

# 万家集利债券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：平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安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             | 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        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>15</b> |
| 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        |
| <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                                 | 17        |
| 6.3 净资产变动表                              | 18        |
| 6.4 报表附注                                | 20        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>44</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 44        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 45        |
| 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       | 46        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 46        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 48        |
| 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      | 48        |

|             |                                   |           |
|-------------|-----------------------------------|-----------|
| 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 | 48        |
| 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 | 48        |
| 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    | 48        |
| 7.10        | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明              | 48        |
| 7.11        | 投资组合报告附注                          | 49        |
| <b>§ 8</b>  | <b>基金份额持有人信息</b>                  | <b>50</b> |
| 8.1         | 期末基金份额持有人户数及持有人结构                 | 50        |
| 8.2         | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况              | 50        |
| 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      | 51        |
| 8.4         | 发起式基金发起资金持有份额情况                   | 51        |
| <b>§ 9</b>  | <b>开放式基金份额变动</b>                  | <b>51</b> |
| <b>§ 10</b> | <b>重大事件揭示</b>                     | <b>52</b> |
| 10.1        | 基金份额持有人大会决议                       | 52        |
| 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       | 52        |
| 10.3        | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼            | 52        |
| 10.4        | 基金投资策略的改变                         | 52        |
| 10.5        | 为基金进行审计的会计师事务所情况                  | 52        |
| 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          | 52        |
| 10.7        | 基金租用证券公司交易单元的有关情况                 | 52        |
| 10.8        | 其他重大事件                            | 53        |
| <b>§ 11</b> | <b>影响投资者决策的其他重要信息</b>             | <b>54</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     | 54        |
| <b>§ 12</b> | <b>备查文件目录</b>                     | <b>55</b> |
| 12.1        | 备查文件目录                            | 55        |
| 12.2        | 存放地点                              | 55        |
| 12.3        | 查阅方式                              | 55        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                  |                |
|-----------------|------------------|----------------|
| 基金名称            | 万家集利债券型发起式证券投资基金 |                |
| 基金简称            | 万家集利债券发起式        |                |
| 基金主代码           | 018741           |                |
| 基金运作方式          | 契约型开放式           |                |
| 基金合同生效日         | 2023 年 6 月 29 日  |                |
| 基金管理人           | 万家基金管理有限公司       |                |
| 基金托管人           | 平安银行股份有限公司       |                |
| 报告期末基金份额总额      | 10,001,065.27 份  |                |
| 基金合同存续期         | 不定期              |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 万家集利债券发起式 A      | 万家集利债券发起式 C    |
| 下属分级基金的交易代码     | 018741           | 018742         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 5,001,052.26 份   | 5,000,013.01 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 在严格控制风险并保持良好流动性的基础上，力争为投资者提供长期稳定的投资回报。   |
| 投资策略   | 1、资产配置策略；2、利率预期策略；3、期限结构配置策略；4、属类配置策略；5、债券品种选择策略；6、股票投资策略；7、公开发行的证券公司短期公司债券投资策略；8、可转换债券和可交换债券投资策略；9、国债期货交易策略；10、信用衍生品投资策略。                         |
| 业绩比较基准 | 中债新综合指数（全价）收益率×90%+沪深 300 指数收益率×5%+恒生指数收益率×5%  |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。<br>本基金可投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。 |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人            | 基金托管人                  |
|-------------|------|------------------|------------------------|
| 名称          |      | 万家基金管理有限公司       | 平安银行股份有限公司             |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 兰剑               | 潘琦                     |
|             | 联系电话 | 021-38909626     | 0755-22168257          |
|             | 电子邮箱 | lanj@wjasset.com | PANQI003@pingan.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 4008880800       | 95511-3                |
| 传真          |      | 021-38909627     | 0755-82080387          |

|       |  |                                  |
|-------|--|----------------------------------|
| 注册地址  | 中国（上海）自由贸易试验区浦<br>电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层） | 广东省深圳市罗湖区深南东路<br>5047 号          |
| 办公地址  | 中国（上海）自由贸易试验区浦<br>电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层） | 广东省深圳市福田区益田路<br>5023 号平安金融中心 B 座 |
| 邮政编码  | 200122                                   | 518001                           |
| 法定代表人 | 方一天                                      | 谢永林                              |

## 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<br>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<br>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<br>浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9<br>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<br>据和指标 | 报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日) |             |
|-------------------|-------------------------------------|-------------|
|                   | 万家集利债券发起式 A                         | 万家集利债券发起式 C |
| 本期已实现收益           | 96,944.91                           | 86,845.34   |
| 本期利润              | 95,969.62                           | 85,890.50   |
| 加权平均基金份<br>额本期利润  | 0.0192                              | 0.0172      |
| 本期加权平均净<br>值利润率   | 1.94%                               | 1.75%       |
| 本期基金份额净<br>值增长率   | 1.97%                               | 1.77%       |
| 3.1.2 期末数<br>据和指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日)               |             |
| 期末可供分配利<br>润      | -28,884.91                          | -48,789.96  |
| 期末可供分配基           | -0.0058                             | -0.0098     |

|              |                  |              |
|--------------|------------------|--------------|
| 金份额利润        |                  |              |
| 期末基金资产净值     | 4,976,435.62     | 4,955,457.62 |
| 期末基金份额净值     | 0.9951           | 0.9911       |
| 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  | -0.49%           | -0.89%       |

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

万家集利债券发起式 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      | -0.04%   | 0.10%       | 0.32%      | 0.07%         | -0.36% | 0.03% |
| 过去三个月      | 0.38%    | 0.11%       | 1.22%      | 0.09%         | -0.84% | 0.02% |
| 过去六个月      | 1.97%    | 0.14%       | 2.50%      | 0.10%         | -0.53% | 0.04% |
| 过去一年       | -0.51%   | 0.14%       | 2.23%      | 0.10%         | -2.74% | 0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.49%   | 0.14%       | 2.23%      | 0.10%         | -2.72% | 0.04% |

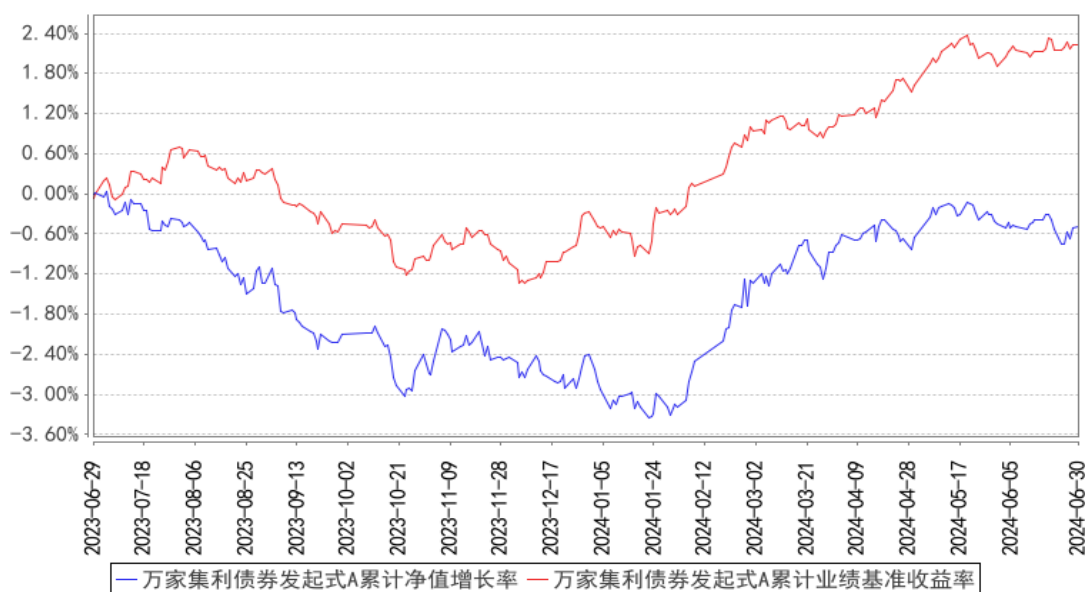
万家集利债券发起式 C

| 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 | -0.07%   | 0.10%       | 0.32%      | 0.07%         | -0.39% | 0.03% |
| 过去三个月 | 0.28%    | 0.11%       | 1.22%      | 0.09%         | -0.94% | 0.02% |
| 过去六个月 | 1.77%    | 0.14%       | 2.50%      | 0.10%         | -0.73% | 0.04% |

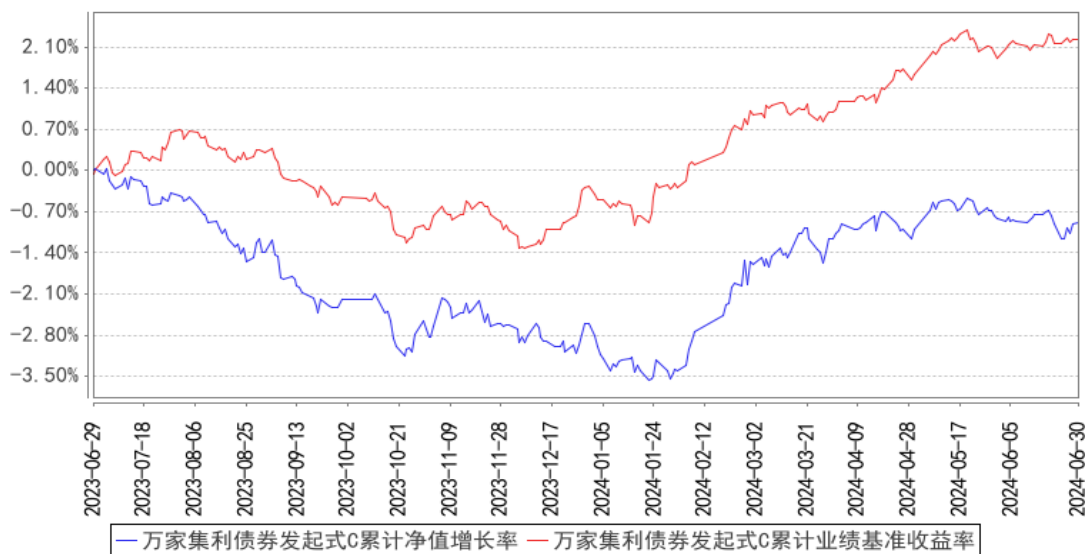
|            |        |       |       |       |        |       |
|------------|--------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 过去一年       | -0.91% | 0.14% | 2.23% | 0.10% | -3.14% | 0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.89% | 0.14% | 2.23% | 0.10% | -3.12% | 0.04% |

### 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

万家集利债券发起式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



万家集利债券发起式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 2023 年 6 月 29 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 |        |  |
| 杨若愚 | 万家民瑞祥和 6 个月持有期债券型证券投资基金、万家集利债券型发起式证券投资基金的基 | 2023 年 6 月 29 日 | -    | 6 年    | 国籍：中国；学历：复旦大学金融专业硕士，2021 年 10 月入职万家基金管理有限公司，现任固定收益部基金经理，历任固定收益部可转债研究员、基金经理助理，曾任融通基金管理有限公司固定收益部研究员等职。 |

|     |  |                 |   |     |   |
|-----|--|-----------------|---|-----|---|
|     | 金经理。   |                 |   |     |   |
| 董一平 | 万家可转债债券型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金、万家锦利债券型发起式证券投资基金、万家集利债券型发起式证券投资基金的基金经理。 | 2023 年 6 月 29 日 | - | 8 年 | 国籍：中国；学历：复旦大学金融专业硕士，2019 年 11 月入职万家基金管理有限公司，现任固定收益部基金经理，历任固定收益部研究员、基金经理助理。曾任鹏华基金管理有限公司稳定收益投资部研究员等职。 |

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

从纯债部分分析,2024 年上半年债券市场收益率整体延续下行趋势,并创下本轮牛市以来新低。年初在股市大幅波动影响下长端利率下行较快,二季度在央行维护收益率曲线形态诉求下长端收益率略有波折,但整体仍以下行为主。本产品纯债部分采用了哑铃型策略,中短端以票息策略为主,长端以交易所超长端利率债进行波段操作,在年初抓住了长端利率的快速下行,对平抑组合净值波动起到了积极效果。

从权益部分分析,2024 年上半年权益市场先跌后涨,整体宽幅震荡,行业分化明显,机构重仓板块如茅指数、宁指数表现较差,而红利板块、上游资源品、出海链表现亮眼,此外以 AI 为代表的 TMT 也出现阶段性行情。本产品权益仓位保持中低配,结构上重点配置了红利、出海、电子 3 个方向。

从转债部分分析,2024 年上半年转债市场基本跟随权益市场先跌后涨,但整体表现不如正股。转债对应正股主要以中小盘为主,在年初跟随小盘股经历了大幅下跌,但在 2 月初至 5 月的反弹过程中涨幅较大,6 月份因评级调整及退市风险对低价低评级转债带来扰动导致上半年转债整体表现不如正股。本产品转债持仓整体保持中性仓位,整体以高评级转债为主,受 6 月份低价转债下跌影响较小。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家集利债券发起式 A 的基金份额净值为 0.9951 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.97%，同期业绩比较基准收益率为 2.50%；截至本报告期末万家集利债券发起式 C 的基金份额净值为 0.9911 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.77%，同期业绩比较基准收益率为 2.50%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于纯债市场，我们认为下半年收益率将以窄幅波动为主：当前货币政策内受经济增长水平和通胀约束，外受海外货币政策掣肘，预计资金面仍将以平稳为主；长端收益率在资产荒背景下易下难上，但需警惕下半年政府债券供给加速以及央行维护曲线形态的扰动。因此纯债部分的策略，我们倾向于维持中等久期，适当博弈波段性交易机会，券种上将以利率债活跃券为主，保持较好流动性。

对于权益市场，我们认为下半年仍以结构性行情为主：权益市场仍处于高赔率阶段，但胜率角度需要等待基本面的配合，目前市场处于资金存量博弈阶段，市场重回上升需要等待政策面与外部流动性等因素的合力。因此权益部分的策略，我们倾向于中性仓位，结构上以高股息、上游周期为主，小仓位参与成长轮动。

对于转债市场，我们认为转债应积极关注做多机会：当前转债估值从多数维度来看处于历史底部附近，但可能受制于权益市场特别是小盘风格情绪偏弱，整体性反弹的难度较大，可以关注有政策催化的主题投资或低位布局机会，重点配置质地较好的平衡、股性转债。

#### 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

本基金为发起式基金，存续期未满三年，不适用本项说明。

## § 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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关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

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、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：万家集利债券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<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                        |                          |
| 货币资金       | 6.4.7.1 | 250,698.18             | 165,554.49               |
| 结算备付金      |         | 56,977.09              | 291,665.60               |
| 存出保证金      |         | 4,364.98               | 3,927.87                 |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 9,577,389.38           | 9,080,766.65             |

|               |            |                           |                             |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 其中：股票投资       |            | 842,263.12                | 1,135,048.86                |
| 基金投资          |            | -                         | -                           |
| 债券投资          |            | 8,735,126.26              | 7,945,717.79                |
| 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    | 100,000.00                | 299,963.54                  |
| 债权投资          |            | -                         | -                           |
| 其中：债券投资       |            | -                         | -                           |
| 资产支持证券投资      |            | -                         | -                           |
| 其他投资          |            | -                         | -                           |
| 其他债权投资        |            | -                         | -                           |
| 其他权益工具投资      |            | -                         | -                           |
| 应收清算款         |            | 21,563.53                 | 12,043.44                   |
| 应收股利          |            | 184.00                    | -                           |
| 应收申购款         |            | 0.99                      | -                           |
| 递延所得税资产       |            | -                         | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                         | -                           |
| 资产总计          |            | 10,011,178.15             | 9,853,921.59                |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2024年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2023年12月31日</b> |
| <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         |            | 67,609.62                 | 74,945.28                   |
| 应付赎回款         |            | -                         | -                           |
| 应付管理人报酬       |            | 4,885.51                  | 4,956.10                    |
| 应付托管费         |            | 814.24                    | 826.03                      |
| 应付销售服务费       |            | 1,625.18                  | 1,650.32                    |
| 应付投资顾问费       |            | -                         | -                           |
| 应交税费          |            | 181.22                    | 50.76                       |
| 应付利润          |            | -                         | -                           |
| 递延所得税负债       |            | -                         | -                           |
| 其他负债          | 6.4.7.6    | 4,169.14                  | 21,506.52                   |
| 负债合计          |            | 79,284.91                 | 103,935.01                  |
| <b>净资产：</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金          | 6.4.7.7    | 10,001,065.27             | 10,001,018.54               |
| 其他综合收益        | 6.4.7.8    | -                         | -                           |
| 未分配利润         | 6.4.7.9    | -69,172.03                | -251,031.96                 |
| 净资产合计         |            | 9,931,893.24              | 9,749,986.58                |
| 负债和净资产总计      |            | 10,011,178.15             | 9,853,921.59                |



注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 10,001,065.27 份，其中万家集利债券发起式 A 基金份额净值 0.9951 元，基金份额总额 5,001,052.26 份；万家集利债券发起式 C 基金份额净值 0.9911 元，基金份额总额 5,000,013.01 份。

## 6.2 利润表

会计主体：万家集利债券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<br>2024 年 1 月 1 日至 2024<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 6 月 29 日（基金<br>合同生效日）至 2023 年<br>6 月 30 日 |
|------------------------|------------|--|---|
| <b>一、营业总收入</b>         |            | 226,008.67                               | 2,300.49  |
| 1. 利息收入                |            | 5,410.40                                 | 194.46  |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.10   | 1,406.64                                 | 194.46  |
| 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             |            | 4,003.76                                 | -   |
| 其他利息收入                 |            | -  | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 222,528.40                               | -285.72   |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.11   | 38,708.29                                | -274.79   |
| 基金投资收益                 |            | -  | -   |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.12   | 169,885.98                               | -10.93  |
| 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   | 13,934.13                                | -   |
| 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   | -1,930.13                                | 2,391.75  |
| 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   | -  | -   |
| <b>减：二、营业总支出</b>       |            | 44,148.55                                | 461.65  |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 29,401.40                                | 164.40  |

|                            |            |            |          |
|----------------------------|------------|------------|----------|
| 其中：暂估管理人报酬                 |            | -          | -        |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 4,900.23   | 27.40    |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 9,784.71   | 54.79    |
| 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                   |            | 62.21      | -        |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.20   | -          | 215.06   |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 181,860.12 | 1,838.84 |
| 减：所得税费用                    |            | -          | -        |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 181,860.12 | 1,838.84 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -          | -        |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | 181,860.12 | 1,838.84 |

注：本基金合同生效日为 2023 年 6 月 29 日，上年度可比期间为 2023 年 6 月 29 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日。

### 6.3 净资产变动表

会计主体：万家集利债券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<br>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            | 10,001,018.54                         | -      | -251,031.96 | 9,749,986.58 |
| 加：会计政策变更             | -                                     | -      | -           | -            |
| 前期差错更正               | -                                     | -      | -           | -            |
| 其他                   | -                                     | -      | -           | -            |
| 二、本期期初净资产            | 10,001,018.54                         | -      | -251,031.96 | 9,749,986.58 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 46.73                                 | -      | 181,859.93  | 181,906.66   |
| （一）、综合收益总额           | -                                     | -      | 181,860.12  | 181,860.12   |

|  |                                |        |            |               |
|--|--------------------------------|--------|------------|---------------|
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数<br>(净资产减少以“-”号填列)  | 46.73                          | -      | -0.19      | 46.54         |
| 其中：1. 基金申购款                              | 46.73                          | -      | -0.19      | 46.54         |
| 2. 基金赎回款                                 | -                              | -      | -          | -             |
| (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                                | 10,001,065.27                  | -      | -69,172.03 | 9,931,893.24  |
| 项目                                       | 上年度可比期间                        |        |            |               |
|  | 2023年6月29日(基金合同生效日)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                                | -                              | -      | -          | -             |
| 加：会计政策变更                                 | -                              | -      | -          | -             |
| 前期差错更正                                   | -                              | -      | -          | -             |
| 其他                                       | -                              | -      | -          | -             |
| 二、本期期初净资产                                | 10,001,018.54                  | -      | -          | 10,001,018.54 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -                              | -      | 1,838.84   | 1,838.84      |
| (一)、综合收益总额                               | -                              | -      | 1,838.84   | 1,838.84      |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数<br>(净资产减少以“-”号填列)  | -                              | -      | -          | -             |
| 其中：1. 基金申购款                              | -                              | -      | -          | -             |

|  |               |   |          |               |
|--|---------------|---|----------|---------------|
| 2. 基金赎回款                                 | -             | - | -        | -             |
| (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                                | 10,001,018.54 | - | 1,838.84 | 10,002,857.38 |

注：本基金合同生效日为 2023 年 6 月 29 日，上年度可比期间为 2023 年 6 月 29 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日。

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

万家集利债券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[2023]1269 号文《关于准予万家集利债券型发起式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 6 月 27 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 ZA31580 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 6 月 29 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 10,001,018.54 元，折合 10,001,018.54 份基金份额，有效认购资金在基金验资确认日之前未产生利息。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，基金托管人为平安银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板以及其他中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的证券公司短期公司债、政府支持机

构债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。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：中债新综合指数（全价）收益率×90%+沪深 300 指数收益率×5%+恒生指数收益率×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<br>2024 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 250,698.18             |
| 等于：本金          | 250,666.54             |
| 加：应计利息         | 31.64                  |
| 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             | 250,698.18             |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |      |            |            |
|----|------------------------|------|------------|------------|
|    | 成本                     | 应计利息 | 公允价值       | 公允价值变动     |
| 股票 | 862,518.84             | -    | 842,263.12 | -20,255.72 |



|               |              |              |              |              |
|---------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -            | -            | -            | -            |
| 债券            | 交易所市场        | 8,615,794.57 | 90,573.26    | 8,735,126.26 |
|               | 银行间市场        | -            | -            | -            |
|               | 合计           | 8,615,794.57 | 90,573.26    | 8,735,126.26 |
| 资产支持证券        | -            | -            | -            | -            |
| 基金            | -            | -            | -            | -            |
| 其他            | -            | -            | -            | -            |
| 合计            | 9,478,313.41 | 90,573.26    | 9,577,389.38 | 8,502.71     |

#### 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

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2024年6月30日 |           |
|-------|-------------------|-----------|
|       | 账面余额              | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 100,000.00        | -         |
| 银行间市场 | -                 | -         |
| 合计    | 100,000.00        | -         |

##### 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<br>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      | 4,169.14          |
| 其中：交易所市场    | 4,169.14          |
| 银行间市场       | -                 |
| 应付利息        | -                 |
| 合计          | 4,169.14          |

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

万家集利债券发起式 A

| 项目            | 本期<br>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          | 5,001,006.54                          | 5,001,006.54 |
| 本期申购          | 45.72                                 | 45.72        |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -            |
| 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           | 5,001,052.26                          | 5,001,052.26 |

万家集利债券发起式 C

| 项目            | 本期<br>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          | 5,000,012.00                          | 5,000,012.00 |
| 本期申购          | 1.01                                  | 1.01         |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -            |
| 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           | 5,000,013.01                          | 5,000,013.01 |

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

万家集利债券发起式 A

| 项目             | 已实现部分       | 未实现部分    | 未分配利润合计     |
|----------------|-------------|----------|-------------|
| 上年度末           | -125,829.51 | 5,243.43 | -120,586.08 |
| 加：会计政策变更       | -           | -        | -           |
| 前期差错更正         | -           | -        | -           |
| 其他             | -           | -        | -           |
| 本期期初           | -125,829.51 | 5,243.43 | -120,586.08 |
| 本期利润           | 96,944.91   | -975.29  | 95,969.62   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -0.31       | 0.13     | -0.18       |
| 其中：基金申购款       | -0.31       | 0.13     | -0.18       |
| 基金赎回款          | -           | -        | -           |
| 本期已分配利润        | -           | -        | -           |

|     |            |          |            |
|-----|------------|----------|------------|
| 本期末 | -28,884.91 | 4,268.27 | -24,616.64 |
|-----|------------|----------|------------|

万家集利债券发起式 C

| 项目             | 已实现部分       | 未实现部分    | 未分配利润合计     |
|----------------|-------------|----------|-------------|
| 上年度末           | -135,635.29 | 5,189.41 | -130,445.88 |
| 加：会计政策变更       | -           | -        | -           |
| 前期差错更正         | -           | -        | -           |
| 其他             | -           | -        | -           |
| 本期期初           | -135,635.29 | 5,189.41 | -130,445.88 |
| 本期利润           | 86,845.34   | -954.84  | 85,890.50   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -0.01       | -        | -0.01       |
| 其中：基金申购款       | -0.01       | -        | -0.01       |
| 基金赎回款          | -           | -        | -           |
| 本期已分配利润        | -           | -        | -           |
| 本期末            | -48,789.96  | 4,234.57 | -44,555.39  |

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  | 475.83               |
| 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 | 895.26               |
| 其他        | 35.55                |
| 合计        | 1,406.64             |

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 | 38,708.29            |
| 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               | 38,708.29            |

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 | 6,659,479.09         |

|            |              |
|------------|--------------|
| 减：卖出股票成本总额 | 6,605,427.38 |
| 减：交易费用     | 15,343.42    |
| 买卖股票差价收入   | 38,708.29    |

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 94,158.22                  |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 75,727.76                  |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | -                          |
| 债券投资收益——申购差价收入               | -                          |
| 合计                           | 169,885.98                 |

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 13,872,003.64              |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 13,699,114.79              |
| 减：应计利息总额               | 96,687.88                  |
| 减：交易费用                 | 473.21                     |
| 买卖债券差价收入               | 75,727.76                  |

#### 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<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 13,934.13                  |
| 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          | 13,934.13 |

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | -1,930.13                  |
| 股票投资                   | -23,596.00                 |
| 债券投资                   | 21,665.87                  |
| 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                     | -1,930.13                  |

#### 6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 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

本基金本报告期无其他费用。

#### 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 |
| 平安银行股份有限公司(“平安银行”) | 基金托管人        |

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

##### 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<br>2024年1月1日至2024年6月30日 | 上年度可比期间<br>2023年6月29日(基金合同生效日)至2023年6月30日 |
|------------------|----------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 29,401.40                  | 164.40                                    |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | -                          | -   |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 29,401.40                  | 164.40                                    |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月月初5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至

最近可支付日支付。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 6 月 29 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,900.23                              | 27.40  |

注：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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月月初 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 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<br>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                                     |                |          |
|                | 万家集利债券发起式<br>A                                       | 万家集利债券发起式<br>C | 合计       |
| 万家基金           | -  | 9,784.71       | 9,784.71 |
| 合计             | -  | 9,784.71       | 9,784.71 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2023 年 6 月 29 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |                |          |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                                     |                |          |
|                | 万家集利债券发起式<br>A                                       | 万家集利债券发起式<br>C | 合计       |
| 万家基金           | -  | 54.79          | 54.79    |
| 合计             | -  | 54.79          | 54.79    |

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%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对

该项费用的列支情况作专项说明。

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。销售服务费的计算方法如下：

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

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

C 类基金份额销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月月初 5 个工作日内从基金财产中一次性付给各销售机构，或一次性支付给基金管理人并由基金管理人代付给各基金销售机构。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 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<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |              |
|---------------------------------|---------------------------------------|--------------|
|                                 | 万家集利债券发起式 A                           | 万家集利债券发起式 C  |
| 基金合同生效日(2023 年 6 月 29 日)持有的基金份额 | -                                     | -            |
| 报告期初持有的基金份额                     | 5,000,000.00                          | 5,000,000.00 |



|                            |   |              |
|----------------------------|---|--------------|
| 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                | 5,000,000.00                              | 5,000,000.00 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例        | 99.9790%                                  | 99.9997%     |
| 项目                         | 上年度可比期间<br>2023年6月29日(基金合同生效日)至2023年6月30日 |              |
|                            | 万家集利债券发起式 A                               | 万家集利债券发起式 C  |
| 基金合同生效日(2023年6月29日)持有的基金份额 | 5,000,000.00                              | 5,000,000.00 |
| 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                | 5,000,000.00                              | 5,000,000.00 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例        | 99.9799%                                  | 99.9998%     |

**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<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |        | 上年度可比期间<br>2023年6月29日(基金合同生效日)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 |
| 平安银行  | 250,698.18                 | 475.83 | 10,001,213.00                             | 194.46 |

注: 本基金的银行存款由基金托管人平安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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

##### 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。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                      | -                        |
| A-1 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 1,018,190.41           | 608,518.36               |
| 合计     | 1,018,190.41           | 608,518.36               |

注：未评级债券包括国债。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 269,552.14             | 787,599.56               |
| AAA 以下 | 851,282.73             | 521,770.08               |
| 未评级    | 6,596,100.98           | 6,027,829.79             |
| 合计     | 7,716,935.85           | 7,337,199.43             |

注：未评级债券包括国债。

#### 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<br>期<br>末<br>202<br>4年<br>6月<br>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                                  | 250,698.18 | -     | -      | -    | -    | -   | 250,698.18 |
| 结                                     | 56,977.09  | -     | -      | -    | -    | -   | 56,977.09  |

|                                      |            |            |              |              |              |            |               |
|--------------------------------------|------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|---------------|
| 算<br>备<br>付<br>金                     |            |            |              |              |              |            |               |
| 存<br>出<br>保<br>证<br>金                | 4,364.98   | -          | -            | -            | -            | -          | 4,364.98      |
| 交<br>易<br>性<br>金<br>融<br>资<br>产      | 153,487.85 | 140,381.55 | 4,076,243.38 | 2,278,786.22 | 2,086,227.26 | 842,263.12 | 9,577,389.38  |
| 买<br>入<br>返<br>售<br>金<br>融<br>资<br>产 | 100,000.00 | -          | -            | -            | -            | -          | 100,000.00    |
| 应<br>收<br>股<br>利                     | -          | -          | -            | -            | -            | 184.00     | 184.00        |
| 应<br>收<br>申<br>购<br>款                | 0.99       | -          | -            | -            | -            | -          | 0.99          |
| 应<br>收<br>清<br>算<br>款                | -          | -          | -            | -            | -            | 21,563.53  | 21,563.53     |
| 资<br>产<br>总<br>计                     | 565,529.09 | 140,381.55 | 4,076,243.38 | 2,278,786.22 | 2,086,227.26 | 864,010.65 | 10,011,178.15 |
| 负<br>债                               |            |            |              |              |              |            |               |
| 应                                    | -          | -          | -            | -            | -            | 4,885.51   | 4,885.51      |

|                                 |            |            |              |              |              |            |              |
|---------------------------------|------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|--------------|
| 付<br>管<br>理<br>人<br>报<br>酬      |            |            |              |              |              |            |              |
| 应<br>付<br>托<br>管<br>费           | -          | -          | -            | -            | -            | 814.24     | 814.24       |
| 应<br>付<br>清<br>算<br>款           | -          | -          | -            | -            | -            | 67,609.62  | 67,609.62    |
| 应<br>付<br>销<br>售<br>服<br>务<br>费 | -          | -          | -            | -            | -            | 1,625.18   | 1,625.18     |
| 应<br>交<br>税<br>费                | -          | -          | -            | -            | -            | 181.22     | 181.22       |
| 其<br>他<br>负<br>债                | -          | -          | -            | -            | -            | 4,169.14   | 4,169.14     |
| 负<br>债<br>总<br>计                | -          | -          | -            | -            | -            | 79,284.91  | 79,284.91    |
| 利<br>率<br>敏<br>感<br>度<br>缺<br>口 | 565,529.09 | 140,381.55 | 4,076,243.38 | 2,278,786.22 | 2,086,227.26 | 784,725.74 | 9,931,893.24 |
| 上<br>年<br>度                     | 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           |

|                                      |            |           |              |              |              |              |              |
|--------------------------------------|------------|-----------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| 末<br>202<br>3年<br>12<br>月<br>31<br>日 |            |           |              |              |              |              |              |
| 资产                                   |            |           |              |              |              |              |              |
| 货币<br>资金                             | 165,554.49 | -         | -            | -            | -            | -            | 165,554.49   |
| 结算<br>备付<br>金                        | 291,665.60 | -         | -            | -            | -            | -            | 291,665.60   |
| 存出<br>保证<br>金                        | 3,927.87   | -         | -            | -            | -            | -            | 3,927.87     |
| 交易<br>性金<br>融资<br>产                  | -          | 38,880.12 | 3,784,402.32 | 3,050,618.36 | 1,071,816.99 | 1,135,048.86 | 9,080,766.65 |
| 买入<br>返售<br>金融<br>资产                 | 299,963.54 | -         | -            | -            | -            | -            | 299,963.54   |
| 应收<br>清算<br>款                        | -          | -         | -            | -            | -            | 12,043.44    | 12,043.44    |
| 资产                                   | 761,111.50 | 38,880.12 | 3,784,402.32 | 3,050,618.36 | 1,071,816.99 | 1,147,092.30 | 9,853,921.59 |

|         |            |           |              |              |              |              |              |
|---------|------------|-----------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| 总计      |            |           |              |              |              |              |              |
| 负债      |            |           |              |              |              |              |              |
| 应付管理人报酬 | -          | -         | -            | -            | -            | 4,956.10     | 4,956.10     |
| 应付托管费   | -          | -         | -            | -            | -            | 826.03       | 826.03       |
| 应付清算款   | -          | -         | -            | -            | -            | 74,945.28    | 74,945.28    |
| 应付销售服务费 | -          | -         | -            | -            | -            | 1,650.32     | 1,650.32     |
| 应交税费    | -          | -         | -            | -            | -            | 50.76        | 50.76        |
| 其他负债    | -          | -         | -            | -            | -            | 21,506.52    | 21,506.52    |
| 负债总计    | -          | -         | -            | -            | -            | 103,935.01   | 103,935.01   |
| 利率敏感度   | 761,111.50 | 38,880.12 | 3,784,402.32 | 3,050,618.36 | 1,071,816.99 | 1,043,157.29 | 9,749,986.58 |



|    |  |  |  |  |  |  |  |
|----|--|--|--|--|--|--|--|
| 缺口 |  |  |  |  |  |  |  |
|----|--|--|--|--|--|--|--|

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

| 假设               | 除市场利率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） |
|                  | 1. 市场利率下降 25 个基点   | 91,478.08                   | 81,730.99         |
| 2. 市场利率上升 25 个基点 | -90,071.28         | -78,338.52                  |                   |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控，并通过外汇远期投资交易对上述外汇风险进行管理。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目                 | 本期末<br>2024年6月30日 |            |            |            |
|--------------------|-------------------|------------|------------|------------|
|                    | 美元折合人民币元          | 港币折合人民币元   | 其他币种折合人民币元 | 合计         |
| 以外币计价的资产           |                   |            |            |            |
| 交易性金融资产            | -                 | 211,696.12 | -          | 211,696.12 |
| 资产合计               | -                 | 211,696.12 | -          | 211,696.12 |
| 以外币计价的负债           |                   |            |            |            |
| 负债合计               | -                 | -          | -          | -          |
| 资产负债表外<br>外汇风险敞口净额 | -                 | 211,696.12 | -          | 211,696.12 |

| 项目                    | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |              |                |           |
|-----------------------|--------------------------|--------------|----------------|-----------|
|                       | 美元<br>折合人民币<br>元         | 港币<br>折合人民币元 | 其他币种<br>折合人民币元 | 合计        |
| 以外币计价的<br>资产          |                          |              |                |           |
| 交易性金融资产               | -                        | 79,819.86    | -              | 79,819.86 |
| 资产合计                  | -                        | 79,819.86    | -              | 79,819.86 |
| 以外币计价的<br>负债          |                          |              |                |           |
| 负债合计                  | -                        | -            | -              | -         |
| 资产负债表外<br>汇风险敞口净<br>额 | -                        | 79,819.86    | -              | 79,819.86 |

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除汇率以外的其他市场变量保持不变 |                                 |                           |
|----|------------------|---------------------------------|---------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变<br>动    | 对资产负债表日基金资产净值的<br>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<br>31 日） |
|    | 港币相对人民币升值 5%     | 10,594.01                       | 3,990.99                  |
|    | 港币相对人民币贬值 5%     | -10,594.01                      | -3,990.99                 |

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>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  | 842,263.12 | 8.48          | 1,135,048.86 | 11.64         |
| 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            | 842,263.12 | 8.48          | 1,135,048.86 | 11.64         |

#### 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) |
|    | 2. 股票基准指数上升 100 个基点  | 8,753.22                      | 11,843.10               |
|    | 1. 股票基准指数下降 100 个基点  | -8,753.22                     | -11,843.10              |

#### 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<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
|               |                        |                          |

|      |              |              |
|------|--------------|--------------|
| 第一层次 | 1,963,097.99 | 1,934,643.43 |
| 第二层次 | 7,614,291.39 | 7,146,123.22 |
| 第三层次 | -            | -            |
| 合计   | 9,577,389.38 | 9,080,766.65 |

#### 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              | 842,263.12   | 8.41          |
|    | 其中：股票             | 842,263.12   | 8.41          |
| 2  | 基金投资              | -            | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 8,735,126.26 | 87.25         |
|    | 其中：债券             | 8,735,126.26 | 87.25         |
|    | 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          | 100,000.00   | 1.00          |
|    | 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 | 307,675.27    | 3.07   |
| 8 | 其他各项资产       | 26,113.50     | 0.26   |
| 9 | 合计           | 10,011,178.15 | 100.00 |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 211,696.12 元，占净值比例 2.13%。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -          | -            |
| B  | 采矿业              | 199,040.00 | 2.00         |
| C  | 制造业              | 242,507.00 | 2.44         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 110,860.00 | 1.12         |
| E  | 建筑业              | -          | -            |
| F  | 批发和零售业           | -          | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 78,160.00  | 0.79         |
| 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               | 630,567.00 | 6.35         |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别  | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|-------|-----------|--------------|
| 材料    | -         | -            |
| 可选消费品 | 36,689.74 | 0.37         |
| 必需消费品 | -         | -            |
| 能源    | -         | -            |
| 金融    | 22,835.25 | 0.23         |
| 医疗保健  | -         | -            |
| 工业    | -         | -            |

|      |            |      |
|------|------------|------|
| 信息技术 | 50,206.52  | 0.51 |
| 通信服务 | 101,964.61 | 1.03 |
| 公用事业 | -          | -    |
| 房地产  | -          | -    |
| 合计   | 211,696.12 | 2.13 |

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称   | 数量（股） | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|-------|------------|--------------|
| 1  | 00700  | 腾讯控股   | 300   | 101,964.61 | 1.03         |
| 2  | 600900 | 长江电力   | 3,000 | 86,760.00  | 0.87         |
| 3  | 601899 | 紫金矿业   | 4,000 | 70,280.00  | 0.71         |
| 4  | 600233 | 圆通速递   | 4,000 | 62,600.00  | 0.63         |
| 5  | 601138 | 工业富联   | 2,000 | 54,800.00  | 0.55         |
| 6  | 601225 | 陕西煤业   | 2,000 | 51,540.00  | 0.52         |
| 7  | 002594 | 比亚迪    | 200   | 50,050.00  | 0.50         |
| 8  | 600256 | 广汇能源   | 6,000 | 40,200.00  | 0.40         |
| 9  | 09863  | 零跑汽车   | 1,500 | 36,689.74  | 0.37         |
| 10 | 300394 | 天孚通信   | 400   | 35,368.00  | 0.36         |
| 11 | 002371 | 北方华创   | 100   | 31,989.00  | 0.32         |
| 12 | 01810  | 小米集团-W | 2,000 | 30,081.93  | 0.30         |
| 13 | 688608 | 恒玄科技   | 200   | 29,276.00  | 0.29         |
| 14 | 600163 | 中闽能源   | 5,000 | 24,100.00  | 0.24         |
| 15 | 00388  | 香港交易所  | 100   | 22,835.25  | 0.23         |
| 16 | 601666 | 平煤股份   | 2,000 | 22,400.00  | 0.23         |
| 17 | 002463 | 沪电股份   | 600   | 21,900.00  | 0.22         |
| 18 | 01347  | 华虹半导体  | 1,000 | 20,124.59  | 0.20         |
| 19 | 603986 | 兆易创新   | 200   | 19,124.00  | 0.19         |
| 20 | 600575 | 淮河能源   | 4,000 | 15,560.00  | 0.16         |
| 21 | 600546 | 山煤国际   | 1,000 | 14,620.00  | 0.15         |

### 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  | 600900 | 长江电力   | 262,682.00 | 2.69           |
| 2  | 600036 | 招商银行   | 181,605.00 | 1.86           |
| 3  | 00700  | 腾讯控股   | 159,533.74 | 1.64           |
| 4  | 601899 | 紫金矿业   | 156,898.00 | 1.61           |
| 5  | 02015  | 理想汽车-W | 130,083.16 | 1.33           |
| 6  | 00688  | 中国海外发展 | 124,425.42 | 1.28           |
| 7  | 002371 | 北方华创   | 113,315.00 | 1.16           |
| 8  | 002594 | 比亚迪    | 111,188.00 | 1.14           |

|    |        |        |            |      |
|----|--------|--------|------------|------|
| 9  | 600048 | 保利发展   | 102,270.00 | 1.05 |
| 10 | 603993 | 洛阳钼业   | 101,920.00 | 1.05 |
| 11 | 300394 | 天孚通信   | 99,351.00  | 1.02 |
| 12 | 600233 | 圆通速递   | 92,925.00  | 0.95 |
| 13 | 600575 | 淮河能源   | 89,700.00  | 0.92 |
| 14 | 601225 | 陕西煤业   | 88,550.00  | 0.91 |
| 15 | 300308 | 中际旭创   | 87,415.00  | 0.90 |
| 16 | 603871 | 嘉友国际   | 79,340.00  | 0.81 |
| 17 | 00883  | 中国海洋石油 | 75,668.92  | 0.78 |
| 18 | 000333 | 美的集团   | 72,174.00  | 0.74 |
| 19 | 688408 | 中信博    | 66,636.00  | 0.68 |
| 20 | 600894 | 广日股份   | 65,690.00  | 0.67 |

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  | 600036 | 招商银行   | 182,360.00 | 1.87           |
| 2  | 600900 | 长江电力   | 178,946.00 | 1.84           |
| 3  | 00700  | 腾讯控股   | 144,998.58 | 1.49           |
| 4  | 02015  | 理想汽车-W | 140,208.98 | 1.44           |
| 5  | 603993 | 洛阳钼业   | 136,610.00 | 1.40           |
| 6  | 002371 | 北方华创   | 135,673.00 | 1.39           |
| 7  | 00688  | 中国海外发展 | 130,243.35 | 1.34           |
| 8  | 600048 | 保利发展   | 117,330.00 | 1.20           |
| 9  | 601899 | 紫金矿业   | 102,405.00 | 1.05           |
| 10 | 300394 | 天孚通信   | 101,517.00 | 1.04           |
| 11 | 600600 | 青岛啤酒   | 93,925.00  | 0.96           |
| 12 | 300308 | 中际旭创   | 91,211.00  | 0.94           |
| 13 | 603871 | 嘉友国际   | 90,247.00  | 0.93           |
| 14 | 00883  | 中国海洋石油 | 83,654.71  | 0.86           |
| 15 | 600760 | 中航沈飞   | 78,224.00  | 0.80           |
| 16 | 603659 | 璞泰来    | 77,107.00  | 0.79           |
| 17 | 600575 | 淮河能源   | 74,750.00  | 0.77           |
| 18 | 301030 | 仕净科技   | 72,950.00  | 0.75           |
| 19 | 000333 | 美的集团   | 71,782.00  | 0.74           |
| 20 | 300750 | 宁德时代   | 68,335.00  | 0.70           |

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 | 6,336,237.64 |
| 卖出股票收入(成交)总额 | 6,659,479.09 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值         | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|--------------|---------------|
| 1  | 国家债券      | 7,614,291.39 | 76.67         |
| 2  | 央行票据      | -            | -             |
| 3  | 金融债券      | -            | -             |
|    | 其中：政策性金融债 | -            | -             |
| 4  | 企业债券      | -            | -             |
| 5  | 企业短期融资券   | -            | -             |
| 6  | 中期票据      | -            | -             |
| 7  | 可转债（可交换债） | 1,120,834.87 | 11.29         |
| 8  | 同业存单      | -            | -             |
| 9  | 其他        | -            | -             |
| 10 | 合计        | 8,735,126.26 | 87.95         |

### 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）  | 公允价值         | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|----------|--------|--------------|---------------|
| 1  | 019693 | 22 国债 28 | 12,000 | 1,218,834.08 | 12.27         |
| 2  | 019725 | 23 国债 22 | 11,000 | 1,146,413.97 | 11.54         |
| 3  | 019728 | 23 国债 25 | 11,000 | 1,132,372.25 | 11.40         |
| 4  | 019735 | 24 国债 04 | 10,000 | 1,018,312.33 | 10.25         |
| 5  | 019727 | 23 国债 24 | 10,000 | 1,018,190.41 | 10.25         |

### 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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金按照风险管理原则、以套期保值为目的，参与国债期货交易。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。



### 7.10.2 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。

### 7.11 投资组合报告附注

#### 7.11.1 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。

#### 7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

#### 7.11.3 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 | 4,364.98  |
| 2  | 应收清算款 | 21,563.53 |
| 3  | 应收股利  | 184.00    |
| 4  | 应收利息  | -         |
| 5  | 应收申购款 | 0.99      |
| 6  | 其他应收款 | -         |
| 7  | 待摊费用  | -         |
| 8  | 其他    | -         |
| 9  | 合计    | 26,113.50 |

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称    | 公允价值       | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|---------|------------|---------------|
| 1  | 113044 | 大秦转债    | 120,265.10 | 1.21          |
| 2  | 127045 | 牧原转债    | 118,349.34 | 1.19          |
| 3  | 127027 | 能化转债    | 102,805.92 | 1.04          |
| 4  | 128136 | 立讯转债    | 91,359.23  | 0.92          |
| 5  | 110048 | 福能转债    | 85,681.21  | 0.86          |
| 6  | 128122 | 兴森转债    | 74,848.60  | 0.75          |
| 7  | 113066 | 平煤转债    | 60,033.52  | 0.60          |
| 8  | 113672 | 福蓉转债    | 53,923.53  | 0.54          |
| 9  | 128137 | 洁美转债    | 46,894.30  | 0.47          |
| 10 | 113616 | 韦尔转债    | 44,907.29  | 0.45          |
| 11 | 127026 | 超声转债    | 44,725.59  | 0.45          |
| 12 | 123115 | 捷捷转债    | 44,294.25  | 0.45          |
| 13 | 127085 | 韵达转债    | 44,040.41  | 0.44          |
| 14 | 110085 | 通 22 转债 | 42,306.81  | 0.43          |
| 15 | 110077 | 洪城转债    | 42,154.20  | 0.42          |

|    |        |         |           |      |
|----|--------|---------|-----------|------|
| 16 | 113067 | 燃 23 转债 | 24,715.72 | 0.25 |
| 17 | 123078 | 飞凯转债    | 22,682.03 | 0.23 |
| 18 | 113043 | 财通转债    | 22,230.99 | 0.22 |
| 19 | 118043 | 福立转债    | 22,032.21 | 0.22 |
| 20 | 113667 | 春 23 转债 | 12,584.62 | 0.13 |

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 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 (%) |
| 万家集利债券发起式 A | 5         | 1,000,210.45 | 5,000,000.00  | 99.98      | 1,052.26 | 0.02       |
| 万家集利债券发起式 C | 4         | 1,250,003.25 | 5,000,000.00  | 100.00     | 13.01    | 0.00       |
| 合计          | 6         | 1,666,844.21 | 10,000,000.00 | 99.99      | 1,065.27 | 0.01       |

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 | 万家集利债券发起式 A | 1,005.55   | 0.0201       |
|                  | 万家集利债券发起式 C | 10.00      | 0.0002       |
|                  | 合计          | 1,015.55   | 0.0102       |

### 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 | 万家集利债券发起式 A | 0                 |
|                                | 万家集利债券发起式 C | 0                 |
|                                | 合计          | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 万家集利债券发起式 A | 0                 |
|                                | 万家集利债券发起式 C | 0                 |
|                                | 合计          | 0                 |

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数        | 持有份额占基金总份额比例 (%) | 发起份额总数        | 发起份额占基金总份额比例 (%) | 发起份额承诺持有期限       |
|-------------|---------------|------------------|---------------|------------------|------------------|
| 基金管理人固有资金   | 10,000,000.00 | 99.99            | 10,000,000.00 | 99.99            | 自基金合同生效日起不少于 3 年 |
| 基金管理人高级管理人员 | -             | -                | -             | -                | -                |
| 基金经理等人员     | -             | -                | -             | -                | -                |
| 基金管理人股东     | -             | -                | -             | -                | -                |
| 其他          | -             | -                | -             | -                | -                |
| 合计          | 10,000,000.00 | 99.99            | 10,000,000.00 | 99.99            | 自基金合同生效日起不少于 3 年 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                     | 万家集利债券发起式 A  | 万家集利债券发起式 C  |
|--|--------------|--------------|
| 基金合同生效日<br>(2023 年 6 月 29 日)<br>基金份额总额 | 5,001,006.54 | 5,000,012.00 |
| 本报告期期初基金份额总额                           | 5,001,006.54 | 5,000,012.00 |
| 本报告期基金总申购份额                            | 45.72        | 1.01         |
| 减：本报告期基金总赎回份额                          | -            | -            |

|              |              |              |
|--------------|--------------|--------------|
| 本报告期基金拆分变动份额 | -            | -            |
| 本报告期期末基金份额总额 | 5,001,052.26 | 5,000,013.01 |

## § 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受到稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 交易单元数量 | 股票交易          |                  | 应支付该券商的佣金 |                | 备注 |
|--------|--------|---------------|------------------|-----------|----------------|----|
|        |        | 成交金额          | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| 中银国际证券 | 2      | 12,995,716.73 | 100.00           | 9,776.07  | 100.00         | -  |

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：

无。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 债券交易          |                  | 债券回购交易        |                    | 权证交易 |                  |
|--------|---------------|------------------|---------------|--------------------|------|------------------|
|        | 成交金额          | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额          | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) |
| 中银国际证券 | 27,747,249.87 | 100.00           | 42,500,000.00 | 100.00             | -    | -                |

### 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旗下基金季度报告提示性公告                          | 指定媒介   | 2024 年 1 月 19 日 |
| 2  | 万家集利债券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 |
| 3  | 关于增加利得基金为万家基金旗下部分基金销售机构并开通定投业务及参加其费率优惠活动的公告      | 指定媒介   | 2024 年 1 月 26 日 |
| 4  | 万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增盈米基金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 30 日 |
| 5  | 万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在陆享基金开通申购、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 2 月 29 日 |
| 6  | 万家集利债券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 |
| 7  | 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 |
| 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  | 万家集利债券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华宝证券开通申购、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 |
| 11 | 万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在国信证券开通申购、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招商证券开通申购、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部分基金在东方证券开通申购、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 22 日 |
| 14 | 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 5 月 30 日 |
| 15 | 万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在光大证券开通申购、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 31 日 |
| 16 | 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 6 月 3 日  |
| 17 | 万家集利债券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 27 日 |
| 18 | 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 27 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              | 20240101-20240630       | 10,000,000.00 | -    | -    | 10,000,000.00 | 99.99    |
| 产品特有风险   |                |                         |               |      |      |               |          |
| <p>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。</p> <p>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。</p> |                |                         |               |      |      |               |          |

## § 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、《万家集利债券型发起式证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家集利债券型发起式证券投资基金托管协议》。
- 4、万家集利债券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