

万家纳斯达克 100 指数型发起式证券投资
基金(QDII)
2025 年中期报告

2025 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 29 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 28 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 2025 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 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	12
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	42
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	42

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	42
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	52
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	53
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	53
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	54
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	54
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	54
7.11 投资组合报告附注	54
§8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	56
§9 开放式基金份额变动	56
§10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 其他重大事件	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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
§12 备查文件目录	60
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	万家纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII)	
基金简称	万家纳斯达克 100 指数发起式 (QDII)	
基金主代码	019441	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 9 月 27 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	319,405,971.63 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	万家纳斯达克 100 指数发起式 (QDII) A	万家纳斯达克 100 指数发起式 (QDII) C
下属分级基金的交易代码	019441	019442
报告期末下属分级基金的份额总额	177,046,252.32 份	142,359,719.31 份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	1、股票投资策略：（1）股票投资组合的构建；（2）股票投资组合的调整；2、存托凭证投资策略；3、指数基金及 ETF 投资策略；4、债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、可转换债券与可交换债券投资策略；7、证券公司短期公司债券投资策略；8、衍生品投资策略：（1）避险；（2）有效管理；9、境外回购交易及证券借贷交易策略；10、其他。
业绩比较基准	纳斯达克 100 指数收益率（经估值汇率调整） $\times$ 95%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪纳斯达克 100 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金可投资境外市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、国家/地区风险等境外投资面临的特有风险。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	王小飞
	联系电话	021-38909626	021-60637103
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	wangxiaofei.zh@ccb.com

客户服务电话	4008880800	021-60637228
传真	021-38909627	021-60635778
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）	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	上海市浦东新区浦电路 360 号陆家嘴投资大厦 9 楼、15 楼、16 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200122	100033
法定代表人	方一天	张金良

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	J. P. Morgan Chase
	中文	-	摩根大通银行
注册地址		-	1111 Polaris Parkway, Columbus, OH 43240, USA
办公地址		-	270 Park Avenue, New York
邮政编码		-	10017

注：本基金无境外投资顾问。

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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	基金管理人办公场所

2.6 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	上海市浦东新区浦电路 360 号陆家嘴投资大厦 9 楼、15 楼、16 楼

§ 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(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)	
	万家纳斯达克 100 指数发起式 (QDII)	万家纳斯达克 100 指数发起式 (QDII)
	A	C
本期已实现收益	2,387,680.41	1,835,111.02
本期利润	14,550,939.35	8,147,080.25

加权平均基金份额本期利润	0.0720	0.0381
本期加权平均净值利润率	5.64%	3.00%
本期基金份额净值增长率	7.47%	7.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-6,585,365.51	-5,895,750.29
期末可供分配基金份额利润	-0.0372	-0.0414
期末基金资产净值	246,197,766.21	197,135,653.02
期末基金份额净值	1.3906	1.3848
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	39.06%	38.48%

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

万家纳斯达克 100 指数发起式 (QDII) A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.51%	0.77%	5.59%	0.78%	-0.08%	-0.01%
过去三个月	16.54%	2.14%	16.47%	2.17%	0.07%	-0.03%

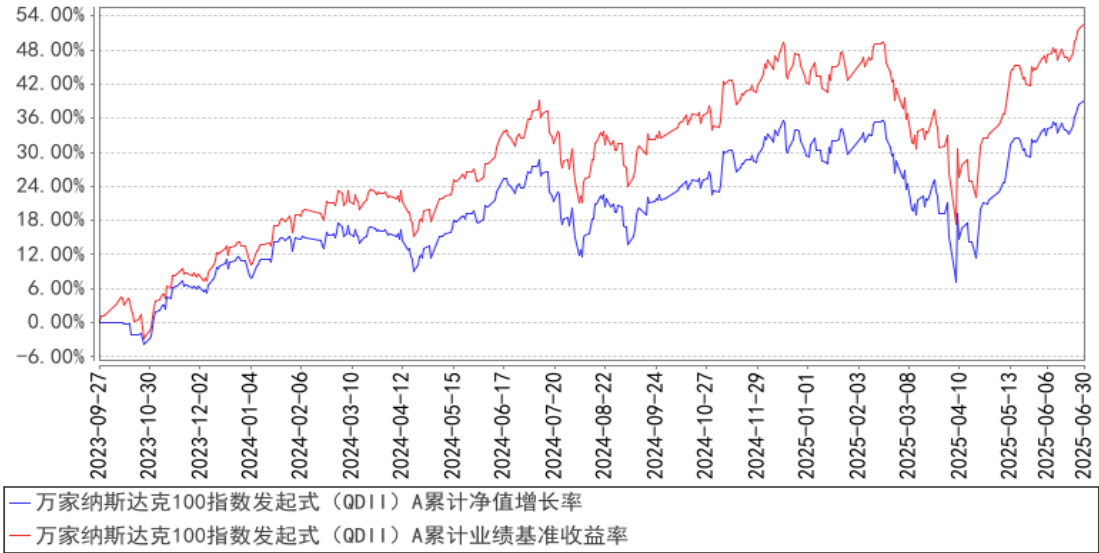
过去六个月	7.47%	1.81%	7.21%	1.84%	0.26%	-0.03%
过去一年	12.30%	1.53%	15.09%	1.56%	-2.79%	-0.03%
自基金合同生效起 至今	39.06%	1.27%	52.55%	1.32%	-13.49 %	-0.05%

万家纳斯达克 100 指数发起式 (QDII) C

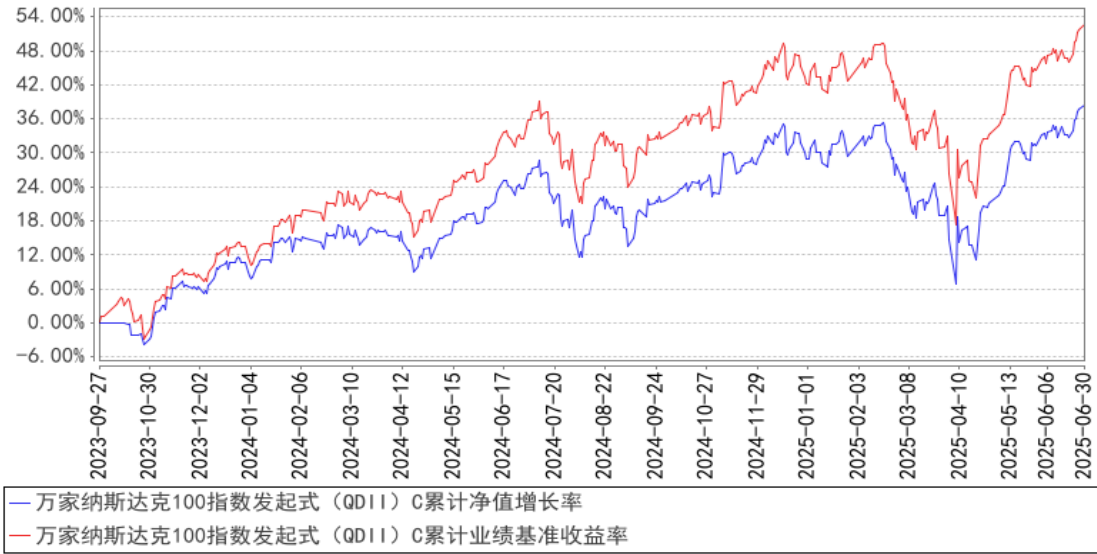
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①－③	②－④
过去一个月	5.49%	0.77%	5.59%	0.78%	-0.10%	-0.01%
过去三个月	16.46%	2.14%	16.47%	2.17%	-0.01%	-0.03%
过去六个月	7.32%	1.81%	7.21%	1.84%	0.11%	-0.03%
过去一年	11.98%	1.53%	15.09%	1.56%	-3.11%	-0.03%
自基金合同生效起 至今	38.48%	1.27%	52.55%	1.32%	-14.07 %	-0.05%

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

万家纳斯达克100指数发起式 (QDII) 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



万家纳斯达克100指数发起式 (QDII) C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2023 年 9 月 27 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。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）。截至 2025 年 6 月 30 日，公司共管理 173 只开放式基金，其中包括 42 只股票型基金、73 只混合型基金、41 只债券型基金、5 只货币市场基金、4 只 QDII 基金、8 只基金中基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨坤	万家中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金、万家中证 A500	2023 年 9 月 27 日	—	10 年	国籍：中国；学历：法国南特国立高等矿业学校自动化与工业信息技术专业硕士，2015 年 6 月入职万家基金管理有限公司，现任量化投资部基金经理，历任量化投资部研究员。曾任 Fractable 量化 IT 工程师等职。

交易型开 放式指数 证券投资 基金发起 式联接基 金、万家 中证港股 通创新药 交易型开 放式指数 证券投资 基金、万 家中证港 股通创新 药交易型 开放式指 数证券投资 基金发起 式联接基 金、万 家中证港 股通央企 红利交易 型开放式 指数证券 投资基金 、万家 中证港股 通央企红 利交易型 开放式指 数证券投资 基金联接 基金、 万家中证 红利交易 型开放式 指数证券 投资基金 、万家 中证红利 交易型开 放式指数 证券投资 基金联接				
--	--	--	--	--

基金、万家中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金、万家中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金、万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金、万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家北证 50 成份指数型发起式证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、万家国证 2000 交易				
---	--	--	--	--

型开放式 指数证券 投资基金 发起式联 接基金、 万家恒生 互联网科 技业交易 型开放式 指数证券 投资基金 (QDII)、 万家恒生 互联网科 技业交易 型开放式 指数证券 投资基金 发起式联 接基金 (QDII)、 万家沪深 300 交易 型开放式 指数证券 投资基金、 万家纳 斯达克 100 指数 型发起式 证券投资 基金 (QDII) 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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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》,管理人制定了《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。

管理人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。

4.4.2 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,管理人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 1 次,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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金作为被动投资的指数基金,其投资目标是通过跟踪、复制指数,为投资者获取市场长期的平均收益。报告期内我们严格按照基金合同规定,原则上采取完全复制的方法进行投资管理,努力拟合标的指数,减小跟踪误差,将基金跟踪误差控制在较低范围之内,导致跟踪误差的主要原因是基金申购赎回、标的指数成分股调整、成分股分红和基金费用等因素。同时,本基金采用有效的量化跟踪技术,降低管理成本。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家纳斯达克 100 指数发起式 (QDII) A 的基金份额净值为 1.3906 元, 本报告期基金份额净值增长率为 7.47%, 同期业绩比较基准收益率为 7.21%; 截至本报告期末万家纳斯达克 100 指数发起式 (QDII) C 的基金份额净值为 1.3848 元, 本报告期基金份额净值增长率为 7.32%, 同期业绩比较基准收益率为 7.21%。

基金报告期内 A 份额、C 份额日均跟踪偏离度分别为 0.0197%、0.0197%, 年跟踪误差分别为 0.5024%、0.5029%。符合基金合同中日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%、年跟踪误差不超过 4% 的规定。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年上半年, 美股整体呈现 V 型走势。年初美股震荡上行, 直至春节期间 DeepSeek 的横空出世动摇了美国科技垄断地位的预期, 引发科技板块估值重估, 美股科技巨头首先遭遇抛售压力。与此同时, 特朗普正式就职后推行“美国优先”政策, 大力推行关税和缩减政府支出政策, 市场提前计入衰退预期。4 月初, 特朗普对等关税政策超预期落地引发市场剧烈震荡, 全球主要股指大幅下挫。但随着中美日内瓦经贸会谈取得突破性进展, 市场对美国经济硬着陆的担忧显著缓解, 风险偏好快速回暖。叠加美国科技“七巨头”一季度财报业绩整体优于市场预期, 带动美股科技板块反弹修复。截至上半年末, 标普 500 累计上涨 5.5%, 道琼斯指数累计上涨 3.64%, 纳斯达克 100 上涨 7.93%。

展望未来, 美股整体处于历史高位, 纳斯达克 100 和标普 500 等主要指数创出历史新高, 但潜在风险因素正在积聚。近期公布的 7 月非农就业数据不及预期, 叠加劳工部下修了过去两个月的非农数据, 市场衰退预期升温, 美国经济不确定性增强。与此同时, 多重不确定性因素可能加剧市场波动: 关税政策的反复、特朗普与鲍威尔的博弈、地缘政治冲突、“大而美”法案加剧美国债务压力的风险等。尽管美股长期投资价值依然显著, 但在多重风险因素交织下, 预计下半年美股市场波动有所加剧。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定, 对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会, 估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序, 指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验, 熟悉相关法律法规, 具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与

估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.8 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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，存续期未满三年，不适用本项说明。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 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：万家纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII)

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			

货币资金	6.4.7.1	41,680,513.94	71,455,712.64
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	416,507,874.91	558,424,361.73
其中：股票投资		416,507,874.91	558,424,361.73
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		2,859,424.53	2,874,280.59
应收股利		56,942.02	164,085.59
应收申购款		1,070,287.90	2,891,115.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		462,175,043.30	635,809,555.61
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		18,491,870.74	36,060,495.49
应付管理人报酬		185,526.94	258,577.86
应付托管费		55,658.10	77,573.36
应付销售服务费		34,134.74	57,151.73
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	74,433.55	167,964.55
负债合计		18,841,624.07	36,621,762.99
净资产：			

实收基金	6.4.7.7	319,405,971.63	463,748,534.87
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	123,927,447.60	135,439,257.75
净资产合计		443,333,419.23	599,187,792.62
负债和净资产总计		462,175,043.30	635,809,555.61

注： 报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额总额 319,405,971.63 份，其中万家纳斯达克 100 指数发起式（QDII）A 基金份额净值 1.3906 元，基金份额总额 177,046,252.32 份；万家纳斯达克 100 指数发起式（QDII）C 基金份额净值 1.3848 元，基金份额总额 142,359,719.31 份。

6.2 利润表

会计主体： 万家纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII)

本报告期： 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位： 人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		24,766,087.01	8,478,464.82
1. 利息收入		130,436.69	44,258.96
其中： 存款利息收入	6.4.7.10	130,436.69	44,258.96
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）		5,353,375.03	314,412.82
其中： 股票投资收益	6.4.7.11	3,611,990.24	58,956.44
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资 收益	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	1,741,384.79	255,456.38
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	18,475,228.17	10,187,162.50
4. 汇兑收益（损失以“-”		792,516.90	-2,084,837.35

号填列)			
5. 其他收入 (损失以 “-” 号填列)	6. 4. 7. 19	14, 530. 22	17, 467. 89
减: 二、营业总支出		2, 068, 067. 41	307, 074. 15
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	1, 317, 473. 42	183, 123. 38
其中: 暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	395, 242. 06	54, 936. 99
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	270, 610. 58	45, 553. 27
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. 20	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 21	84, 741. 35	23, 460. 51
三、利润总额 (亏损总额以 “-” 号填列)		22, 698, 019. 60	8, 171, 390. 67
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以 “-” 号填列)		22, 698, 019. 60	8, 171, 390. 67
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		22, 698, 019. 60	8, 171, 390. 67

6.3 净资产变动表

会计主体: 万家纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII)

本报告期: 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	463, 748, 534. 87	-	135, 439, 257. 75	599, 187, 792. 62
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	463, 748, 534. 87	-	135, 439, 257. 75	599, 187, 792. 62
三、本期增减变动额 (减少以 “-” 号填列)	-144, 342, 563. 24	-	-11, 511, 810. 15	-155, 854, 373. 39

(一)、综合收益总额	-	-	22,698,019.60	22,698,019.60
(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)	-144,342,563.24	-	-34,209,829.75	-178,552,392.99
其中：1. 基金申购款	163,357,718.47	-	48,259,821.90	211,617,540.37
2. 基金赎回款	-307,700,281.71	-	-82,469,651.65	-390,169,933.36
(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	319,405,971.63	-	123,927,447.60	443,333,419.23
项目	上年度可比期间 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	12,204,376.42	-	1,315,406.80	13,519,783.22
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	12,204,376.42	-	1,315,406.80	13,519,783.22
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	105,719,872.07	-	26,670,462.84	132,390,334.91
(一)、综合收益总额	-	-	8,171,390.67	8,171,390.67
(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)	105,719,872.07	-	18,499,072.17	124,218,944.24

“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	220,082,429.14	-	37,605,099.57	257,687,528.71
2. 基金赎回款	-114,362,557.07	-	-19,106,027.40	-133,468,584.47
(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	117,924,248.49	-	27,985,869.64	145,910,118.13

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

方一天

陈广益

尹超

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

万家纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) (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]1907 号文《关于准予万家纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) 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 26 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 ZA31767 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 27 日生效, 本基金为契约型开放式, 存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金 (本金) 为人民币 10,001,073.00 元, 折合 10,001,073.00 份基金份额, 有效认购资金在基金验资确认日之前未产生利息。本基金的基金管理人与注册登记机构均为万家基金管理有限公司, 基金托管人为中国建设银行股份有限公司, 境外托管人为摩根大通银行。

本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股 (含存托凭证)。此外, 本基金还可投资于以下金融产品或工具: 境外市场投资工具包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家

或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（含交易型开放式指数基金（ETF））；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；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。境内市场投资工具包括债券（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、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以进行境外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易。有关证券借贷交易的内容以专门签署的三方或多方协议约定为准。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：纳斯达克 100 指数收益率（经估值汇率调整） $\times 95\%$ +银行活期存款利率（税后） $\times 5\%$ 。

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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日至 2025 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、城建税、教育费附加及地方教育附加

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；

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加；

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收增值税。

（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；

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内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；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规

执行，在境内暂不征收个人所得税。

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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	41,680,513.94
等于：本金	41,678,323.79
加：应计利息	2,190.15
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	41,680,513.94

注：截至 2025 年 6 月 30 日本基金持有的银行存款外币余额为：2,441,941.19 美元(折合人民币 17,480,880.21 元)。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	371,744,630.90	-	416,507,874.91	44,763,244.01
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	371,744,630.90	-	416,507,874.91	44,763,244.01

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 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	49.79
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	74,383.76
合计	74,433.55

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

万家纳斯达克 100 指数发起式 (QDII) A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	215,996,242.14	215,996,242.14
本期申购	51,270,943.36	51,270,943.36
本期赎回 (以“-”号填列)	-90,220,933.18	-90,220,933.18
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	177,046,252.32	177,046,252.32

万家纳斯达克 100 指数发起式 (QDII) C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	247,752,292.73	247,752,292.73
本期申购	112,086,775.11	112,086,775.11
本期赎回（以“-”号填列）	-217,479,348.53	-217,479,348.53
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	142,359,719.31	142,359,719.31

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

万家纳斯达克 100 指数发起式 (QDII) A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-10,753,020.53	74,257,266.70	63,504,246.17
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-10,753,020.53	74,257,266.70	63,504,246.17
本期利润	2,387,680.41	12,163,258.94	14,550,939.35
本期基金份额交易产生的变动数	1,779,974.61	-10,683,646.24	-8,903,671.63
其中：基金申购款	-2,504,774.31	17,646,832.65	15,142,058.34
基金赎回款	4,284,748.92	-28,330,478.89	-24,045,729.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,585,365.51	75,736,879.40	69,151,513.89

万家纳斯达克 100 指数发起式 (QDII) C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-13,050,908.26	84,985,919.84	71,935,011.58
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-13,050,908.26	84,985,919.84	71,935,011.58
本期利润	1,835,111.02	6,311,969.23	8,147,080.25
本期基金份额交易产生的变动数	5,320,046.95	-30,626,205.07	-25,306,158.12
其中：基金申购款	-5,855,520.35	38,973,283.91	33,117,763.56
基金赎回款	11,175,567.30	-69,599,488.98	-58,423,921.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,895,750.29	60,671,684.00	54,775,933.71

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	130,430.81
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	—
其他	5.88
合计	130,436.69

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,611,990.24
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	3,611,990.24

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	224,063,975.16
减：卖出股票成本总额	220,413,293.72
减：交易费用	38,691.20
买卖股票差价收入	3,611,990.24

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

本基金本报告期无债券投资收益。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,741,384.79
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,741,384.79

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	18,475,228.17
股票投资	18,475,228.17
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	18,475,228.17

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	14,530.22
合计	14,530.22

6.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行费用	5,361.52
账户维护费	4,500.00
其他	496.07
合计	84,741.35

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

本报告期内，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
中泰证券股份有限公司（“中泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
万家财富基金销售（天津）有限公司（“万家财富”）	基金管理人的子公司、基金销售机构
摩根大通银行（“摩根大通银行”）	境外资产托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

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基金交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	1,317,473.42	183,123.38
其中：应支付销售机构的客户维护费	567,289.82	68,382.51
应支付基金管理人的净管理费	750,183.60	114,740.87

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月首日起 5 个工作日内按照指定的账户路径进行支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	395,242.06	54,936.99

注：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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月首日起 5 个工作日内按照指定的账户路径进行支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家纳斯达克 100 指数发起式 (QDII) A	万家纳斯达克 100 指数发起式 (QDII) C	合计
建设银行	—	3,986.72	3,986.72
万家财富	—	6,308.18	6,308.18
万家基金	—	1,146.77	1,146.77
中泰证券	—	5.77	5.77
合计	—	11,447.44	11,447.44
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	万家纳斯达克 100 指数发起式 (QDII) A	万家纳斯达克 100 指数发起式 (QDII) C	合计
万家财富	—	5,751.89	5,751.89
万家基金	—	1,186.48	1,186.48
合计	—	6,938.37	6,938.37

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 0.20%，按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

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

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

销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月首日起 5 个工作日内按照指定的账户路径进行支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	万家纳斯达克 100 指数发起式 (QDII) A	万家纳斯达克 100 指数发起式 (QDII) C
基金合同生效日(2023 年 9 月 27 日) 持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减: 报告期间赎回/卖出总份 额	—	—
报告期末持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	2.8241%	3.5122%
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	万家纳斯达克 100 指数发起式 (QDII) A	万家纳斯达克 100 指数发起式 (QDII) C
基金合同生效日(2023 年 9 月 27 日) 持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减: 报告期间赎回/卖出总份 额	—	—

报告期末持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	10.4067%	7.1553%

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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
建设银行	24,199,827.66	59,925.20	12,526,538.12	10,655.28
摩根大通银行	17,480,686.28	70,505.61	10,117,574.16	33,402.95

注：本基金的银行存款由基金境内托管人中国建设银行股份有限公司和境外托管人摩根大通银行保管，存款按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方所承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间没有需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2025 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 2025 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 2025 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，建立了四道防线：以各岗位目标责任制为基础，形成第一道防线；合规风控部门通过完善的风险控制制度和手段对各一线部门的风险管理工作进行指导、管理和监督，形成第二道防线；独立的监察稽核部门对公司内部控制制度的总体执行情况和有效性进行监督、检查、评估和反馈，形成第三道防线；董事会及其风险管理委员会听取公司管理层对公司整体运营情况的报告，并提出指导性意见，形成第四道防线。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。(2024 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（2025 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 2025 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	41,680,513.94	-	-	-	-	-	41,680,513.94
交易性金融资产	-	-	-	-	-	416,507,874.91	416,507,874.91
应收股利	-	-	-	-	-	56,942.02	56,942.02
应收申购款	2,054.00	-	-	-	-	1,068,233.90	1,070,287.90
应收清算款	-	-	-	-	-	2,859,424.53	2,859,424.53

资产总计	41,682,567.94	-	-	-	-	-420,492,475.36	462,175,043.30
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	18,491,870.74	18,491,870.74
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	185,526.94	185,526.94
应付托管费	-	-	-	-	-	55,658.10	55,658.10
应付销售服务费	-	-	-	-	-	34,134.74	34,134.74
其他负债	-	-	-	-	-	74,433.55	74,433.55
负债总计	-	-	-	-	-	18,841,624.07	18,841,624.07
利率敏感度缺口	41,682,567.94	-	-	-	-	-401,650,851.29	443,333,419.23
上年度末 2024 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	71,455,712.64	-	-	-	-	-	71,455,712.64
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-558,424,361.73	558,424,361.73
应收股利	-	-	-	-	-	164,085.59	164,085.59
应收申购款	4,475.02	-	-	-	-	2,886,640.04	2,891,115.06
应收清算款	-	-	-	-	-	2,874,280.59	2,874,280.59
资产总计	71,460,187.66	-	-	-	-	-564,349,367.95	635,809,555.61
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	36,060,495.49	36,060,495.49
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	258,577.86	258,577.86
应付托管费	-	-	-	-	-	77,573.36	77,573.36
应付销售服务费	-	-	-	-	-	57,151.73	57,151.73
其他负债	-	-	-	-	-	167,964.55	167,964.55
负债总计	-	-	-	-	-	36,621,762.99	36,621,762.99
利率敏感度缺口	71,460,187.66	-	-	-	-	-527,727,604.96	599,187,792.62

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 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2024 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（2024 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民 币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
货币资金	17,480,880.21	-	-	17,480,880.21
交易性金融资产	416,507,874.91	-	-	416,507,874.91
应收股利	56,942.02	-	-	56,942.02
应收清算款	2,859,424.53	-	-	2,859,424.53
资产合计	436,905,121.67	-	-	436,905,121.67
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	436,905,121.67	-	-	436,905,121.67
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民 币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
货币资金	33,252,283.74	-	-	33,252,283.74
交易性金融资产	558,424,361.73	-	-	558,424,361.73
应收股利	164,085.5	-	-	164,085.59

	9			
应收清算款	2, 874, 280 . 59	-	-	2, 874, 280. 59
资产合计	594, 715, 0 11. 65	-	-	594, 715, 011. 65
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	594, 715, 0 11. 65	-	-	594, 715, 011. 65

6. 4. 13. 4. 2. 2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变 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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	所有外币相对于人 民币升值 5%	20, 828, 240. 85	27, 929, 422. 37
	所有外币相对于人 民币贬值 5%	-20, 828, 240. 85	-27, 929, 422. 37

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，所面临的最大的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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	416,507,874.91	93.95	558,424,361.73	93.20
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	416,507,874.91	93.95	558,424,361.73	93.20

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准增加 5%	21,681,785.97	28,307,475.74
	业绩比较基准减少 5%	-21,681,785.97	-28,307,475.74

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	416,507,874.91	558,424,361.73

第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	416, 507, 874. 91	558, 424, 361. 73

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	416, 507, 874. 91	90. 12
	其中：普通股	411, 552, 768. 73	89. 05
	存托凭证	4, 955, 106. 18	1. 07
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-

	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	41,680,513.94	9.02
8	其他各项资产	3,986,654.45	0.86
9	合计	462,175,043.30	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	416,507,874.91	93.95
合计	416,507,874.91	93.95

注：国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
材料	5,383,951.13	1.21
可选消费品	55,779,264.99	12.58
必需消费品	21,606,315.74	4.87
能源	1,904,429.70	0.43
金融	1,761,541.90	0.40
医疗保健	20,085,444.76	4.53
工业	18,675,975.27	4.21
信息技术	220,362,661.83	49.71
通信服务	64,279,611.99	14.50
公用事业	5,842,185.73	1.32
房地产	826,491.87	0.19
合计	416,507,874.91	93.95

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的权益投资。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

7.4.1 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权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	NVIDI	英伟达	NVDA	纳斯达克	美国	33,764	38,186,652.29	8.61

	A Corp	公司	US	克 证 券 交 易 所				
2	Micro soft Corp	微软公 司	MSFT US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	10, 285	36, 622, 408. 64	8. 26
3	Apple Inc	苹果公 司	AAPL US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	20, 668	30, 355, 710. 85	6. 85
4	Amazo n. com Inc	亚马逊 公司	AMZN US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	14, 691	23, 072, 586. 51	5. 20
5	Broad com Inc	博通公 司	AVGO US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	10, 761	21, 234, 337. 92	4. 79
6	Meta Platf orms Inc	脸书	META US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3, 004	15, 872, 207. 99	3. 58
7	Netfl ix Inc	奈飞公 司	NFLX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1, 449	13, 890, 542. 93	3. 13
8	Tesla Inc	特斯拉	TSLA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	5, 036	11, 451, 868. 41	2. 58
9	Costc o Whole sale Corp	好市多 公司	COST US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1, 510	10, 700, 742. 57	2. 41
10	Alpha bet Inc	谷歌-A	GOOGL US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	8, 054	10, 160, 604. 87	2. 29
11	Alpha bet Inc	谷歌-C	GOOG US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	7, 554	9, 592, 553. 06	2. 16
12	Palan tir Techn ologi es Inc	Palant ir 公 司	PLTR US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	7, 704	7, 518, 028. 15	1. 70
13	Cisco Syste ms Inc	思科	CSCO US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	13, 482	6, 696, 019. 57	1. 51
14	T-Mob	T-Mobi	TMUS	纳 斯 达	美国	3, 866	6, 593, 880. 67	1. 49

	ile US Inc	1 公司	US	克 证 券 交易所				
15	Advanced Micro Devices Inc	超威半导体	AMD US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	5,520	5,607,245.48	1.26
16	Linde PLC	Linde 公司	LIN US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	1,603	5,383,951.13	1.21
17	Intuit Inc	财捷公司	INTU US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	950	5,356,411.71	1.21
18	Intuitive Surgical Inc	直觉外科手术公司	ISRG US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	1,220	4,745,866.89	1.07
19	Booking Holdings Inc	Bookin g 公司	BKNG US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	111	4,600,156.73	1.04
20	Texas Instruments Inc	德州仪器公司	TXN US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	3,093	4,597,028.57	1.04
21	PepsiCo Inc	百事	PEP US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	4,668	4,412,294.17	1.00
22	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	3,738	4,261,613.94	0.96
23	Adobe Inc	奥多比	ADBE US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	1,451	4,018,572.31	0.91
24	Amgen Inc	安进公司	AMGN US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	1,831	3,659,716.20	0.83
25	Honeywell International Inc	霍尼韦尔国际公司	HON US	纳 斯 达 克 证 券 交易所	美国	2,188	3,647,603.35	0.82

26	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT US	纳斯达克证券交易所	美国	2,732	3,580,354.03	0.81
27	Shopify Inc	Shopify 公司	SHOP US	纳斯达克证券交易所	美国	4,147	3,424,362.48	0.77
28	Gilead Sciences Inc	吉利德科学公司	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	4,235	3,361,209.31	0.76
29	Micro n Technology Inc	美光科技公司	MU US	纳斯达克证券交易所	美国	3,805	3,357,141.80	0.76
30	Palo Alto Networks Inc	Palo Alto 网络公司	PANW US	纳斯达克证券交易所	美国	2,270	3,325,404.50	0.75
31	Comcast Corp	康卡斯特公司	CMCSA US	纳斯达克证券交易所	美国	12,679	3,239,363.21	0.73
32	MercadoLibre Inc	MercadoLibre 公司	MELI US	纳斯达克证券交易所	美国	173	3,236,818.19	0.73
33	CrowdStrike Holdings Inc	CrowdStrike 公司	CRWD US	纳斯达克证券交易所	美国	848	3,091,762.69	0.70
34	Automatic Data Processing Inc	自动数据处理公司	ADP US	纳斯达克证券交易所	美国	1,382	3,051,058.32	0.69
35	Lam Research Corp	拉姆研究公司	LRCX US	纳斯达克证券交易所	美国	4,355	3,034,642.93	0.68

36	KLA Corp	科天半导体公司	KLAC US	纳斯达克证券交易所	美国	450	2,885,509.96	0.65
37	Analog Devices Inc	亚德诺公司	ADI US	纳斯达克证券交易所	美国	1,689	2,877,870.16	0.65
38	Vertex Pharmaceuticals Inc	福泰制药公司	VRTX US	纳斯达克证券交易所	美国	874	2,785,445.62	0.63
39	AppLovin Corp	Applovin 公司	APP US	纳斯达克证券交易所	美国	1,048	2,626,374.66	0.59
40	Starbucks Corp	星巴克	SBUX US	纳斯达克证券交易所	美国	3,869	2,537,841.60	0.57
41	Strategy Inc	微策投资公司	MSTR US	纳斯达克证券交易所	美国	864	2,500,174.84	0.56
42	Constellation Energy Corp	Constellation 能源公司	CEG US	纳斯达克证券交易所	美国	1,067	2,465,313.89	0.56
43	DoorDash Inc	DoorDash 公司	DASH US	纳斯达克证券交易所	美国	1,357	2,394,652.42	0.54
44	Intel Corp	英特尔公司	INTC US	纳斯达克证券交易所	美国	14,850	2,381,236.70	0.54
45	Cintas Corp	信达思公司	CTAS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,375	2,193,726.13	0.49
46	Mondelez International Inc	亿滋国际有限公司	MDLZ US	纳斯达克证券交易所	美国	4,408	2,128,076.54	0.48
47	Cadence Design	铿腾电子公司	CDNS US	纳斯达克证券交易所	美国	930	2,051,508.01	0.46

	n Syste ms Inc							
48	Forti net Inc	飞塔公 司	FTNT US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	2,606	1,972,239.54	0.44
49	Synop sys Inc	新思科 技公司	SNPS US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	528	1,937,797.51	0.44
50	O'Rei lly Autom otive Inc	奥莱利 汽车股 份有限 公司	ORLY US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	2,910	1,877,545.44	0.42
51	Marri ott Inter natio nal Inc/M D	万豪国 际	MAR US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	932	1,822,806.63	0.41
52	PayPa l Holdi ngs Inc	贝宝公 司	PYPL US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	3,311	1,761,541.90	0.40
53	ASML Holdi ng NV	阿斯麦 公司	ASML US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	298	1,709,575.48	0.39
54	PDD Holdi ngs Inc	拼多多	PDD US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	2,274	1,703,724.18	0.38
55	Marve ll Techn ology Inc	迈威尔 科技公 司	MRVL US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	2,935	1,626,212.00	0.37
56	Autod esk Inc	欧特克 有限公 司	ADSK US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	729	1,615,528.01	0.36
57	Axon Enter prise Inc	Axon 公司	AXON US	纳 斯 达 克 证 券 交易 所	美国	265	1,570,626.19	0.35

58	CSX Corp	CSX 运输公司	CSX US	纳斯达克证券交易所	美国	6,395	1,493,776.83	0.34
59	Monster Beverage Corp	怪物饮料公司	MNST US	纳斯达克证券交易所	美国	3,320	1,488,736.82	0.34
60	Roper Technologies Inc	儒博科技公司	ROP US	纳斯达克证券交易所	美国	366	1,485,147.78	0.33
61	Charter Communications Inc	特许通讯公司	CHTR US	纳斯达克证券交易所	美国	478	1,398,870.47	0.32
62	Airbnb Inc	爱彼迎	ABNB US	纳斯达克证券交易所	美国	1,469	1,391,685.24	0.31
63	Regeneron Pharmaceuticals Inc	再生元制药股份有限公司	REGN US	纳斯达克证券交易所	美国	361	1,356,733.67	0.31
64	American Electric Power Co Inc	美国电力公司	AEP US	纳斯达克证券交易所	美国	1,819	1,351,110.16	0.30
65	NXP Semiconductors NV	恩智浦半导体公司	NXPI US	纳斯达克证券交易所	美国	860	1,345,110.96	0.30
66	Paycom Software Inc	沛齐公司	PAYX US	纳斯达克证券交易所	美国	1,226	1,276,621.49	0.29
67	Workday Inc	Workday 公司	WDAY US	纳斯达克证券交易所	美国	735	1,262,777.04	0.28
68	PACCA	帕卡公	PCAR	纳斯达克	美国	1,787	1,216,047.27	0.27

	R Inc	司	US	克 证 券 交 易 所				
69	Zscal er Inc	Zscale r 公司	ZS US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	530	1, 191, 106. 57	0. 27
70	Faste nal Co	快扣	FAST US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3, 906	1, 174, 382. 65	0. 26
71	Copar t Inc	科帕特 公司	CPRT US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3, 289	1, 155, 335. 26	0. 26
72	Keuri g Dr Peppe r Inc	Keurig Dr Pepper 公司	KDP US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	4, 624	1, 094, 331. 17	0. 25
73	Take- Two Inter activ e Softw are	TAKE-T WO 互 动软件 公司	TTWO US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	620	1, 077, 848. 93	0. 24
74	Exelo n Corp	爱克斯 龙电力 公司	EXC US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3, 437	1, 068, 310. 38	0. 24
75	Veris k Analy tics Inc	Verisk Analyt ics 公 司	VRSK US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	476	1, 061, 434. 26	0. 24
76	IDEX Labor atorie s Inc	IDEX 实验室 公司	IDXX US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	274	1, 052, 007. 53	0. 24
77	Datad og Inc	Datado g 公司	DDOG US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1, 088	1, 046, 236. 83	0. 24
78	Coca- Cola Europ acifi c Partn ers	可口可 乐欧洲 合伙公 司	CCEP US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1, 563	1, 037, 434. 05	0. 23
79	Ross	罗斯百	ROST	纳 斯 达	美国	1, 120	1, 022, 889. 49	0. 23

	Stores Inc	货公司	US	克 证 券 交 易 所				
80	AstraZeneca PLC	阿斯利康制药有限公司	AZN US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,029	1,014,992.98	0.23
81	Diamondback Energy Inc	DIAMONDBACK 能源公司 FANG	FANG US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	995	978,673.68	0.22
82	Electronic Arts Inc	艺电公司	EA US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	854	976,317.07	0.22
83	Xcel Energy Inc	碍克希尔能源公司	XEL US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,964	957,451.30	0.22
84	Cognizant Technology Solutions	高知特科技公司	CTSH US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,678	937,306.57	0.21
85	Baker Hughes Co	贝克休斯公司	BKR US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	3,373	925,756.02	0.21
86	Microchip Technology Inc	微芯科技公司	MCHP US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,836	924,886.25	0.21
87	Old Dominion Freight Line Inc	统领货运线公司	ODFL US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	719	835,363.52	0.19
88	Dexcom Inc	德康医疗公司	DXCM US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,335	834,207.05	0.19
89	GE Healthcare	GE Healthcare	GEHC US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,559	826,640.27	0.19

	Technologies Inc	技术公司						
90	CoStar Group Inc	科斯塔集团	CSGP US	纳斯达克证券交易所	美国	1,436	826,491.87	0.19
91	Atlasian Corp	Atlassian 公司	TEAM US	纳斯达克证券交易所	美国	563	818,511.96	0.18
92	Trade Desk Inc/The	Trade Desk 公司	TTD US	纳斯达克证券交易所	美国	1,526	786,420.46	0.18
93	ANSYS INC	安西斯公司	ANSS US	纳斯达克证券交易所	美国	299	751,758.80	0.17
94	Kraft Heinz Co/The	卡夫亨氏公司	KHC US	纳斯达克证券交易所	美国	4,029	744,700.42	0.17
95	Warner Bros Discovery Inc	华纳兄弟股份有限公司	WBD US	纳斯达克证券交易所	美国	8,423	691,002.33	0.16
96	Lululemon Athletica Inc	露露乐蒙公司	LULU US	纳斯达克证券交易所	美国	392	666,690.15	0.15
97	CDW Corp/DE	CDW 公司	CDW US	纳斯达克证券交易所	美国	448	572,747.56	0.13
98	ON Semiconductor Corp	安森美半导体	ON US	纳斯达克证券交易所	美国	1,423	533,884.31	0.12
99	ARM Holdings PLC	ARM 公司	ARM US	纳斯达克证券交易所	美国	455	526,813.54	0.12
100	GLOBALFOUND	格芯股份有限公司	GFS US	纳斯达克证券交易所	美国	1,882	514,648.93	0.12

	DRIES Inc	公司		交易所				
101	Biogen Inc	生物基因公司	BIIB US	纳斯达克证券交易所	美国	499	448,625.24	0.10

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.4.2 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权益投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的权益投资。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	Apple Inc	AAPL US	4,880,810.59	0.81
2	NVIDIA Corp	NVDA US	4,553,633.78	0.76
3	Microsoft Corp	MSFT US	4,296,487.22	0.72
4	Shopify Inc	SHOP US	3,769,660.67	0.63
5	Amazon.com Inc	AMZN US	3,335,255.28	0.56
6	Broadcom Inc	AVGO US	2,484,000.27	0.41
7	Meta Platforms Inc	META US	2,068,183.09	0.35
8	Tesla Inc	TSLA US	1,856,739.05	0.31
9	Costco Wholesale Corp	COST US	1,537,948.05	0.26
10	Alphabet Inc	GOOGL US	1,529,146.65	0.26
11	Alphabet Inc	GOOG US	1,459,513.48	0.24
12	Netflix Inc	NFLX US	1,435,523.22	0.24
13	Strategy Inc	MSTR US	971,706.73	0.16
14	T-Mobile US Inc	TMUS US	965,623.09	0.16
15	Cisco Systems Inc	CSCO US	850,301.27	0.14
16	Palantir Technologies Inc	PLTR US	731,030.40	0.12
17	Linde PLC	LIN US	728,419.21	0.12
18	Intuitive Surgical Inc	ISRG US	712,881.58	0.12
19	PepsiCo Inc	PEP US	683,339.86	0.11
20	Adobe Inc	ADBE US	665,919.32	0.11

注：1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、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。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	Apple Inc	AAPL US	19,415,857.63	3.24
2	Microsoft Corp	MSFT US	18,303,693.53	3.05
3	NVIDIA Corp	NVDA US	18,258,518.47	3.05
4	Amazon.com Inc	AMZN US	12,383,754.00	2.07
5	Broadcom Inc	AVGO US	9,503,409.49	1.59
6	Meta Platforms Inc	META US	8,217,977.44	1.37
7	Netflix Inc	NFLX US	6,554,965.47	1.09
8	Tesla Inc	TSLA US	6,347,924.26	1.06
9	Costco Wholesale Corp	COST US	6,330,237.97	1.06
10	Alphabet Inc	GOOGL US	5,793,515.24	0.97
11	Alphabet Inc	GOOG US	5,622,072.76	0.94
12	T-Mobile US Inc	TMUS US	4,348,763.00	0.73
13	Cisco Systems Inc	CSCO US	3,622,763.89	0.60
14	Linde PLC	LIN US	3,189,348.58	0.53
15	Palantir Technologies Inc	PLTR US	3,115,694.03	0.52
16	PepsiCo Inc	PEP US	2,807,836.11	0.47
17	Adobe Inc	ADBE US	2,728,399.17	0.46
18	Intuitive Surgical Inc	ISRG US	2,721,948.93	0.45
19	Intuit Inc	INTU US	2,614,853.99	0.44
20	Advanced Micro Devices Inc	AMD US	2,530,544.35	0.42

注：1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、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。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	60,021,578.73
卖出收入（成交）总额	224,063,975.16

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。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注**7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

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

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	2,859,424.53
3	应收股利	56,942.02
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,070,287.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,986,654.45

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**7.11.5.1 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。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
万家纳斯 达克 100 指数发起 式 (QDII) A	30,586	5,788.47	11,189,788.23	6.32	165,856,464.09	93.68
万家纳斯 达克 100 指数发起 式 (QDII) C	35,995	3,954.99	5,000,007.25	3.51	137,359,712.06	96.49
合计	62,239	5,131.93	16,189,795.48	5.07	303,216,176.15	94.93

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	万家纳斯达克 100 指数发起式 (QDII) A	803,935.06	0.4541
	万家纳斯达克 100 指数发起式 (QDII) C	439,533.64	0.3087
	合计	1,243,468.70	0.3893

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	万家纳斯达克 100 指数发起式 (QDII) A	50~100
	万家纳斯达克 100 指数发起式 (QDII) C	0~10
	合计	50~100

本基金基金经理持有 本开放式基金	万家纳斯达克 100 指数发起式 (QDII) A	0
	万家纳斯达克 100 指数发起式 (QDII) C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	3.13	10,000,000.00	3.13	自基金合同生效日起不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	10,000,000.00	3.13	10,000,000.00	3.13	自基金合同生效日起不少于 3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家纳斯达克 100 指数发起式 (QDII) A	万家纳斯达克 100 指数发起式 (QDII) C
基金合同生效日 (2023 年 9 月 27 日) 基金份额总额	5,001,053.00	5,000,020.00
本报告期期初基金份额总额	215,996,242.14	247,752,292.73
本报告期基金总申购份额	51,270,943.36	112,086,775.11
减：本报告期基金总赎回份额	90,220,933.18	217,479,348.53
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	177,046,252.32	142,359,719.31

§ 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

基金管理人：

无。

基金托管人：

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

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未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

			(%)		(%)	
海通国际	-	284,085,554.23	100.00	38,691.20	100.00	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
高盛证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源西部证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
中银国际证券	2	-	-	-	-	-

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准

为加强证券投资基金交易费用管理，管理人特制定《证券投资基金交易费用管理办法》。依据该办法，管理人设立合作证券公司备选库，并按照业务类型进行分类管理。备选库具体分为被动股票型基金合作证券公司备选库和其他类型基金合作证券公司备选库。纳入备选库内的证券经营机构方可参与管理人基金产品的证券交易服务。

选择证券公司参与证券交易的标准如下：

- (1) 财务状况稳健：证券公司应具备良好的财务状况，经营行为符合相关法律法规及行业规范；
- (2) 内控与风控能力强：证券公司具备完善的内部控制制度，合规管理和风险控制能力较强；
- (3) 技术支持完善：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求；
- (4) 专业能力与服务水平：具有较强的研究能力及金融服务水平，或在交易服务、券商结算等业务方面具备较强能力。

2、选择证券公司参与证券交易的程序

(1) 管理人从财务状况、研究服务能力、风险管理能力、合规管理能力、交易服务水平、交易信息技术能力等方面对证券公司进行评估考察，经内部审批完成后，最终确定入选合作证券公司的备选库。

(2) 与入选备选库证券公司达成合作意向后，双方签订协议，明确双方的权利义务，包括服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式等。

3、基金专用交易席位的变更情况：

本报告期内，本基金减少东北证券交易单元 1 个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金 2025 年 1 月 9 日因境外主要投资市场节假日暂停开放申购（含转换转入及定期定额投资）、赎回（含转换转出）业务的公告	指定媒介	2025 年 1 月 8 日
2	关于万家纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金（QDII）2025 年境外主要投资场所节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	指定媒介	2025 年 1 月 10 日
3	万家纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金(QDII)2024 年第 4 季度报告	指定媒介	2025 年 1 月 21 日

4	关于万家纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) 暂停大额申购 (含定期定额投资) 的公告	指定媒介	2025 年 2 月 24 日
5	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在中山证券开通申购、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2025 年 3 月 11 日
6	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在国泰君安证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2025 年 3 月 14 日
7	万家纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) 2024 年年度报告	指定媒介	2025 年 3 月 29 日
8	万家基金管理有限公司关于增加邮储银行为旗下部分基金销售机构并开通定投业务的公告	指定媒介	2025 年 4 月 19 日
9	万家纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) 2025 年第 1 季度报告	指定媒介	2025 年 4 月 21 日
10	万家基金管理有限公司关于增加申万宏源及申万宏源西部证券为旗下部分基金销售机构并开通定投及参与费率优惠活动的公告	指定媒介	2025 年 5 月 7 日
11	万家基金管理有限公司关于增加广发银行为旗下部分基金销售机构并开通转换、定投业务的公告	指定媒介	2025 年 6 月 13 日
12	万家基金管理有限公司关于增加宁波银行为旗下部分基金销售机构并开通定投业务的公告	指定媒介	2025 年 6 月 18 日
13	关于万家纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) 恢复大额申购 (含定期定额投资) 并设置总规模上限的公告	指定媒介	2025 年 6 月 28 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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、《万家纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) 基金合同》。

- 3、《万家纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) 托管协议》。
- 4、万家纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) 2025 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

2025 年 8 月 29 日