币。截至报告期末，公司共管理一百五十二只开放式基金，分别为万家 180 指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利

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

月购一年滚动持有混合型证券投资基金、万家科创板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家创业板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家周期优势企业混合型证券投资基金、万家健康产业混合型证券投资基金、万家互联互通中国优势量化策略混合型证券投资基金、万家战略发展产业混合型证券投资基金、万家创业板指数增强型证券投资基金、万家陆家嘴金融城金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家内需增长一年持有期混合型证券投资基金、万家互联互通核心资产量化策略混合型证券投资基金、万家民瑞祥明 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家瑞泽回报一年持有期混合型证券投资基金、万家惠裕回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家悦兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金、万家稳鑫 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、万家全球成长一年持有期混合型证券投资基金(QDII)、万家沪港深蓝筹混合型证券投资基金、万家北交所慧选两年定期开放混合型证券投资基金、万家鼎鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家新机遇成长一年持有期混合型发起式证券投资基金、万家港股通精选混合型证券投资基金、万家景气驱动混合型证券投资基金、万家安恒纯债 3 个月持有期债券型发起式证券投资基金、万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫橙纯债债券型证券投资基金、万家聚优稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、万家新能源主题混合型发起式证券投资基金、万家中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、万家匠心致远一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫融纯债债券型证券投资基金、万家颐远均衡一年持有期混合型发起式证券投资基金、万家鑫耀纯债债券型证券投资基金、万家欣远混合型证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家惠利债券型证券投资基金、万家鑫怡债券型证券投资基金、万家优享平衡混合型发起式证券投资基金、万家洞见进取混合型发起式证券投资基金、万家沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、万家中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金、万家沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家元贞量化选股股票型证券投资基金、万家 CFETS0-3 年期政策性金融债指数证券投资基金、万家中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家先进制造混合型发起式证券投资基金、万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金、万家颐德一年持有期混合型证券投资基金、万家北证 50 成份指数型发起式证券投资基金、万家恒生互联网科技业指数型发起式证券投资基金(QDII)、万家中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家欣优混合型证券投资基金、万家集利债券型发起式证券投资基金、万家远见先锋一年持有期混合型证券投资基金、万家国证 2000 指数增强型证券投资基金、万家纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金(QDII)、万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金、万家稳安

60 天持有期债券型证券投资基金、万家周期驱动股票型发起式证券投资基金、万家优选积极三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、万家养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、万家红利量化选股混合型发起式证券投资基金、万家医药量化选股混合型发起式证券投资基金、万家锦利债券型发起式证券投资基金、万家高端装备量化选股混合型发起式证券投资基金、万家趋势领先混合型证券投资基金、万家稳航 90 天持有期债券型证券投资基金、万家中证红利交易型开放式指数证券投资基金、万家惠诚回报平衡一年持有期混合型证券投资基金、万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家国企动力混合型证券投资基金、万家 CFETS 0-3 年期山东省国有企业信用债精选指数发起式证券投资基金、万家稳丰 6 个月持有期债券型证券投资基金、万家研究领航混合型证券投资基金、万家中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨坤	万家 180 指数证券投资基金、万家上证 50 交易型开放式指数证券投资基金、万家中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金、万家中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家中证	2023 年 10 月 18 日	-	9.5 年	国籍：中国；学历：法国南特国立高等矿业学校自动化及工业信息技术专业硕士，2015 年 6 月入职万家基金管理有限公司，现任量化投资部基金经理，历任量化投资部研究员。曾任 Fractabole 量化 IT 工程师等职。

	红利交易 型开放式 指数证券 投资基金 基金、万 家中证红 利交易型 开放式指 数证券投 资基金联 接基金、 万家中证 软件服务 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 券投资基 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、 万家创业 板综合交 易型开放 式指数证 券投资基 金、万家 创业板综 合交易型 开放式指 数证券投资 基金发起 式联接基 金、万家 北证 50 成份指数 型发起式 证券投资 基金、万 家 国 证 2000 交 易型开放 式				
--	--	--	--	--	--

<p>指数证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金、万家恒生互联网科技业指数型发起式证券投资基金（QDII）、万家沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、万家沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金（QDII）的基金经理。</p>				
--	--	--	--	--

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 9 次，均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

2024 年上半年，A 股呈现震荡行情，基本面疲弱是制约市场上行的主因。1 月份，随着指数下挫，雪球、杠杆资金等资管产品平仓压力加剧，流动性负反馈愈演愈烈，沪指大幅下探、最低

触及 2635 点，微盘领跌。2 月 6 日，类平准基金发力托底、宏观基本面“开门红”等一系列催化共同助力，指数开始迎来反弹，沪指于 2 月下旬收复年初以来跌幅并向向上突破。行至二季度，宏观基本面的亮眼表现未能延续，指数表现受基本面影响。到了 4 月下旬，以房地产宽松为代表的稳增长政策预期驱动指数冲高，但具体政策落地后快速迎来兑现，反映市场对经济预期仍然保持谨慎，市场延续震荡。2024H1 本基金投资标的指数——创业板综合指数收益率为-15.63%。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家创业板综合 ETF 的基金份额净值为 0.8531 元，本报告期基金份额净值增长率为-15.90%，同期业绩比较基准收益率为-15.63%。基金报告期内日跟踪偏离度为 0.0887%，年化跟踪误差为 1.8715%，符合基金合同中日均跟踪偏离度低于 0.2%和年跟踪误差低于 2%的规定。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，对于拐点的讨论可能迈入新的阶段、指数震荡筑底后有望上行。当前基本面信心的扰动因素主要包括两方面，一是国内财政发力的政策力度，二是海外宽货币进程与国内跟进力度。上述因素后续均有望边际缓解，带动市场信心回暖。首先，近期 3000 亿大规模设备更新和消费品以旧换新政策落地，超长期特别国债的安排反映中央财政承担权重提升。其次，美联储 9 月降息仍是大概率，而近期央行宽货币频率和力度增加，跟进海外宽松态度相对确定。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

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

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不介入基金日常估值业务。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对万家基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 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：万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	2,874,586.03	2,112,497.44
结算备付金		203.88	133,147.41
存出保证金		1,806.79	68,185.76
交易性金融资产	6.4.7.2	159,862,276.10	116,853,007.79
其中：股票投资		159,862,276.10	116,853,007.79
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		-	47,815.29
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	75,409.12	-
资产总计		162,814,281.92	119,214,653.69
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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		10,791.34	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		70,536.89	37,611.10
应付托管费		14,107.37	7,522.23
应付销售服务费		-	-
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	116,143.88	386,543.02
负债合计		211,579.48	431,676.35
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	190,593,326.00	117,093,326.00
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	-27,990,623.56	1,689,651.34
净资产合计		162,602,702.44	118,782,977.34
负债和净资产总计		162,814,281.92	119,214,653.69

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8531 元，基金份额总额 190,593,326.00 份。

6.2 利润表

会计主体：万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-17,576,222.53
1. 利息收入		5,555.18
其中：存款利息收入	6.4.7.10	5,555.18
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）		-2,173,882.74
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-3,753,951.49
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.12	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	1,580,068.75
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	-15,426,945.16
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	19,050.19

减：二、营业总支出		585,197.25
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	363,181.26
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	72,636.23
3. 销售服务费		-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.20	149,379.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-18,161,419.78
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-18,161,419.78
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-18,161,419.78

注：本基金合同生效日为 2023 年 10 月 18 日，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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	117,093,326.00	-	1,689,651.34	118,782,977.34
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	117,093,326.00	-	1,689,651.34	118,782,977.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	73,500,000.00	-	-29,680,274.90	43,819,725.10
（一）、综合收益总额	-	-	-18,161,419.78	-18,161,419.78
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数	73,500,000.00	-	-11,518,855.12	61,981,144.88

(净资产减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	163,500,000.00	-	-18,719,491.46	144,780,508.54
2. 基金赎回款	-90,000,000.00	-	7,200,636.34	-82,799,363.66
(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	190,593,326.00	-	-27,990,623.56	162,602,702.44

注：本基金合同生效日为 2023 年 10 月 18 日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]1823号文《关于准予万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的核准,由万家基金管理有限公司作为基金管理人于2023年10月9日至2023年10月13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ZA31815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10月18日生效,本基金为交易型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币321,076,000.00元(现金部分),有效认购资金在基金验资确认日之前产生的利息为人民币17,326.00元,以上实收基金(本息)合计为人民币321,093,326.00元,折合321,093,326.00份基金份额。本基金目前暂不开通网下股票认购业务。本基金的基金管理人为万家基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公

司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 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

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规

定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

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

（三）企业所得税

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

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

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

（四）个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差

别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	2,874,586.03
等于：本金	2,874,319.10
加：应计利息	266.93
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	2,874,586.03

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	174,449,053.89	-	159,862,276.10	-14,586,777.79
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	174,449,053.89	-	159,862,276.10	-14,586,777.79

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,409.12
合计	75,409.12

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	11,553.00
其中：交易所市场	11,553.00

银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	104,590.88
合计	116,143.88

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	117,093,326.00	117,093,326.00
本期申购	163,500,000.00	163,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-90,000,000.00	-90,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	190,593,326.00	190,593,326.00

6.4.7.8 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,205,365.61	-7,515,714.27	1,689,651.34
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	9,205,365.61	-7,515,714.27	1,689,651.34
本期利润	-2,734,474.62	-15,426,945.16	-18,161,419.78
本期基金份额交易产生的变动数	4,350,923.19	-15,869,778.31	-11,518,855.12
其中：基金申购款	9,858,559.87	-28,578,051.33	-18,719,491.46
基金赎回款	-5,507,636.68	12,708,273.02	7,200,636.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,821,814.18	-38,812,437.74	-27,990,623.56

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
	活期存款利息收入
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	175.18
其他	391.19
合计	5,555.18

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-813,470.46
股票投资收益——赎回差价收入	-2,940,481.03
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	-3,753,951.49

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	8,402,974.10
减：卖出股票成本总额	9,192,276.45
减：交易费用	24,168.11
买卖股票差价收入	-813,470.46

6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	82,799,363.66
减：现金支付赎回款总额	684,351.66
减：赎回股票成本总额	85,055,493.03
减：交易费用	-
赎回差价收入	-2,940,481.03

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,580,068.75
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,580,068.75

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-15,426,945.16
股票投资	-15,426,945.16
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	-15,426,945.16

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	19,050.19
合计	19,050.19

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 2024年1月1日至2024年6月30日
----	----------------------------

审计费用	14,918.54
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	198.00
中登登记结算服务费	74,590.88
合计	149,379.76

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

2024 年 2 月 20 日，基金管理人万家基金管理有限公司控制的上海万家朴智投资管理有限公司已办理完成工商注销手续。

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
万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“万家创业板综合 ETF 发起式联接”）	本基金的联接基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。本基金合同生效日为 2023 年 10 月 18 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。本基金合同生效日为 2023 年 10 月 18 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。本基金合同生效日为 2023 年 10

月 18 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金合同生效日为 2023 年 10 月 18 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。本基金合同生效日为 2023 年 10 月 18 日，无上年度可比期间数据。

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
	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	363,181.26
其中：应支付销售机构的客户维护费	24,580.75
应支付基金管理人的净管理费	338,600.51

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

2、本基金合同生效日为 2023 年 10 月 18 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	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	72,636.23

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

2、本基金合同生效日为 2023 年 10 月 18 日，无上年度可比期间数据。

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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。本基金合同生效日为 2023 年 10 月 18 日，无上年度可比期间数据。

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

本基金本报告期末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。本基金合同生效日为 2023 年 10 月 18 日，无上年度可比期间数据。

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

本基金本报告期末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。本基金合同生效日为 2023 年 10 月 18 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期末未发生基金管理人运用自有资金投资本基金的情况。本基金合同生效日为 2023 年 10 月 18 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
万家创业板综合ETF发起式联接	73,200,000.00	38.4064	-	-

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 2024年1月1日至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	2,874,586.03	4,988.81

注：1、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。

2、本基金合同生效日为2023年10月18日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方所承销的证券。本基金合同生效日为2023年10月18日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期没有需作说明的其他关联交易事项。本基金合同生效日为2023年10月18日，无上年度可比期间数据。

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（2024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
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	44.95	65.93	113	5,079.35	7,450.09	-

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
300630	普利制药	2024年5月6日	重大事项停牌	12.35	2024年7月8日	9.88	18,800	364,552.51	232,180.00	-

		日							
--	--	---	--	--	--	--	--	--	--

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 2024 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 2024 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，建立了三道防线：以各岗位目标责任制为基础，形成第一道防线；通过相关部门、相关岗位之间相互监督制衡，形成第二道防线；由监察稽核部门、督察长对各岗位、各部门、各机构、各项业务实施监督反馈，形成第三道防线。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，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 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。(2023 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（2024 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 2024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	2,874,586.03	-	-	-	-	-	2,874,586.03
结算备付金	203.88	-	-	-	-	-	203.88
存出保证金	1,806.79	-	-	-	-	-	1,806.79
交易性金融资产	-	-	-	-	-	159,862,276.10	159,862,276.10
其他资产	-	-	-	-	-	75,409.12	75,409.12
资产总计	2,876,596.70	-	-	-	-	159,937,685.22	162,814,281.92
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	70,536.89	70,536.89
应付托管费	-	-	-	-	-	14,107.37	14,107.37
应付清算款	-	-	-	-	-	10,791.34	10,791.34
其他负债	-	-	-	-	-	116,143.88	116,143.88
负债总计	-	-	-	-	-	211,579.48	211,579.48
利率敏感度缺口	2,876,596.70	-	-	-	-	-159,726,105.74	162,602,702.44
上年度末 2023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	2,112,497.44	-	-	-	-	-	2,112,497.44
结算备付金	133,147.41	-	-	-	-	-	133,147.41
存出保证金	68,185.76	-	-	-	-	-	68,185.76
交易性金融资产	-	-	-	-	-	116,853,007.79	116,853,007.79
应收清算款	-	-	-	-	-	47,815.29	47,815.29
资产总计	2,313,830.61	-	-	-	-	116,900,823.08	119,214,653.69
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	37,611.10	37,611.10
应付托管费	-	-	-	-	-	7,522.23	7,522.23
其他负债	-	-	-	-	-	386,543.02	386,543.02
负债总计	-	-	-	-	-	431,676.35	431,676.35
利率敏感度缺口	2,313,830.61	-	-	-	-	-116,469,146.73	118,782,977.34

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2024年6月30日，本基金未持有交易性债券投资（2023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（2023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 2024年6月30日		上年度末 2023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	159,862,276.10	98.31	116,853,007.79	98.38
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	159,862,276.10	98.31	116,853,007.79	98.38

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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	股票基准指数上升100个基点	1,627,917.52	1,188,622.04
	股票基准指数下降100个基点	-1,627,917.52	-1,188,622.04

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	159,622,646.01	116,853,007.79
第二层次	232,180.00	-
第三层次	7,450.09	-
合计	159,862,276.10	116,853,007.79

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	159,862,276.10	98.19
	其中：股票	159,862,276.10	98.19
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	2,874,789.91	1.77
8	其他各项资产	77,215.91	0.05
9	合计	162,814,281.92	100.00

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

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	4,067,580.00	2.50
B	采矿业	232,806.00	0.14
C	制造业	120,278,935.02	73.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	295,767.00	0.18
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,873,809.00	1.15
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	16,161,223.45	9.94
J	金融业	4,092,971.00	2.52
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	803,251.00	0.49
M	科学研究和技术服务业	4,987,804.00	3.07

N	水利、环境和公共设施管理业	2,104,999.00	1.29
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,809,096.00	1.11
R	文化、体育和娱乐业	3,146,584.54	1.94
S	综合	-	-
	合计	159,854,826.01	98.31

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	7,450.09	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,450.09	0.00

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	90,098	16,220,342.94	9.98
2	300760	迈瑞医疗	27,800	8,087,298.00	4.97
3	300308	中际旭创	24,620	3,394,605.60	2.09
4	300059	东方财富	284,800	3,007,488.00	1.85
5	300124	汇川技术	49,800	2,554,740.00	1.57
6	300274	阳光电源	36,900	2,288,907.00	1.41
7	300498	温氏股份	115,300	2,285,246.00	1.41
8	300502	新易盛	17,600	1,857,680.00	1.14
9	300433	蓝思科技	101,500	1,852,375.00	1.14
10	300210	森远股份	216,600	1,834,602.00	1.13
11	300015	爱尔眼科	175,300	1,809,096.00	1.11
12	300014	亿纬锂能	43,400	1,732,528.00	1.07
13	300394	天孚通信	13,820	1,221,964.40	0.75
14	300832	新产业	17,400	1,173,456.00	0.72
15	300408	三环集团	38,500	1,123,815.00	0.69
16	300321	同大股份	59,900	1,115,937.00	0.69
17	300661	圣邦股份	12,100	1,001,638.00	0.62
18	300719	安达维尔	56,600	959,370.00	0.59
19	300717	华信新材	53,400	917,946.00	0.56
20	300765	新诺威	36,160	912,316.80	0.56
21	300418	昆仑万维	28,200	909,168.00	0.56
22	300122	智飞生物	32,200	902,566.00	0.56
23	300316	晶盛机电	29,100	836,043.00	0.51
24	300843	胜蓝股份	30,400	817,152.00	0.50
25	300100	双林股份	75,800	816,366.00	0.50
26	300782	卓胜微	10,500	816,270.00	0.50
27	300896	爱美客	4,620	795,102.00	0.49
28	300181	佐力药业	51,600	780,192.00	0.48
29	300281	金明精机	169,300	763,543.00	0.47
30	300207	欣旺达	49,900	756,983.00	0.47
31	300373	扬杰科技	19,300	750,770.00	0.46
32	300739	明阳电路	52,500	742,875.00	0.46
33	300628	亿联网络	19,900	731,723.00	0.45
34	300775	三角防务	23,900	731,340.00	0.45
35	300441	鲍斯股份	122,600	727,018.00	0.45
36	300626	华瑞股份	95,800	717,542.00	0.44
37	300751	迈为股份	6,000	716,880.00	0.44
38	300173	福能东方	189,900	715,923.00	0.44
39	300761	立华股份	31,500	713,160.00	0.44

40	300347	泰格医药	14,500	704,700.00	0.43
41	301105	鸿铭股份	27,871	696,496.29	0.43
42	300001	特锐德	34,600	696,152.00	0.43
43	300573	兴齐眼药	4,240	695,360.00	0.43
44	300114	中航电测	15,200	687,800.00	0.42
45	301236	软通动力	19,500	686,595.00	0.42
46	300450	先导智能	41,100	683,493.00	0.42
47	300033	同花顺	6,500	674,050.00	0.41
48	300251	光线传媒	79,500	668,595.00	0.41
49	300701	森霸传感	79,200	666,072.00	0.41
50	300811	铂科新材	15,100	662,890.00	0.41
51	300388	节能国祯	119,300	660,922.00	0.41
52	300017	网宿科技	83,100	656,490.00	0.40
53	300241	瑞丰光电	160,100	656,410.00	0.40
54	300073	当升科技	19,100	655,321.00	0.40
55	300759	康龙化成	35,000	650,300.00	0.40
56	300492	华图山鼎	6,900	649,980.00	0.40
57	300852	四会富仕	22,020	641,222.40	0.39
58	300699	光威复材	25,601	635,672.83	0.39
59	300046	台基股份	40,200	635,160.00	0.39
60	300003	乐普医疗	42,700	633,668.00	0.39
61	300223	北京君正	11,400	632,016.00	0.39
62	300383	光环新网	74,600	630,370.00	0.39
63	300652	雷迪克	31,400	622,662.00	0.38
64	300757	罗博特科	7,100	620,185.00	0.38
65	300596	利安隆	22,800	618,564.00	0.38
66	300318	博晖创新	126,700	618,296.00	0.38
67	300470	中密控股	18,200	615,342.00	0.38
68	300136	信维通信	31,400	614,812.00	0.38
69	300535	达威股份	51,600	608,880.00	0.37
70	300131	英唐智控	136,500	607,425.00	0.37
71	300664	鹏鹞环保	133,700	594,965.00	0.37
72	300474	景嘉微	9,400	594,362.00	0.37
73	300133	华策影视	96,200	590,668.00	0.36
74	300126	锐奇股份	130,000	588,900.00	0.36
75	300679	电连技术	14,500	583,335.00	0.36
76	300352	北信源	151,800	582,912.00	0.36
77	300298	三诺生物	22,500	570,150.00	0.35
78	300364	中文在线	26,313	567,834.54	0.35
79	300866	安克创新	7,970	567,543.70	0.35
80	300618	寒锐钴业	21,300	563,385.00	0.35
81	300144	宋城演艺	70,000	562,100.00	0.35
82	300819	聚杰微纤	48,500	561,145.00	0.35

83	300346	南大光电	19,600	560,364.00	0.34
84	300115	长盈精密	46,400	556,336.00	0.34
85	300054	鼎龙股份	24,200	548,856.00	0.34
86	300141	和顺电气	66,400	545,144.00	0.34
87	300395	菲利华	17,700	544,275.00	0.33
88	300357	我武生物	26,900	543,918.00	0.33
89	300024	机器人	54,800	533,752.00	0.33
90	300929	华骐环保	72,600	531,432.00	0.33
91	300748	金力永磁	40,840	529,286.40	0.33
92	300493	润欣科技	64,700	523,423.00	0.32
93	300883	龙利得	122,600	518,598.00	0.32
94	300413	芒果超媒	24,700	516,230.00	0.32
95	300303	聚飞光电	106,000	515,160.00	0.32
96	300455	航天智装	41,600	514,176.00	0.32
97	300154	瑞凌股份	96,200	512,746.00	0.32
98	300142	沃森生物	44,700	508,686.00	0.31
99	300770	新媒股份	15,200	507,376.00	0.31
100	300685	艾德生物	28,700	506,268.00	0.31
101	300236	上海新阳	16,200	504,468.00	0.31
102	300821	东岳硅材	73,500	502,740.00	0.31
103	300608	思特奇	55,500	498,390.00	0.31
104	300034	钢研高纳	31,300	497,357.00	0.31
105	300640	德艺文创	125,500	494,470.00	0.30
106	300531	优博讯	47,300	492,866.00	0.30
107	300326	凯利泰	128,300	487,540.00	0.30
108	300416	苏试试验	37,800	486,108.00	0.30
109	300724	捷佳伟创	9,000	486,090.00	0.30
110	300735	光弘科技	22,500	486,000.00	0.30
111	300002	神州泰岳	59,700	484,764.00	0.30
112	300233	金城医药	32,400	483,408.00	0.30
113	300488	恒锋工具	23,400	476,190.00	0.29
114	300390	天华新能	27,600	474,168.00	0.29
115	300458	全志科技	20,100	472,551.00	0.29
116	300327	中颖电子	24,000	472,320.00	0.29
117	301269	华大九天	6,100	470,005.00	0.29
118	300527	中船应急	71,900	465,193.00	0.29
119	300642	透景生命	39,800	463,272.00	0.28
120	300496	中科创达	10,000	455,900.00	0.28
121	300676	华大基因	13,000	455,130.00	0.28
122	301356	天振股份	35,140	454,711.60	0.28
123	300856	科思股份	14,200	454,542.00	0.28
124	300219	鸿利智汇	80,800	451,672.00	0.28
125	300012	华测检测	44,800	450,688.00	0.28

126	300762	上海瀚讯	25,060	448,824.60	0.28
127	300037	新宙邦	15,400	439,824.00	0.27
128	300568	星源材质	53,600	439,520.00	0.27
129	300285	国瓷材料	24,500	437,325.00	0.27
130	301335	天元宠物	27,500	436,975.00	0.27
131	300966	共同药业	26,700	436,278.00	0.27
132	301091	深城交	16,000	434,240.00	0.27
133	300604	长川科技	15,970	433,904.90	0.27
134	300763	锦浪科技	10,400	433,056.00	0.27
135	300049	福瑞股份	8,600	432,924.00	0.27
136	300339	润和软件	20,900	432,003.00	0.27
137	300083	创世纪	70,000	429,100.00	0.26
138	300671	富满微	16,600	421,972.00	0.26
139	300777	中简科技	19,400	417,100.00	0.26
140	300633	开立医疗	10,500	415,590.00	0.26
141	300317	珈伟新能	109,400	412,438.00	0.25
142	300396	迪瑞医疗	20,300	412,293.00	0.25
143	300803	指南针	11,300	411,433.00	0.25
144	300475	香农芯创	13,900	411,023.00	0.25
145	300036	超图软件	29,300	409,028.00	0.25
146	300666	江丰电子	8,600	409,016.00	0.25
147	300376	ST 易事特	101,500	407,015.00	0.25
148	301390	经纬股份	12,200	404,308.00	0.25
149	300601	康泰生物	25,700	401,177.00	0.25
150	300674	宇信科技	36,000	398,880.00	0.25
151	300087	荃银高科	63,900	394,902.00	0.24
152	300487	蓝晓科技	9,400	392,544.00	0.24
153	300613	富瀚微	11,900	391,629.00	0.24
154	300672	国科微	7,300	385,732.00	0.24
155	300841	康华生物	7,600	384,864.00	0.24
156	301378	通达海	17,660	383,222.00	0.24
157	300026	红日药业	125,600	383,080.00	0.24
158	300428	立中集团	20,600	382,954.00	0.24
159	300286	安科瑞	17,600	380,864.00	0.23
160	300558	贝达药业	11,700	380,835.00	0.23
161	300182	捷成股份	102,500	380,275.00	0.23
162	300747	锐科激光	21,400	379,850.00	0.23
163	300457	赢合科技	21,300	379,779.00	0.23
164	300058	蓝色光标	69,800	379,712.00	0.23
165	300006	莱美药业	162,099	379,311.66	0.23
166	300454	深信服	7,500	378,975.00	0.23
167	301308	江波龙	4,000	378,960.00	0.23
168	300788	中信出版	15,200	377,112.00	0.23

169	300315	掌趣科技	89,400	372,798.00	0.23
170	300229	拓尔思	27,500	369,325.00	0.23
171	300171	东富龙	31,000	368,590.00	0.23
172	300741	华宝股份	23,900	364,236.00	0.22
173	300118	东方日升	30,100	364,210.00	0.22
174	300967	晓鸣股份	40,100	363,707.00	0.22
175	300910	瑞丰新材	8,300	362,876.00	0.22
176	300878	维康药业	24,500	356,230.00	0.22
177	300580	贝斯特	24,038	353,358.60	0.22
178	300579	数字认证	17,900	349,050.00	0.21
179	300723	一品红	17,500	343,875.00	0.21
180	300005	探路者	68,500	343,185.00	0.21
181	300660	江苏雷利	13,400	341,968.00	0.21
182	300253	卫宁健康	57,900	341,610.00	0.21
183	300101	振芯科技	23,000	339,710.00	0.21
184	300567	精测电子	6,000	339,060.00	0.21
185	300456	赛微电子	21,200	336,444.00	0.21
186	300827	上能电气	15,000	335,400.00	0.21
187	300587	天铁股份	82,700	334,108.00	0.21
188	300459	汤姆猫	98,300	333,237.00	0.20
189	300755	华致酒行	24,300	331,938.00	0.20
190	300170	汉得信息	54,000	331,560.00	0.20
191	300188	国投智能	29,700	329,967.00	0.20
192	300382	斯莱克	55,300	326,823.00	0.20
193	300773	拉卡拉	26,200	325,666.00	0.20
194	300957	贝泰妮	6,700	323,744.00	0.20
195	300624	万兴科技	6,095	323,461.65	0.20
196	300620	光库科技	8,700	319,986.00	0.20
197	300355	蒙草生态	144,400	317,680.00	0.20
198	300053	航宇微	34,500	314,295.00	0.19
199	300595	欧普康视	20,000	313,600.00	0.19
200	300079	数码视讯	77,200	313,432.00	0.19
201	300189	神农种业	173,500	310,565.00	0.19
202	300068	南都电源	37,200	308,016.00	0.19
203	300725	药石科技	11,500	307,855.00	0.19
204	300432	富临精工	47,750	307,510.00	0.19
205	300212	易华录	18,200	306,306.00	0.19
206	300598	诚迈科技	10,760	302,140.80	0.19
207	300693	盛弘股份	14,300	299,442.00	0.18
208	300657	弘信电子	19,900	298,898.00	0.18
209	300075	数字政通	20,200	297,950.00	0.18
210	300634	彩讯股份	17,700	297,891.00	0.18
211	300332	天壕能源	55,700	295,767.00	0.18

212	300776	帝尔激光	6,400	294,144.00	0.18
213	300655	晶瑞电材	40,700	293,040.00	0.18
214	300682	朗新集团	34,400	292,744.00	0.18
215	300678	中科信息	11,000	291,720.00	0.18
216	300369	绿盟科技	56,400	288,204.00	0.18
217	300438	鹏辉能源	15,400	282,436.00	0.17
218	300490	华自科技	39,200	280,672.00	0.17
219	300570	太辰光	8,400	274,344.00	0.17
219	300593	新雷能	27,600	274,344.00	0.17
220	300766	每日互动	27,300	269,997.00	0.17
221	300130	新国都	16,200	269,568.00	0.17
222	300700	岱勒新材	34,100	265,298.00	0.16
223	300203	聚光科技	26,000	262,340.00	0.16
224	300378	鼎捷软件	16,000	260,320.00	0.16
225	300687	赛意信息	18,600	258,912.00	0.16
226	300045	华力创通	14,600	257,690.00	0.16
227	300166	东方国信	42,000	257,040.00	0.16
228	300199	翰宇药业	23,658	256,689.30	0.16
229	300363	博腾股份	21,400	255,730.00	0.16
230	300393	中来股份	43,100	248,687.00	0.15
231	300168	万达信息	52,300	248,425.00	0.15
232	301349	信德新材	8,900	245,996.00	0.15
233	300260	新莱应材	11,600	242,904.00	0.15
234	300261	雅本化学	45,400	240,620.00	0.15
235	300483	首华燃气	32,200	232,806.00	0.14
236	300630	普利制药	18,800	232,180.00	0.14
237	300149	睿智医药	56,700	224,532.00	0.14
238	300226	上海钢联	13,100	221,914.00	0.14
239	300134	大富科技	32,500	221,650.00	0.14
240	300825	阿尔特	22,700	219,963.00	0.14
241	300769	德方纳米	7,800	219,960.00	0.14
242	300258	精锻科技	26,800	217,884.00	0.13
243	300548	博创科技	10,900	212,441.00	0.13
244	300161	华中数控	9,400	211,406.00	0.13
245	300341	麦克奥迪	23,600	202,488.00	0.12
246	300662	科锐国际	12,500	201,625.00	0.12
247	301205	联特科技	3,200	200,800.00	0.12
248	300366	创意信息	22,000	159,280.00	0.10
249	300322	硕贝德	17,300	144,974.00	0.09

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	301580	爱迪特	113	7,450.09	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	300308	中际旭创	587,519.00	0.49
2	300896	爱美客	564,150.80	0.47
3	300760	迈瑞医疗	536,011.00	0.45
4	300750	宁德时代	464,611.00	0.39
5	301091	深城交	428,187.60	0.36
6	300719	安达维尔	416,841.00	0.35
7	301390	经纬股份	410,738.00	0.35
8	301378	通达海	388,623.00	0.33
9	300573	兴齐眼药	380,623.00	0.32
10	300757	罗博特科	375,436.60	0.32
11	300866	安克创新	339,644.00	0.29
12	300700	岱勒新材	306,271.00	0.26
13	300502	新易盛	267,346.00	0.23
14	300567	精测电子	233,173.00	0.20
15	300832	新产业	230,984.00	0.19
16	300624	万兴科技	219,225.00	0.18
17	301308	江波龙	215,184.00	0.18
18	300751	迈为股份	205,904.00	0.17
19	300765	新诺威	201,536.00	0.17
20	301205	联特科技	157,023.00	0.13

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	300033	同花顺	445,883.00	0.38
2	300237	美晨生态	422,009.00	0.36
3	300311	任子行	379,094.00	0.32
4	300197	节能铁汉	377,349.00	0.32
5	300492	华图山鼎	327,299.00	0.28
6	300751	迈为股份	310,536.00	0.26
7	300091	金通灵	289,851.00	0.24
8	300856	科思股份	275,419.00	0.23
9	300394	天孚通信	254,544.00	0.21
10	300776	帝尔激光	186,194.00	0.16
11	301269	华大九天	185,355.00	0.16
12	300957	贝泰妮	184,218.00	0.16

13	300672	国科微	181,244.00	0.15
14	301236	软通动力	161,209.00	0.14
15	300454	深信服	160,056.00	0.13
16	300841	康华生物	156,050.00	0.13
17	300724	捷佳伟创	137,586.00	0.12
18	300474	景嘉微	137,481.00	0.12
19	300122	智飞生物	123,670.00	0.10
20	300666	江丰电子	114,264.00	0.10

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	11,416,069.95
卖出股票收入（成交）总额	8,402,974.10

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,806.79
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,409.12
8	其他	-
9	合计	77,215.91

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公	占基金资产净	流通受限情况说
----	------	------	----------	--------	---------

			允价值	值比例 (%)	明
1	301580	爱迪特	7,450.09	0.00	新股流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		万家创业板综合 ETF 发起式联接	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
660	288,777.77	103,439,709.00	54.27	13,953,617.00	7.32	73,200,000.00	38.41

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	招商信诺人寿保险有限公司—传统	15,667,600.00	8.22
2	华泰证券股份有限公司	15,298,489.00	8.03
3	招商证券股份有限公司	14,874,750.00	7.80
4	陆家嘴国泰人寿保险有限责任公司—传统保险产品	10,000,000.00	5.25
5	海通证券股份有限公司	9,127,401.00	4.79
6	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—个险分红	6,396,300.00	3.36
7	国泰君安证券股份有限公司	4,783,600.00	2.51
8	中国银河证券股份有限公司	4,645,100.00	2.44
9	中信建投证券股份有限公司	4,184,498.00	2.20

10	方正证券股份有限公司	3,847,833.00	2.02
11	中国工商银行股份有限公司—万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	73,200,000.00	38.41

注：上述持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023年10月18日） 基金份额总额	321,093,326.00
本报告期期初基金份额总额	117,093,326.00
本报告期基金总申购份额	163,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	90,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	190,593,326.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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 (%)	
开源证券	1	10,241,617.50	51.81	9,687.38	51.81	-
国信证券	2	9,527,037.60	48.19	9,011.68	48.19	-
财通证券	3	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	3	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 财务状况良好，经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的金融服务能力和水平。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

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

3、基金专用交易席位的变更情况：

本报告期内，本基金新增广发证券交易单元 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	关于万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	指定媒介	2024 年 1 月 2 日
2	关于万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	指定媒介	2024 年 1 月 12 日
3	万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	指定媒介	2024 年 1 月 19 日
4	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	2024 年 1 月 19 日
5	关于万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	指定媒介	2024 年 1 月 26 日
6	关于万家基金管理有限公司指定证券投资基金主流流动性服务商的公告	指定媒介	2024 年 1 月 29 日
7	万家基金管理有限公司关于万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金增加西南证券为申购赎回代办券商的公告	指定媒介	2024 年 3 月 14 日
8	万家基金管理有限公司关于万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金增加渤海证券为申购赎回代办券商	指定媒介	2024 年 3 月 18 日

	的公告		
9	万家基金管理有限公司关于万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金增加浙商证券为申购赎回代办券商的公告	指定媒介	2024年3月18日
10	万家基金管理有限公司关于万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金增加长江证券为申购赎回代办券商的公告	指定媒介	2024年3月21日
11	关于万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	指定媒介	2024年3月26日
12	万家基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	指定媒介	2024年3月29日
13	万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金 2023 年年度报告	指定媒介	2024年3月29日
14	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	2024年4月19日
15	万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	指定媒介	2024年4月19日
16	万家基金管理有限公司关于万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金增加申万宏源证券及申万宏源西部证券为申购赎回代办券商的公告	指定媒介	2024年6月19日
17	万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要(更新)	指定媒介	2024年6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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
联接基金	1	20240418-20240630	-	95,700,000.00	22,500,000.00	73,200,000.00	38.41

产品特有风险

报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

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

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金托管协议》。
- 4、万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金 2024 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

2024 年 8 月 30 日