

万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资
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：兴业银行股份有限公司

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。

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

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
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	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
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	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54

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	54
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	54
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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 本报告期投资基金情况	55
7.13 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	58
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	58
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.9 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	63
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
§ 12 备查文件目录	63
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	万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	万家兴恒回报一年持有期混合	
基金主代码	014693	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 4 月 15 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	59,243,953.98 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	万家兴恒回报一年持有期混合 A	万家兴恒回报一年持有期混合 C
下属分级基金的交易代码	014693	014694
报告期末下属分级基金的份额总额	39,835,118.59 份	19,408,835.39 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，谋求实现基金财产的长期稳健增值。
投资策略	1、大类资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、可转换债券与可交换债券投资策略；6、证券公司短期公司债券投资策略；7、股指期货投资策略；8、国债期货投资策略；9、股票期权投资策略；10、融资交易策略；11、信用衍生品投资策略；12、基金投资策略。
业绩比较基准	中债新综合指数（全价）收益率×85%+沪深 300 指数收益率×10%+恒生指数收益率×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。 本基金可投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	万家基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑
	联系电话	021-38909626
	电子邮箱	lanj@wjasset.com
客户服务电话	4008880800	95561

传真	021-38909627	021-62159217
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）	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
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）	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码	200122	200120
法定代表人	方一天	吕家进

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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)	
	万家兴恒回报一年持有期混合 A	万家兴恒回报一年持有期混合 C
本期已实现收益	-1,861,323.55	-764,759.32
本期利润	373,505.07	96,435.09
加权平均基金份额本期利润	0.0073	0.0045
本期加权平均净值利润率	0.74%	0.46%
本期基金份额净值增长率	0.79%	0.59%
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	-1,638,741.47	-961,968.82

期末可供分配基金份额利润	-0.0411	-0.0496
期末基金资产净值	39,264,152.76	18,962,183.56
期末基金份额净值	0.9857	0.9770
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	-1.43%	-2.30%

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

万家兴恒回报一年持有期混合 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	-0.20%	0.12%	0.12%	0.08%	-0.32%	0.04%
过去三个月	0.78%	0.11%	1.07%	0.11%	-0.29%	0.00%
过去六个月	0.79%	0.19%	2.45%	0.14%	-1.66%	0.05%
过去一年	-0.05%	0.22%	1.57%	0.14%	-1.62%	0.08%
自基金合同生效起至今	-1.43%	0.23%	1.56%	0.16%	-2.99%	0.07%

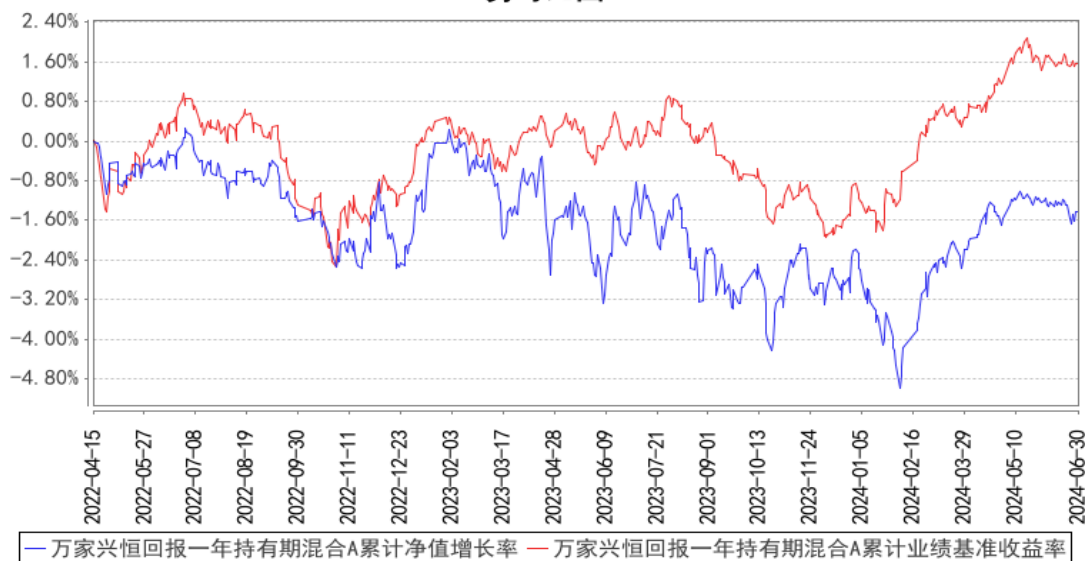
万家兴恒回报一年持有期混合 C

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	-0.23%	0.12%	0.12%	0.08%	-0.35%	0.04%
过去三个月	0.67%	0.11%	1.07%	0.11%	-0.40%	0.00%
过去六个月	0.59%	0.19%	2.45%	0.14%	-1.86%	0.05%

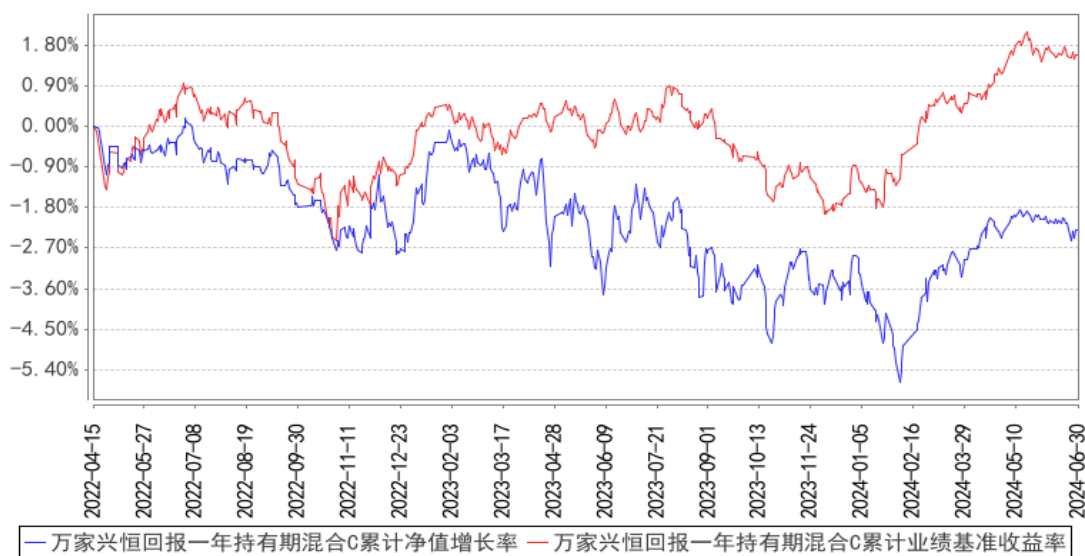
过去一年	-0.46%	0.22%	1.57%	0.14%	-2.03%	0.08%
自基金合同生效起至今	-2.30%	0.23%	1.56%	0.16%	-3.86%	0.07%

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

万家兴恒回报一年持有期混合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



万家兴恒回报一年持有期混合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 2022 年 4 月 15 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		
苏谋东	公司领导 总经理助理；万家信用恒利债券型证券投资基金、万家兴恒回报一年持有期混合型	2022 年 4 月 15 日	-	16 年	国籍：中国；学历：复旦大学经济学硕士，2013 年 3 月入职万家基金管理有限公司，现任公司总经理助理、基金经理，历任固定收益部副总监、固定收益部总监、现金管理部总监。曾任宝钢集团财务有限责任公司资金运用部投资经理等职。

	<p>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、万家民丰回报一年持有期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、万家瑞泽回报一年持有期混合型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>				
<p>张永强</p>	<p>万家兴恒回报一年持有期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、万家惠利债券型证券投资基金、万家招瑞回报一年持有</p>	<p>2024 年 1 月 11 日</p>	<p>-</p>	<p>9 年</p>	<p>国籍：中国；学历：复旦大学基础数学专业硕士，2019 年 7 月入职万家基金管理有限公司，现任量化投资部基金经理，历任量化投资部研究员、投资经理。曾任上海恒生聚源数据服务有限公司研发中心指标算法研究员，上海元普投资管理有限公司量化投资部量化策略研究员，上海寻乾资产管理有限公司量化投资部量化策略研究员，巨杉(上海)资产管理有限公司量化投资部量化策略研究员等职。</p>

	期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、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。				
--	---	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

4.1.3 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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律、法规和监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋取最大利益，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 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

1、债券部分

上半年国内债市表现较好，债券收益率整体震荡下行，各品种、各期限收益率均已经创下或者正在接近历史最低水平。受益于央行货币政策整体宽松取向以及实体经济融资需求不足等情况，银行间市场资金面整体宽松。信用风险整体平稳可控，上半年没有重大信用风险事件暴露。宏观方面，经济内需不足的问题仍然较为突出，且中长期预期有进一步悲观的倾向。上半年本基金继续以高等级银行二级资本债作为主要配置，同时保持较高的杠杆水平，但是考虑到上半年债券收益率已经大幅走低，本基金在收益率下行过程中逐步降低了持仓债券的剩余期限。

2、权益部分

本产品股票部分的投资策略为主动量化选股策略，运用量化选股模型和行业配置策略，来主动适应不同的市场风格，前瞻性选股，提高选股胜率，力争能获得长期稳定的超额收益。万家兴恒的股票投资在行业和风格配置上相对均衡，在量化选股方面精选行业内质优个股组合，持股较为分散。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家兴恒回报一年持有期混合 A 的基金份额净值为 0.9857 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.79%，同期业绩比较基准收益率为 2.45%；截至本报告期末万家兴恒回报一年持有期混合 C 的基金份额净值为 0.9770 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.59%，同期业绩比较基准收益率为 2.45%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

1、债券部分

国内经济结构转型已经进入深水区。短期，受制于传统内需难以有效提振等原因，我们认为国内经济仍将是偏弱格局，预计下半年宏观政策会更加积极一些，但是在经济进入结构转型期的大背景下，宏观经济的弹性并不会很大。因而，我们预计国内利率水平整体仍将是低位震荡格局，

本基金仍然看好高等级信用债，将继续维持高等级二级资本债配置策略，同时关注资金面波动宏观经济以及外部环境的变化。

2、权益部分

2024 年上半年 A 股市场走势一波三折，指数有所分化，大盘指数强于中小盘指数，行业上来看，银行、煤炭、公用事业等防御性行业表现较好。展望后市，当前 A 股估值处于历史较低区间，具有较高的配置性价比；二十届三中全会强调重大改革，注重发挥经济体制改革牵引作用、注重构建支持全面创新体制机制等，这些改革有利于经济长期向好发展；同时 7 月 22 日，为进一步加强逆周期调节，加大金融支持实体经济力度，央行降息，显示稳增长诉求上升，稳增长政策加码有利于经济企稳回升。整体来看，随着资本市场改革有序落地、稳增长进一步发力，投资者信心有望逐步修复，市场机会大于风险。

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合规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	643,449.62	954,317.46
结算备付金		98,383.07	83,302.70
存出保证金		5,796.75	15,377.06
交易性金融资产	6.4.7.2	63,154,722.83	102,757,271.91
其中：股票投资		5,289,244.83	16,609,225.00
基金投资		-	-
债券投资		57,865,478.00	86,148,046.91
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		-	473,273.89
应收股利		-	-
应收申购款		-	9.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		63,902,352.27	104,283,552.94
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		5,301,391.20	20,015,460.12
应付清算款		843.70	-
应付赎回款		88,139.91	9,942.28
应付管理人报酬		38,744.18	65,732.80
应付托管费		7,264.56	12,324.92
应付销售服务费		6,254.04	8,142.79
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	233,378.36	178,233.36
负债合计		5,676,015.95	20,289,836.27
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	59,243,953.98	86,055,194.68
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	-1,017,617.66	-2,061,478.01
净资产合计		58,226,336.32	83,993,716.67
负债和净资产总计		63,902,352.27	104,283,552.94

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 59,243,953.98 份，其中万家兴恒回报一年持有期混合 A 基金份额净值 0.9857 元，基金份额总额 39,835,118.59 份；万家兴恒回报一年持有期混合 C 基金份额净值 0.9770 元，基金份额总额 19,408,835.39 份。

6.2 利润表

会计主体：万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金

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
一、营业总收入		1,083,982.39	2,742,275.49
1. 利息收入		6,669.26	53,827.01
其中：存款利息收入	6.4.7.10	3,558.93	7,032.52
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		3,110.33	46,794.49
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,018,709.90	3,243,745.56
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-3,873,711.50	-101,118.42
基金投资收益	6.4.7.12	-	-167,961.34
债券投资收益	6.4.7.13	1,807,146.48	3,121,930.31
资产支持证券投资	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	47,855.12	390,895.01
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）	6.4.7.18	3,096,023.03	-555,297.08
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-	-
减：二、营业总支出		614,042.23	1,224,494.71
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	283,112.27	734,569.25
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	53,083.56	137,731.73
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	41,645.25	104,464.09
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		134,816.50	145,557.00
其中：卖出回购金融资产支出		134,816.50	145,557.00

6. 信用减值损失	6.4.7.21	-	-
7. 税金及附加		-	2,806.35
8. 其他费用	6.4.7.22	101,384.65	99,366.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		469,940.16	1,517,780.78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		469,940.16	1,517,780.78
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		469,940.16	1,517,780.78

6.3 净资产变动表

会计主体：万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金

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	86,055,194.68	-	-2,061,478.01	83,993,716.67
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	86,055,194.68	-	-2,061,478.01	83,993,716.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-26,811,240.70	-	1,043,860.35	-25,767,380.35
（一）、综合收益总额	-	-	469,940.16	469,940.16
（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）	-26,811,240.70	-	573,920.19	-26,237,320.51
其中：1. 基金申购款	31,385.68	-	-977.02	30,408.66
2. 基金赎回款	-26,842,626.38	-	574,897.21	-26,267,729.17
（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	59,243,953.98	-	-1,017,617.66	58,226,336.32
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	207,661,738.88	-	-4,474,557.85	203,187,181.03
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	207,661,738.88	-	-4,474,557.85	203,187,181.03
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-67,255,440.75	-	2,358,132.82	-64,897,307.93
（一）、综合收益总额	-	-	1,517,780.78	1,517,780.78
（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）	-67,255,440.75	-	840,352.04	-66,415,088.71
其中：1. 基金申购款	28,673.13	-	-442.33	28,230.80
2. 基金赎回款	-67,284,113.88	-	840,794.37	-66,443,319.51
（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	140,406,298.13	-	-2,116,425.03	138,289,873.10

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

万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]3966 号文《关于准予万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由万家基金管理有限公司作为基金管理人于 2022 年 3 月 7 日至 2022 年 4 月 13 日向社会公开募集，募集期结束经立信会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具信会师报字[2022]第 ZA30129 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 2022 年 4 月 15 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 207,391,961.17 元，有效认购资金在基金验资确认日之前产生的利息为人民币 200,262.05 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 207,592,223.22 元，折合 207,592,223.22 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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金的主要投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板以及其他中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（不含 QDII 基金、香港互认基金、基金中基金、货币市场基金和其他投资范围包含基金的公开募集证券投资基金）、港股通标的股票、股指期货、国债期货、股票期权以及债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、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、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：中债新综合指数（全价）收益率×85%+沪深 300 指数收益率×10%+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 2024 年 6 月 30 日
活期存款	643,449.62
等于：本金	643,391.61
加：应计利息	58.01
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	643,449.62

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	5,489,393.81	-	5,289,244.83	-200,148.98	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	15,050,002.18	192,676.16	15,362,676.16	119,997.82
	银行间市场	41,075,636.57	741,901.84	42,502,801.84	685,263.43
	合计	56,125,638.75	934,578.00	57,865,478.00	805,261.25
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	61,615,032.56	934,578.00	63,154,722.83	605,112.27	

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	37,793.76
其中：交易所市场	34,606.60
银行间市场	3,187.16
应付利息	-
预提费用	195,584.60
合计	233,378.36

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

万家兴恒回报一年持有期混合 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	61,345,439.92	61,345,439.92
本期申购	13,714.34	13,714.34
本期赎回（以“-”号填列）	-21,524,035.67	-21,524,035.67
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	39,835,118.59	39,835,118.59

万家兴恒回报一年持有期混合 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	24,709,754.76	24,709,754.76
本期申购	17,671.34	17,671.34
本期赎回（以“-”号填列）	-5,318,590.71	-5,318,590.71
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	19,408,835.39	19,408,835.39

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

万家兴恒回报一年持有期混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-827,107.37	-524,644.25	-1,351,751.62
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-827,107.37	-524,644.25	-1,351,751.62
本期利润	-1,861,323.55	2,234,828.62	373,505.07
本期基金份额交易产生的变动数	1,049,689.45	-642,408.73	407,280.72
其中：基金申购款	-830.07	465.39	-364.68
基金赎回款	1,050,519.52	-642,874.12	407,645.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,638,741.47	1,067,775.64	-570,965.83

万家兴恒回报一年持有期混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-498,070.37	-211,656.02	-709,726.39
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-498,070.37	-211,656.02	-709,726.39
本期利润	-764,759.32	861,194.41	96,435.09
本期基金份额交易产生的变动数	300,860.87	-134,221.40	166,639.47
其中：基金申购款	-1,096.02	483.68	-612.34
基金赎回款	301,956.89	-134,705.08	167,251.81
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-961,968.82	515,316.99	-446,651.83
-----	-------------	------------	-------------

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		2,417.60
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		1,075.35
其他		65.98
合计		3,558.93

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		-3,873,711.50
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		-3,873,711.50

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		47,625,912.49
减：卖出股票成本总额		51,390,257.33
减：交易费用		109,366.66
买卖股票差价收入		-3,873,711.50

6.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
债券投资收益——利息收入		1,032,700.84
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入		774,445.64

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	1,807,146.48

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	62,185,246.85
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	60,363,736.28
减：应计利息总额	1,044,779.93
减：交易费用	2,285.00
买卖债券差价收入	774,445.64

6.4.7.14 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。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.17 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	47,855.12
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	47,855.12

6.4.7.18 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	3,096,023.03
股票投资	2,768,314.05
债券投资	327,708.98
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	3,096,023.03

6.4.7.19 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.20 持有基金产生的费用

本基金本报告期无持有基金产生的费用。

6.4.7.21 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.22 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	15,912.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	7,200.05
账户维护费	18,600.00
合计	101,384.65

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

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
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人、基金销售机构

中泰证券股份有限公司(“中泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
--------------------	-----------------

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	39,842,913.84	46.91	102,036,127.90	76.86

6.4.10.1.2 债券交易

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	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)
中泰证券	400,113.00	7.96	33,739,709.10	59.17

6.4.10.1.3 债券回购交易

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	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)
中泰证券	45,600,000.00	49.30	30,100,000.00	15.65

6.4.10.1.4 基金交易

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	占当期基金成交总额的比例(%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)
中泰证券	-	-	25,066,354.90	68.47

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.1.6 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	37,693.00	47.06	11,963.29	34.57
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	95,027.04	77.31	20,135.64	65.12

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	283,112.27	734,569.25
其中：应支付销售机构的客户维护费	98,482.95	259,553.29
应支付基金管理人的净管理费	184,629.32	475,015.96

注：本基金投资于本基金管理人所管理的其他基金的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有本基金管理人管理的其他基金份额所对应的资产净值后的余额（若为负数，则取0）的0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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扣除前一日所持有本基金管理人管理的其他基金份额所对应的资产净值后的余额，若为负数，则 E 取 0

基金管理费每日计提，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首日起五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	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	53,083.56	137,731.73

注：本基金投资于本基金托管人所托管的其他基金的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有基金托管人托管的其他基金份额所对应的资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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扣除前一日所持有的基金托管人托管的其他基金份额所对应的资产净值后的余额，若为负数，则 E 取 0

基金托管费每日计提，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首日起五个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 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		
	万家兴恒回报一年持有期混合 A	万家兴恒回报一年持有期混合 C	合计
兴业银行	-	21,074.39	21,074.39
中泰证券	-	16,106.45	16,106.45
合计	-	37,180.84	37,180.84
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		
	万家兴恒回报一年持有期混合 A	万家兴恒回报一年持有期混合 C	合计
中泰证券	-	42,857.34	42,857.34
兴业银行	-	53,167.75	53,167.75
合计	-	96,025.09	96,025.09

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，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首日起五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据相关协议支付给各销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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	
	万家兴恒回报一年持有期混合 A	万家兴恒回报一年持有期混合 C
基金合同生效日（2022 年 4 月 15 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	8,499,000.00	-
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	8,499,000.00	-
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	
	万家兴恒回报一年持有期混合 A	万家兴恒回报一年持有期混合 C
基金合同生效日（2022 年 4 月 15 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	25,999,000.00	-
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	25,999,000.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	25.4105%	-

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
兴业银行	643,449.62	2,417.60	876,534.65	4,558.69

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方所承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 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。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

无。

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，本基金因从事证券交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 5,301,391.20 元，将于 2024 年 7 月 2 日、2024 年 7 月 3 日、2024 年 7 月 4 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	4,361,048.22
合计	-	4,361,048.22

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	54,330,902.79	61,573,173.65
AAA 以下	-	-
未评级	3,534,575.21	20,213,825.04
合计	57,865,478.00	81,786,998.69

注：未评级债券包括政策性金融债。

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 期 末 202 4 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	643,449.62	-	-	-	-	-	643,449.62
结	98,383.07	-	-	-	-	-	98,383.07

算备付金							
存出保证金	5,796.75	-	-	-	-	-	5,796.75
交易性金融资产	-	-	8,621,323.70	49,244,154.30	-	5,289,244.83	63,154,722.83
资产总计	747,629.44	-	8,621,323.70	49,244,154.30	-	5,289,244.83	63,902,352.27
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	88,139.91	88,139.91
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	38,744.18	38,744.18
应付托管费	-	-	-	-	-	7,264.56	7,264.56
应付清算款	-	-	-	-	-	843.70	843.70
卖	5,301,391.20	-	-	-	-	-	5,301,391.20

出回购金融资产款							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	6,254.04	6,254.04
其他负债	-	-	-	-	-	233,378.36	233,378.36
负债总计	5,301,391.20	-	-	-	-	374,624.75	5,676,015.95
利率敏感度缺口	-4,553,761.76	-	8,621,323.70	49,244,154.30	-	-4,914,620.08	58,226,336.32
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	954,317.46	-	-	-	-	-	954,317.46

金							
结算备付金	83,302.70	-	-	-	-	-	83,302.70
存出保证金	15,377.06	-	-	-	-	-	15,377.06
交易性金融资产	-	4,361,048.22	66,681,091.68	15,105,907.01	16,609,225.00	102,757,271.91	
应收申购款	-	-	-	-	9.92	9.92	
应收清算款	-	-	-	-	473,273.89	473,273.89	
资产总计	1,052,997.22	4,361,048.22	66,681,091.68	15,105,907.01	17,082,508.81	104,283,552.94	
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	9,942.28	9,942.28	
应付管理人报	-	-	-	-	65,732.80	65,732.80	

酬							
应付托管费						12,324.92	12,324.92
卖出回购金融资产款	20,015,460.12	-	-	-	-	-	20,015,460.12
应付销售服务费						8,142.79	8,142.79
其他负债						178,233.36	178,233.36
负债总计	20,015,460.12	-	-	-	-	274,376.15	20,289,836.27
利率敏感度缺口	-18,962,462.90	4,361,048.22	66,681,091.68	15,105,907.01	16,808,132.66		83,993,716.67

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	259,780.86
2. 市场利率上升 25个基点	-257,977.53	-741,990.44	

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。

本基金主要投资于开放式基金及证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的重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 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	5,289,244.83	9.08	16,609,225.00	19.77
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	5,289,244.83	9.08	16,609,225.00	19.77

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	80,445.05	180,388.98
股票基准指数下降100个基点	-80,445.05	-180,388.98	

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	5,289,244.83	16,609,225.00
第二层次	57,865,478.00	86,148,046.91
第三层次	-	-
合计	63,154,722.83	102,757,271.91

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	5,289,244.83	8.28
	其中：股票	5,289,244.83	8.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	57,865,478.00	90.55
	其中：债券	57,865,478.00	90.55
	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	741,832.69	1.16
8	其他各项资产	5,796.75	0.01
9	合计	63,902,352.27	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	22,400.00	0.04
B	采矿业	727,148.00	1.25
C	制造业	3,847,620.05	6.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供	77,088.00	0.13

	应业		
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	53,143.80	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	41,252.00	0.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	348,971.98	0.60
J	金融业	134,665.00	0.23
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	496.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	9,420.00	0.02
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	27,040.00	0.05
	合计	5,289,244.83	9.08

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

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

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	002897	意华股份	2,300	86,618.00	0.15
2	300394	天孚通信	920	81,346.40	0.14
3	601168	西部矿业	4,500	80,775.00	0.14
4	600015	华夏银行	12,500	80,000.00	0.14
5	601138	工业富联	2,900	79,460.00	0.14
6	000758	中色股份	15,600	79,248.00	0.14
7	000039	中集集团	8,500	78,710.00	0.14
8	300570	太辰光	2,400	78,384.00	0.13
9	002237	恒邦股份	6,800	78,268.00	0.13
10	002340	格林美	12,200	77,714.00	0.13
11	688036	传音控股	1,012	77,458.48	0.13
12	601225	陕西煤业	2,900	74,733.00	0.13
13	300502	新易盛	700	73,885.00	0.13
14	300308	中际旭创	520	71,697.60	0.12
15	603501	韦尔股份	700	69,559.00	0.12
16	000725	京东方 A	16,400	67,076.00	0.12
17	600703	三安光电	5,600	65,632.00	0.11
18	601001	晋控煤业	3,900	64,428.00	0.11

19	603019	中科曙光	1,500	62,250.00	0.11
20	688256	寒武纪	300	59,601.00	0.10
21	600547	山东黄金	2,100	57,498.00	0.10
22	688408	中信博	623	57,365.84	0.10
23	300679	电连技术	1,400	56,322.00	0.10
24	601127	赛力斯	600	54,672.00	0.09
25	600362	江西铜业	2,300	54,464.00	0.09
26	002296	辉煌科技	5,200	53,612.00	0.09
27	688188	柏楚电子	280	51,674.00	0.09
28	688313	仕佳光子	5,410	51,503.20	0.09
29	603496	恒为科技	2,100	51,345.00	0.09
30	300274	阳光电源	800	49,624.00	0.09
31	600482	中国动力	2,400	46,752.00	0.08
32	601699	潞安环能	2,400	43,512.00	0.07
33	002023	海特高新	4,700	43,005.00	0.07
34	603993	洛阳钼业	5,000	42,500.00	0.07
35	689009	九号公司	1,135	41,779.35	0.07
36	300563	神宇股份	1,600	40,720.00	0.07
37	601608	中信重工	10,400	39,624.00	0.07
38	002128	电投能源	1,800	37,980.00	0.07
39	301308	江波龙	400	37,896.00	0.07
40	301205	联特科技	600	37,650.00	0.06
41	603556	海兴电力	800	37,464.00	0.06
42	300529	健帆生物	1,300	35,373.00	0.06
43	600985	淮北矿业	2,100	35,154.00	0.06
44	000830	鲁西化工	3,000	34,770.00	0.06
45	688195	腾景科技	1,400	34,314.00	0.06
46	688525	佰维存储	525	33,678.75	0.06
47	688041	海光信息	473	33,261.36	0.06
48	603629	利通电子	1,800	33,228.00	0.06
49	603587	地素时尚	2,700	33,156.00	0.06
50	688234	天岳先进	700	32,844.00	0.06
51	600916	中国黄金	3,400	32,708.00	0.06
52	300810	中科海讯	2,100	32,151.00	0.06
53	002371	北方华创	100	31,989.00	0.05
54	003015	日久光电	3,400	30,872.00	0.05
55	002318	久立特材	1,300	30,329.00	0.05
56	300916	朗特智能	1,200	30,216.00	0.05
57	002465	海格通信	2,900	30,044.00	0.05
58	601600	中国铝业	3,900	29,757.00	0.05
59	301012	扬电科技	1,200	29,712.00	0.05
60	600938	中国海油	900	29,700.00	0.05
61	002463	沪电股份	800	29,200.00	0.05

62	688516	奥特维	697	29,141.57	0.05
63	600150	中国船舶	700	28,497.00	0.05
64	000063	中兴通讯	1,000	27,970.00	0.05
65	003019	宸展光电	1,100	27,863.00	0.05
66	000983	山西焦煤	2,700	27,837.00	0.05
67	688661	和林微纳	900	27,585.00	0.05
68	002215	诺普信	3,700	27,565.00	0.05
69	000155	川能动力	2,500	26,925.00	0.05
70	002975	博杰股份	900	26,892.00	0.05
71	000166	申万宏源	6,200	26,722.00	0.05
72	600489	中金黄金	1,800	26,640.00	0.05
73	300711	广哈通信	1,700	26,231.00	0.05
74	688123	聚辰股份	425	25,852.75	0.04
75	300476	胜宏科技	800	25,808.00	0.04
76	601169	北京银行	4,400	25,696.00	0.04
77	300433	蓝思科技	1,400	25,550.00	0.04
78	603516	淳中科技	800	25,256.00	0.04
79	605376	博迁新材	1,100	24,827.00	0.04
80	000933	神火股份	1,200	24,276.00	0.04
81	688349	三一重能	944	23,448.96	0.04
82	603897	长城科技	1,300	22,815.00	0.04
83	002281	光迅科技	600	22,422.00	0.04
84	002036	联创电子	3,300	22,275.00	0.04
85	002249	大洋电机	4,700	22,231.00	0.04
86	688662	富信科技	900	21,960.00	0.04
87	000975	山金国际	1,300	21,177.00	0.04
88	603015	弘讯科技	2,800	21,168.00	0.04
88	688609	九联科技	2,400	21,168.00	0.04
89	600990	四创电子	1,200	21,060.00	0.04
90	600256	广汇能源	3,000	20,100.00	0.03
91	688018	乐鑫科技	200	19,736.00	0.03
92	300842	帝科股份	500	19,400.00	0.03
93	000532	华金资本	1,600	19,296.00	0.03
94	600114	东睦股份	1,300	18,707.00	0.03
95	601918	新集能源	1,900	18,525.00	0.03
96	603861	白云电器	2,200	18,414.00	0.03
97	601020	华钰矿业	1,400	17,920.00	0.03
98	000786	北新建材	600	17,796.00	0.03
99	300870	欧陆通	400	17,352.00	0.03
100	601101	昊华能源	1,800	16,542.00	0.03
101	688409	富创精密	444	16,401.36	0.03
102	688472	阿特斯	1,600	16,288.00	0.03
103	002322	理工能科	1,000	16,020.00	0.03

104	300542	新晨科技	1,300	15,977.00	0.03
105	688362	甬矽电子	820	15,957.20	0.03
106	300045	华力创通	900	15,885.00	0.03
107	601038	一拖股份	1,000	15,810.00	0.03
108	601700	风范股份	3,600	15,804.00	0.03
109	688208	道通科技	649	15,666.86	0.03
110	600018	上港集团	2,700	15,606.00	0.03
111	688187	时代电气	313	15,455.94	0.03
112	601877	正泰电器	800	15,248.00	0.03
113	300735	光弘科技	700	15,120.00	0.03
114	000958	电投产融	4,100	15,006.00	0.03
115	601898	中煤能源	1,200	14,976.00	0.03
116	688025	杰普特	369	14,903.91	0.03
117	603628	清源股份	1,200	14,724.00	0.03
118	603212	赛伍技术	1,300	14,352.00	0.02
119	300441	鲍斯股份	2,400	14,232.00	0.02
120	600026	中远海能	900	14,049.00	0.02
121	300005	探路者	2,800	14,028.00	0.02
122	600885	宏发股份	500	13,840.00	0.02
123	300131	英唐智控	3,100	13,795.00	0.02
124	688095	福昕软件	300	13,743.00	0.02
125	600050	中国联通	2,900	13,630.00	0.02
126	300170	汉得信息	2,200	13,508.00	0.02
127	002893	京能热力	1,400	13,244.00	0.02
128	688498	源杰科技	100	13,099.00	0.02
129	002544	普天科技	700	13,083.00	0.02
130	688252	天德钰	890	12,931.70	0.02
131	600219	南山铝业	3,300	12,573.00	0.02
132	600598	北大荒	1,000	12,490.00	0.02
133	000999	华润三九	290	12,348.20	0.02
134	601636	旗滨集团	1,900	12,255.00	0.02
135	600971	恒源煤电	1,000	11,940.00	0.02
136	300233	金城医药	800	11,936.00	0.02
137	688173	希荻微	1,076	11,868.28	0.02
138	688378	奥来德	500	11,730.00	0.02
139	688253	英诺特	307	11,699.77	0.02
140	002298	中电兴发	2,600	11,492.00	0.02
141	600141	兴发集团	600	11,448.00	0.02
142	300857	协创数据	200	11,400.00	0.02
143	002915	中欣氟材	1,100	10,945.00	0.02
144	603890	春秋电子	1,200	10,872.00	0.02
145	300724	捷佳伟创	200	10,802.00	0.02
146	002111	威海广泰	1,000	10,420.00	0.02

147	601975	招商南油	2,900	10,411.00	0.02
148	600803	新奥股份	500	10,400.00	0.02
149	603612	索通发展	800	10,208.00	0.02
150	601633	长城汽车	400	10,120.00	0.02
151	300322	硕贝德	1,200	10,056.00	0.02
152	000738	航发控制	500	10,035.00	0.02
153	002362	汉王科技	600	9,990.00	0.02
154	600602	云赛智联	900	9,936.00	0.02
155	300498	温氏股份	500	9,910.00	0.02
156	603158	腾龙股份	1,400	9,856.00	0.02
157	688685	迈信林	400	9,780.00	0.02
158	688766	普冉股份	100	9,717.00	0.02
159	002264	新华都	1,900	9,709.00	0.02
160	688213	思特威	200	9,700.00	0.02
161	603025	大豪科技	700	9,674.00	0.02
162	002292	奥飞娱乐	1,600	9,568.00	0.02
163	300492	华图山鼎	100	9,420.00	0.02
164	603726	朗迪集团	700	9,380.00	0.02
165	688326	经纬恒润	156	8,943.48	0.02
166	000795	英洛华	1,600	8,864.00	0.02
167	002920	德赛西威	100	8,709.00	0.01
168	600549	厦门钨业	500	8,625.00	0.01
169	002837	英维克	400	8,556.00	0.01
170	600389	江山股份	600	8,466.00	0.01
171	688002	睿创微纳	300	8,391.00	0.01
172	605333	沪光股份	300	8,355.00	0.01
173	600562	国睿科技	600	8,196.00	0.01
174	600186	莲花控股	2,300	7,889.00	0.01
175	688668	鼎通科技	200	7,858.00	0.01
176	600673	东阳光	1,100	7,744.00	0.01
177	300772	运达股份	800	7,680.00	0.01
178	603299	苏盐井神	800	7,600.00	0.01
179	002019	亿帆医药	600	7,416.00	0.01
180	688510	航亚科技	400	7,364.00	0.01
181	688031	星环科技	200	7,342.00	0.01
182	600580	卧龙电驱	600	7,290.00	0.01
183	000977	浪潮信息	200	7,274.00	0.01
184	002705	新宝股份	500	7,035.00	0.01
185	688418	震有科技	400	6,852.00	0.01
186	300134	大富科技	1,000	6,820.00	0.01
187	000625	长安汽车	500	6,715.00	0.01
188	000883	湖北能源	1,100	6,611.00	0.01
189	000066	中国长城	700	6,125.00	0.01

190	002422	科伦药业	200	6,066.00	0.01
191	300925	法本信息	600	6,054.00	0.01
192	000801	四川九洲	600	6,000.00	0.01
192	688595	芯海科技	200	6,000.00	0.01
193	301165	锐捷网络	200	5,968.00	0.01
194	002755	奥赛康	600	5,790.00	0.01
195	688205	德科立	200	5,762.00	0.01
196	301345	涛涛车业	100	5,510.00	0.01
197	301260	格力博	400	5,448.00	0.01
198	600459	贵研铂业	400	5,404.00	0.01
199	688153	唯捷创芯	146	5,402.00	0.01
200	002519	银河电子	1,100	5,401.00	0.01
201	000403	派林生物	200	5,332.00	0.01
202	600618	氯碱化工	600	5,268.00	0.01
203	688127	蓝特光学	279	5,130.81	0.01
204	300707	威唐工业	400	4,952.00	0.01
205	003025	思进智能	400	4,924.00	0.01
206	600956	新天绿能	600	4,902.00	0.01
207	600366	宁波韵升	900	4,698.00	0.01
208	002737	葵花药业	200	4,676.00	0.01
209	002455	百川股份	500	4,590.00	0.01
210	300496	中科创达	100	4,559.00	0.01
211	300560	中富通	400	4,328.00	0.01
212	603600	永艺股份	400	4,176.00	0.01
213	002701	奥瑞金	1,000	4,160.00	0.01
214	688158	优刻得	400	4,092.00	0.01
215	688235	百济神州	35	4,054.40	0.01
216	688260	昀冢科技	270	4,014.90	0.01
217	603727	博迈科	300	3,948.00	0.01
218	688150	莱特光电	200	3,880.00	0.01
219	301219	腾远钴业	100	3,826.00	0.01
220	000949	新乡化纤	1,100	3,740.00	0.01
221	601216	君正集团	1,000	3,690.00	0.01
222	688575	亚辉龙	151	3,521.32	0.01
223	002835	同为股份	200	3,378.00	0.01
224	688116	天奈科技	142	3,277.36	0.01
225	300380	安硕信息	200	3,072.00	0.01
226	002559	亚威股份	400	3,064.00	0.01
227	001208	华菱线缆	400	3,032.00	0.01
228	300408	三环集团	100	2,919.00	0.01
229	600299	安迪苏	300	2,910.00	0.00
230	600577	精达股份	700	2,779.00	0.00
231	002100	天康生物	400	2,772.00	0.00

232	603348	文灿股份	100	2,769.00	0.00
233	603131	上海沪工	200	2,768.00	0.00
234	600066	宇通客车	100	2,580.00	0.00
235	603883	老百姓	130	2,386.80	0.00
236	000969	安泰科技	300	2,379.00	0.00
237	002423	中粮资本	300	2,247.00	0.00
238	000550	江铃汽车	100	2,171.00	0.00
239	605056	咸亨国际	200	2,156.00	0.00
240	600610	中毅达	500	1,990.00	0.00
241	300548	博创科技	100	1,949.00	0.00
242	600096	云天化	100	1,942.00	0.00
243	002416	爱施德	200	1,770.00	0.00
244	300684	中石科技	100	1,734.00	0.00
245	002467	二六三	500	1,670.00	0.00
246	300378	鼎捷软件	100	1,627.00	0.00
247	300729	乐歌股份	100	1,549.00	0.00
248	301316	慧博云通	100	1,468.00	0.00
249	300879	大叶股份	100	1,338.00	0.00
250	000612	焦作万方	200	1,300.00	0.00
251	688778	厦钨新能	41	1,280.84	0.00
252	002577	雷柏科技	100	1,237.00	0.00
253	001965	招商公路	100	1,186.00	0.00
254	601666	平煤股份	100	1,120.00	0.00
255	603110	东方材料	100	1,113.00	0.00
256	301013	利和兴	100	1,068.00	0.00
257	600123	兰花科创	100	895.00	0.00
258	603085	天成自控	100	894.00	0.00
259	688177	百奥泰	37	781.44	0.00
260	002068	黑猫股份	100	710.00	0.00
261	300180	华峰超纤	200	706.00	0.00
262	600210	紫江企业	100	532.00	0.00
263	002404	嘉欣丝绸	100	529.00	0.00
264	002103	广博股份	100	496.00	0.00
265	601113	华鼎股份	100	328.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300502	新易盛	335,889.00	0.40
2	601699	潞安环能	273,286.00	0.33
3	300308	中际旭创	265,643.00	0.32
4	601058	赛轮轮胎	261,530.00	0.31

5	300498	温氏股份	223,406.00	0.27
6	688041	海光信息	203,224.47	0.24
7	000625	长安汽车	194,970.00	0.23
8	601633	长城汽车	192,597.00	0.23
9	688169	石头科技	189,469.26	0.23
10	601138	工业富联	187,143.00	0.22
11	688256	寒武纪	186,778.04	0.22
12	300394	天孚通信	186,357.00	0.22
13	000338	潍柴动力	183,096.00	0.22
14	688418	震有科技	180,763.28	0.22
15	600406	国电南瑞	171,794.00	0.20
16	603993	洛阳钼业	171,340.00	0.20
17	600025	华能水电	168,910.00	0.20
18	000983	山西焦煤	164,928.00	0.20
19	300570	太辰光	160,390.00	0.19
20	601225	陕西煤业	156,163.00	0.19

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	600348	华阳股份	1,763,032.00	2.10
2	002371	北方华创	1,559,954.00	1.86
3	600256	广汇能源	1,391,519.00	1.66
4	600158	中体产业	1,318,562.00	1.57
5	002230	科大讯飞	1,316,823.00	1.57
6	688111	金山办公	1,254,563.52	1.49
7	603019	中科曙光	1,186,044.00	1.41
8	000887	中鼎股份	1,108,709.00	1.32
9	002929	润建股份	868,824.00	1.03
10	002466	天齐锂业	843,739.00	1.00
11	000792	盐湖股份	775,089.00	0.92
12	002324	普利特	742,604.00	0.88
13	600011	华能国际	710,494.00	0.85
14	002074	国轩高科	709,341.00	0.84
15	300394	天孚通信	391,101.00	0.47
16	300502	新易盛	297,057.00	0.35
17	601058	赛轮轮胎	286,314.00	0.34
18	300308	中际旭创	247,674.00	0.29
19	300498	温氏股份	229,512.00	0.27
20	688169	石头科技	224,132.60	0.27

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	37,301,963.11
卖出股票收入（成交）总额	47,625,912.49

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	57,865,478.00	99.38
	其中：政策性金融债	3,534,575.21	6.07
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	57,865,478.00	99.38

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	2128030	21 交通银行二级	50,000	5,308,396.17	9.12
2	2128025	21 建设银行二级 01	50,000	5,294,418.03	9.09
3	2028038	20 中国银行二级 01	50,000	5,293,860.66	9.09
4	2028044	20 广发银行二级 01	50,000	5,285,203.28	9.08
5	092280069	22 华夏银行二级资本债 01	50,000	5,274,366.12	9.06

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本基金采用定量分析和定性分析相结合的方式，一方面通过严格的量化规则筛选有潜在投资价值的标的纳入研究范围，另一方面结合所选基金的基金管理人的基本情况和投研文化等定性因素进行二次研判，双重维度筛选出中长期业绩稳定的优秀基金。本基金仅限于投资股票 ETF 以及由本基金管理人管理的权益类基金。

本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.12.3 报告期末基金持有的全部公开募集基础设施证券投资基金情况

本基金本报告期末未持有公开募集基础设施证券投资基金。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受

到中国人民银行、国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局的处罚，交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局商丘监管分局的处罚，海通证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会的处罚，南京银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局江苏省分局的处罚，广发银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	5,796.75
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,796.75

7.13.4 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。

7.13.5 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。

7.13.6 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	户均持有的基	持有人结构
------	-----	--------	-------

	户数 (户)	金份额	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 (%)
万家兴恒 回报一年 持有期混 合 A	878	45,370.29	1,044,726.46	2.62	38,790,392.13	97.38
万家兴恒 回报一年 持有期混 合 C	582	33,348.51	-	-	19,408,835.39	100.00
合计	1,436	41,256.24	1,044,726.46	1.76	58,199,227.52	98.24

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	万家兴恒回报一年持有期混合 A	10,083.38	0.0253
	万家兴恒回报一年持有期混合 C	10.01	0.0001
	合计	10,093.39	0.0170

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	万家兴恒回报一年持有期混 合 A	0
	万家兴恒回报一年持有期混 合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	万家兴恒回报一年持有期混 合 A	0
	万家兴恒回报一年持有期混 合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家兴恒回报一年持有期混合 A	万家兴恒回报一年持有期混合 C
基金合同生效日 (2022 年 4 月 15 日)		
基金份额总额	146,714,410.05	60,877,813.17
本报告期期初基金份额总额	61,345,439.92	24,709,754.76
本报告期基金总申购份额	13,714.34	17,671.34
减:本报告期基金总赎回份额	21,524,035.67	5,318,590.71
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	39,835,118.59	19,408,835.39

§ 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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期持有的基金未发生重大影响事件。

10.6 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。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.7.1 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。

10.7.2 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稽查或处罚等情况。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中泰证券	2	39,842,913.84	46.91	37,693.00	47.06	-
国海证券	1	25,333,048.43	29.83	23,962.65	29.92	-
国投证券	1	10,297,084.54	12.12	9,502.06	11.86	-
招商证券	2	9,454,828.79	11.13	8,944.20	11.17	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中金财富	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
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：

无。

10.8.2 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		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
中泰证券	400,113.00	7.96	45,600,000.00	49.30	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	199,978.00	3.98	19,800,000.00	21.41	-	-	-	-
招商证券	4,424,651.00	88.06	27,100,000.00	29.30	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
川财 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰 君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
红塔 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华融 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中国中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.9 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	万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金基金经理变更公告	指定媒介	2024 年 1 月 11 日
2	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招募说明书和基金产品资料概要的提示性公告	指定媒介	2024 年 1 月 12 日
3	万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金招募说明书更新（2024 年第 1 号）	指定媒介	2024 年 1 月 12 日
4	万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	指定媒介	2024 年 1 月 12 日
5	万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	指定媒介	2024 年 1 月 19 日
6	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
7	万家基金管理有限公司旗下基金 2023	指定媒介	2024 年 3 月 29 日

	年年度报告提示性公告		
8	万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金 2023 年年度报告	指定媒介	2024 年 3 月 29 日
9	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
10	万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	指定媒介	2024 年 4 月 19 日
11	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 14 日
12	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招募说明书和基金产品资料概要的提示性公告	指定媒介	2024 年 6 月 17 日
13	万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	指定媒介	2024 年 6 月 17 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金托管协议》。
- 4、万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金 2024 年中期报告原文。
- 5、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。
- 7、本报告期内在中国证监会指定媒介公开披露的基金净值、更新招募说明书及其他临时公告。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人网站：www.wjasset.com。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日