

万家中证 500 指数增强型发起式证券投资  
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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
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	14
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	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	57

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 .....	57
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 .....	57
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 .....	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	57
7.12 投资组合报告附注 .....	57
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>58</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	58
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 .....	59
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	59
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>59</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>60</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	60
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 .....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	60
10.4 基金投资策略的改变 .....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	60
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 .....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	60
10.8 其他重大事件 .....	62
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>63</b>
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 .....	63
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>63</b>
12.1 备查文件目录 .....	63
12.2 存放地点 .....	63
12.3 查阅方式 .....	63

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	万家中证 500 指数增强发起式	
基金主代码	006729	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 5 月 23 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,279,962,741.72 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	万家中证 500 指数增强发起式 A	万家中证 500 指数增强发起式 C
下属分级基金的交易代码	006729	006730
报告期末下属分级基金的份额总额	729,569,982.68 份	550,392,759.04 份

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

电子邮箱	lanj@wjasset.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	4008880800	95588
传真	021-38909627	010-66105798
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区浦 电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	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	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.wjasset.com">http://www.wjasset.com</a>
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	万家基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区 浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）

## § 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)	
	万家中证 500 指数增强发起式 A	万家中证 500 指数增强发起式 C
本期已实现收益	-93,745,440.04	-50,473,673.03
本期利润	-75,651,131.37	-41,037,350.92
加权平均基金份 额本期利润	-0.0769	-0.0731
本期加权平均净 值利润率	-7.07%	-6.85%
本期基金份额净 值增长率	-6.56%	-6.73%
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	37,721,385.52	16,062,844.88
期末可供分配基金份额利润	0.0517	0.0292
期末基金资产净值	767,291,368.20	566,455,603.92
期末基金份额净值	1.0517	1.0292
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	54.62%	51.06%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家中证 500 指数增强发起式 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.21%	0.94%	-6.55%	0.91%	1.34%	0.03%
过去三个月	-4.02%	0.99%	-6.15%	1.09%	2.13%	-0.10%
过去六个月	-6.56%	1.43%	-8.43%	1.53%	1.87%	-0.10%
过去一年	-15.76%	1.15%	-16.66%	1.21%	0.90%	-0.06%
过去三年	-14.35%	1.12%	-25.88%	1.14%	11.53%	-0.02%
自基金合同生效起至今	54.62%	1.19%	0.22%	1.20%	54.40%	-0.01%

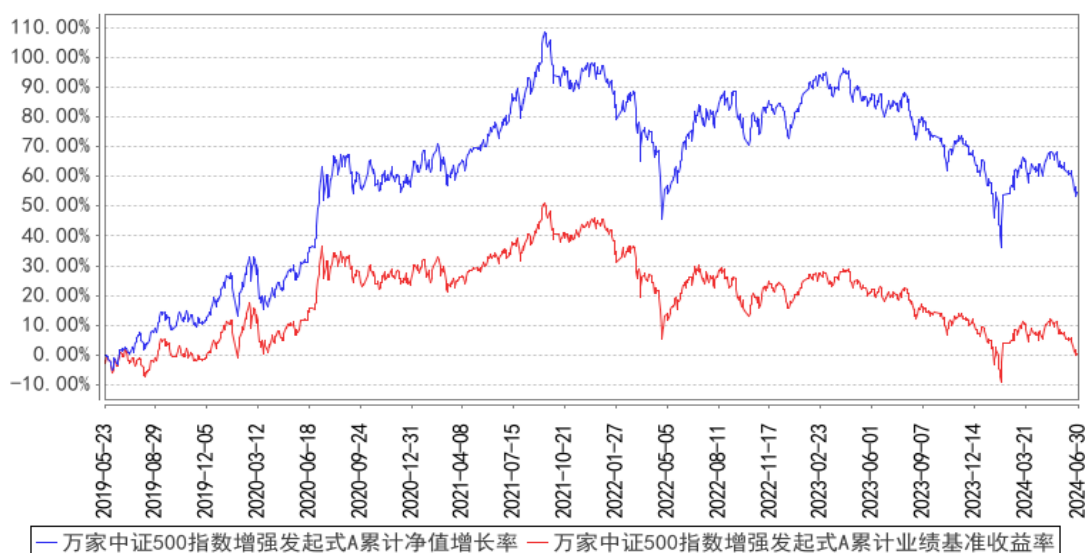
万家中证 500 指数增强发起式 C

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

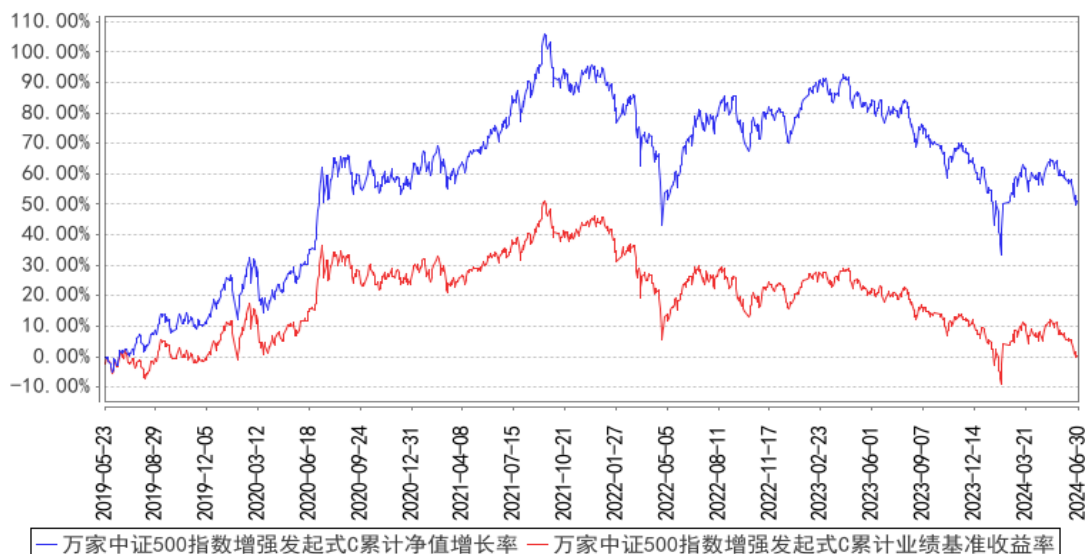
过去一个月	-5.23%	0.94%	-6.55%	0.91%	1.32%	0.03%
过去三个月	-4.11%	0.99%	-6.15%	1.09%	2.04%	-0.10%
过去六个月	-6.73%	1.43%	-8.43%	1.53%	1.70%	-0.10%
过去一年	-16.09%	1.15%	-16.66%	1.21%	0.57%	-0.06%
过去三年	-15.37%	1.12%	-25.88%	1.14%	10.51%	-0.02%
自基金合同生效起至今	51.06%	1.18%	0.22%	1.20%	50.84%	-0.02%

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

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



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





注：本基金于 2019 年 5 月 23 日成立，根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44 号文批准设立。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		
乔亮	公司领导副总经理；万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家中证 500	2019 年 9 月 6 日	-	17.5 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，现任公司副总经理、

<p>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。</p>			<p>基金经理，历任总经理助理、量化投资部总监（兼）。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。</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

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家中证 500 指数增强发起式 A 的基金份额净值为 1.0517 元,本报告期基金份额净值增长率为-6.56%,同期业绩比较基准收益率为-8.43%;截至本报告期末万家中证 500 指数增强发起式 C 的基金份额净值为 1.0292 元,本报告期基金份额净值增长率为-6.73%,同期业绩比较基准收益率为-8.43%。基金报告期内 A 份额、C 份额日均跟踪偏离度分别为 0.1961%、0.1966%,年跟踪误差分别为 4.4289%、4.4335%,符合基金合同中日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%的规定。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市,7 月政治局会议研究分析当前经济形势,认为经济运行总体平稳、稳中有进,延续回升向好态势,同时仍存在部分挑战,宏观政策要持续用力、更加给力,政策定调更为积极。上半年 GDP 增速 5%,但二季度以来显现边际放缓迹象,要实现全年 GDP5%目标,政策力度加码预期抬升,三中全会后货币与财政政策有所发力,央行实施降息、发改委牵头安排约 3000 亿元超长期特别国债资金,支持大规模设备更新和消费品以旧换新,更大力度推动大规模设备更新和大宗耐用消费品以旧换新,加大财政发力的迹象已较为明显。总体来看,当前 A 股整体估值处于较低区间,随着国内政策继续发力、金融监管强化,助力股市信心回稳、估值修复,市场有望稳中向

好。

#### 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：万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	79,186,237.25	245,230,963.09
结算备付金		10,680,518.75	15,730,244.49
存出保证金		559,751.60	569,693.47
交易性金融资产	6.4.7.2	1,252,930,989.84	2,376,705,642.21
其中：股票投资		1,252,930,989.84	2,376,705,642.21
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		2,790,994.52	146,627,646.43
应收股利		-	-
应收申购款		414,477.67	935,470.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,346,562,969.63	2,785,799,660.50
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

		2024 年 6 月 30 日	2023 年 12 月 31 日
<b>负 债:</b>			
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		3,102,357.71	-
应付赎回款		450,360.24	245,957,367.99
应付管理人报酬		1,164,109.82	2,541,926.76
应付托管费		232,822.00	508,385.37
应付销售服务费		182,954.32	492,206.13
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	7,683,393.42	10,732,383.80
负债合计		12,815,997.51	260,232,270.05
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.7	1,279,962,741.72	2,262,777,455.77
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	53,784,230.40	262,789,934.68
净资产合计		1,333,746,972.12	2,525,567,390.45
负债和净资产总计		1,346,562,969.63	2,785,799,660.50

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 1,279,962,741.72 份，其中万家中证 500 指数增强发起式 A 基金份额净值 1.0517 元，基金份额总额 729,569,982.68 份；万家中证 500 指数增强发起式 C 基金份额净值 1.0292 元，基金份额总额 550,392,759.04 份。

## 6.2 利润表

会计主体：万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：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	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-105,292,438.02	-26,481,608.95
1. 利息收入		297,172.57	314,755.61
其中：存款利息收入	6.4.7.10	297,172.57	314,755.61
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）		-133,710,960.92	48,728,613.02
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-151,453,664.69	20,927,118.20
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	17,742,703.77	27,801,494.82
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	27,530,630.78	-76,071,627.98
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	590,719.55	546,650.40
<b>减：二、营业总支出</b>		11,396,044.27	11,813,376.03
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,317,331.44	8,185,118.36
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,663,466.35	1,637,023.66
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,191,670.14	1,790,209.49
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	223,576.34	201,024.52
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		-116,688,482.29	-38,294,984.98
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		-116,688,482.29	-38,294,984.98
<b>五、其他综合收益的税后 净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-116,688,482.29	-38,294,984.98

### 6.3 净资产变动表

会计主体：万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：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	2,262,777,455.77	-	262,789,934.68	2,525,567,390.45
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,262,777,455.77	-	262,789,934.68	2,525,567,390.45
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-982,814,714.05	-	-209,005,704.28	-1,191,820,418.33
(一)、综合收益总额	-	-	-116,688,482.29	-116,688,482.29
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-982,814,714.05	-	-92,317,221.99	-1,075,131,936.04
其中：1. 基金申购款	283,889,032.80	-	8,403,604.76	292,292,637.56
2. 基金赎回款	-1,266,703,746.85	-	-100,720,826.75	-1,367,424,573.60
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,279,962,741.	-	53,784,230.40	1,333,746,972.1

	72			2
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	407,012,691.45	-	144,230,050.48	551,242,741.93
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	407,012,691.45	-	144,230,050.48	551,242,741.93
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,342,807,551.69	-	507,355,585.49	2,850,163,137.18
(一)、综合收益总额	-	-	-38,294,984.98	-38,294,984.98
(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)	2,342,807,551.69	-	989,319,220.39	3,332,126,772.08
其中：1. 基金申购款	2,802,024,504.92	-	1,182,148,433.41	3,984,172,938.33
2. 基金赎回款	-459,216,953.23	-	-192,829,213.02	-652,046,166.25
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-443,668,649.92	-443,668,649.92
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,749,820,243.14	-	651,585,635.97	3,401,405,879.11

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

基金管理人负责人

陈广益

主管会计工作负责人

尹超

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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

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

### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

期报告》及其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 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	79,186,237.25
等于：本金	79,178,079.77
加：应计利息	8,157.48
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	79,186,237.25

## 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	1,306,058,960.92	-	1,252,930,989.84	-53,127,971.08
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	1,306,058,960.92	-	1,252,930,989.84	-53,127,971.08

## 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 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	217.87
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	7,418,176.91
其中：交易所市场	7,418,176.91
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	203,541.64
应付指数使用费	61,457.00
合计	7,683,393.42

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

##### 万家中证 500 指数增强发起式 A

项目	本期 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	1,298,792,250.06	1,298,792,250.06
本期申购	118,019,500.01	118,019,500.01
本期赎回（以“-”号填列）	-687,241,767.39	-687,241,767.39
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	729,569,982.68	729,569,982.68

##### 万家中证 500 指数增强发起式 C

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	963,985,205.71	963,985,205.71

本期申购	165,869,532.79	165,869,532.79
本期赎回(以“-”号填列)	-579,461,979.46	-579,461,979.46
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	550,392,759.04	550,392,759.04

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

#### 6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

万家中证 500 指数增强发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	449,209,460.22	-286,237,156.85	162,972,303.37
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	449,209,460.22	-286,237,156.85	162,972,303.37
本期利润	-93,745,440.04	18,094,308.67	-75,651,131.37
本期基金份额交易产生的变动数	-167,057,523.03	117,457,736.55	-49,599,786.48
其中：基金申购款	29,478,862.12	-23,860,020.38	5,618,841.74
基金赎回款	-196,536,385.15	141,317,756.93	-55,218,628.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	188,406,497.15	-150,685,111.63	37,721,385.52

万家中证 500 指数增强发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	309,574,659.12	-209,757,027.81	99,817,631.31
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	309,574,659.12	-209,757,027.81	99,817,631.31
本期利润	-50,473,673.03	9,436,322.11	-41,037,350.92
本期基金份额交易产生的变动数	-130,782,222.18	88,064,786.67	-42,717,435.51
其中：基金申购款	37,343,353.19	-34,558,590.17	2,784,763.02
基金赎回款	-168,125,575.37	122,623,376.84	-45,502,198.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	128,318,763.91	-112,255,919.03	16,062,844.88

**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	202,347.87
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	90,109.65
其他	4,715.05
合计	297,172.57

**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	-151,453,664.69
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	-151,453,664.69

**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	8,931,522,440.62
减：卖出股票成本总额	9,062,027,738.80
减：交易费用	20,948,366.51
买卖股票差价收入	-151,453,664.69

**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	17,742,703.77
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	17,742,703.77

## 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	27,530,630.78
股票投资	27,530,630.78
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	27,530,630.78

## 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	497,507.97
基金转换费收入	93,211.58
合计	590,719.55

## 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	23,869.30
信息披露费	59,672.34

证券出借违约金	-
银行费用	957.38
账户维护费	6,000.00
指数使用费	133,077.32
合计	223,576.34

#### 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、基金销售机构
中泰证券股份有限公司（“中泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
万家财富基金销售（天津）有限公司（“万家财富”）	基金管理人的子公司、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
中泰证券	2,016,628,138.06	11.97	4,833,405,559.29	32.29

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中泰证券	1,836,954.22	11.93	1,183,636.75	15.96
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中泰证券	4,332,212.87	32.84	2,835,304.06	29.88

#### 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	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,317,331.44	8,185,118.36
其中：应支付销售机构的客户维护 费	1,972,252.62	1,063,903.87
应支付基金管理人的净管理费	6,345,078.82	7,121,214.49

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

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,663,466.35	1,637,023.66

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

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家中证 500 指数增强发起式 A	万家中证 500 指数增强发起式 C	合计
工商银行	-	10,369.36	10,369.36
万家财富	-	4.74	4.74
万家基金	-	128,485.43	128,485.43
中泰证券	-	6,790.47	6,790.47
合计	-	145,650.00	145,650.00
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家中证 500 指数增强发起式 A	万家中证 500 指数增强发起式 C	合计
万家基金	-	1,179,018.81	1,179,018.81
中泰证券	-	6,857.20	6,857.20
工商银行	-	15,738.02	15,738.02
合计	-	1,201,614.03	1,201,614.03

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

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	万家中证 500 指数增强发起式 A	万家中证 500 指数增强发起式 C
基金合同生效日（2019 年 5 月 23 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	万家中证 500 指数增强发起式 A	万家中证 500 指数增强发起式 C
基金合同生效日（2019 年 5 月 23 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,001,000.10	-
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	10,001,000.10	-
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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	79,186,237.25	202,347.87	192,653,965.67	240,193.18

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

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方所承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间没有需作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（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
001359	平安电工	2024 年 3 月 19 日	6 个月	新股流通受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001387	雪祺电气	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股流通受限	11.82	15.25	173	2,045.54	2,638.25	含转增股
001389	广合科技	2024 年 3 月 26 日	6 个月	新股流通受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇成真空	2024 年 5 月 28 日	6 个月	新股流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024 年 1 月 26 日	6 个月	新股流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024 年 3 月 20 日	6 个月	新股流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301539	宏鑫科技	2024 年 4 月 3 日	6 个月	新股流通受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	新股流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
301587	中	2024	6 个月	新股	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-

	瑞股份	年3月27日		流通受限						
301588	美新科技	2024年3月6日	6个月	新股流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301591	肯特股份	2024年2月20日	6个月	新股流通受限	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
601033	永兴股份	2024年1月11日	6个月	新股流通受限	16.20	15.96	1,258	20,379.60	20,077.68	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股流通受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股流通受限	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新股流通受限	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙旗科技	2024年2月23日	6个月	新股流通受限	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
603344	星德胜	2024年3月13日	6个月	新股流通受限	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603375	盛景	2024年1月	6个月	新股流通	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-

	微	17 日		受限						
603381	永臻股份	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
688530	欧莱新材	2024 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通受限	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	新股流通受限	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创股份	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股流通受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024 年 1 月 31 日	6 个月	新股流通受限	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 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同责任，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	79,186,237.25	-	-	-	-	-	79,186,237.25
结算备付金	10,680,518.75	-	-	-	-	-	10,680,518.75
存出保证金	559,751.60	-	-	-	-	-	559,751.60
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,252,930,989.84	1,252,930,989.84
应收申购款	2,195.31	-	-	-	-	412,282.36	414,477.67
应收清算款	-	-	-	-	-	2,790,994.52	2,790,994.52

资产总计	90,428,702.91	-	-	-	-	-1,256,134,266.72	1,346,562,969.63
负债							
应付赎回款						450,360.24	450,360.24
应付管理人报酬						1,164,109.82	1,164,109.82
应付托管费						232,822.00	232,822.00
应付清算款						3,102,357.71	3,102,357.71
应付销售服务费						182,954.32	182,954.32
其他负债						7,683,393.42	7,683,393.42
负债总计						12,815,997.51	12,815,997.51
利率敏感度缺口	90,428,702.91					-1,243,318,269.21	1,333,746,972.12
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	245,230,963.09						245,230,963.09
结算备付金	15,730,244.49						15,730,244.49
存出保证金	569,693.47						569,693.47
交易性金融资产						-2,376,705,642.21	2,376,705,642.21
应收申购款	1,015.46					934,455.35	935,470.81
应收清算款						146,627,646.43	146,627,646.43
资产总计	261,531,916.51					-2,524,267,743.99	2,785,799,660.50
负债							
应付赎回款						245,957,367.99	245,957,367.99
应付管理人报酬						2,541,926.76	2,541,926.76
应付托管费						508,385.37	508,385.37
应付销售服务费						492,206.13	492,206.13
其他负债						10,732,383.80	10,732,383.80
负债总计						260,232,270.05	260,232,270.05
利率敏感度缺口	261,531,916.51					-2,264,035,473.94	2,525,567,390.45

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	1,252,930,989.84	93.94	2,376,705,642.21	94.11
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	1,252,930,989.84	93.94	2,376,705,642.21	94.11

##### 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	12,041,322.27	23,632,914.21



	股票基准指数下降 100 个基点	-12, 041, 322. 27	-23, 632, 914. 21
--	---------------------	-------------------	-------------------

#### 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	1, 252, 671, 975. 68	2, 375, 604, 999. 23
第二层次	24, 002. 55	-
第三层次	235, 011. 61	1, 100, 642. 98
合计	1, 252, 930, 989. 84	2, 376, 705, 642. 21

###### 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	1,252,930,989.84	93.05
	其中：股票	1,252,930,989.84	93.05
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	89,866,756.00	6.67
8	其他各项资产	3,765,223.79	0.28
9	合计	1,346,562,969.63	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	16,639,178.00	1.25
B	采矿业	90,245,075.90	6.77
C	制造业	681,089,029.59	51.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	66,386,567.31	4.98
E	建筑业	13,845,160.80	1.04
F	批发和零售业	4,939,660.80	0.37
G	交通运输、仓储和邮政业	18,919,429.20	1.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	58,017,473.33	4.35
J	金融业	39,621,256.00	2.97
K	房地产业	1,653,630.00	0.12
L	租赁和商务服务业	881,280.00	0.07

M	科学研究和技术服务业	5,197,497.40	0.39
N	水利、环境和公共设施管理业	4,231,248.00	0.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	660,717.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	13,985,128.00	1.05
S	综合	3,697,971.20	0.28
	合计	1,020,010,302.53	76.48

### 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	13,169,465.22	0.99
C	制造业	142,023,037.15	10.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,608,457.00	0.35
E	建筑业	1,014,750.00	0.08
F	批发和零售业	8,001,254.00	0.60
G	交通运输、仓储和邮政业	5,581,570.00	0.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,558,882.83	1.39
J	金融业	35,231,957.43	2.64
K	房地产业	1,896,122.00	0.14
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	480,420.00	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	20,077.68	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	588,406.00	0.04
S	综合	1,746,288.00	0.13
	合计	232,920,687.31	17.46

### 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	600598	北大荒	1,332,200	16,639,178.00	1.25
2	000738	航发控制	807,400	16,204,518.00	1.21
3	601216	君正集团	4,365,000	16,106,850.00	1.21
4	300502	新易盛	148,000	15,621,400.00	1.17
5	300394	天孚通信	173,943	15,380,040.06	1.15
6	600096	云天化	762,765	14,812,896.30	1.11
7	002128	电投能源	652,900	13,776,190.00	1.03
8	601168	西部矿业	750,322	13,468,279.90	1.01
9	002281	光迅科技	356,917	13,337,988.29	1.00
10	600141	兴发集团	693,700	13,235,796.00	0.99
11	600885	宏发股份	449,188	12,433,523.84	0.93
12	000883	湖北能源	1,920,100	11,539,801.00	0.87
13	000933	神火股份	562,700	11,383,421.00	0.85
14	600985	淮北矿业	662,600	11,091,924.00	0.83
15	689009	九号公司	288,483	10,619,059.23	0.80
16	000423	东阿阿胶	166,100	10,397,860.00	0.78
17	600862	中航高科	546,700	10,267,026.00	0.77
18	601608	中信重工	2,659,100	10,131,171.00	0.76
19	600497	驰宏锌锗	1,857,300	9,917,982.00	0.74
20	603160	汇顶科技	144,200	9,913,750.00	0.74
21	600282	南钢股份	1,987,500	9,897,750.00	0.74
22	601666	平煤股份	868,700	9,729,440.00	0.73
23	300529	健帆生物	352,726	9,597,674.46	0.72
24	600988	赤峰黄金	570,700	9,325,238.00	0.70
25	000958	电投产融	2,517,000	9,212,220.00	0.69
26	600549	厦门钨业	527,200	9,094,200.00	0.68
27	000066	中国长城	952,100	8,330,875.00	0.62
28	000155	川能动力	759,200	8,176,584.00	0.61
29	600707	彩虹股份	1,200,041	8,172,279.21	0.61
30	603379	三美股份	207,100	8,105,894.00	0.61
31	601966	玲珑轮胎	440,900	8,099,333.00	0.61
32	688213	思特威	161,600	7,837,600.00	0.59
33	600863	内蒙华电	1,686,200	7,823,968.00	0.59
34	002372	伟星新材	496,400	7,654,488.00	0.57
35	688052	纳芯微	74,300	7,636,554.00	0.57
36	300017	网宿科技	955,100	7,545,290.00	0.57

37	002432	九安医疗	185,179	7,507,156.66	0.56
38	002078	太阳纸业	537,400	7,496,730.00	0.56
39	600546	山煤国际	510,800	7,467,896.00	0.56
40	600399	抚顺特钢	1,316,400	7,411,332.00	0.56
41	601598	中国外运	1,316,300	7,410,769.00	0.56
42	688002	睿创微纳	259,800	7,266,606.00	0.54
43	000830	鲁西化工	619,500	7,180,005.00	0.54
44	600566	济川药业	223,700	7,093,527.00	0.53
45	002465	海格通信	681,300	7,058,268.00	0.53
46	603077	和邦生物	4,257,600	7,025,040.00	0.53
47	688188	柏楚电子	38,000	7,012,900.00	0.53
48	000783	长江证券	1,400,500	6,764,415.00	0.51
49	600529	山东药玻	266,200	6,745,508.00	0.51
50	688220	翱捷科技	173,734	6,508,075.64	0.49
51	601179	中国西电	807,400	6,491,496.00	0.49
52	688234	天岳先进	134,100	6,291,972.00	0.47
53	600348	华阳股份	625,200	6,226,992.00	0.47
54	601665	齐鲁银行	1,261,200	6,192,492.00	0.46
55	601198	东兴证券	762,200	6,067,112.00	0.45
56	601298	青岛港	634,170	6,062,665.20	0.45
57	600699	均胜电子	408,900	6,059,898.00	0.45
58	002340	格林美	941,800	5,999,266.00	0.45
59	000921	海信家电	184,336	5,942,992.64	0.45
60	688122	西部超导	152,310	5,836,519.20	0.44
61	301165	锐捷网络	192,500	5,744,200.00	0.43
62	300438	鹏辉能源	309,500	5,676,230.00	0.43
63	002273	水晶光电	332,200	5,640,756.00	0.42
64	002155	湖南黄金	311,200	5,632,720.00	0.42
65	688180	君实生物	185,900	5,400,395.00	0.40
66	688120	华海清科	27,900	5,289,282.00	0.40
67	301236	软通动力	149,750	5,272,697.50	0.40
68	000960	锡业股份	329,700	5,107,053.00	0.38
69	600398	海澜之家	546,100	5,045,964.00	0.38
70	600580	卧龙电驱	411,900	5,004,585.00	0.38
71	002261	拓维信息	451,300	4,995,891.00	0.37
72	688525	佰维存储	77,277	4,957,319.55	0.37
73	000400	许继电气	141,600	4,872,456.00	0.37
74	688169	石头科技	12,098	4,749,674.80	0.36
75	600008	首创环保	1,730,500	4,637,740.00	0.35
76	601016	节能风电	1,548,200	4,629,118.00	0.35
77	688349	三一重能	186,000	4,620,240.00	0.35
78	688778	厦钨新能	147,204	4,598,652.96	0.34
79	002436	兴森科技	444,600	4,588,272.00	0.34

80	300888	稳健医疗	177,200	4,483,160.00	0.34
81	600315	上海家化	249,300	4,432,554.00	0.33
82	000032	深桑达 A	295,800	4,431,084.00	0.33
83	600177	雅戈尔	617,212	4,394,549.44	0.33
84	000039	中集集团	474,400	4,392,944.00	0.33
85	603658	安图生物	94,600	4,358,222.00	0.33
86	002487	大金重工	190,228	4,352,416.64	0.33
87	600956	新天绿能	527,400	4,308,858.00	0.32
88	688153	唯捷创芯	116,100	4,295,700.00	0.32
89	000887	中鼎股份	349,500	4,277,880.00	0.32
90	601636	旗滨集团	659,600	4,254,420.00	0.32
91	603568	伟明环保	205,600	4,231,248.00	0.32
92	300724	捷佳伟创	78,200	4,223,582.00	0.32
93	600516	方大炭素	975,900	4,206,129.00	0.32
94	002294	信立泰	155,700	4,146,291.00	0.31
95	002019	亿帆医药	334,600	4,135,656.00	0.31
96	002028	思源电气	60,700	4,060,830.00	0.30
97	688779	长远锂科	874,900	4,050,787.00	0.30
98	688297	中无人机	121,400	4,009,842.00	0.30
99	300136	信维通信	204,700	4,008,026.00	0.30
100	600038	中直股份	96,300	3,958,893.00	0.30
101	600578	京能电力	1,209,300	3,918,132.00	0.29
102	002797	第一创业	769,000	3,914,210.00	0.29
103	688063	派能科技	97,540	3,873,313.40	0.29
104	000009	中国宝安	449,800	3,868,280.00	0.29
105	688385	复旦微电	121,000	3,796,980.00	0.28
106	000598	兴蓉环境	496,400	3,732,928.00	0.28
107	000818	航锦科技	168,443	3,719,221.44	0.28
108	600418	江淮汽车	234,000	3,706,560.00	0.28
109	600673	东阳光	525,280	3,697,971.20	0.28
110	603000	人民网	184,200	3,682,158.00	0.28
111	601019	山东出版	309,800	3,661,836.00	0.27
112	603338	浙江鼎力	60,000	3,625,200.00	0.27
113	000021	深科技	235,600	3,562,272.00	0.27
114	002444	巨星科技	143,200	3,537,040.00	0.27
115	000988	华工科技	114,700	3,432,971.00	0.26
116	600820	隧道股份	515,800	3,368,174.00	0.25
117	600486	扬农化工	59,000	3,330,550.00	0.25
118	600126	杭钢股份	796,913	3,275,312.43	0.25
119	603728	鸣志电器	81,400	3,274,722.00	0.25
120	300251	光线传媒	387,800	3,261,398.00	0.24
121	600536	中国软件	108,600	3,249,312.00	0.24
122	000878	云南铜业	256,500	3,195,990.00	0.24

123	688516	奥特维	76,143	3,183,538.83	0.24
124	000703	恒逸石化	447,700	3,174,193.00	0.24
125	600062	华润双鹤	161,600	3,164,128.00	0.24
126	600416	湘电股份	315,700	3,138,058.00	0.24
127	601611	中国核建	387,200	3,132,448.00	0.23
128	600380	健康元	279,400	3,120,898.00	0.23
129	601058	赛轮轮胎	222,300	3,112,200.00	0.23
130	601933	永辉超市	1,251,500	3,103,720.00	0.23
131	300012	华测检测	306,240	3,080,774.40	0.23
132	002608	江苏国信	396,800	3,075,200.00	0.23
133	002500	山西证券	631,400	2,967,580.00	0.22
134	002739	万达电影	244,900	2,960,841.00	0.22
135	002683	广东宏大	145,800	2,934,954.00	0.22
136	300114	中航电测	64,700	2,927,675.00	0.22
137	002064	华峰化学	406,500	2,914,605.00	0.22
138	600970	中材国际	241,580	2,913,454.80	0.22
139	600299	安迪苏	300,033	2,910,320.10	0.22
140	000559	万向钱潮	651,773	2,906,907.58	0.22
141	603317	天味食品	254,200	2,900,422.00	0.22
142	688538	和辉光电	1,447,900	2,866,842.00	0.21
143	600066	宇通客车	108,900	2,809,620.00	0.21
144	002025	航天电器	59,900	2,778,162.00	0.21
145	600155	华创云信	456,400	2,697,324.00	0.20
146	300037	新宙邦	94,280	2,692,636.80	0.20
147	601567	三星医疗	74,800	2,618,000.00	0.20
148	002850	科达利	32,600	2,489,988.00	0.19
149	000519	中兵红箭	167,500	2,457,225.00	0.18
150	002185	华天科技	299,600	2,441,740.00	0.18
151	002653	海思科	79,000	2,425,300.00	0.18
152	601717	郑煤机	163,700	2,422,760.00	0.18
153	600612	老凤祥	40,900	2,379,971.00	0.18
154	002152	广电运通	227,200	2,376,512.00	0.18
155	603885	吉祥航空	214,000	2,351,860.00	0.18
156	601555	东吴证券	393,900	2,324,010.00	0.17
157	603893	瑞芯微	38,400	2,272,128.00	0.17
158	603596	伯特利	58,196	2,263,824.40	0.17
159	300002	神州泰岳	275,800	2,239,496.00	0.17
160	601991	大唐发电	735,200	2,212,952.00	0.17
161	603345	安井食品	29,600	2,199,576.00	0.16
162	688114	华大智造	45,600	2,161,896.00	0.16
163	000967	盈峰环境	504,020	2,132,004.60	0.16
164	688099	晶晨股份	35,694	2,117,368.08	0.16
165	600498	烽火通信	127,200	2,022,480.00	0.15

166	002472	双环传动	91,100	2,006,022.00	0.15
167	300144	宋城演艺	245,900	1,974,577.00	0.15
168	603305	旭升集团	183,198	1,934,570.88	0.15
169	000729	燕京啤酒	216,700	1,913,461.00	0.14
170	300073	当升科技	55,600	1,907,636.00	0.14
171	300383	光环新网	219,000	1,850,550.00	0.14
172	603298	杭叉集团	94,000	1,846,160.00	0.14
173	600032	浙江新能	251,300	1,829,464.00	0.14
174	600808	马钢股份	901,200	1,820,424.00	0.14
175	300001	特锐德	89,800	1,806,776.00	0.14
176	300567	精测电子	31,300	1,768,763.00	0.13
177	601156	东航物流	86,900	1,768,415.00	0.13
178	000050	深天马 A	233,000	1,696,240.00	0.13
179	002508	老板电器	75,063	1,658,892.30	0.12
180	300207	欣旺达	108,200	1,641,394.00	0.12
181	603858	步长制药	106,081	1,607,127.15	0.12
182	000959	首钢股份	587,700	1,598,544.00	0.12
183	600563	法拉电子	20,700	1,576,926.00	0.12
184	002409	雅克科技	23,900	1,503,549.00	0.11
185	002156	通富微电	66,100	1,479,979.00	0.11
186	300699	光威复材	57,800	1,435,174.00	0.11
187	600499	科达制造	170,100	1,433,943.00	0.11
188	002517	恺英网络	148,300	1,416,265.00	0.11
189	000513	丽珠集团	38,000	1,413,980.00	0.11
190	688200	华峰测控	15,100	1,385,425.00	0.10
191	300776	帝尔激光	28,900	1,328,244.00	0.10
192	002945	华林证券	133,000	1,327,340.00	0.10
193	603056	德邦股份	101,200	1,325,720.00	0.10
194	603529	爱玛科技	48,100	1,314,573.00	0.10
195	000031	大悦城	551,100	1,289,574.00	0.10
196	600927	永安期货	115,480	1,287,602.00	0.10
197	603816	顾家家居	38,700	1,249,623.00	0.09
198	600521	华海药业	71,400	1,217,370.00	0.09
199	688248	南网科技	38,000	1,125,940.00	0.08
200	601568	北元集团	299,800	1,112,258.00	0.08
201	688772	珠海冠宇	69,674	1,038,142.60	0.08
202	603606	东方电缆	20,600	1,005,486.00	0.08
203	300676	华大基因	28,300	990,783.00	0.07
204	603883	老百姓	52,480	963,532.80	0.07
205	600095	湘财股份	153,700	916,052.00	0.07
206	601212	白银有色	328,300	912,674.00	0.07
207	000898	鞍钢股份	423,500	897,820.00	0.07
208	300058	蓝色光标	162,000	881,280.00	0.07



209	002867	周大生	66,800	872,408.00	0.07
210	603156	养元饮品	39,800	846,546.00	0.06
211	601098	中南传媒	66,400	824,688.00	0.06
212	600642	申能股份	91,557	808,448.31	0.06
213	600369	西南证券	221,100	791,538.00	0.06
214	002430	杭氧股份	35,500	789,875.00	0.06
215	603786	科博达	12,300	789,045.00	0.06
216	603225	新凤鸣	50,400	785,736.00	0.06
217	688536	思瑞浦	7,700	753,137.00	0.06
218	601615	明阳智能	79,500	750,480.00	0.06
219	600373	中文传媒	50,100	743,484.00	0.06
220	688521	芯原股份	27,445	734,153.75	0.06
221	300765	新诺威	28,700	724,101.00	0.05
222	300212	易华录	41,700	701,811.00	0.05
223	600129	太极集团	24,100	696,972.00	0.05
224	688301	奕瑞科技	6,000	691,380.00	0.05
225	002497	雅化集团	75,500	673,460.00	0.05
226	002138	顺络电子	24,100	661,786.00	0.05
227	603882	金域医学	24,300	660,717.00	0.05
228	603290	斯达半导	7,300	628,603.00	0.05
229	600765	中航重机	30,700	626,280.00	0.05
230	002223	鱼跃医疗	16,400	616,640.00	0.05
231	688017	绿的谐波	6,900	566,490.00	0.04
232	601858	中国科传	29,200	558,304.00	0.04
233	688331	荣昌生物	12,600	544,320.00	0.04
234	002414	高德红外	88,200	519,498.00	0.04
235	688567	孚能科技	47,400	455,040.00	0.03
236	001286	陕西能源	38,900	448,517.00	0.03
237	300054	鼎龙股份	19,000	430,920.00	0.03
238	002558	巨人网络	45,000	424,800.00	0.03
239	688032	禾迈股份	3,372	387,038.16	0.03
240	002532	天山铝业	47,000	381,170.00	0.03
241	600895	张江高科	19,700	364,056.00	0.03
242	688777	中控技术	9,600	361,920.00	0.03
243	688281	华秦科技	4,300	358,276.00	0.03
244	002423	中粮资本	45,900	343,791.00	0.03
245	300357	我武生物	15,500	313,410.00	0.02
246	603737	三棵树	7,700	279,279.00	0.02
247	002563	森马服饰	43,600	253,316.00	0.02
248	600329	达仁堂	6,900	223,491.00	0.02
249	688348	昱能科技	3,600	212,400.00	0.02
250	600361	创新新材	49,500	199,485.00	0.01
251	600131	国网信通	11,000	185,570.00	0.01

252	601577	长沙银行	19,500	159,510.00	0.01
253	002385	大北农	33,000	127,050.00	0.01
254	003031	中瓷电子	800	36,992.00	0.00
255	600021	上海电力	3,300	32,637.00	0.00
256	002984	森麒麟	1,000	24,090.00	0.00
257	688107	安路科技	600	15,252.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601328	交通银行	1,175,500	8,780,985.00	0.66
2	600016	民生银行	2,012,100	7,625,859.00	0.57
3	601009	南京银行	667,552	6,935,865.28	0.52
4	603501	韦尔股份	58,900	5,852,893.00	0.44
5	000727	冠捷科技	2,577,600	5,309,856.00	0.40
6	000166	申万宏源	1,122,300	4,837,113.00	0.36
7	000725	京东方 A	1,148,200	4,696,138.00	0.35
8	600019	宝钢股份	701,700	4,666,305.00	0.35
9	600015	华夏银行	695,300	4,449,920.00	0.33
10	000758	中色股份	869,500	4,417,060.00	0.33
11	002304	洋河股份	52,100	4,206,554.00	0.32
12	601001	晋控煤业	247,900	4,095,308.00	0.31
13	002249	大洋电机	853,500	4,037,055.00	0.30
14	600703	三安光电	343,900	4,030,508.00	0.30
15	603986	兆易创新	35,100	3,356,262.00	0.25
16	601127	赛力斯	36,700	3,344,104.00	0.25
17	600916	中国黄金	325,400	3,130,348.00	0.23
18	601600	中国铝业	388,600	2,965,018.00	0.22
19	688036	传音控股	32,996	2,525,513.84	0.19
20	002416	爱施德	284,700	2,519,595.00	0.19
21	300679	电连技术	62,600	2,518,398.00	0.19
22	688686	奥普特	38,889	2,490,062.67	0.19
23	002897	意华股份	65,800	2,478,028.00	0.19
24	600018	上港集团	417,100	2,410,838.00	0.18
25	601699	潞安环能	132,800	2,407,664.00	0.18
26	603496	恒为科技	95,400	2,332,530.00	0.17
27	002961	瑞达期货	212,277	2,324,433.15	0.17
28	002237	恒邦股份	200,300	2,305,453.00	0.17
29	688506	百利天恒	12,500	2,267,500.00	0.17
30	000600	建投能源	344,300	2,169,090.00	0.16
31	002023	海特高新	236,000	2,159,400.00	0.16
32	002326	永太科技	269,200	2,105,144.00	0.16
33	603019	中科曙光	49,500	2,054,250.00	0.15
34	300170	汉得信息	321,800	1,975,852.00	0.15

35	002036	联创电子	287,800	1,942,650.00	0.15
36	688400	凌云光	114,400	1,908,192.00	0.14
37	600602	云赛智联	171,500	1,893,360.00	0.14
38	688256	寒武纪	8,993	1,786,639.31	0.13
39	601919	中远海控	115,100	1,782,899.00	0.13
40	600640	国脉文化	172,000	1,780,200.00	0.13
41	688313	仕佳光子	185,030	1,761,485.60	0.13
42	000532	华金资本	144,800	1,746,288.00	0.13
43	601700	风范股份	383,600	1,684,004.00	0.13
44	300968	格林精密	180,700	1,673,282.00	0.13
45	002097	山河智能	264,100	1,592,523.00	0.12
46	001914	招商积余	157,100	1,574,142.00	0.12
47	000403	派林生物	58,900	1,570,274.00	0.12
48	301260	格力博	105,900	1,442,358.00	0.11
49	000786	北新建材	48,200	1,429,612.00	0.11
50	688408	中信博	15,500	1,427,240.00	0.11
51	300821	东岳硅材	202,300	1,383,732.00	0.10
52	300113	顺网科技	132,000	1,351,680.00	0.10
53	002296	辉煌科技	126,600	1,305,246.00	0.10
54	600050	中国联通	277,400	1,303,780.00	0.10
55	605333	沪光股份	46,700	1,300,595.00	0.10
56	603178	圣龙股份	60,600	1,298,658.00	0.10
57	600006	东风股份	199,200	1,272,888.00	0.10
58	600610	中毅达	311,700	1,240,566.00	0.09
59	603083	剑桥科技	38,100	1,229,868.00	0.09
60	600186	莲花控股	338,100	1,159,683.00	0.09
61	000801	四川九洲	114,600	1,146,000.00	0.09
62	300079	数码视讯	281,600	1,143,296.00	0.09
63	003015	日久光电	125,400	1,138,632.00	0.09
64	601096	宏盛华源	270,000	1,104,300.00	0.08
65	301219	腾远钴业	28,800	1,101,888.00	0.08
66	600436	片仔癀	5,200	1,077,284.00	0.08
67	300045	华力创通	60,900	1,074,885.00	0.08
68	002467	二六三	321,800	1,074,812.00	0.08
69	300846	首都在线	113,400	1,061,424.00	0.08
70	300166	东方国信	168,500	1,031,220.00	0.08
71	000975	山金国际	63,200	1,029,528.00	0.08
72	688048	长光华芯	32,700	1,021,548.00	0.08
73	002151	北斗星通	42,200	1,020,396.00	0.08
74	002701	奥瑞金	241,700	1,005,472.00	0.08
75	300641	正丹股份	37,500	997,125.00	0.07
76	603131	上海沪工	67,900	939,736.00	0.07
77	002527	新时达	149,000	892,510.00	0.07

78	300586	美联新材	141,730	891,481.70	0.07
79	300979	华利集团	14,400	876,240.00	0.07
80	600478	科力远	232,100	875,017.00	0.07
81	300735	光弘科技	39,400	851,040.00	0.06
82	301205	联特科技	13,400	840,850.00	0.06
83	300570	太辰光	25,300	826,298.00	0.06
84	600027	华电国际	118,600	823,084.00	0.06
85	603015	弘讯科技	106,900	808,164.00	0.06
86	601225	陕西煤业	30,900	796,293.00	0.06
87	000555	神州信息	83,500	778,220.00	0.06
88	688095	福昕软件	16,900	774,189.00	0.06
89	000151	中成股份	74,600	771,364.00	0.06
90	002298	中电兴发	172,400	762,008.00	0.06
91	688110	东芯股份	39,100	745,637.00	0.06
92	600114	东睦股份	50,800	731,012.00	0.05
93	601038	一拖股份	45,800	724,098.00	0.05
94	301345	涛涛车业	13,100	721,810.00	0.05
95	300408	三环集团	24,200	706,398.00	0.05
96	600618	氯碱化工	79,800	700,644.00	0.05
97	002264	新华都	134,000	684,740.00	0.05
98	688195	腾景科技	27,800	681,378.00	0.05
99	603861	白云电器	80,800	676,296.00	0.05
100	603960	克来机电	31,900	673,090.00	0.05
101	688150	莱特光电	34,500	669,300.00	0.05
102	003019	宸展光电	26,100	661,113.00	0.05
103	600183	生益科技	31,000	652,860.00	0.05
104	000722	湖南发展	70,800	650,652.00	0.05
105	603595	东尼电子	31,600	650,644.00	0.05
106	002906	华阳集团	24,300	650,268.00	0.05
107	300322	硕贝德	77,500	649,450.00	0.05
108	601800	中国交建	71,700	640,998.00	0.05
109	002520	日发精机	168,600	638,994.00	0.05
110	002913	奥士康	23,000	616,630.00	0.05
111	605376	博迁新材	27,100	611,647.00	0.05
112	300182	捷成股份	158,600	588,406.00	0.04
113	603108	润达医疗	38,000	575,320.00	0.04
114	603025	大豪科技	41,100	568,002.00	0.04
115	002215	诺普信	75,500	562,475.00	0.04
116	002577	雷柏科技	44,400	549,228.00	0.04
117	603897	长城科技	30,000	526,500.00	0.04
118	300870	欧陆通	12,100	524,898.00	0.04
119	000099	中信海直	32,200	522,928.00	0.04
120	301012	扬电科技	21,100	522,436.00	0.04

121	002099	海翔药业	101,100	516,621.00	0.04
122	300674	宇信科技	46,000	509,680.00	0.04
123	300131	英唐智控	113,100	503,295.00	0.04
124	300005	探路者	98,300	492,483.00	0.04
125	000550	江铃汽车	22,600	490,646.00	0.04
126	002214	大立科技	43,400	489,552.00	0.04
127	301316	慧博云通	32,900	482,972.00	0.04
128	300492	华图山鼎	5,100	480,420.00	0.04
129	603612	索通发展	37,100	473,396.00	0.04
130	600012	皖通高速	32,700	456,819.00	0.03
131	601877	正泰电器	23,800	453,628.00	0.03
132	300620	光库科技	12,100	445,038.00	0.03
133	002455	百川股份	47,400	435,132.00	0.03
134	688111	金山办公	1,895	431,112.50	0.03
135	300563	神宇股份	16,700	425,015.00	0.03
136	002192	融捷股份	14,111	423,612.22	0.03
137	002238	天威视讯	53,700	421,545.00	0.03
138	605011	杭州热电	17,200	418,476.00	0.03
139	002292	奥飞娱乐	69,100	413,218.00	0.03
140	300916	朗特智能	15,900	400,362.00	0.03
141	603005	晶方科技	19,312	393,578.56	0.03
142	000899	赣能股份	40,500	391,635.00	0.03
143	002920	德赛西威	4,300	374,487.00	0.03
144	600133	东湖高新	35,800	373,752.00	0.03
145	300660	江苏雷利	14,600	372,592.00	0.03
146	600362	江西铜业	15,300	362,304.00	0.03
147	601975	招商南油	99,400	356,846.00	0.03
148	688661	和林微纳	11,600	355,540.00	0.03
149	000420	吉林化纤	112,100	354,236.00	0.03
150	688685	迈信林	14,400	352,080.00	0.03
151	688496	清越科技	37,600	347,424.00	0.03
152	300842	帝科股份	8,900	345,320.00	0.03
153	688123	聚辰股份	5,600	340,648.00	0.03
154	002362	汉王科技	20,400	339,660.00	0.03
155	300180	华峰超纤	93,800	331,114.00	0.02
156	600383	金地集团	94,700	321,980.00	0.02
157	603629	利通电子	16,300	300,898.00	0.02
158	300274	阳光电源	4,800	297,744.00	0.02
159	301308	江波龙	3,100	293,694.00	0.02
160	601865	福莱特	14,600	293,460.00	0.02
161	600031	三一重工	17,400	287,100.00	0.02
162	002839	张家港行	69,100	277,782.00	0.02
163	002792	通宇通讯	25,710	268,412.40	0.02

164	688025	杰普特	6,600	266,574.00	0.02
165	000829	天音控股	27,200	246,976.00	0.02
166	300895	铜牛信息	9,900	245,817.00	0.02
167	688409	富创精密	6,596	243,656.24	0.02
168	000657	中钨高新	24,200	221,188.00	0.02
169	688662	富信科技	8,900	217,160.00	0.02
170	688609	九联科技	23,600	208,152.00	0.02
171	603516	淳中科技	6,400	202,048.00	0.02
172	600178	东安动力	20,100	201,402.00	0.02
173	002399	海普瑞	22,800	197,676.00	0.01
174	300975	商络电子	21,400	193,456.00	0.01
175	688235	百济神州	1,589	184,069.76	0.01
176	301238	瑞泰新材	12,000	179,640.00	0.01
177	002031	巨轮智能	75,700	171,839.00	0.01
178	002463	沪电股份	4,550	166,075.00	0.01
179	001896	豫能控股	36,000	155,520.00	0.01
180	603158	腾龙股份	21,000	147,840.00	0.01
181	603236	移远通信	2,700	126,171.00	0.01
182	688208	道通科技	4,316	104,188.24	0.01
183	688158	优刻得	8,900	91,047.00	0.01
184	600841	动力新科	24,600	80,688.00	0.01
185	002703	浙江世宝	6,900	76,866.00	0.01
186	300678	中科信息	2,700	71,604.00	0.01
187	600809	山西汾酒	300	63,264.00	0.00
188	301060	兰卫医学	7,500	60,900.00	0.00
189	300127	银河磁体	4,000	60,200.00	0.00
190	603556	海兴电力	1,200	56,196.00	0.00
191	600717	天津港	12,000	51,240.00	0.00
192	603085	天成自控	4,500	40,230.00	0.00
193	688668	鼎通科技	900	35,361.00	0.00
194	688362	甬矽电子	1,600	31,136.00	0.00
195	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
196	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
197	688798	艾为电子	400	22,648.00	0.00
198	300252	金信诺	3,600	22,500.00	0.00
199	002837	英维克	1,000	21,390.00	0.00
200	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00
201	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
202	000903	云内动力	10,800	18,576.00	0.00
203	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
204	000999	华润三九	346	14,732.68	0.00
205	300969	恒帅股份	200	13,826.00	0.00
206	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00

207	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
208	002559	亚威股份	1,600	12,256.00	0.00
209	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
210	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
211	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
212	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
213	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
214	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
215	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
216	603806	福斯特	500	7,350.00	0.00
217	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
218	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
219	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
220	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
221	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
222	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
223	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
224	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
225	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
226	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
227	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
228	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
229	001387	雪祺电气	173	2,638.25	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	002326	永太科技	50,162,739.00	1.99
2	600497	驰宏锌锗	49,064,688.00	1.94
3	600863	内蒙华电	48,710,856.00	1.93
4	000933	神火股份	44,707,927.00	1.77
5	601009	南京银行	43,371,638.40	1.72
6	601128	常熟银行	42,311,824.98	1.68
7	600015	华夏银行	42,001,206.00	1.66
8	000009	中国宝安	41,439,093.00	1.64
9	300748	金力永磁	39,745,337.00	1.57
10	600161	天坛生物	39,673,534.60	1.57
11	300017	网宿科技	39,317,080.00	1.56
12	600160	巨化股份	38,584,044.42	1.53
13	601225	陕西煤业	37,915,420.00	1.50
14	600909	华安证券	37,899,607.00	1.50
15	600549	厦门钨业	37,512,212.00	1.49

16	300394	天孚通信	37,424,448.80	1.48
17	601168	西部矿业	37,051,922.00	1.47
18	601666	平煤股份	36,435,815.00	1.44
19	600546	山煤国际	35,720,461.00	1.41
20	601058	赛轮轮胎	35,666,335.00	1.41

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	000039	中集集团	69,506,201.34	2.75
2	600160	巨化股份	61,589,575.99	2.44
3	600161	天坛生物	61,223,401.40	2.42
4	300136	信维通信	54,823,571.70	2.17
5	002463	沪电股份	53,455,594.40	2.12
6	600863	内蒙华电	51,154,238.00	2.03
7	002326	永太科技	50,233,112.41	1.99
8	600015	华夏银行	46,110,966.00	1.83
9	600392	盛和资源	45,759,818.80	1.81
10	688169	石头科技	45,713,772.63	1.81
11	601128	常熟银行	45,366,628.75	1.80
12	000519	中兵红箭	44,795,664.97	1.77
13	601168	西部矿业	44,019,138.45	1.74
14	601000	唐山港	43,467,040.00	1.72
15	600497	驰宏锌锗	43,319,937.00	1.72
16	000932	华菱钢铁	43,220,102.00	1.71
17	601077	渝农商行	42,576,606.00	1.69
18	300676	华大基因	41,525,106.08	1.64
19	002557	洽洽食品	41,265,353.54	1.63
20	600141	兴发集团	40,434,739.00	1.60

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	7,910,722,455.65
卖出股票收入(成交)总额	8,931,522,440.62

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。



## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

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

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	559,751.60
2	应收清算款	2,790,994.52
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	414,477.67
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,765,223.79

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
万家中证 500 指数增强发起式 A	108,113	6,748.22	418,643,357.24	57.38	310,926,625.44	42.62
万家中证 500 指数增强发起式 C	14,609	37,674.91	420,703,063.08	76.44	129,689,695.96	23.56
合计	121,849	10,504.50	839,346,420.32	65.58	440,616,321.40	34.42

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

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

基金管理人所有从业人员持有本基金	万家中证 500 指数增强发起式 A	340,028.66	0.0466
	万家中证 500 指数增强发起式 C	107,125.67	0.0195
	合计	447,154.33	0.0349

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	万家中证 500 指数增强发起式 A	10~50
	万家中证 500 指数增强发起式 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	万家中证 500 指数增强发起式 A	10~50
	万家中证 500 指数增强发起式 C	0
	合计	10~50

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家中证 500 指数增强发起式 A	万家中证 500 指数增强发起式 C
基金合同生效日 （2019 年 5 月 23 日） 基金份额总额	193,620,037.68	22,381,542.21
本报告期期初基金份额总额	1,298,792,250.06	963,985,205.71
本报告期基金总申购份额	118,019,500.01	165,869,532.79
减：本报告期基金总赎回份额	687,241,767.39	579,461,979.46
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	729,569,982.68	550,392,759.04

## § 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 (%)	
财通证券	3	3,064,351,283.97	18.20	2,483,599.44	16.12	-
浙商证券	1	2,927,758,468.44	17.39	2,769,827.57	17.98	-
开源证券	1	2,303,973,706.36	13.68	2,179,346.62	14.15	-
中信建投	1	2,129,301,571.59	12.64	2,014,199.33	13.08	-
中泰证券	1	2,016,628,13	11.97	1,836,954.22	11.93	-

		8.06				
国信证券	2	1,809,895,047.92	10.75	1,712,161.17	11.12	-
东吴证券	1	1,484,491,335.71	8.81	1,404,187.06	9.12	-
德邦证券	2	891,572,155.64	5.29	843,422.77	5.48	-
广发证券	3	212,611,762.34	1.26	158,587.26	1.03	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	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	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	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	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增光大银行为销售机构并开通转换、基金定投业务的公告	指定媒介	2024 年 1 月 15 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	2024 年 1 月 19 日
3	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 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关于旗下部分基金新增微众银行为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2024 年 3 月 20 日
5	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在创金启富基金开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2024 年 3 月 21 日
6	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
7	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年年度报告	指定媒介	2024 年 3 月 29 日
8	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
9	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	指定媒介	2024 年 4 月 19 日
10	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在银泰证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2024 年 4 月 22 日
11	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在渤海证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2024 年 5 月 17 日
12	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在江海证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2024 年 5 月 20 日
13	万家基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金更新基金产品资料概要的提示性公告	指定媒介	2024 年 6 月 26 日
14	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金产品资料概要（更新）	指定媒介	2024 年 6 月 26 日
15	万家基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在交通银行股份有限公司定投起点的公告	指定媒介	2024 年 6 月 28 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240108-20240630	366,394,924.75	48,208,544.20	48,208,544.20	366,394,924.75	28.63

#### 产品特有风险

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

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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