

# 万家国证 2000 指数增强型证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	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	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55

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 .....	55
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 .....	55
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 投资组合报告附注 .....	56
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>56</b>
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
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>57</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>58</b>
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 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	58
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 .....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	58
10.8 其他重大事件 .....	59
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>60</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 .....	60
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>60</b>
12.1 备查文件目录 .....	60
12.2 存放地点 .....	61
12.3 查阅方式 .....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	万家国证 2000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	万家国证 2000 指数增强	
基金主代码	018653	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 9 月 26 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	765,452,997.96 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	万家国证 2000 指数增强 A	万家国证 2000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	018653	018654
报告期末下属分级基金的份额总额	435,183,373.48 份	330,269,624.48 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金，采取量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，在力求有效跟踪标的指数的基础上，实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强投资策略，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。具体策略包括：1、大类资产配置策略；2、股票投资策略：（1）指数化投资策略；（2）指数增强策略；（3）港股通标的股票投资策略；（4）存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、可转换债券与可交换债券投资策略；6、证券公司短期公司债券投资策略；7、金融衍生产品投资策略：（1）股指期货交易策略；（2）国债期货交易策略；（3）股票期权投资策略；8、信用衍生品投资策略；9、融资及转融通证券出借业务投资策略。
业绩比较基准	国证 2000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为指数增强型股票基金，其预期风险收益水平理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 本基金可投资于港股，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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	兰剑	郭明
	联系电话	021-38909626	010-66105799
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008880800	95588
传真		021-38909627	010-66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦 电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区浦 电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200122	100140
法定代表人		方一天	廖林

### 2.4 信息披露方式

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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	万家基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区 浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	万家国证 2000 指数增强 A	万家国证 2000 指数增强 C
本期已实现收益	-74,518,387.96	-57,917,650.97
本期利润	-88,024,105.08	-70,722,043.83
加权平均基金份 额本期利润	-0.1777	-0.1853
本期加权平均净 值利润率	-20.25%	-21.15%
本期基金份额净	-16.56%	-16.72%

值增长率		
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	-75,009,532.08	-57,756,476.85
期末可供分配基金份额利润	-0.1724	-0.1749
期末基金资产净值	360,173,841.40	272,513,147.63
期末基金份额净值	0.8276	0.8251
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	-17.24%	-17.49%

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

万家国证 2000 指数增强 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	-7.55%	1.45%	-8.54%	1.50%	0.99%	-0.05%
过去三个月	-7.08%	1.57%	-11.29%	1.60%	4.21%	-0.03%
过去六个月	-16.56%	1.85%	-18.67%	2.02%	2.11%	-0.17%
自基金合同生效起至今	-17.24%	1.52%	-18.58%	1.73%	1.34%	-0.21%

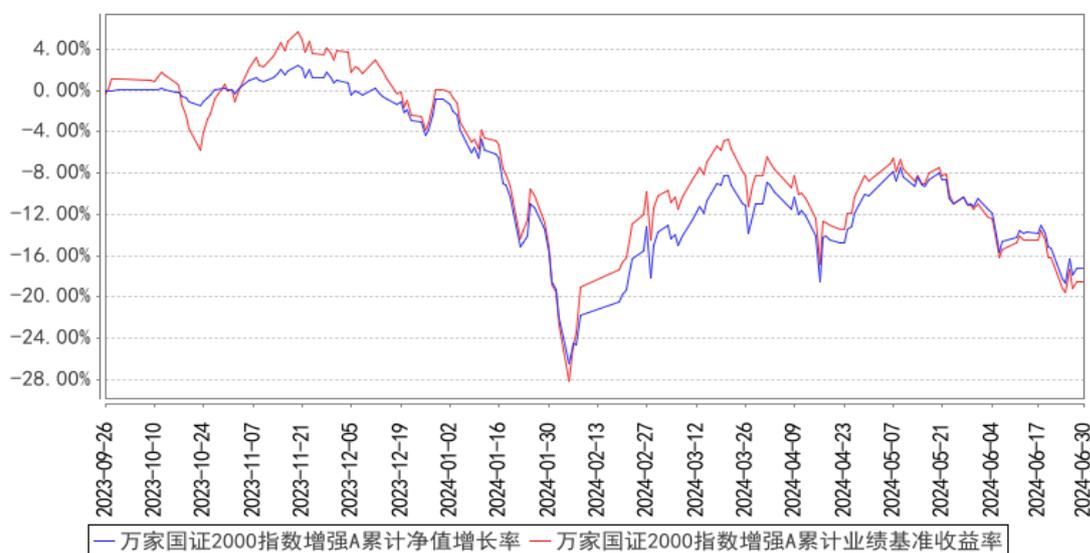
万家国证 2000 指数增强 C

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

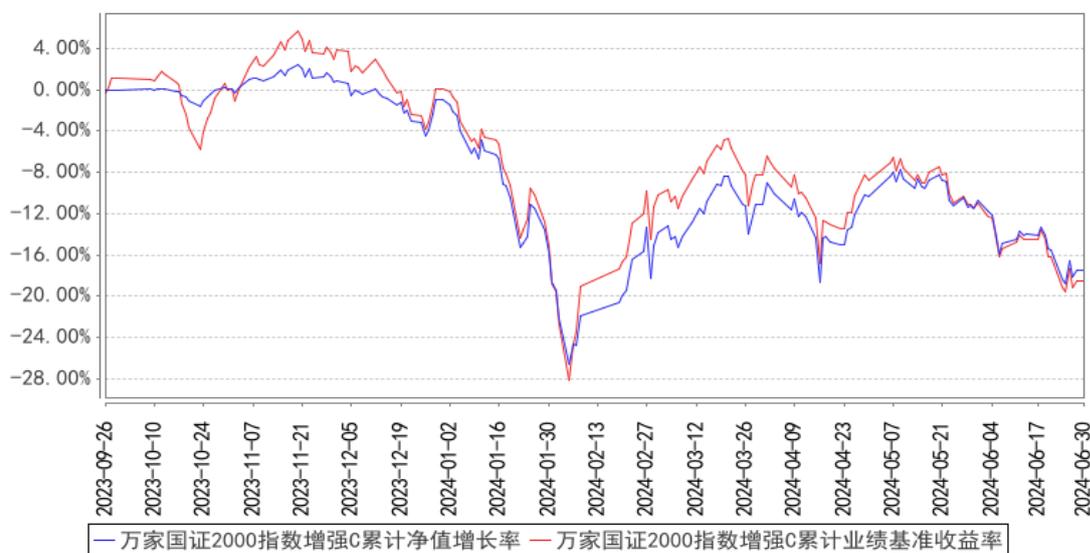
	率①	准差②		④		
过去一个月	-7.57%	1.45%	-8.54%	1.50%	0.97%	-0.05%
过去三个月	-7.18%	1.57%	-11.29%	1.60%	4.11%	-0.03%
过去六个月	-16.72%	1.85%	-18.67%	2.02%	1.95%	-0.17%
自基金合同生效起 至今	-17.49%	1.52%	-18.58%	1.73%	1.09%	-0.21%

### 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

万家国证2000指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



万家国证2000指数增强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：1、本基金合同生效日期为 2023 年 9 月 26 日，基金合同生效未满一年。

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

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44号文批准设立。截至报告期末，公司的股东为中泰证券股份有限公司、山东省新动能基金管理有限公司，住所：中国（上海）自由贸易试验区浦电路360号8楼（名义楼层9层），办公地点：上海市浦东新区浦电路360号9楼，注册资本3亿元人民币。截至报告期末，公司共管理一百五十二只开放式基金，分别为万家180指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金（LOF）、万家添利债券型证券投资基金（LOF）、万家新机遇价值驱动灵活配置混合型证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家上证50交易型开放式指数证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞和灵活配置混合型证券投资基金、万家颐达灵活配置混合型证券投资基金、万家颐和灵活配置混合型证券投资基金、万家恒瑞18个月定期开放债券型证券投资基金、万家鑫安纯债债券型证券投资基金、万家鑫璟纯债债券型证券投资基金、万家沪深300指数增强型证券投资基金、万家家享中短债债券型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家1-3年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家瑞隆混合型证券投资基金、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家现金增利货币市场基金、万家消费成长股票型证券投资基金、万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家玖盛纯债9个月定期开放债券型证券投资基金、万家天添宝货币市场基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、万家家瑞债券型证券投资基金、万家臻选混合

型证券投资基金、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金、万家成长优选灵活配置混合型证券投资基金、万家经济新动能混合型证券投资基金、万家潜力价值灵活配置混合型证券投资基金、万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家新机遇龙头企业灵活配置混合型证券投资基金、万家智造优势混合型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型证券投资基金、万家人工智能混合型证券投资基金、万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金 (LOF)、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、万家平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、万家科创主题灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、万家鑫盛纯债债券型证券投资基金、万家民安增利 12 个月定期开放债券型证券投资基金、万家汽车新趋势混合型证券投资基金、万家惠享 39 个月定期开放债券型证券投资基金、万家科技创新混合型证券投资基金、万家自主创新混合型证券投资基金、万家民丰回报一年持有期混合型证券投资基金、万家可转债债券型证券投资基金、万家民瑞祥和 6 个月持有期债券型证券投资基金、万家价值优势一年持有期混合型证券投资基金、万家养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、万家鑫动力月月购一年滚动持有混合型证券投资基金、万家科创板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家创业板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家周期优势企业混合型证券投资基金、万家健康产业混合型证券投资基金、万家互联互通中国优势量化策略混合型证券投资基金、万家战略发展产业混合型证券投资基金、万家创业板指数增强型证券投资基金、万家陆家嘴金融城金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家内需增长一年持有期混合型证券投资基金、万家互联互通核心资产量化策略混合型证券投资基金、万家民瑞祥明 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家瑞泽回报一年持有期混合型证券投资基金、万家惠裕回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家悦兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金、万家稳鑫 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、万家全球成长一年持有期混合型基金 (QDII)、万家沪港深蓝筹混合型证券投资基金、万家北交所慧选两年定期开放混合型证券投资基金、万家鼎鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家新机遇成长一年持有期混合型发起式证券投资基金、万家港股通精选混合型证券投资基金、万家景气驱动混合型证券投资基金、万家安恒纯债 3 个月持有期债券型发起式证券投资基金、万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫橙纯债债券型证券投资基金、万家聚优稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF) 、万家新能源主题混合型发起式证券投资基金、万家中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、万家匠心致远一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫融纯债债券型证券投资基金、万家颐远均衡一年持有期混合型发起式证券

投资基金、万家鑫耀纯债债券型证券投资基金、万家欣远混合型证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家惠利债券型证券投资基金、万家鑫怡债券型证券投资基金、万家优享平衡混合型发起式证券投资基金、万家洞见进取混合型发起式证券投资基金、万家沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、万家中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金、万家沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家元贞量化选股股票型证券投资基金、万家 CFETS0-3 年期政策性金融债指数证券投资基金、万家中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家先进制造混合型发起式证券投资基金、万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金、万家颐德一年持有期混合型证券投资基金、万家北证 50 成份指数型发起式证券投资基金、万家恒生互联网科技业指数型发起式证券投资基金 (QDII)、万家中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家欣优混合型证券投资基金、万家集利债券型发起式证券投资基金、万家远见先锋一年持有期混合型证券投资基金、万家国证 2000 指数增强型证券投资基金、万家纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII)、万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金、万家稳安 60 天持有期债券型证券投资基金、万家周期驱动股票型发起式证券投资基金、万家优选积极三个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、万家养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、万家红利量化选股混合型发起式证券投资基金、万家医药量化选股混合型发起式证券投资基金、万家锦利债券型发起式证券投资基金、万家高端装备量化选股混合型发起式证券投资基金、万家趋势领先混合型证券投资基金、万家稳航 90 天持有期债券型证券投资基金、万家中证红利交易型开放式指数证券投资基金、万家惠诚回报平衡一年持有期混合型证券投资基金、万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家国企动力混合型证券投资基金、万家 CFETS 0-3 年期山东省国有企业信用债精选指数发起式证券投资基金、万家稳丰 6 个月持有期债券型证券投资基金、万家研究领航混合型证券投资基金、万家中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
乔亮	公司领导副总经理；万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、万家元贞量化选股股票型证券投资基金、万家创业板指数	2023 年 9 月 26 日	-	17.5 年	国籍：中国；学历：美国斯坦福大学工商管理博士，2019 年 7 月入职万家基金管理有限公司，现任公司副总经理、基

	<p>增强型证券投资基金、万家国证 2000 指数增强型证券投资基金、万家家瑞债券型证券投资基金、万家沪深 300 指数增强型证券投资基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家颐达灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>			<p>金经理, 历任总经理助理、量化投资部总监(兼)。曾任美国巴克莱国际投资管理公司投资部基金经理, 加拿大退休基金国际投资管理公司量化投资部基金经理, 南方基金管理有限公司数量化投资部投资经理, 通联数据股份公司联合创始人、首席投资官, 上海寻乾资产管理有限公司投资总监、总经理, 巨杉(上海)资产管理有限公司量化投资部投资总监等职。</p>
--	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

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

本报告期末，本基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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

本基金为指数增强型股票基金,采取量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制,在力求有效跟踪标的指数基础上,力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%的基础上,实现超越目标指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。本基金采用量化多因子选股策略,控制行业权重偏离度、个股集中度,通过量化多因子选股的方式选取一篮子股票组合。在行业和风格配置相对于业绩基准指数相对均衡,无重仓行业或具体风格,在量化选股方面精选行业内质优个股组合,持股较为分散。采用量化风险模型合理控制组合风险,保证较小的跟踪误差,投资目标是获取在既定跟踪误差下的超额收益最大化。本基金股票组合中 80%以上权重为国证 2000 成分股,保持了跟标的指数的风格基本一致。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家国证 2000 指数增强 A 的基金份额净值为 0.8276 元,本报告期基金份额净值增长率为-16.56%,同期业绩比较基准收益率为-18.67%;截至本报告期末万家国证 2000 指数增强 C 的基金份额净值为 0.8251 元,本报告期基金份额净值增长率为-16.72%,同期业绩比较基准收益率为-18.67%。基金报告期内 A 份额、C 份额日均跟踪偏离度分别为 0.2451%、0.2440%,年跟踪误差分别为 6.6027%、6.5909%。符合基金合同中日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%的规定。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市,7 月政治局会议研究分析当前经济形势,认为经济运行总体平稳、稳中有进,延续回升向好态势,同时仍存在部分挑战,宏观政策要持续用力、更加给力,政策定调更为积极。

上半年 GDP 增速 5%，但二季度以来显现边际放缓迹象，要实现全年 GDP5%目标，政策力度加码预期抬升，三中全会后货币与财政政策有所发力，央行实施降息、发改委牵头安排约 3000 亿元超长期特别国债资金，支持大规模设备更新和消费品以旧换新，更大力度推动大规模设备更新和大宗耐用消费品以旧换新，加大财政发力的迹象已较为明显。总体来看，当前 A 股整体估值处于较低区间，随着国内政策继续发力、金融监管强化，助力股市信心回稳、估值修复，市场有望稳中向好。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

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

##### 2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不介入基金日常估值业务。

##### 3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

##### 4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他

法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对万家基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：万家国证 2000 指数增强型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	6,154,184.49	48,337,097.18
结算备付金		34,926,212.35	128,683,406.98
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	593,463,682.23	874,820,876.31
其中：股票投资		593,463,682.23	874,820,876.31
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-

其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		140,424.35	291,974.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		634,684,503.42	1,052,133,354.73
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 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		-	-
应付赎回款		1,072,061.26	11,502,527.61
应付管理人报酬		543,116.41	930,473.50
应付托管费		81,467.47	139,571.02
应付销售服务费		93,784.00	164,239.34
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	207,085.25	88,695.99
负债合计		1,997,514.39	12,825,507.46
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.7	765,452,997.96	1,048,393,167.28
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	-132,766,008.93	-9,085,320.01
净资产合计		632,686,989.03	1,039,307,847.27
负债和净资产总计		634,684,503.42	1,052,133,354.73

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 765,452,997.96 份，其中万家国证 2000 指数增强 A 基金份额净值 0.8276 元，基金份额总额 435,183,373.48 份；万家国证 2000 指数增强 C 基金份额净值 0.8251 元，基金份额总额 330,269,624.48 份。

## 6.2 利润表

会计主体：万家国证 2000 指数增强型证券投资基金

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
----	-----	----------------------------

<b>一、营业总收入</b>		-153,618,187.79
1. 利息收入		83,214.76
其中：存款利息收入	6.4.7.10	83,214.76
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-127,658,787.29
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-135,780,960.78
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.12	-
资产支持证券投资	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	8,122,173.49
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	-26,310,109.98
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	267,494.72
<b>减：二、营业总支出</b>		5,127,961.12
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,813,887.74
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	572,083.19
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	662,996.19
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.20	78,994.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-158,746,148.91
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-158,746,148.91
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		-158,746,148.91

注：本基金合同生效日为 2023 年 9 月 26 日，无上年度可比期间数据。

### 6.3 净资产变动表

会计主体：万家国证 2000 指数增强型证券投资基金

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	1,048,393,167.28	-	-9,085,320.01	1,039,307,847.27
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,048,393,167.28	-	-9,085,320.01	1,039,307,847.27
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-282,940,169.32	-	-123,680,688.92	-406,620,858.24
(一)、综合收益总额	-	-	-158,746,148.91	-158,746,148.91
(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)	-282,940,169.32	-	35,065,459.99	-247,874,709.33
其中：1. 基金申购款	35,805,203.28	-	-5,350,658.51	30,454,544.77
2. 基金赎回款	-318,745,372.60	-	40,416,118.50	-278,329,254.10
(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	765,452,997.96	-	-132,766,008.93	632,686,989.03

注：本基金合同生效日为 2023 年 9 月 26 日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

万家国证 2000 指数增强型证券投资基金（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[2023]1138 号文《关于准予万家国证 2000 指数增强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 2023 年 9 月 1 日至 2023 年 9 月 22 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 ZA31748 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 9 月 26 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 1,116,462,284.91 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 320,158.23 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,116,782,443.14 元，折合 1,116,782,443.14 份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为万家基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的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）、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、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、股指期货、国债期货、股票期权、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）。本基金可根据法律法规的规定参与融资业务和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，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：国证 2000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投

资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本中期报告所采用的会计政策、会计估计与上年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### (一) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》的规定，基金通过深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税；

根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

## (二) 增值税

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

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

## (三) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，

自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

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

#### (四) 个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	6,154,184.49
等于：本金	6,153,414.14
加：应计利息	770.35
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	6,154,184.49

### 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	627,393,365.15	-	593,463,682.23	-33,929,682.92
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	627,393,365.15	-	593,463,682.23	-33,929,682.92

### 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	2.28
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	117,077.00
其他	90,005.97
合计	207,085.25

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

##### 万家国证 2000 指数增强 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	587,407,651.31	587,407,651.31
本期申购	14,021,935.02	14,021,935.02
本期赎回（以“-”号填列）	-166,246,212.85	-166,246,212.85
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	435,183,373.48	435,183,373.48

##### 万家国证 2000 指数增强 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	460,985,515.97	460,985,515.97

本期申购	21,783,268.26	21,783,268.26
本期赎回(以“-”号填列)	-152,499,159.75	-152,499,159.75
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	330,269,624.48	330,269,624.48

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

万家国证 2000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,923,893.99	-2,897,299.42	-4,821,193.41
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-1,923,893.99	-2,897,299.42	-4,821,193.41
本期利润	-74,518,387.96	-13,505,717.12	-88,024,105.08
本期基金份额交易产生的变动数	15,087,816.57	2,747,949.84	17,835,766.41
其中：基金申购款	-1,569,871.68	-716,912.44	-2,286,784.12
基金赎回款	16,657,688.25	3,464,862.28	20,122,550.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-61,354,465.38	-13,655,066.70	-75,009,532.08

万家国证 2000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,991,250.91	-2,272,875.69	-4,264,126.60
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-1,991,250.91	-2,272,875.69	-4,264,126.60
本期利润	-57,917,650.97	-12,804,392.86	-70,722,043.83
本期基金份额交易产生的变动数	12,494,437.60	4,735,255.98	17,229,693.58
其中：基金申购款	-2,668,769.67	-395,104.72	-3,063,874.39
基金赎回款	15,163,207.27	5,130,360.70	20,293,567.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-47,414,464.28	-10,342,012.57	-57,756,476.85

#### 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		19,014.62
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		64,195.64
其他		4.50
合计		83,214.76

#### 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		-135,780,960.78
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		-135,780,960.78

##### 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		4,595,526,014.79
减：卖出股票成本总额		4,724,471,527.60
减：交易费用		6,835,447.97
买卖股票差价收入		-135,780,960.78

#### 6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	8,122,173.49
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	8,122,173.49

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-26,310,109.98
股票投资	-26,310,109.98
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-26,310,109.98

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	264,770.82
基金转换费收入	2,723.90
合计	267,494.72

#### 6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	17,404.66
信息披露费	59,672.34

证券出借违约金	-
银行费用	417.00
账户维护费	1,500.00
合计	78,994.00

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

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

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司（“万家基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
中泰证券股份有限公司（“中泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

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

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。本基金合同生效日为 2023 年 9 月 26 日，无上年度可比期间数据。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。本基金合同生效日为 2023 年 9 月 26 日，无上年度可比期间数据。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。本基金合同生效日为 2023 年 9 月 26 日，无上年度可比期间数据。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。本基金合同生效日为 2023 年 9 月 26

日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。本基金合同生效日为 2023 年 9 月 26 日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,813,887.74
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,514,746.91
应支付基金管理人的净管理费	2,299,140.83

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

2、本基金合同生效日为 2023 年 9 月 26 日，无上年度可比期间数据。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	572,083.19

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日

或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

2、本基金合同生效日为 2023 年 9 月 26 日，无上年度可比期间数据。

#### 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		
	万家国证 2000 指数增 强 A	万家国证 2000 指数增 强 C	合计
工商银行	-	26,799.14	26,799.14
万家基金	-	0.60	0.60
中泰证券	-	15,212.87	15,212.87
合计	-	42,012.61	42,012.61

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

2、本基金合同生效日为 2023 年 9 月 26 日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。本基金合同生效日为 2023 年 9 月 26 日，无上年度可比期间数据。

**6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。本基金合同生效日为 2023 年 9 月 26 日，无上年度可比期间数据。

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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。本基金合同生效日为 2023 年 9 月 26 日，无上年度可比期间数据。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期末未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。本基金合同生效日为 2023 年 9 月 26 日，无上年度可比期间数据。

**6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

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	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	6,154,184.49	19,014.62

注：1、本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，存款按银行同业利率或约定利率计息。

2、本基金合同生效日为 2023 年 9 月 26 日，无上年度可比期间数据。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方所承销的证券。本基金合同生效日为 2023 年 9 月 26 日，无上年度可比期间数据。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期没有需作说明的其他关联交易事项。本基金合同生效日为 2023 年 9 月 26 日，无上年度可比期间数据。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001359	平安电工	2024 年 3 月 19 日	6 个月	新股流通受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001387	雪祺电气	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股流通受限	11.82	15.25	173	2,045.54	2,638.25	含转增股
001389	广合科技	2024 年 3 月 26 日	6 个月	新股流通受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇成真空	2024 年 5 月 28 日	6 个月	新股流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024 年 1 月 26 日	6 个月	新股流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024 年 3 月 20 日	6 个月	新股流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301539	宏鑫科技	2024 年 4 月 3 日	6 个月	新股流通受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	新股流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
301587	中	2024	6 个月	新股	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-

	瑞股份	年3月27日		流通受限						
301588	美新科技	2024年3月6日	6个月	新股流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301591	肯特股份	2024年2月20日	6个月	新股流通受限	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
601033	永兴股份	2024年1月11日	6个月	新股流通受限	16.20	15.96	1,258	20,379.60	20,077.68	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股流通受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	1,161	21,652.65	21,652.65	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股流通受限	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新股流通受限	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙旗科技	2024年2月23日	6个月	新股流通受限	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
603344	星德胜	2024年3月13日	6个月	新股流通受限	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603375	盛景	2024年1月	6个月	新股流通	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-

	微	17 日		受限						
603381	永臻股份	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
688530	欧莱新材	2024 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通受限	22.66	15.89	897	20,326.02	14,253.33	-
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	新股流通受限	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创股份	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股流通受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024 年 1 月 31 日	6 个月	新股流通受限	15.69	18.79	1,249	19,596.81	23,468.71	-

#### 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。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。(2023 年 12 月 31 日：同)

##### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金期末持有的流通受限证券外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比

例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金资产的流动性风险进行管理，基金管理人建立了健全的流动性风险管理的内部控制体系，在申购赎回确认、投资交易、估值和信息披露等运作过程中专业审慎、勤勉尽责地管控基金的流动性风险，维护投资者的合法权益，公平对待投资者。本基金开放期间管理人对组合持仓集中度、短期变现能力、流动性受限资产比例、现金类资产比例等流动性指标进行持续的监测和分析，通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，对交易对手进行必要的尽职调查和准入，加强逆回购的流动性风险和交易对手风险的管理，并健全了逆回购交易质押品管理制度。

本基金所持有的证券大部分具有良好的流动性，部分证券流通暂时受限的情况参见附注 6.4.12 “期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券”，本报告期内本基金未出现因投资品种变现困难或投资集中而无法以合理价格及时变现基金资产以支付赎回款的情况。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	6,154,184.49	-	-	-	-	-	6,154,184.49
结算备付金	34,926,212.35	-	-	-	-	-	34,926,212.35
交易性金融资产	-	-	-	-	-	593,463,682.23	593,463,682.23
应收申购款	0.07	-	-	-	-	140,424.28	140,424.35
资产总计	41,080,396.91	-	-	-	-	593,604,106.51	634,684,503.42
负债							

应付赎回款	-	-	-	-	-	1,072,061.26	1,072,061.26
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	543,116.41	543,116.41
应付托管费	-	-	-	-	-	81,467.47	81,467.47
应付销售服务费	-	-	-	-	-	93,784.00	93,784.00
其他负债	-	-	-	-	-	207,085.25	207,085.25
负债总计	-	-	-	-	-	1,997,514.39	1,997,514.39
利率敏感度缺口	41,080,396.91	-	-	-	-	-591,606,592.12	632,686,989.03
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	48,337,097.18	-	-	-	-	-	48,337,097.18
结算备付金	128,683,406.98	-	-	-	-	-	128,683,406.98
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-874,820,876.31	874,820,876.31
应收申购款	-	-	-	-	-	291,974.26	291,974.26
资产总计	177,020,504.16	-	-	-	-	-875,112,850.57	1,052,133,354.73
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	11,502,527.61	11,502,527.61
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	930,473.50	930,473.50
应付托管费	-	-	-	-	-	139,571.02	139,571.02
应付销售服务费	-	-	-	-	-	164,239.34	164,239.34
其他负债	-	-	-	-	-	88,695.99	88,695.99
负债总计	-	-	-	-	-	12,825,507.46	12,825,507.46
利率敏感度缺口	177,020,504.16	-	-	-	-	-862,287,343.11	1,039,307,847.27

注：该表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2023 年 12 月 31 日：同），货币资金、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2023 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	593,463,682.23	93.80	874,820,876.31	84.17
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	593,463,682.23	93.80	874,820,876.31	84.17

#### 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		5,365,205.37
股票基准指数下降100个基点		-5,365,205.37	-7,796,504.15

## 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	593,200,286.37	870,132,715.37
第二层次	24,058.50	4,516,820.00
第三层次	239,337.36	171,340.94
合计	593,463,682.23	874,820,876.31

#### 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	593,463,682.23	93.51
	其中：股票	593,463,682.23	93.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	41,080,396.84	6.47
8	其他各项资产	140,424.35	0.02
9	合计	634,684,503.42	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	21,102,502.94	3.34
C	制造业	326,254,262.11	51.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,330,107.86	2.26
E	建筑业	2,430,089.00	0.38
F	批发和零售业	19,988,043.90	3.16
G	交通运输、仓储和邮政业	4,709,329.00	0.74
H	住宿和餐饮业	2,393,764.00	0.38
I	信息传输、软件和信息技术服务业	53,601,342.45	8.47
J	金融业	7,106,716.80	1.12
K	房地产业	3,524,528.00	0.56
L	租赁和商务服务业	4,025,310.00	0.64
M	科学研究和技术服务业	8,331,250.81	1.32
N	水利、环境和公共	4,152,624.00	0.66

	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	698,244.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	8,152,885.00	1.29
S	综合	1,702,872.00	0.27
	合计	482,503,871.87	76.26

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	8,703,032.00	1.38
B	采矿业	-	-
C	制造业	66,062,576.66	10.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,492,739.00	0.87
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,001,722.00	0.32
G	交通运输、仓储和邮政业	1,448,811.00	0.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,290,365.02	0.84
J	金融业	14,470,037.00	2.29
K	房地产业	3,261,984.00	0.52
L	租赁和商务服务业	2,325,600.00	0.37
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	490,917.68	0.08
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	1,412,026.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	110,959,810.36	17.54

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000758	中色股份	1,757,700	8,929,116.00	1.41
2	002237	恒邦股份	765,100	8,806,301.00	1.39
3	688313	仕佳光子	762,900	7,262,808.00	1.15
4	002839	张家港行	1,767,840	7,106,716.80	1.12
5	603299	苏盐井神	699,800	6,648,100.00	1.05
6	603897	长城科技	353,000	6,195,150.00	0.98
7	688289	圣湘生物	318,763	5,603,853.54	0.89
8	600366	宁波韵升	1,024,400	5,347,368.00	0.85
9	000915	华特达因	168,700	5,087,992.00	0.80
10	300170	汉得信息	810,100	4,974,014.00	0.79
11	603367	辰欣药业	345,000	4,809,300.00	0.76
12	002697	红旗连锁	881,700	4,082,271.00	0.65
13	300005	探路者	794,200	3,978,942.00	0.63
14	002737	葵花药业	168,800	3,946,544.00	0.62
15	002036	联创电子	582,700	3,933,225.00	0.62
16	688252	天德钰	267,072	3,880,556.16	0.61
17	688123	聚辰股份	63,735	3,877,000.05	0.61
18	688018	乐鑫科技	39,262	3,874,374.16	0.61
19	002651	利君股份	698,900	3,836,961.00	0.61
20	603612	索通发展	299,900	3,826,724.00	0.60
21	600509	天富能源	694,200	3,825,042.00	0.60
22	600428	中远海特	615,100	3,764,412.00	0.59
23	300463	迈克生物	330,700	3,763,366.00	0.59
24	600123	兰花科创	418,280	3,743,606.00	0.59
25	605286	同力日升	150,900	3,671,397.00	0.58
26	301219	腾远钴业	93,200	3,565,832.00	0.56
27	002635	安洁科技	226,300	3,494,072.00	0.55
28	601700	风范股份	778,800	3,418,932.00	0.54
29	688800	瑞可达	120,068	3,371,509.44	0.53
30	688173	希荻微	305,400	3,368,562.00	0.53
31	688365	光云科技	555,913	3,346,596.26	0.53
32	300369	绿盟科技	653,100	3,337,341.00	0.53
33	603348	文灿股份	120,300	3,331,107.00	0.53
34	301080	百普赛斯	92,350	3,232,250.00	0.51
35	605333	沪光股份	113,800	3,169,330.00	0.50
36	002322	理工能科	195,700	3,135,114.00	0.50
37	002004	华邦健康	816,600	3,103,080.00	0.49
38	000600	建投能源	490,600	3,090,780.00	0.49
39	300493	润欣科技	379,700	3,071,773.00	0.49

40	002404	嘉欣丝绸	576,400	3,049,156.00	0.48
41	300441	鲍斯股份	513,400	3,044,462.00	0.48
42	002975	博杰股份	101,000	3,017,880.00	0.48
43	688095	福昕软件	65,470	2,999,180.70	0.47
44	605376	博迁新材	128,900	2,909,273.00	0.46
45	603099	长白山	127,600	2,840,376.00	0.45
46	000968	蓝焰控股	441,000	2,804,760.00	0.44
47	301260	格力博	203,200	2,767,584.00	0.44
48	600929	雪天盐业	515,300	2,731,090.00	0.43
49	002111	威海广泰	258,400	2,692,528.00	0.43
50	300772	运达股份	280,100	2,688,960.00	0.43
51	600186	莲花控股	777,900	2,668,197.00	0.42
52	300531	优博讯	251,400	2,619,588.00	0.41
53	002550	千红制药	473,900	2,554,321.00	0.40
54	001208	华菱线缆	335,000	2,539,300.00	0.40
55	600389	江山股份	178,285	2,515,601.35	0.40
56	603085	天成自控	269,800	2,412,012.00	0.38
57	002615	哈尔斯	387,200	2,400,640.00	0.38
58	002915	中欣氟材	240,300	2,390,985.00	0.38
59	300870	欧陆通	54,400	2,359,872.00	0.37
60	300061	旗天科技	525,200	2,352,896.00	0.37
61	603355	莱克电气	108,760	2,349,216.00	0.37
62	600114	东睦股份	163,000	2,345,570.00	0.37
63	002245	蔚蓝锂芯	301,600	2,337,400.00	0.37
64	000420	吉林化纤	737,200	2,329,552.00	0.37
65	301060	兰卫医学	286,300	2,324,756.00	0.37
66	300679	电连技术	57,000	2,293,110.00	0.36
67	000969	安泰科技	286,600	2,272,738.00	0.36
68	688025	杰普特	56,110	2,266,282.90	0.36
69	002275	桂林三金	182,300	2,262,343.00	0.36
70	000719	中原传媒	221,100	2,235,321.00	0.35
71	300674	宇信科技	198,400	2,198,272.00	0.35
72	603508	思维列控	116,200	2,178,750.00	0.34
73	002903	宇环数控	121,972	2,130,850.84	0.34
74	300233	金城医药	140,800	2,100,736.00	0.33
75	000042	中洲控股	530,200	2,094,290.00	0.33
76	002292	奥飞娱乐	350,200	2,094,196.00	0.33
77	688661	和林微纳	68,290	2,093,088.50	0.33
78	688690	纳微科技	119,500	2,075,715.00	0.33
79	300081	恒信东方	469,200	2,073,864.00	0.33
80	605577	龙版传媒	133,000	2,065,490.00	0.33
81	601616	广电电气	703,700	2,047,767.00	0.32
82	600971	恒源煤电	170,801	2,039,363.94	0.32

83	688205	德科立	70,716	2,037,327.96	0.32
84	688408	中信博	21,792	2,006,607.36	0.32
85	300134	大富科技	291,300	1,986,666.00	0.31
86	600882	妙可蓝多	156,600	1,952,802.00	0.31
87	300180	华峰超纤	552,600	1,950,678.00	0.31
88	688609	九联科技	220,400	1,943,928.00	0.31
89	688362	甬矽电子	98,600	1,918,756.00	0.30
90	002035	华帝股份	307,500	1,915,725.00	0.30
91	300133	华策影视	306,900	1,884,366.00	0.30
92	300587	天铁股份	465,400	1,880,216.00	0.30
93	603693	江苏新能	160,700	1,867,334.00	0.30
94	688798	艾为电子	32,929	1,864,439.98	0.29
95	002543	万和电气	186,200	1,854,552.00	0.29
96	601038	一拖股份	112,900	1,784,949.00	0.28
97	688158	优刻得	174,268	1,782,761.64	0.28
98	688566	吉贝尔	79,000	1,777,500.00	0.28
99	601388	怡球资源	809,800	1,773,462.00	0.28
100	688381	帝奥微	91,000	1,772,680.00	0.28
101	688299	长阳科技	138,400	1,770,136.00	0.28
102	603727	博迈科	134,000	1,763,440.00	0.28
103	002489	浙江永强	727,900	1,725,123.00	0.27
104	002296	辉煌科技	166,900	1,720,739.00	0.27
105	300590	移为通信	150,300	1,716,426.00	0.27
106	002897	意华股份	45,500	1,713,530.00	0.27
107	000532	华金资本	141,200	1,702,872.00	0.27
108	301073	君亭酒店	93,500	1,701,700.00	0.27
109	002577	雷柏科技	137,300	1,698,401.00	0.27
110	002837	英维克	79,200	1,694,088.00	0.27
111	301316	慧博云通	115,400	1,694,072.00	0.27
112	002023	海特高新	184,600	1,689,090.00	0.27
113	000795	英洛华	302,800	1,677,512.00	0.27
114	002761	浙江建投	212,600	1,660,406.00	0.26
115	600645	中源协和	101,600	1,635,760.00	0.26
116	300729	乐歌股份	103,490	1,603,060.10	0.25
117	603368	柳药集团	90,400	1,582,000.00	0.25
118	603558	健盛集团	157,600	1,568,120.00	0.25
119	603012	创力集团	347,200	1,548,512.00	0.24
120	688686	奥普特	24,000	1,536,720.00	0.24
121	603158	腾龙股份	217,500	1,531,200.00	0.24
122	600557	康缘药业	97,400	1,529,180.00	0.24
123	601311	骆驼股份	188,500	1,511,770.00	0.24
124	603595	东尼电子	72,800	1,498,952.00	0.24
125	688127	蓝特光学	81,420	1,497,313.80	0.24

126	688378	奥来德	63,767	1,495,973.82	0.24
127	300492	华图山鼎	15,800	1,488,360.00	0.24
128	002046	国机精工	146,300	1,487,871.00	0.24
129	688608	恒玄科技	10,000	1,463,800.00	0.23
130	600710	苏美达	179,000	1,458,850.00	0.23
131	002911	佛燃能源	157,699	1,441,368.86	0.23
132	603719	良品铺子	122,800	1,433,076.00	0.23
133	600990	四创电子	81,200	1,425,060.00	0.23
134	603212	赛伍技术	128,800	1,421,952.00	0.22
135	002303	美盈森	586,900	1,414,429.00	0.22
136	603877	太平鸟	102,800	1,411,444.00	0.22
137	688031	星环科技	38,400	1,409,664.00	0.22
138	600508	上海能源	97,300	1,376,795.00	0.22
139	300781	因赛集团	26,300	1,372,334.00	0.22
140	300570	太辰光	41,200	1,345,592.00	0.21
141	000801	四川九洲	133,900	1,339,000.00	0.21
142	300925	法本信息	132,600	1,337,934.00	0.21
143	600577	精达股份	333,100	1,322,407.00	0.21
144	002970	锐明技术	36,700	1,322,301.00	0.21
145	300045	华力创通	74,500	1,314,925.00	0.21
146	002033	丽江股份	149,800	1,312,248.00	0.21
147	688208	道通科技	54,285	1,310,439.90	0.21
148	301205	联特科技	20,550	1,289,512.50	0.20
149	002662	京威股份	419,300	1,274,672.00	0.20
150	603890	春秋电子	140,300	1,271,118.00	0.20
151	000555	神州信息	134,500	1,253,540.00	0.20
152	300113	顺网科技	122,400	1,253,376.00	0.20
153	301345	涛涛车业	22,600	1,245,260.00	0.20
154	002416	爱施德	138,354	1,224,432.90	0.19
155	601801	皖新传媒	175,300	1,214,829.00	0.19
156	603855	华荣股份	54,755	1,210,633.05	0.19
157	688668	鼎通科技	30,414	1,194,966.06	0.19
158	600163	中闽能源	240,300	1,158,246.00	0.18
159	600351	亚宝药业	206,300	1,157,343.00	0.18
160	300131	英唐智控	254,900	1,134,305.00	0.18
161	600420	国药现代	105,200	1,123,536.00	0.18
162	688766	普冉股份	11,560	1,123,285.20	0.18
163	301263	泰恩康	87,400	1,095,122.00	0.17
164	300151	昌红科技	67,000	1,059,940.00	0.17
165	688321	微芯生物	59,700	1,050,720.00	0.17
166	002090	金智科技	121,100	1,046,304.00	0.17
167	600479	千金药业	99,500	1,011,915.00	0.16
168	300691	联合光电	66,712	1,004,015.60	0.16

169	000681	视觉中国	87,200	1,002,800.00	0.16
170	300203	聚光科技	98,700	995,883.00	0.16
171	603337	杰克股份	37,700	992,264.00	0.16
172	603983	丸美股份	35,800	985,574.00	0.16
173	300499	高澜股份	90,600	982,104.00	0.16
174	002907	华森制药	77,800	981,836.00	0.16
175	603308	应流股份	78,700	977,454.00	0.15
176	300578	会畅通讯	65,800	973,840.00	0.15
177	600874	创业环保	174,100	973,219.00	0.15
178	688799	华纳药厂	22,517	955,396.31	0.15
179	688383	新益昌	18,200	948,402.00	0.15
180	002881	美格智能	47,800	948,352.00	0.15
181	002182	宝武镁业	83,900	946,392.00	0.15
182	600210	紫江企业	175,300	932,596.00	0.15
183	002238	天威视讯	118,700	931,795.00	0.15
184	300846	首都在线	99,300	929,448.00	0.15
185	688116	天奈科技	40,100	925,508.00	0.15
186	300825	阿尔特	94,800	918,612.00	0.15
187	605305	中际联合	35,460	914,513.40	0.14
188	000917	电广传媒	178,500	901,425.00	0.14
189	603496	恒为科技	36,200	885,090.00	0.14
190	688510	航亚科技	47,900	881,839.00	0.14
191	688416	恒烁股份	23,100	877,107.00	0.14
192	603711	香飘飘	62,000	858,700.00	0.14
193	002559	亚威股份	111,800	856,388.00	0.14
194	688167	炬光科技	15,400	847,000.00	0.13
195	000036	华联控股	260,900	845,316.00	0.13
196	603629	利通电子	44,800	827,008.00	0.13
197	300589	江龙船艇	69,100	820,908.00	0.13
198	603110	东方材料	73,500	818,055.00	0.13
199	000657	中钨高新	89,200	815,288.00	0.13
200	688550	瑞联新材	35,010	811,881.90	0.13
201	002646	天佑德酒	78,200	799,986.00	0.13
202	600618	氯碱化工	88,400	776,152.00	0.12
203	002361	神剑股份	238,700	773,388.00	0.12
204	603309	维力医疗	69,900	769,599.00	0.12
205	300673	佩蒂股份	58,200	763,584.00	0.12
206	300900	广联航空	40,720	762,685.60	0.12
207	300725	药石科技	28,300	757,591.00	0.12
208	300039	上海凯宝	140,700	752,745.00	0.12
209	300166	东方国信	120,021	734,528.52	0.12
210	600814	杭州解百	124,000	731,600.00	0.12
211	002799	环球印务	124,400	731,472.00	0.12

212	000899	赣能股份	74,100	716,547.00	0.11
213	603628	清源股份	57,500	705,525.00	0.11
214	002765	蓝黛科技	149,400	702,180.00	0.11
215	300727	润禾材料	31,800	698,328.00	0.11
216	002219	新里程	375,400	698,244.00	0.11
217	002432	九安医疗	17,100	693,234.00	0.11
218	605108	同庆楼	32,400	692,064.00	0.11
219	603915	国茂股份	65,500	673,995.00	0.11
220	000722	湖南发展	73,000	670,870.00	0.11
221	603239	浙江仙通	48,800	669,048.00	0.11
222	688787	海天瑞声	12,100	664,048.00	0.10
223	000521	长虹美菱	86,100	652,638.00	0.10
224	002100	天康生物	93,300	646,569.00	0.10
225	301058	中粮科工	68,100	644,907.00	0.10
226	601500	通用股份	118,300	631,722.00	0.10
227	300378	鼎捷软件	38,300	623,141.00	0.10
228	000550	江铃汽车	28,600	620,906.00	0.10
229	688389	普门科技	37,906	616,351.56	0.10
230	688372	伟测科技	15,482	608,907.06	0.10
231	688238	和元生物	128,400	594,492.00	0.09
232	000950	重药控股	121,700	592,679.00	0.09
233	603533	掌阅科技	30,700	573,169.00	0.09
234	300624	万兴科技	10,800	573,156.00	0.09
235	600211	西藏药业	17,500	570,150.00	0.09
236	300332	天壕能源	106,500	565,515.00	0.09
237	002020	京新药业	51,500	539,205.00	0.09
238	605218	伟时电子	33,200	536,180.00	0.08
239	600330	天通股份	78,600	534,480.00	0.08
240	605599	菜百股份	41,100	523,203.00	0.08
241	002215	诺普信	68,200	508,090.00	0.08
242	002876	三利谱	20,900	504,108.00	0.08
243	300542	新晨科技	39,600	486,684.00	0.08
244	605018	长华集团	53,100	481,086.00	0.08
245	300723	一品红	24,000	471,600.00	0.07
246	600602	云赛智联	42,700	471,408.00	0.07
247	002006	精工科技	33,900	454,938.00	0.07
248	605399	晨光新材	41,900	450,425.00	0.07
249	688279	峰岬科技	4,051	449,255.90	0.07
250	601975	招商南油	120,300	431,877.00	0.07
251	300788	中信出版	17,000	421,770.00	0.07
252	002562	兄弟科技	138,200	411,836.00	0.07
253	603186	华正新材	16,500	392,370.00	0.06
254	600278	东方创业	72,200	387,714.00	0.06

255	300314	戴维医疗	36,700	379,478.00	0.06
256	688409	富创精密	9,992	369,104.48	0.06
257	605183	确成股份	23,500	363,310.00	0.06
258	002116	中国海诚	37,500	349,125.00	0.06
259	688160	步科股份	8,565	342,514.35	0.05
260	688088	虹软科技	11,700	337,662.00	0.05
261	688369	致远互联	21,200	333,476.00	0.05
262	600639	浦东金桥	32,600	332,846.00	0.05
263	301071	力量钻石	11,400	315,894.00	0.05
264	688150	莱特光电	16,200	314,280.00	0.05
265	000707	双环科技	45,000	307,800.00	0.05
266	300688	创业黑马	12,100	300,080.00	0.05
267	300969	恒帅股份	4,300	297,259.00	0.05
268	688091	上海谊众	13,020	294,121.80	0.05
269	000828	东莞控股	31,800	286,518.00	0.05
270	300709	精研科技	11,300	285,664.00	0.05
271	601069	西部黄金	24,400	283,772.00	0.04
272	600229	城市传媒	38,500	265,265.00	0.04
273	002969	嘉美包装	92,500	263,625.00	0.04
274	300783	三只松鼠	12,000	262,440.00	0.04
275	300712	永福股份	12,000	261,000.00	0.04
276	600266	城建发展	67,400	252,076.00	0.04
277	300083	创世纪	41,000	251,330.00	0.04
278	300618	寒锐钴业	9,300	245,985.00	0.04
279	300354	东华测试	7,600	236,132.00	0.04
280	688089	嘉必优	17,800	235,672.00	0.04
281	601137	博威合金	15,400	234,696.00	0.04
282	002545	东方铁塔	33,500	228,135.00	0.04
283	300323	华灿光电	51,900	225,765.00	0.04
284	603995	甬金股份	12,800	224,256.00	0.04
285	300586	美联新材	34,400	216,376.00	0.03
286	688326	经纬恒润	3,773	216,306.09	0.03
287	600610	中毅达	54,200	215,716.00	0.03
288	002980	华盛昌	9,800	214,522.00	0.03
289	002688	金河生物	58,900	213,807.00	0.03
290	002544	普天科技	11,200	209,328.00	0.03
291	603738	泰晶科技	14,900	203,236.00	0.03
292	300909	汇创达	8,700	194,358.00	0.03
293	000936	华西股份	33,700	192,764.00	0.03
294	000756	新华制药	12,900	186,792.00	0.03
295	301150	中一科技	10,000	179,700.00	0.03
296	600775	南京熊猫	21,000	168,000.00	0.03
297	300581	晨曦航空	21,700	166,439.00	0.03

298	002150	通润装备	13,300	162,659.00	0.03
299	603098	森特股份	20,300	159,558.00	0.03
300	002957	科瑞技术	11,700	158,652.00	0.03
301	600575	淮河能源	39,000	151,710.00	0.02
302	300684	中石科技	8,200	142,188.00	0.02
303	300842	帝科股份	3,600	139,680.00	0.02
304	000603	盛达资源	11,800	139,594.00	0.02
305	601968	宝钢包装	29,800	139,464.00	0.02
306	603556	海兴电力	2,900	135,807.00	0.02
307	002587	奥拓电子	25,000	134,500.00	0.02
308	688776	国光电气	2,400	132,960.00	0.02
309	688630	芯碁微装	1,896	118,632.72	0.02
310	600997	开滦股份	16,900	115,934.00	0.02
311	603610	麒盛科技	11,400	112,632.00	0.02
312	002792	通宇通讯	10,360	108,158.40	0.02
313	600223	福瑞达	14,600	103,222.00	0.02
314	603997	继峰股份	8,800	90,024.00	0.01
315	688222	成都先导	7,496	85,079.60	0.01
316	603767	中马传动	6,600	79,794.00	0.01
317	601326	秦港股份	23,600	74,812.00	0.01
318	603266	天龙股份	4,400	74,448.00	0.01
319	300548	博创科技	3,800	74,062.00	0.01
320	688400	凌云光	4,380	73,058.40	0.01
321	002537	海联金汇	13,900	71,863.00	0.01
322	688022	瀚川智能	5,200	71,292.00	0.01
323	603178	圣龙股份	3,200	68,576.00	0.01
324	300130	新国都	4,000	66,560.00	0.01
325	600551	时代出版	9,300	65,844.00	0.01
326	000065	北方国际	6,300	65,331.00	0.01
327	300365	恒华科技	13,000	63,830.00	0.01
328	300533	冰川网络	4,200	58,296.00	0.01
329	300241	瑞丰光电	11,600	47,560.00	0.01
330	603297	永新光学	600	36,294.00	0.01
331	600075	新疆天业	10,500	36,225.00	0.01
332	002611	东方精工	6,700	35,175.00	0.01
333	688177	百奥泰	1,513	31,954.56	0.01
334	603171	税友股份	1,100	29,744.00	0.00
335	603912	佳力图	3,900	23,400.00	0.00
336	601101	昊华能源	2,400	22,056.00	0.00
337	300435	中泰股份	1,800	21,186.00	0.00
338	000727	冠捷科技	9,100	18,746.00	0.00
339	600694	大商股份	1,100	18,491.00	0.00
340	002476	宝莫股份	4,800	17,616.00	0.00

341	600178	东安动力	1,500	15,030.00	0.00
342	301191	菲菱科思	200	13,994.00	0.00
343	300785	值得买	600	10,146.00	0.00
344	002519	银河电子	1,900	9,329.00	0.00
345	600252	中恒集团	3,000	6,510.00	0.00
346	688366	昊海生科	73	4,502.64	0.00
347	688235	百济神州	38	4,401.92	0.00
348	688076	诺泰生物	40	3,131.20	0.00
349	688601	力芯微	59	2,577.71	0.00
350	688680	海优新材	81	2,327.94	0.00
351	688575	亚辉龙	91	2,122.12	0.00
352	688300	联瑞新材	44	2,116.40	0.00
353	688658	悦康药业	86	1,534.24	0.00
354	688595	芯海科技	50	1,500.00	0.00
355	688311	盟升电子	59	1,208.91	0.00
356	688035	德邦科技	37	1,192.14	0.00
357	688131	皓元医药	55	1,052.15	0.00
358	688020	方邦股份	31	1,034.16	0.00
359	688553	汇宇制药	80	993.60	0.00
360	688556	高测股份	81	963.09	0.00
361	688733	壹石通	61	911.95	0.00
362	688023	安恒信息	22	880.22	0.00
363	688192	迪哲医药	22	810.48	0.00
364	688302	海创药业	33	777.48	0.00
365	688165	埃夫特	99	774.18	0.00
366	688258	卓易信息	22	734.80	0.00
367	688588	凌志软件	97	664.45	0.00
368	688559	海目星	17	559.13	0.00
369	688128	中国电研	27	464.67	0.00
370	688687	凯因科技	16	408.16	0.00
371	002043	兔宝宝	37	383.69	0.00
372	688259	创耀科技	9	359.64	0.00
373	688382	益方生物	37	267.51	0.00
374	688102	斯瑞新材	22	251.24	0.00
375	688108	赛诺医疗	10	89.40	0.00
376	688176	亚虹医药	11	56.21	0.00
377	688322	奥比中光	2	53.42	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600598	北大荒	696,800	8,703,032.00	1.38
2	002500	山西证券	1,431,800	6,729,460.00	1.06
3	002318	久立特材	207,300	4,836,309.00	0.76

4	000155	川能动力	402,900	4,339,233.00	0.69
5	603861	白云电器	454,400	3,803,328.00	0.60
6	601187	厦门银行	596,200	3,177,746.00	0.50
7	603015	弘讯科技	411,700	3,112,452.00	0.49
8	000039	中集集团	326,900	3,027,094.00	0.48
9	000783	长江证券	611,700	2,954,511.00	0.47
10	002563	森马服饰	446,100	2,591,841.00	0.41
11	600267	海正药业	366,700	2,574,234.00	0.41
12	300016	北陆药业	552,700	2,437,407.00	0.39
13	600057	厦门象屿	342,000	2,325,600.00	0.37
14	001914	招商积余	228,800	2,292,576.00	0.36
15	688349	三一重能	80,313	1,994,974.92	0.32
16	002019	亿帆医药	161,100	1,991,196.00	0.31
17	000403	派林生物	74,500	1,986,170.00	0.31
18	600703	三安光电	164,600	1,929,112.00	0.30
19	300810	中科海讯	120,200	1,840,262.00	0.29
20	000698	沈阳化工	580,600	1,765,024.00	0.28
21	003019	宸展光电	66,300	1,679,379.00	0.27
22	300916	朗特智能	66,100	1,664,398.00	0.26
23	600015	华夏银行	251,300	1,608,320.00	0.25
24	002755	奥赛康	164,900	1,591,285.00	0.25
25	601608	中信重工	416,700	1,587,627.00	0.25
26	603600	永艺股份	148,900	1,554,516.00	0.25
27	600516	方大炭素	357,600	1,541,256.00	0.24
28	600717	天津港	339,300	1,448,811.00	0.23
29	300182	捷成股份	380,600	1,412,026.00	0.22
30	688662	富信科技	55,800	1,361,520.00	0.22
31	300879	大叶股份	93,200	1,247,016.00	0.20
32	688195	腾景科技	49,930	1,223,784.30	0.19
33	301012	扬电科技	47,500	1,176,100.00	0.19
34	603895	天永智能	63,100	1,087,213.00	0.17
35	688253	英诺特	27,180	1,035,829.80	0.16
36	603726	朗迪集团	76,300	1,022,420.00	0.16
37	603131	上海沪工	72,480	1,003,123.20	0.16
38	300529	健帆生物	35,900	976,839.00	0.15
39	688685	迈信林	39,800	973,110.00	0.15
40	002405	四维图新	155,600	967,832.00	0.15
41	000546	金圆股份	241,000	966,410.00	0.15
42	600956	新天绿能	118,200	965,694.00	0.15
43	600841	动力新科	283,600	930,208.00	0.15
44	603330	天洋新材	186,000	890,940.00	0.14
45	601113	华鼎股份	263,200	863,296.00	0.14
46	603365	水星家纺	54,800	857,620.00	0.14

47	000930	中粮科技	167,400	842,022.00	0.13
48	601933	永辉超市	309,700	768,056.00	0.12
49	002906	华阳集团	27,300	730,548.00	0.12
50	002701	奥瑞金	171,900	715,104.00	0.11
51	002264	新华都	137,000	700,070.00	0.11
52	000031	大悦城	291,600	682,344.00	0.11
53	002298	中电兴发	151,300	668,746.00	0.11
54	688036	传音控股	8,600	658,244.00	0.10
55	300735	光弘科技	30,100	650,160.00	0.10
56	300380	安硕信息	40,500	622,080.00	0.10
57	689009	九号公司	16,849	620,211.69	0.10
58	003025	思进智能	49,415	608,298.65	0.10
59	002372	伟星新材	36,600	564,372.00	0.09
60	002312	川发龙蟒	72,400	487,252.00	0.08
61	603199	九华旅游	15,800	470,840.00	0.07
62	601216	君正集团	103,100	380,439.00	0.06
63	301318	维海德	13,740	377,437.80	0.06
64	600916	中国黄金	38,500	370,370.00	0.06
65	002362	汉王科技	20,700	344,655.00	0.05
66	300643	万通智控	23,000	324,300.00	0.05
67	002520	日发精机	83,600	316,844.00	0.05
68	002042	华孚时尚	79,800	304,038.00	0.05
69	300496	中科创达	6,600	300,894.00	0.05
70	002068	黑猫股份	35,900	254,890.00	0.04
71	688260	昀冢科技	15,500	230,485.00	0.04
72	300711	广哈通信	14,700	226,821.00	0.04
73	603286	日盈电子	13,700	218,241.00	0.03
74	000421	南京公用	42,300	187,812.00	0.03
75	000738	航发控制	8,100	162,567.00	0.03
76	003015	日久光电	16,700	151,636.00	0.02
77	000560	我爱我家	67,500	149,850.00	0.02
78	002968	新大正	15,400	137,214.00	0.02
79	600006	东风股份	18,500	118,215.00	0.02
80	688015	交控科技	5,600	100,632.00	0.02
81	002425	凯撒文化	30,000	75,600.00	0.01
82	688213	思特威	1,400	67,900.00	0.01
83	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
84	300407	凯发电气	3,300	25,080.00	0.00
85	603285	键邦股份	1,290	24,058.50	0.00
86	688709	成都华微	1,249	23,468.71	0.00
87	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00
88	688170	德龙激光	725	15,964.50	0.00
89	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00

90	688584	上海合晶	897	14,253.33	0.00
91	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
92	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
93	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
94	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
95	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
96	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
97	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
98	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
99	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
100	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
101	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
102	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
103	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
104	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
105	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
106	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
107	688516	奥特维	96	4,013.76	0.00
108	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
109	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
110	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
111	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
112	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
113	688312	燕麦科技	86	2,085.50	0.00
114	688028	沃尔德	97	1,593.71	0.00
115	688551	科威尔	44	1,386.00	0.00
116	688002	睿创微纳	47	1,314.59	0.00
117	688607	康众医疗	95	1,179.90	0.00
118	688220	翱捷科技	31	1,161.26	0.00
119	688393	安必平	71	1,088.43	0.00
120	688234	天岳先进	19	891.48	0.00
121	688418	震有科技	46	787.98	0.00
122	688135	利扬芯片	40	640.80	0.00
123	688080	映翰通	18	545.94	0.00
124	688571	杭华股份	89	470.81	0.00
125	688580	伟思医疗	17	454.92	0.00
126	688079	美迪凯	48	356.16	0.00
127	688139	海尔生物	2	74.40	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	002318	久立特材	14,909,973.00	1.43
2	300570	太辰光	14,553,056.00	1.40
3	600971	恒源煤电	13,909,772.21	1.34
4	600015	华夏银行	13,267,411.00	1.28
5	600742	一汽富维	13,019,713.00	1.25
6	002036	联创电子	12,918,136.00	1.24
7	000727	冠捷科技	12,831,822.00	1.23
8	600645	中源协和	12,712,553.00	1.22
9	688158	优刻得	12,674,574.54	1.22
10	600366	宁波韵升	12,612,778.00	1.21
11	000521	长虹美菱	12,031,124.00	1.16
12	600598	北大荒	11,688,071.00	1.12
13	000876	新希望	11,579,667.00	1.11
14	002839	张家港行	11,439,376.00	1.10
15	600123	兰花科创	11,150,197.60	1.07
16	688313	仕佳光子	10,956,502.61	1.05
17	300369	绿盟科技	10,825,660.00	1.04
18	688095	福昕软件	10,662,932.91	1.03
19	002237	恒邦股份	10,610,608.00	1.02
20	300545	联得装备	10,290,879.00	0.99

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	688158	优刻得	23,236,229.43	2.24
2	601606	长城军工	14,870,266.00	1.43
3	601699	潞安环能	14,504,593.00	1.40
4	600025	华能水电	14,330,929.10	1.38
5	000727	冠捷科技	13,868,095.00	1.33
6	002036	联创电子	13,590,863.36	1.31
7	300570	太辰光	13,294,702.00	1.28
8	603196	日播时尚	13,267,901.00	1.28
9	300432	富临精工	13,155,746.50	1.27
10	301080	百普赛斯	12,996,613.48	1.25
11	600742	一汽富维	12,913,080.56	1.24
12	688018	乐鑫科技	12,345,623.04	1.19
13	600971	恒源煤电	12,345,378.00	1.19
14	688095	福昕软件	12,198,996.15	1.17
15	000876	新希望	12,075,625.00	1.16
16	300193	佳士科技	12,013,684.24	1.16
17	688049	炬芯科技	12,003,397.55	1.15
18	600015	华夏银行	11,973,704.00	1.15

19	300394	天孚通信	11,782,675.23	1.13
20	600645	中源协和	11,777,776.00	1.13

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	4,469,424,443.50
卖出股票收入（成交）总额	4,595,526,014.79

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

### 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

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

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	140,424.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	140,424.35

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
万家国证 2000 指数 增强 A	5,574	78,073.80	11,011,002.59	2.53	424,172,370.89	97.47
万家国证 2000 指数 增强 C	5,991	55,127.63	3,345,445.65	1.01	326,924,178.83	98.99
合计	11,447	66,869.31	14,356,448.24	1.88	751,096,549.72	98.12

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	万家国证 2000 指数增强 A	132,138.83	0.0304
	万家国证 2000 指数增强 C	211.14	0.0001
	合计	132,349.97	0.0173

### 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	万家国证 2000 指数增强 A	10~50
	万家国证 2000 指数增强 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有 本开放式基金	万家国证 2000 指数增强 A	10~50
	万家国证 2000 指数增强 C	0
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家国证 2000 指数增强 A	万家国证 2000 指数增强 C
基金合同生效日 (2023 年 9 月 26 日)	623,505,338.37	493,277,104.77

基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	587,407,651.31	460,985,515.97
本报告期基金总申购份额	14,021,935.02	21,783,268.26
减：本报告期基金总赎回份额	166,246,212.85	152,499,159.75
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	435,183,373.48	330,269,624.48

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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 (%)	
国信证券	2	5,729,842,081.77	63.22	2,471,448.77	62.47	-
中国中金财富	2	3,001,017,227.81	33.11	1,338,422.84	33.83	-
中信证券	3	332,390,841.76	3.67	146,509.01	3.70	-

注：

1、本基金的证券交易模式为券商结算模式，本报告期内管理人选择国信证券、中国中金财富证券和中信证券作为证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准如下：

- (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；
- (4) 资金划付、交收、调整、差异处理及时，且基金交易、结算、对账等数据的提供能满足券商结算模式下 T+0 估值的时效性要求。

2、基金证券经纪商的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定证券经营机构，然后基金管理人、基金托管人和证券经纪商签订证券经纪服务协议。

3、交易佣金包含已由证券经纪商扣收的相关交易费用。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

#### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	万家国证 2000 指数增强型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	指定媒介	2024 年 1 月 19 日
2	万家基金管理有限公司旗下基金季度报告提示性公告	指定媒介	2024 年 1 月 19 日
3	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中欧财富为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2024 年 1 月 23 日
4	万家基金管理有限公司关于旗下基金在华源证券开通申购、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 2 月 24 日
5	万家基金管理有限公司关于旗下部分	指定媒介	2024 年 3 月 20 日

	基金新增微众银行为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告		
6	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在创金启富基金开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2024 年 3 月 21 日
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	万家国证 2000 指数增强型证券投资基金 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	万家国证 2000 指数增强型证券投资基金 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银泰证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2024 年 4 月 22 日
12	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 16 日
13	万家国证 2000 指数增强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 21 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

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、《万家国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家国证 2000 指数增强型证券投资基金托管协议》。
- 4、万家国证 2000 指数增强型证券投资基金 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](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