

万家沪深 300 指数增强型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 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：宁波银行股份有限公司

送出日期：2026 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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 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 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	58

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	58
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	59
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	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
§ 8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
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	61
§ 9 开放式基金份额变动	61
§ 10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
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	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	62
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	63
10.8 其他重大事件	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	64
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	64
§ 12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家沪深 300 指数增强型证券投资基金		
基金简称	万家沪深 300 指数增强		
基金主代码	002670		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2016 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	宁波银行股份有限公司		
报告期末基金份 额总额	685,727,179.02 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基 金简称	万家沪深 300 指数增强 A	万家沪深 300 指数增强 C	万家沪深 300 指数增强 Y
下属分级基金的交 易代码	002670	002671	022917
报告期末下属分级 基金的份额总额	464,057,824.08 份	212,490,627.45 份	9,178,727.49 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金，采取量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，在力求有效跟踪标的指数基础上，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.5%的基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型指数产品，在标的指数成份股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。 1、股票投资策略（（1）指数化投资策略、（2）指数增强策略、（3）存托凭证投资策略）；2、债券投资策略；3、中小企业私募债券债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、可转换债券投资策略；6、证券公司短期公司债券投资策略；7、衍生产品投资策略（（1）权证投资策略、（2）股指期货投资策略、（3）国债期货投资策略、（4）股票期权投资策略、（5）本基金将关注其他金融衍生产品的推出情况，谨慎地进行投资）；8、融资及转融通证券出借业务投资策略；9、其他
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*95%+一年期人民币定期存款利率（税后）*5%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	万家基金管理有限公司	宁波银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	兰剑	柴飞桦
	联系电话	021-38909626	0574-81851181
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	custody-audit@nbc.cn
客户服务电话		4008880800	0574-83895886
传真		021-38909627	0574-89103213
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）	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 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	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号
邮政编码		200122	315100
法定代表人		陈广益	庄灵君

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.wjasset.com
基金中期报告置备地点	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	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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)		
	万家沪深 300 指数增强 A	万家沪深 300 指数增强 C	万家沪深 300 指数增强 Y
本期已实现 收益	44,501,223.66	24,980,658.52	908,200.62
本期利润	60,794,844.01	43,977,004.48	1,247,406.65
加权平均基 金份额本期 利润	0.1964	0.3119	0.2117
本期加权平 均净值利润 率	12.24%	15.64%	12.97%

本期基金份额净值增长率	12.82%	12.60%	13.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
期末可供分配利润	282,680,653.05	208,297,317.37	5,725,791.75
期末可供分配基金份额利润	0.6091	0.9803	0.6238
期末基金资产净值	790,820,030.44	446,256,496.22	15,780,203.36
期末基金份额净值	1.7041	2.1001	1.7192
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
基金份额累计净值增长率	89.01%	133.05%	37.08%

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

万家沪深 300 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
过去三个月	12.90%	1.26%	11.31%	1.19%	1.59%	0.07%
过去六个月	12.82%	1.14%	7.24%	1.07%	5.58%	0.07%

过去一年	33.13%	0.99%	25.20%	0.97%	7.93%	0.02%
过去三年	29.29%	1.04%	28.48%	1.06%	0.81%	-0.02%
过去五年	8.56%	1.03%	-3.75%	1.06%	12.31%	-0.03%
过去七年	86.53%	1.09%	29.85%	1.11%	56.68%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	89.01%	1.06%	51.58%	1.06%	37.43%	0.00%

万家沪深 300 指数增强 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
过去三个月	12.79%	1.26%	11.31%	1.19%	1.48%	0.07%
过去六个月	12.60%	1.14%	7.24%	1.07%	5.36%	0.07%
过去一年	32.61%	0.99%	25.20%	0.97%	7.41%	0.02%
过去三年	27.76%	1.04%	28.48%	1.06%	-0.72%	-0.02%
过去五年	6.43%	1.03%	-3.75%	1.06%	10.18%	-0.03%
过去七年	81.84%	1.09%	29.85%	1.11%	51.99%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	133.05%	1.17%	51.58%	1.06%	81.47%	0.11%

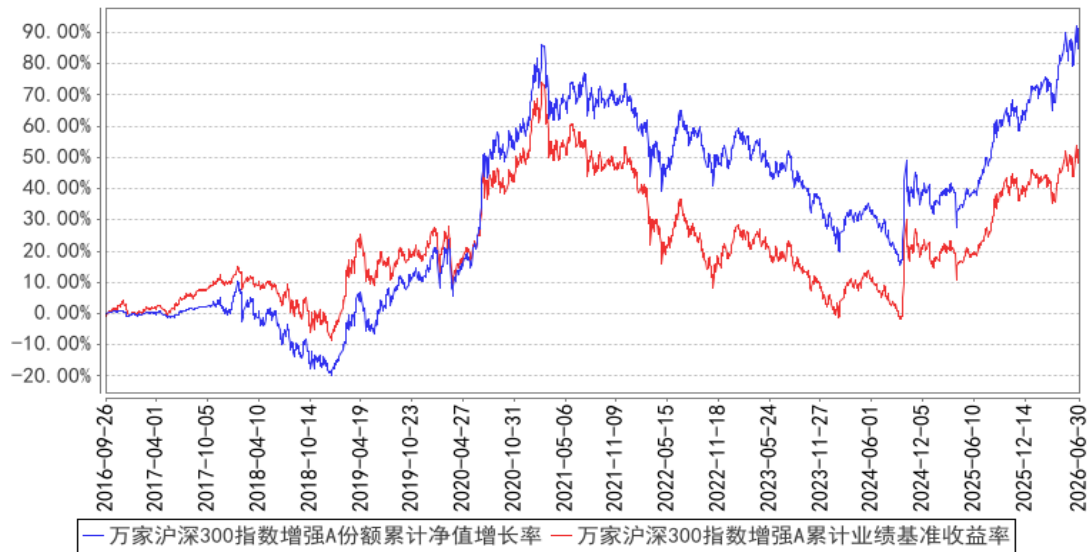
万家沪深 300 指数增强 Y

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
过去三个月	13.05%	1.26%	11.31%	1.19%	1.74%	0.07%
过去六个月	13.14%	1.14%	7.24%	1.07%	5.90%	0.07%
过去一年	33.89%	0.99%	25.20%	0.97%	8.69%	0.02%
自基金合同 生效起至今	37.08%	0.98%	25.38%	0.96%	11.70%	0.02%

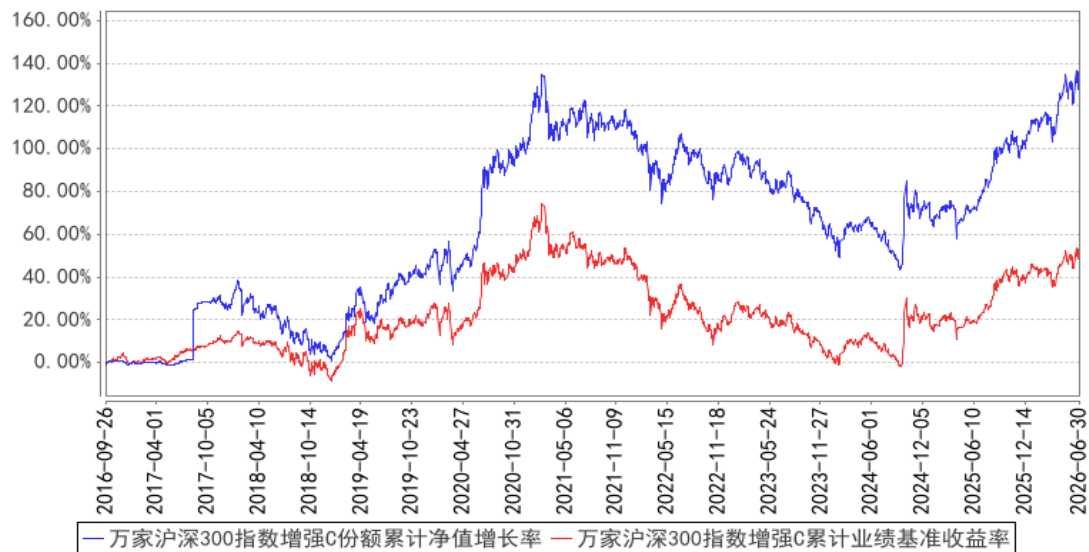
注：万家沪深 300 指数增强 Y 上述“自基金合同生效起至今”实际为“自基金份额类别首次确认起至今”，下同。

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

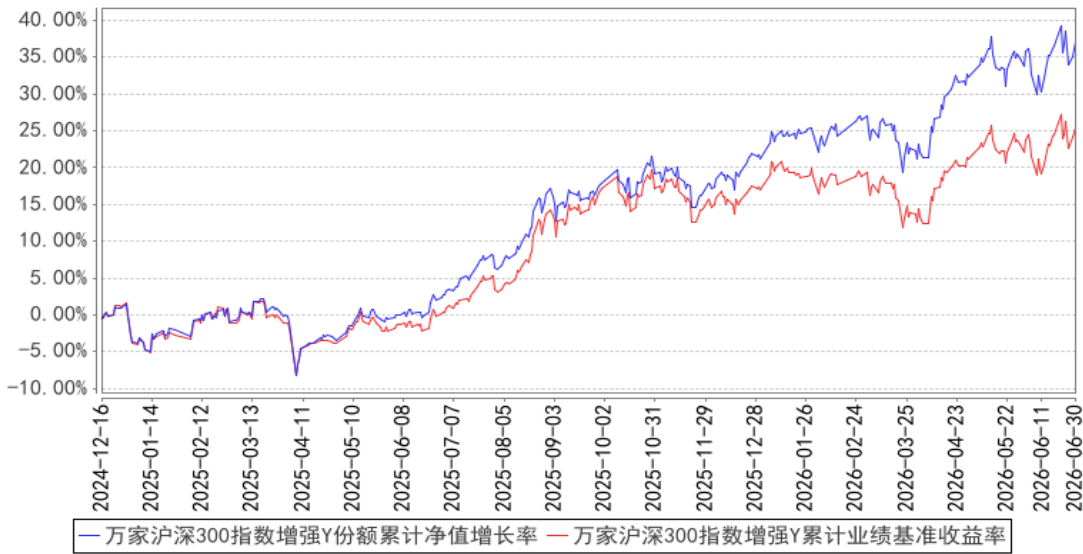
万家沪深300指数增强A份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



万家沪深300指数增强C份额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



万家沪深300指数增强Y份额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、本基金于 2016 年 9 月 26 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。

2、本基金自 2024 年 12 月 13 日起增设 Y 类份额，2024 年 12 月 16 日起确认有 Y 类基金份额登记在册。

§ 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 2026 年 6 月 30 日，公司共管理 208 只开放式基金，其中包括 59 只股票型基金、80 只混合型基金、48 只债券型基金、5 只货币市场基金、4 只 QDII 基金、12 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		
乔亮	公司领导，首席量化投资官；万家	2019 年 9 月 6 日	-	19.5 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，现任公司首席量化投资官、基金经理，历任公司总经理助理、量化投资

上证科创板 100 指数增强型发起式证券投资基金、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家中证 2000 指数增强型证券投资基金、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				部总监（兼）、副总经理。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。
---	--	--	--	--

	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。				
--	-----------------------------------	--	--	--	--

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》，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。

4.3.2 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，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 4 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。

4.4 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 7.5% 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。

本基金在保持相对沪深 300 指数较小跟踪误差情况下，控制行业权重偏离度、个股集中度，通过量化多因子选股的方式选取一篮子股票组合。在行业和风格配置相对于沪深 300 指数相对均衡，没有行业或具体风格大幅暴露，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，选股方面取得了较好的超额收益回报。选股组合 80% 权重以上为沪深 300 成分股，保证了较小的跟踪误差标准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家沪深 300 指数增强 A 的基金份额净值为 1.7041 元，本报告期基金份额净值增长率为 12.82%，同期业绩比较基准收益率为 7.24%；截至本报告期末万家沪深 300 指数增强 C 的基金份额净值为 2.1001 元，本报告期基金份额净值增长率为 12.60%，同期业绩比较基准收益率为 7.24%；截至本报告期末万家沪深 300 指数增强 Y 的基金份额净值为 1.7192 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.14%，同期业绩比较基准收益率为 7.24%。基金报告期内 A 份额、C 份额、Y 份额日均跟踪偏离度分别为 0.1665%、0.1662%、0.1665%，年跟踪误差分别为 3.4357%、3.4348%、3.4397%。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 7.5% 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

2026 年上半年，A 股市场呈现“科技领涨、指数震荡抬升”的结构分化格局。人工智能产业革命、国产替代加速与全球科技周期共振向上，三重驱动之下，资金深度抱团 AI 相关板块，科技成长走出独立行情；而传统价值板块则持续承压，资金流出与价格下跌并行，市场分化显著。

展望后市，7 月以来 AI 板块杠杆资金快速出清，市场经历大幅调整后估值已回归合理区间，A 股有望逐步企稳回升。从政策层面看，近期决策层对资本市场积极表态，稳定信号明确，维稳资金正有序入场，托底力度增强；从基本面看，二季度 PPI 中枢较一季度显著抬升，价格端改善正向企业盈利传导，上市公司盈利有望进一步上行，为市场走强提供有力支撑；从政策定调看，7

月政治局会议基调积极，强调高度重视经济运行中的困难挑战，要求及时谋划增量政策，加大逆周期调节与扩内需力度，财政与货币表述均较 4 月更为积极—财政端加快支出与债券资金使用进度，推进“两重”“两新”落地，货币端要求适时调整政策工具，降准降息预期升温，且股市表述从“稳信心”升级为“提升韧性信心”，政策呵护力度进一步加码。总体而言，市场调整已较为充分，叠加政策托底与基本面改善的双重支撑，A 股有望企稳回升。

4.6 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。

4.7 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，本托管人在万家沪深 300 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金

合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：“财务会计报告”中的“各关联方投资本基金的情况”、“金融工具风险及管理”部分以及“基金份额持有人信息”部分均未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：万家沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	10,192,285.41	5,385,457.55
结算备付金		56,424,112.23	33,961,416.63
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,176,306,141.36	577,248,281.02
其中：股票投资		1,176,306,141.36	577,248,281.02
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		12,903,013.09	507,216.12
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,255,825,552.09	617,102,371.32
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		1,747,310.55	2,368,063.54
应付管理人报酬		900,634.76	526,844.73
应付托管费		108,076.14	63,221.36
应付销售服务费		135,986.10	61,205.86
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	76,814.52	160,913.48
负债合计		2,968,822.07	3,180,248.97
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	685,727,179.02	384,037,294.52
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	567,129,551.00	229,884,827.83
净资产合计		1,252,856,730.02	613,922,122.35
负债和净资产总计		1,255,825,552.09	617,102,371.32

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 685,727,179.02 份，其中万家沪深 300 指数增强 A 基金份额净值 1.7041 元，基金份额总额 464,057,824.08 份；万家沪深 300 指数增强 C 基金份额净值 2.1001 元，基金份额总额 212,490,627.45 份；万家沪深 300 指数增强 Y 基金份额净值 1.7192 元，基金份额总额 9,178,727.49 份。

6.2 利润表

会计主体：万家沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		110,983,583.80	34,295,822.23
1. 利息收入		83,913.21	174,512.65
其中：存款利息收入	6.4.7.10	83,913.21	174,512.65

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）		74,408,299.90	40,073,447.98
其中：股票投资收益	6.4.7.11	65,502,130.86	26,593,518.60
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	-	-
收益			
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	8,906,169.04	13,479,929.38
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）	6.4.7.17	35,629,172.34	-6,047,427.28
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	862,198.35	95,288.88
减：二、营业总支出		4,964,328.66	8,063,858.82
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,856,102.88	6,215,047.47
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	462,732.44	745,805.63
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	552,509.58	949,677.49
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.20	92,983.76	153,328.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		106,019,255.14	26,231,963.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		106,019,255.14	26,231,963.41
五、其他综合收益的税后		-	-

净额			
六、综合收益总额		106,019,255.14	26,231,963.41

6.3 净资产变动表

会计主体：万家沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	384,037,294.52	-	229,884,827.83	613,922,122.35
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	384,037,294.52	-	229,884,827.83	613,922,122.35
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	301,689,884.50	-	337,244,723.17	638,934,607.67
（一）、综合收益总额	-	-	106,019,255.14	106,019,255.14
（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）	301,689,884.50	-	231,225,468.03	532,915,352.53
其中：1. 基金申购款	507,844,727.07	-	413,564,805.94	921,409,533.01
2. 基金赎回款	-206,154,842.57	-	-182,339,337.91	-388,494,180.48
（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	685,727,179.02	-	567,129,551.00	1,252,856,730.02
项目	上年度可比期间 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	1,337,575,753.80	-	460,435,298.57	1,798,011,052.37
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,337,575,753.80	-	460,435,298.57	1,798,011,052.37
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-632,187,533.92	-	-189,920,148.81	-822,107,682.73
（一）、综合收益总额	-	-	26,231,963.41	26,231,963.41
（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）	-632,187,533.92	-	-216,152,112.22	-848,339,646.14
其中：1. 基金申购款	113,336,983.94	-	52,836,174.18	166,173,158.12
2. 基金赎回款	-745,524,517.86	-	-268,988,286.40	-1,014,512,804.26
（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	705,388,219.88	-	270,515,149.76	975,903,369.64

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>陈广益</u>	<u>莫海波</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

万家沪深 300 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），原名万家瑞旭灵活配置混合型证券投资基金，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[2015]1960 号文《关于准予万家瑞旭灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》的批准，由万家基金管理有限公司作为基金管理人于 2016 年 9 月 19 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具（2016）验字第 60778298_B13 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 2016 年 9 月 26 日正式生效，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 200,012,714.80 元，有效认购资金在初始销售期内产生的利息为人民币 0.82 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 200,012,715.62 元，折合 200,012,715.62 份基金份额。本基金管理人为万家基金管理有限公司，注册登记机构为万家基金管理有限公司，基金托管人为宁波银行股份有限公司。

为提高基金资产的运作效率，保护基金份额持有人利益，经与本基金托管人宁波银行股份有限公司协商一致，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《万家瑞旭灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，基金管理人于 2018 年 7 月 9 日表决通过了《关于万家瑞旭灵活配置混合型证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》，同意变更万家瑞旭灵活配置混合型证券投资基金的基金名称、基金类别、投资范围、投资策略等内容并相应修订基金合同。自 2018 年 7 月 9 日起，《万家瑞旭灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效且《万家沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》同日起生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《个人养老金投资公开募集证券投资基金业务管理暂行规定》和《万家沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，经与本基金基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，2024 年 12 月 13 日起，本基金增设 Y 类基金份额。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）、其他股票（包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公

开发行的次级债、中小企业私募债券、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、债券回购、银行存款、同业存单、资产支持证券、金融衍生品(包括权证、股指期货、国债期货、股票期权等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可参与融资业务和转融通证券出借交易。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金在履行适当程序后可将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率*95%+一年期人民币定期存款利率(税后)*5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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 2026 年 1 月 1 日起施行的《中华人民共和国增值税法》的规定，取得存款利息收入不征收增值税；

根据 2026 年 1 月 1 日起施行的《中华人民共和国增值税法实施条例》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；

根据财政部、国家税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，公募证券投资基金（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、债券取得的收入免征增值税；金融同业往来利息收入免征增值税；资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为可以选择适用简易计税方法，按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税；

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

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。

（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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	10,192,285.41
等于：本金	10,187,868.00
加：应计利息	4,417.41
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	10,192,285.41

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,118,493,187.43	-	1,176,306,141.36	57,812,953.93
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,118,493,187.43	-	1,176,306,141.36	57,812,953.93

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 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	458.67
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
其他	1,972.09
合计	76,814.52

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

万家沪深 300 指数增强 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	287,384,158.40	287,384,158.40
本期申购	241,921,564.34	241,921,564.34
本期赎回（以“-”号填列）	-65,247,898.66	-65,247,898.66
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	464,057,824.08	464,057,824.08

万家沪深 300 指数增强 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	95,373,900.91	95,373,900.91

本期申购	255,888,138.10	255,888,138.10
本期赎回（以“-”号填列）	-138,771,411.56	-138,771,411.56
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	212,490,627.45	212,490,627.45

万家沪深 300 指数增强 Y

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,279,235.21	1,279,235.21
本期申购	10,035,024.63	10,035,024.63
本期赎回（以“-”号填列）	-2,135,532.35	-2,135,532.35
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	9,178,727.49	9,178,727.49

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

万家沪深 300 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	132,824,722.57	13,885,608.97	146,710,331.54
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	132,824,722.57	13,885,608.97	146,710,331.54
本期利润	44,501,223.66	16,293,620.35	60,794,844.01
本期基金份额交易产生的变动数	105,354,706.82	13,902,323.99	119,257,030.81
其中：基金申购款	139,872,523.68	18,724,591.80	158,597,115.48
基金赎回款	-34,517,816.86	-4,822,267.81	-39,340,084.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	282,680,653.05	44,081,553.31	326,762,206.36

万家沪深 300 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	76,568,074.88	5,941,737.17	82,509,812.05

加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	76,568,074.88	5,941,737.17	82,509,812.05
本期利润	24,980,658.52	18,996,345.96	43,977,004.48
本期基金份额交易产生的变动数	106,748,583.97	530,468.27	107,279,052.24
其中：基金申购款	231,017,480.97	17,850,005.13	248,867,486.10
基金赎回款	-124,268,897.00	-17,319,536.86	-141,588,433.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	208,297,317.37	25,468,551.40	233,765,868.77

万家沪深 300 指数增强 Y

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	602,824.40	61,859.84	664,684.24
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	602,824.40	61,859.84	664,684.24
本期利润	908,200.62	339,206.03	1,247,406.65
本期基金份额交易产生的变动数	4,214,766.73	474,618.25	4,689,384.98
其中：基金申购款	5,439,155.14	661,049.22	6,100,204.36
基金赎回款	-1,224,388.41	-186,430.97	-1,410,819.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,725,791.75	875,684.12	6,601,475.87

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	68,936.36
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	14,959.71
其他	17.14
合计	83,913.21

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	65,502,130.86
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	65,502,130.86

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	863,710,730.58
减：卖出股票成本总额	797,200,843.74
减：交易费用	1,007,755.98
买卖股票差价收入	65,502,130.86

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	8,906,169.04
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	8,906,169.04

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	35,629,172.34
股票投资	35,629,172.34
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	35,629,172.34

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	705,007.85
基金转换费收入	157,190.50
合计	862,198.35

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	-
账户维护费	18,600.00
合计	92,983.76

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、关联关系

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
宁波银行股份有限公司（“宁波银行”）	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、基金证券经纪商
--------------------	-------------------------

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
中泰证券	229,499,339.86	10.33	3,290,079,386.68	31.83

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
中泰证券	43,900.23	10.13	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
中泰证券	631,832.81	31.50	-	-

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------	--

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3, 856, 102. 88	6, 215, 047. 47
其中：应支付销售机构的客户维护费	1, 049, 900. 20	1, 940, 976. 67
应支付基金管理人的净管理费	2, 806, 202. 68	4, 274, 070. 80

注：本基金 A 类、C 类基金份额的管理费按前一日该类基金份额基金资产净值的 1.00%年费率计提。本基金 Y 类基金份额的管理费按前一日该类基金份额基金资产净值的 0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times \text{该类基金份额管理费年费率}\div \text{当年天数}$$

H 为该类基金份额每日应计提的基金管理费

E 为该类基金份额前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	462, 732. 44	745, 805. 63

注：本基金 A 类、C 类基金份额的托管费按前一日该类基金份额基金资产净值的 0.12%的年费率计提。本基金 Y 类基金份额的托管费按前一日该类基金份额基金资产净值的 0.06%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times \text{该类基金份额托管费年费率}\div \text{当年天数}$$

H 为该类基金份额每日应计提的基金托管费

E 为该类基金份额前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 当期发生的基金应支付的销售服务费
----------------	---

	万家沪深 300 指 数增强 A	万家沪深 300 指 数增强 C	万家沪深 300 指 数增强 Y	合计
宁波银行	-	11,805.48	-	11,805.48
万家基金	-	102,907.01	-	102,907.01
中泰证券	-	53,629.49	-	53,629.49
合计	-	168,341.98	-	168,341.98
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 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			
	万家沪深 300 指 数增强 A	万家沪深 300 指 数增强 C	万家沪深 300 指 数增强 Y	合计
万家基金	-	157,300.39	-	157,300.39
中泰证券	-	165,561.02	-	165,561.02
合计	-	322,861.41	-	322,861.41

注：本基金 A 类、Y 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算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 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、公休假或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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
宁波银行	10,192,285.41	68,936.36	16,433,873.88	128,699.65

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方所承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间没有需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2026 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
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股流通受	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-

				限						
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	5,242	53,049.04	145,360.66	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理	2026	6 个	新	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-

	奇智能	年 4 月 22 日	月	股流通受限						
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	1,063	48,983.04	492,519.79	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	622	43,328.52	99,557.32	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-

	能	日		通受限						
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	626	6,998.68	11,011.34	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-

				限						
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	9 个月	新股流通受限	22.68	42.16	6,177	140,094.36	260,422.32	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	9 个月	新股流通受限	114.28	676.94	2,362	269,929.36	1,598,932.28	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股流通受限	104.66	768.89	1,764	184,620.24	1,356,321.96	-
688808	联	2026	6 个	新	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-

	讯 仪 器	年 4 月 16 日	月	股 流 通 受 限						
688811	有 研 复 材	2026 年 4 月 1 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰 金 新 能	2026 年 3 月 24 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易 思 维	2026 年 2 月 4 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电 科 蓝 天	2026 年 2 月 3 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛 合 晶 微	2026 年 4 月 13 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	19.68	141.49	1,035	20,368.80	146,442.15	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代 码	股 票 名 称	停牌 日期	停 牌 原 因	期 末 估 值 单 价	复 牌 日 期	复 牌 开 盘 单 价	数 量 （ 股 ）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29	重大 事项 停牌	879.53	2026 年 7 月 13	890.99	1,800	1,484,220.00	1,583,154.00	-

		日			日					
300332	天壕能源	2026 年 6 月 26 日	重大事项停牌	4.30	2026 年 7 月 9 日	4.64	175,200	881,015.65	753,360.00	-

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 2026 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 2026 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%。

本基金的货币资金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 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。(2025 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（2026 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 2026 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	10,192,285.41	-	-	-	-	-	10,192,285.41
结算备付金	56,424,112.23	-	-	-	-	-	56,424,112.23
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,176,306,141.36	1,176,306,141.36
应收申购款	16.30	-	-	-	-	12,902,996.79	12,903,013.09
资产总计	66,616,413.94	-	-	-	-	1,189,209,138.15	1,255,825,552.09
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,747,310.55	1,747,310.55
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-900,634.76	900,634.76
应付托管费	-	-	-	-	-	-108,076.14	108,076.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-135,986.10	135,986.10
其他负债	-	-	-	-	-	76,814.52	76,814.52
负债总计	-	-	-	-	-	2,968,822.07	2,968,822.07
利率敏感度缺口	66,616,413.94	-	-	-	-	1,186,240,316.08	1,252,856,730.02
上年度末 2025 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	5,385,457.55	-	-	-	-	-	5,385,457.55
结算备付金	33,961,416.63	-	-	-	-	-	33,961,416.63
交易性金融资产	-	-	-	-	-	577,248,281.02	577,248,281.02
应收申购款	22,331.42	-	-	-	-	-484,884.70	507,216.12

资产总计	39,369,205.60	-	-	-	-	577,733,165.72	617,102,371.32
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,368,063.54	2,368,063.54
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	526,844.73	526,844.73
应付托管费	-	-	-	-	-	63,221.36	63,221.36
应付销售服务费	-	-	-	-	-	61,205.86	61,205.86
其他负债	-	-	-	-	-	160,913.48	160,913.48
负债总计	-	-	-	-	-	3,180,248.97	3,180,248.97
利率敏感度缺口	39,369,205.60	-	-	-	-	574,552,916.75	613,922,122.35

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 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2025 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（2025 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，所面临的重大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）

交易性金融资产—股票投资	1,176,306,141.36	93.89	577,248,281.02	94.03
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,176,306,141.36	93.89	577,248,281.02	94.03

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	股票基准指数上升 100 个基点	14,035,728.41	6,619,234.40
	股票基准指数下降 100 个基点	-14,035,728.41	-6,619,234.40

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	1,168,926,648.18	569,384,523.86
第二层次	2,336,514.00	5,146,554.00

第三层次	5,042,979.18	2,717,203.16
合计	1,176,306,141.36	577,248,281.02

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）和非公开发行情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产以及其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,176,306,141.36	93.67
	其中：股票	1,176,306,141.36	93.67
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	66,616,397.64	5.30
8	其他各项资产	12,903,013.09	1.03
9	合计	1,255,825,552.09	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	41,788,753.16	3.34
C	制造业	677,343,781.20	54.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,487,938.00	1.48
E	建筑业	471,546.00	0.04
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	11,741,538.00	0.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	59,852,503.19	4.78
J	金融业	189,629,654.01	15.14
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,126,350.49	0.41
M	科学研究和技术服务业	16,727,793.99	1.34
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	784.70	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,021,170,642.74	81.51

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	1,713,539.40	0.14
B	采矿业	8,090,772.82	0.65
C	制造业	119,767,304.86	9.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	920,575.80	0.07
E	建筑业	824,982.00	0.07
F	批发和零售业	7,893,971.06	0.63
G	交通运输、仓储和	2,506,940.46	0.20

	邮政业		
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,457,341.20	0.60
J	金融业	224.70	0.00
K	房地产业	28,919.92	0.00
L	租赁和商务服务业	1,975,070.20	0.16
M	科学研究和技术服务业	3,221,094.00	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	456,010.20	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	130,384.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	148,368.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	155,135,498.62	12.38

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。

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	300308	中际旭创	50,500	64,135,000.00	5.12
2	300750	宁德时代	122,303	48,066,302.03	3.84
3	300502	新易盛	70,080	42,538,560.00	3.40
4	002384	东山精密	81,800	21,460,230.00	1.71
5	600519	贵州茅台	17,477	20,718,808.73	1.65
6	601318	中国平安	402,918	19,235,305.32	1.54
7	600183	生益科技	106,800	18,519,120.00	1.48
8	600036	招商银行	489,800	17,387,900.00	1.39
9	603259	药明康德	134,349	16,727,793.99	1.34
10	600919	江苏银行	1,519,300	16,378,054.00	1.31
11	601166	兴业银行	978,200	16,198,992.00	1.29
12	688256	寒武纪	9,935	15,851,789.25	1.27
13	600150	中国船舶	458,800	15,502,852.00	1.24
14	000333	美的集团	201,300	15,204,189.00	1.21
15	601211	国泰海通	832,826	15,157,433.20	1.21

16	002415	海康威视	438,600	15,000,120.00	1.20
17	601899	紫金矿业	588,200	14,787,348.00	1.18
18	300394	天孚通信	48,538	14,691,481.84	1.17
19	603986	兆易创新	17,500	14,262,500.00	1.14
20	601138	工业富联	194,300	14,018,745.00	1.12
21	002916	深南电路	30,400	13,920,160.00	1.11
22	002475	立讯精密	196,500	13,833,600.00	1.10
23	300476	胜宏科技	39,800	13,787,914.00	1.10
24	600887	伊利股份	567,854	13,605,781.84	1.09
25	002460	赣锋锂业	201,700	13,191,180.00	1.05
26	000938	紫光股份	444,000	12,813,840.00	1.02
27	002463	沪电股份	83,500	12,758,800.00	1.02
28	600030	中信证券	418,850	12,033,560.50	0.96
29	002466	天齐锂业	194,300	11,914,476.00	0.95
30	300408	三环集团	71,000	11,849,900.00	0.95
31	688041	海光信息	30,900	11,442,270.00	0.91
32	688008	澜起科技	30,500	9,451,950.00	0.75
33	601688	华泰证券	456,000	9,402,720.00	0.75
34	601225	陕西煤业	455,300	9,265,355.00	0.74
35	600031	三一重工	524,400	9,061,632.00	0.72
36	601939	建设银行	916,900	8,829,747.00	0.70
37	300014	亿纬锂能	133,300	8,668,499.00	0.69
38	688981	中芯国际	53,500	8,496,870.00	0.68
39	600276	恒瑞医药	162,980	8,481,479.20	0.68
40	002028	思源电气	48,700	8,425,100.00	0.67
41	300661	圣邦股份	55,300	7,934,444.00	0.63
42	300442	润泽科技	94,800	7,875,036.00	0.63
43	002558	巨人网络	278,400	7,672,704.00	0.61
44	600000	浦发银行	862,619	7,427,149.59	0.59
45	600309	万华化学	103,900	7,107,799.00	0.57
46	601229	上海银行	801,900	6,960,492.00	0.56
47	601398	工商银行	966,500	6,833,155.00	0.55
48	300418	昆仑万维	168,400	6,796,624.00	0.54
49	600104	上汽集团	695,000	6,783,200.00	0.54
50	603019	中科曙光	63,200	6,776,936.00	0.54
51	688396	华润微	69,000	6,730,950.00	0.54
52	603799	华友钴业	137,700	6,645,402.00	0.53
53	601360	三六零	755,000	6,560,950.00	0.52
54	688012	中微公司	13,668	6,403,458.00	0.51
55	605117	德业股份	58,500	6,211,530.00	0.50
56	002049	紫光国微	65,200	5,786,500.00	0.46
57	000338	潍柴动力	210,000	5,722,500.00	0.46
58	000895	双汇发展	251,308	5,629,299.20	0.45

59	601998	中信银行	806,000	5,585,580.00	0.45
60	600025	华能水电	609,100	5,414,899.00	0.43
61	300274	阳光电源	33,246	5,286,778.92	0.42
62	600522	中天科技	82,100	4,981,828.00	0.40
63	601658	邮储银行	1,001,000	4,934,930.00	0.39
64	600489	中金黄金	271,700	4,904,185.00	0.39
65	002648	卫星化学	204,200	4,796,658.00	0.38
66	688521	芯原股份	12,800	4,750,592.00	0.38
67	600549	厦门钨业	55,100	4,694,520.00	0.37
68	600406	国电南瑞	200,248	4,575,666.80	0.37
69	601601	中国太保	157,700	4,497,604.00	0.36
70	601995	中金公司	123,000	4,446,450.00	0.35
71	600926	杭州银行	307,300	4,440,485.00	0.35
72	601100	恒立液压	40,100	4,313,156.00	0.34
73	603296	华勤技术	57,920	4,301,718.40	0.34
74	000166	申万宏源	975,700	4,293,080.00	0.34
75	000977	浪潮信息	61,299	4,290,930.00	0.34
76	002602	世纪华通	301,600	4,252,560.00	0.34
77	600900	长江电力	160,400	4,245,788.00	0.34
78	601012	隆基绿能	322,500	4,231,200.00	0.34
79	601818	光大银行	1,444,500	4,174,605.00	0.33
80	600875	东方电气	144,000	4,142,880.00	0.33
81	000988	华工科技	20,500	3,784,505.00	0.30
82	002371	北方华创	4,100	3,626,696.00	0.29
83	601888	中国中免	67,019	3,599,590.49	0.29
84	003816	中国广核	919,100	3,593,681.00	0.29
85	600989	宝丰能源	174,900	3,555,717.00	0.28
86	600795	国电电力	750,900	3,506,703.00	0.28
87	601009	南京银行	352,300	3,484,247.00	0.28
88	688183	生益电子	25,800	3,415,920.00	0.27
89	600893	航发动力	88,800	3,404,592.00	0.27
90	600938	中国海油	125,300	3,401,895.00	0.27
91	600015	华夏银行	532,300	3,401,397.00	0.27
92	600118	中国卫星	40,900	3,355,845.00	0.27
93	301308	江波龙	4,500	3,167,100.00	0.25
94	601018	宁波港	987,800	3,111,570.00	0.25
95	601600	中国铝业	373,335	3,068,813.70	0.24
96	600547	山东黄金	132,124	3,050,743.16	0.24
97	000063	中兴通讯	80,350	2,907,866.50	0.23
98	000807	云铝股份	129,200	2,860,488.00	0.23
99	000776	广发证券	118,894	2,782,119.60	0.22
100	300124	汇川技术	40,800	2,706,264.00	0.22
101	601872	招商轮船	153,000	2,688,210.00	0.21

102	601328	交通银行	398,650	2,563,319.50	0.20
103	002353	杰瑞股份	16,800	2,562,000.00	0.20
104	002600	领益智造	144,800	2,510,832.00	0.20
105	000657	中钨高新	23,100	2,211,132.00	0.18
106	000425	徐工机械	259,400	2,098,546.00	0.17
107	300866	安克创新	19,980	2,087,910.00	0.17
108	000708	中信特钢	156,841	1,979,333.42	0.16
109	601898	中煤能源	160,400	1,953,672.00	0.16
110	601766	中国中车	366,600	1,906,320.00	0.15
111	002594	比亚迪	23,600	1,880,920.00	0.15
112	002493	荣盛石化	171,700	1,845,775.00	0.15
113	301165	锐捷网络	22,900	1,842,305.00	0.15
114	002050	三花智控	41,400	1,814,562.00	0.14
115	600362	江西铜业	38,400	1,662,720.00	0.13
116	688072	拓荆科技	1,800	1,583,154.00	0.13
117	000408	藏格矿业	21,800	1,511,176.00	0.12
118	601857	中国石油	172,700	1,499,036.00	0.12
119	002027	分众传媒	306,000	1,481,040.00	0.12
120	601111	中国国航	237,900	1,439,295.00	0.11
121	603993	洛阳钼业	79,700	1,398,735.00	0.11
122	002736	国信证券	130,500	1,303,695.00	0.10
123	002837	英维克	15,510	1,233,975.60	0.10
124	600018	上港集团	261,400	1,233,808.00	0.10
125	000617	中油资本	179,900	1,185,541.00	0.09
126	600346	恒力石化	66,700	1,181,257.00	0.09
127	600026	中远海能	61,500	1,103,310.00	0.09
128	600809	山西汾酒	10,016	1,095,449.92	0.09
129	688036	传音控股	18,500	1,090,575.00	0.09
130	600690	海尔智家	49,300	1,006,213.00	0.08
131	000001	平安银行	99,800	1,002,990.00	0.08
132	300033	同花顺	4,160	1,002,560.00	0.08
133	601919	中远海控	72,900	966,654.00	0.08
134	600426	华鲁恒升	38,800	928,096.00	0.07
135	601698	中国卫通	30,600	925,650.00	0.07
136	600886	国投电力	67,400	897,094.00	0.07
137	601336	新华保险	14,700	877,002.00	0.07
138	002938	鹏鼎控股	7,900	832,502.00	0.07
139	000975	山金国际	47,400	805,800.00	0.06
140	600176	中国巨石	10,800	787,104.00	0.06
141	600999	招商证券	36,300	765,930.00	0.06
142	601881	中国银河	60,600	761,742.00	0.06
143	600233	圆通速递	48,300	760,725.00	0.06
144	600066	宇通客车	28,000	750,680.00	0.06

145	605499	东鹏饮料	5,440	671,459.20	0.05
146	601088	中国神华	16,300	636,352.00	0.05
147	601288	农业银行	103,900	630,673.00	0.05
148	601077	渝农商行	97,700	596,947.00	0.05
149	600019	宝钢股份	107,100	581,553.00	0.05
150	002179	中航光电	12,300	568,260.00	0.05
151	300628	亿联网络	16,353	553,058.46	0.04
152	300059	东方财富	26,200	533,956.00	0.04
153	600674	川投能源	35,000	495,950.00	0.04
154	600482	中国动力	15,100	495,280.00	0.04
155	300433	蓝思科技	9,200	493,672.00	0.04
156	002001	新 和 成	17,280	491,097.60	0.04
157	600039	四川路桥	60,300	471,546.00	0.04
158	302132	中航成飞	7,400	431,568.00	0.03
159	300450	先导智能	9,500	386,840.00	0.03
160	002709	天赐材料	7,500	385,725.00	0.03
161	001965	招商公路	39,500	361,820.00	0.03
162	600196	复星医药	14,800	332,556.00	0.03
163	600588	用友网络	33,400	306,612.00	0.02
164	601628	中国人寿	8,500	300,475.00	0.02
165	600111	北方稀土	5,200	249,860.00	0.02
166	600011	华能国际	31,700	240,603.00	0.02
167	600219	南山铝业	58,200	232,218.00	0.02
168	600050	中国联通	49,900	199,600.00	0.02
169	601689	拓普集团	2,900	163,618.00	0.01
170	601058	赛轮轮胎	14,100	162,573.00	0.01
171	601238	广汽集团	28,800	146,304.00	0.01
172	600958	东方证券	13,900	131,216.00	0.01
173	600803	新奥股份	5,900	93,220.00	0.01
174	601988	中国银行	15,400	88,088.00	0.01
175	600028	中国石化	19,200	85,632.00	0.01
176	600845	宝信软件	5,080	84,480.40	0.01
177	600029	南方航空	14,700	76,146.00	0.01
178	300122	智飞生物	4,900	57,281.00	0.00
179	000858	五 粮 液	659	48,766.00	0.00
180	600415	小商品城	4,500	45,720.00	0.00
181	688472	阿特斯	3,200	34,624.00	0.00
182	603288	海天味业	84	2,785.44	0.00
183	603501	豪威集团	18	1,707.30	0.00
184	002236	大华股份	81	1,335.69	0.00
185	600372	中航机载	95	1,030.75	0.00
186	300015	爱尔眼科	95	784.70	0.00
187	601838	成都银行	29	513.30	0.00

188	000100	TCL 科技	80	465.60	0.00
189	688303	大全能源	22	383.46	0.00
190	000301	东方盛虹	32	366.40	0.00
191	601728	中国电信	46	238.74	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	300223	君正股份	33,500	8,338,150.00	0.67
2	688503	聚和材料	43,300	5,745,910.00	0.46
3	601699	潞安环能	378,900	5,410,692.00	0.43
4	300458	全志科技	125,687	4,959,609.02	0.40
5	300236	上海新阳	34,900	4,589,350.00	0.37
6	002414	高德红外	285,800	3,789,708.00	0.30
7	301536	星宸科技	27,900	3,591,009.00	0.29
8	300475	香农芯创	10,900	3,270,000.00	0.26
9	300765	石药创新	116,400	3,169,572.00	0.25
10	300438	鹏辉能源	37,900	3,140,015.00	0.25
11	002271	东方雨虹	252,800	3,000,736.00	0.24
12	300857	协创数据	8,800	2,991,120.00	0.24
13	300073	当升科技	57,000	2,738,280.00	0.22
14	688599	天合光能	156,200	2,205,544.00	0.18
15	688390	固德威	19,900	2,159,349.00	0.17
16	688795	摩尔线程	2,862	1,957,177.28	0.16
17	300548	长芯博创	7,000	1,946,000.00	0.16
18	688025	杰普特	3,700	1,739,000.00	0.14
19	300568	星源材质	92,100	1,724,112.00	0.14
20	000607	华媒控股	549,900	1,688,193.00	0.13
21	603126	中材节能	265,800	1,674,540.00	0.13
22	603863	松炆资源	135,600	1,667,880.00	0.13
23	300842	帝科股份	18,700	1,667,479.00	0.13
24	300677	英科医疗	42,100	1,649,057.00	0.13
25	600418	江淮汽车	62,428	1,612,515.24	0.13
26	688630	芯碁微装	2,700	1,483,353.00	0.12
27	688127	蓝特光学	14,900	1,454,240.00	0.12
28	002487	大金重工	24,400	1,414,468.00	0.11
29	001270	铖昌科技	8,900	1,388,311.00	0.11
30	300738	奥飞数据	67,800	1,370,916.00	0.11
31	688802	沐曦股份	1,764	1,356,321.96	0.11
32	300975	商络电子	26,200	1,355,850.00	0.11
33	600105	永鼎股份	20,000	1,349,600.00	0.11
34	688062	迈威生物	47,700	1,347,525.00	0.11
35	688498	源杰科技	700	1,320,200.00	0.11
36	002738	中矿资源	22,100	1,303,679.00	0.10

37	002850	科达利	6,800	1,287,240.00	0.10
38	002819	东方中科	55,400	1,238,190.00	0.10
39	688559	海目星	14,400	1,208,448.00	0.10
40	603195	公牛集团	30,800	1,205,820.00	0.10
41	300184	力源信息	67,800	1,189,890.00	0.09
42	688388	嘉元科技	26,600	1,170,400.00	0.09
43	600988	赤峰黄金	44,200	1,163,344.00	0.09
44	301510	固高科技	34,200	1,092,006.00	0.09
45	002821	凯莱英	6,700	1,085,400.00	0.09
46	300454	深信服	10,900	1,048,580.00	0.08
47	601107	四川成渝	211,000	1,029,680.00	0.08
48	601777	千里科技	123,200	1,005,312.00	0.08
49	300600	国瑞科技	105,400	989,706.00	0.08
50	300955	嘉亨家化	27,400	988,866.00	0.08
51	301285	鸿日达	8,900	981,937.00	0.08
52	601298	青岛港	119,300	960,365.00	0.08
53	688110	东芯股份	4,700	957,390.00	0.08
54	300490	华自科技	71,500	945,945.00	0.08
55	301136	招标股份	84,700	930,006.00	0.07
56	002458	益生股份	117,220	910,799.40	0.07
57	000572	海马汽车	242,300	896,510.00	0.07
58	601279	英利汽车	276,500	843,325.00	0.07
59	603701	德宏股份	38,200	839,636.00	0.07
60	300432	富临精工	41,440	832,529.60	0.07
61	002041	登海种业	102,000	802,740.00	0.06
62	000800	一汽解放	131,500	782,425.00	0.06
63	688428	诺诚健华	27,300	777,231.00	0.06
64	002152	广电运通	81,800	767,284.00	0.06
65	300672	国科微	2,600	767,000.00	0.06
66	003016	欣贺股份	124,500	763,185.00	0.06
67	300332	天壕能源	175,200	753,360.00	0.06
68	688525	佰维存储	1,500	742,095.00	0.06
69	600929	雪天盐业	157,500	715,050.00	0.06
70	688717	艾罗能源	8,000	660,560.00	0.05
71	301128	强瑞技术	3,840	598,656.00	0.05
72	002544	普天科技	31,800	579,396.00	0.05
73	688320	禾川科技	13,600	563,720.00	0.04
74	002163	海南发展	67,300	561,282.00	0.04
75	002603	以岭药业	36,800	552,000.00	0.04
76	603268	松发股份	3,900	543,192.00	0.04
77	301095	广立微	4,600	543,030.00	0.04
78	600316	洪都航空	19,200	536,448.00	0.04
79	300390	天华新能	5,700	533,007.00	0.04

80	688167	炬光科技	1,485	526,001.85	0.04
81	300166	东方国信	29,100	515,361.00	0.04
82	605358	立昂微	6,600	512,160.00	0.04
83	301666	大普微	1,063	492,519.79	0.04
84	300115	长盈精密	17,500	488,950.00	0.04
85	002497	雅化集团	24,000	488,880.00	0.04
86	002238	天威视讯	90,200	487,080.00	0.04
87	600685	中船防务	18,300	465,552.00	0.04
88	301215	中汽股份	89,200	462,948.00	0.04
89	301153	中科江南	28,000	456,120.00	0.04
90	688469	芯联集成	42,600	451,986.00	0.04
91	600601	方正科技	32,000	442,880.00	0.04
92	000886	海南高速	107,700	439,416.00	0.04
93	000519	中兵红箭	20,700	436,149.00	0.03
94	300323	华灿光电	21,100	430,440.00	0.03
95	301302	华如科技	15,600	419,952.00	0.03
96	300440	运达科技	19,500	415,935.00	0.03
97	301099	雅创电子	4,300	410,650.00	0.03
98	600985	淮北矿业	29,100	408,855.00	0.03
99	301487	盟固利	21,000	402,150.00	0.03
100	301191	菲菱科思	3,400	386,070.00	0.03
101	300830	金现代	46,700	370,798.00	0.03
102	300552	万集科技	16,200	370,170.00	0.03
103	300756	金马游乐	11,120	367,516.00	0.03
104	002402	和而泰	14,200	366,786.00	0.03
105	603926	铁流股份	20,700	366,183.00	0.03
106	603212	赛伍技术	28,900	353,736.00	0.03
107	001203	大中矿业	11,200	335,440.00	0.03
108	688660	电气风电	38,900	335,318.00	0.03
109	301201	诚达药业	9,200	334,512.00	0.03
110	600732	爱旭股份	22,900	317,165.00	0.03
111	300919	中伟新材	7,200	315,000.00	0.03
112	300816	艾可蓝	4,200	307,440.00	0.02
113	688766	普冉股份	400	306,640.00	0.02
114	300748	金力永磁	9,200	283,820.00	0.02
115	002115	三维通信	27,200	280,160.00	0.02
116	002644	佛慈制药	40,905	278,563.05	0.02
117	301389	隆扬电子	3,100	269,049.00	0.02
118	688781	视涯科技	6,177	260,422.32	0.02
119	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.02
120	300862	蓝盾光电	11,800	245,912.00	0.02
121	600487	亨通光电	2,200	240,548.00	0.02
122	688235	百济神州	900	229,149.00	0.02

123	300953	震裕科技	1,700	227,290.00	0.02
124	603025	大豪科技	16,600	226,424.00	0.02
125	600711	盛屯矿业	20,500	224,885.00	0.02
126	300766	每日互动	10,500	224,700.00	0.02
127	002240	盛新锂能	4,900	219,667.00	0.02
128	600546	山煤国际	20,000	218,600.00	0.02
129	002851	麦格米特	1,300	217,334.00	0.02
130	300872	天阳科技	13,600	214,880.00	0.02
131	688266	泽璟制药	1,800	209,988.00	0.02
132	000960	锡业股份	4,800	204,912.00	0.02
133	000829	天音控股	26,000	202,800.00	0.02
134	601969	海南矿业	24,100	190,631.00	0.02
135	605289	罗曼股份	1,300	188,500.00	0.02
136	603013	亚普股份	11,900	187,901.00	0.01
137	688107	安路科技	4,000	182,400.00	0.01
138	002405	四维图新	26,500	171,455.00	0.01
139	688002	睿创微纳	1,100	170,159.00	0.01
140	688700	东威科技	1,900	169,860.00	0.01
141	002317	众生药业	6,800	167,076.00	0.01
142	002911	佛燃能源	17,600	167,024.00	0.01
143	600724	宁波富达	31,500	159,705.00	0.01
144	002465	海格通信	12,400	158,348.00	0.01
145	688372	伟测科技	800	148,800.00	0.01
146	001330	博纳影业	26,400	148,368.00	0.01
147	688820	盛合晶微	1,035	146,442.15	0.01
148	001399	惠科股份	5,242	145,360.66	0.01
149	300579	数字认证	7,000	144,900.00	0.01
150	301511	德福科技	1,000	143,850.00	0.01
151	603882	金域医学	5,800	130,384.00	0.01
152	300118	东方日升	10,100	125,745.00	0.01
153	688775	影石创新	900	124,785.00	0.01
154	300678	中科信息	5,500	123,200.00	0.01
155	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
156	300049	福瑞医科	3,000	116,640.00	0.01
157	000701	厦门信达	25,200	111,636.00	0.01
158	002294	信立泰	3,500	111,615.00	0.01
159	301550	斯菱智驱	1,200	109,716.00	0.01
160	688336	三生国健	2,030	107,793.00	0.01
161	002518	科士达	2,000	107,180.00	0.01
162	000810	创维数字	7,900	104,675.00	0.01
163	000426	兴业银锡	3,100	102,176.00	0.01
164	605318	法狮龙	900	101,574.00	0.01
165	300762	上海瀚讯	2,200	100,430.00	0.01

166	688153	唯捷创芯	3,100	99,572.00	0.01
167	301682	宏明电子	622	99,557.32	0.01
168	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
169	001389	广合科技	400	94,900.00	0.01
170	603606	东方电缆	2,280	94,642.80	0.01
171	301571	国科天成	1,400	91,252.00	0.01
172	300034	钢研高纳	5,300	90,842.00	0.01
173	300846	首都在线	4,100	86,961.00	0.01
174	301086	鸿富瀚	400	83,712.00	0.01
175	688778	厦钨新能	1,500	81,600.00	0.01
176	603076	乐惠国际	3,900	80,808.00	0.01
177	000703	恒逸石化	5,700	77,349.00	0.01
178	002682	龙洲股份	17,900	75,896.00	0.01
179	301248	杰创智能	900	75,537.00	0.01
180	600939	重庆建工	32,000	75,200.00	0.01
181	000803	山高环能	10,900	73,902.00	0.01
182	603686	福龙马	5,700	73,644.00	0.01
183	301345	涛涛车业	300	69,300.00	0.01
184	300229	拓尔思	4,800	66,336.00	0.01
185	603121	华培动力	5,600	65,800.00	0.01
186	002097	山河智能	9,100	65,793.00	0.01
187	603353	和顺石油	1,500	57,630.00	0.00
188	600838	上海九百	7,900	56,485.00	0.00
189	603496	恒为科技	2,400	55,152.00	0.00
190	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
191	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
192	002407	多氟多	1,000	50,230.00	0.00
193	300207	欣旺达	2,600	49,374.00	0.00
194	301391	卡莱特	800	45,680.00	0.00
195	688011	新光光电	600	41,922.00	0.00
196	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
197	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
198	300277	汽轮科技	2,600	39,104.00	0.00
199	002459	晶澳科技	4,700	38,070.00	0.00
199	300810	中科海讯	1,500	38,070.00	0.00
200	688100	威胜信息	1,200	36,708.00	0.00
201	605088	冠盛股份	1,300	36,634.00	0.00
202	300619	金银河	1,170	36,398.70	0.00
203	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
204	688343	云天励飞	400	32,664.00	0.00
205	300720	海川智能	300	28,860.00	0.00
206	000031	大悦城	13,600	28,832.00	0.00
207	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00

208	002912	中新赛克	1,500	27,660.00	0.00
209	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
210	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
211	000822	山东海化	4,900	19,698.00	0.00
212	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
213	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
214	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
215	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
216	603185	弘元绿能	900	15,021.00	0.00
217	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
218	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
219	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
220	001369	双欣材料	897	12,127.44	0.00
221	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
222	601112	振石股份	626	11,011.34	0.00
223	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
224	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
225	300990	同飞股份	91	9,561.37	0.00
226	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
227	600984	建设机械	1,700	6,358.00	0.00
228	601865	福莱特	600	6,306.00	0.00
229	603379	三美股份	77	5,843.53	0.00
230	605389	长龄液压	60	5,760.00	0.00
231	688655	迅捷兴	95	5,088.20	0.00
232	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
233	300347	泰格医药	100	4,800.00	0.00
234	688301	奕瑞科技	38	4,712.00	0.00
235	002379	宏桥控股	300	4,431.00	0.00
236	301162	国能日新	80	3,500.00	0.00
237	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
238	603119	浙江荣泰	40	2,653.60	0.00
239	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
240	603202	天有为	49	2,407.86	0.00
241	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
242	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
243	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
244	002393	力生制药	100	1,419.00	0.00
245	301501	恒鑫生活	49	1,274.98	0.00
246	603317	天味食品	80	1,040.80	0.00
247	688091	上海谊众	25	1,005.00	0.00
248	603179	新泉股份	20	993.00	0.00
249	688408	中信博	27	868.05	0.00
250	601061	中信金属	78	840.06	0.00

251	300700	岱勒新材	33	702.24	0.00
252	300815	玉禾田	40	654.00	0.00
253	002624	完美世界	50	621.00	0.00
254	003025	思进智能	40	563.20	0.00
255	301016	雷尔伟	40	558.80	0.00
256	688553	汇宇制药	48	510.24	0.00
257	603707	健友股份	72	509.04	0.00
258	601952	苏垦农发	60	449.40	0.00
259	000039	中集集团	50	405.50	0.00
260	688292	浩瀚深度	21	390.60	0.00
261	300388	节能国祯	60	370.20	0.00
262	603329	上海雅仕	40	359.20	0.00
263	301082	久盛电气	40	358.40	0.00
264	688068	热景生物	3	259.80	0.00
265	300701	森霸传感	25	239.25	0.00
266	000728	国元证券	30	224.70	0.00
267	002987	京北方	20	194.60	0.00
268	600226	亨通股份	20	191.80	0.00
269	600663	陆家嘴	14	87.92	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	300308	中际旭创	37,497,654.00	6.11
2	300750	宁德时代	36,907,701.00	6.01
3	300502	新易盛	23,652,072.40	3.85
4	601318	中国平安	21,423,096.00	3.49
5	603259	药明康德	18,124,536.00	2.95
6	600150	中国船舶	17,474,140.80	2.85
7	002475	立讯精密	17,154,179.00	2.79
8	300476	胜宏科技	17,063,672.00	2.78
9	600036	招商银行	15,841,718.00	2.58
10	600519	贵州茅台	15,751,480.00	2.57
11	300014	亿纬锂能	14,918,143.00	2.43
12	300394	天孚通信	14,875,532.20	2.42
13	603986	兆易创新	13,893,451.30	2.26
14	002384	东山精密	13,653,990.00	2.22
15	000333	美的集团	13,392,067.48	2.18
16	601899	紫金矿业	13,269,172.00	2.16
17	600183	生益科技	13,252,054.00	2.16
18	600919	江苏银行	13,188,115.00	2.15
19	601166	兴业银行	13,036,614.00	2.12
20	002466	天齐锂业	12,931,011.00	2.11

21	000938	紫光股份	12,566,402.00	2.05
----	--------	------	---------------	------

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	600183	生益科技	17,002,123.00	2.77
2	002475	立讯精密	15,618,934.00	2.54
3	603259	药明康德	14,130,511.00	2.30
4	601318	中国平安	13,044,273.00	2.12
5	300308	中际旭创	12,417,591.00	2.02
6	600989	宝丰能源	12,263,982.00	2.00
7	600406	国电南瑞	11,711,072.94	1.91
8	601872	招商轮船	10,842,586.00	1.77
9	300502	新易盛	9,684,318.93	1.58
10	002938	鹏鼎控股	9,280,334.00	1.51
11	300476	胜宏科技	8,768,454.00	1.43
12	300394	天孚通信	8,532,579.00	1.39
13	300750	宁德时代	8,527,483.00	1.39
14	600031	三一重工	8,331,564.00	1.36
15	300014	亿纬锂能	8,227,215.00	1.34
16	601138	工业富联	7,445,204.00	1.21
17	600019	宝钢股份	6,722,061.00	1.09
18	603296	华勤技术	6,658,492.40	1.08
19	603993	洛阳钼业	6,649,129.00	1.08
20	000338	潍柴动力	6,648,521.00	1.08

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	1,360,629,531.74
卖出股票收入（成交）总额	863,710,730.58

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金可基于谨慎原则，以套期保值为目的，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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同约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	12,903,013.09
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,903,013.09

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
万家沪深 300 指数 增强 A	59,753	7,766.27	288,284,326.27	62.12	175,773,497.81	37.88
万家沪深 300 指数 增强 C	9,903	21,457.20	153,544,716.31	72.26	58,945,911.14	27.74
万家沪深 300 指数 增强 Y	2,257	4,066.78	-	-	9,178,727.49	100.00
合计	71,286	9,619.38	441,829,042.58	64.43	243,898,136.44	35.57

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	万家沪深 300 指数增强 A	1,764,936.88	0.3803
	万家沪深 300 指数增强 C	78,310.78	0.0369
	万家沪深 300 指数增强 Y	25,665.45	0.2796
	合计	1,868,913.11	0.2725

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	万家沪深 300 指数增强 A	>100
	万家沪深 300 指数增强 C	0~10
	万家沪深 300 指数增强 Y	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	万家沪深 300 指数增强 A	10~50
	万家沪深 300 指数增强 C	0
	万家沪深 300 指数增强 Y	0~10
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家沪深 300 指数增强 A	万家沪深 300 指数增强 C	万家沪深 300 指数增强 Y
基金合同生效日（2016 年 9 月 26 日）基金份额总额	200,003,856.66	8,858.96	—
本报告期期初基金份额总额	287,384,158.40	95,373,900.91	1,279,235.21
本报告期基金总申购份额	241,921,564.34	255,888,138.10	10,035,024.63
减：本报告期基金总赎回份额	65,247,898.66	138,771,411.56	2,135,532.35
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—
本报告期期末基金份额总额	464,057,824.08	212,490,627.45	9,178,727.49

§ 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：

自 2026 年 4 月 16 日起，陈广益先生担任公司董事长，方一天先生不再担任公司董事长；莫海波先生担任公司总经理，陈广益先生不再担任公司总经理；

自 2026 年 5 月 25 日起，王焱女士担任公司首席信息官，陈广益先生不再担任公司首席信息官。

基金托管人：

报告期内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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 (%)	
国信证券	2	1,822,091,763.99	82.01	356,996.57	82.36	-
中泰证券	3	229,499,339.86	10.33	43,900.23	10.13	-
金融街证券	3	170,270,619.91	7.66	32,558.01	7.51	-

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、本基金于 2022 年 6 月 23 日完成证券交易模式转换工作，启用券商结算模式，本报告期内管理人选择中泰证券、金融街证券和国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。

10.7.2 基金租用或者通过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基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	指定媒介	2026 年 1 月 21 日
2	万家沪深 300 指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	指定媒介	2026 年 1 月 21 日
3	万家基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	指定媒介	2026 年 3 月 30 日
4	万家沪深 300 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	指定媒介	2026 年 3 月 30 日
5	万家基金管理有限公司关于董事长、高级管理人员变更的公告	指定媒介	2026 年 4 月 17 日
6	万家基金管理有限公司关于旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	指定媒介	2026 年 4 月 21 日
7	万家沪深 300 指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	指定媒介	2026 年 4 月 21 日
8	万家基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	指定媒介	2026 年 5 月 27 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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、《万家沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》。
- 4、万家沪深 300 指数增强型证券投资基金 2026 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

2026 年 8 月 29 日