

# 万家国证 2000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 2 季度报告

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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2025 年 7 月 18 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。  
本报告期自 2025 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 万家国证 2000 指数增强                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 基金主代码      | 018653                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 基金合同生效日    | 2023 年 9 月 26 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 报告期末基金份额总额 | 179,193,535.97 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 投资目标       | 本基金为指数增强型股票基金，采取量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，在力求有效跟踪标的指数的基础上，实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 投资策略       | 本基金采用指数增强投资策略，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。具体策略包括：1、大类资产配置策略；2、股票投资策略：（1）指数化投资策略；（2）指数增强策略；（3）港股通标的股票投资策略；（4）存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、可转换债券与可交换债券投资策略；6、证券公司短期公司债券投资策略；7、金融衍生产品投资策略：（1）股指期货交易策略；（2）国债期货交易策略；（3）股票期权投资策略；8、信用衍生品投资策略；9、融资及转融通证券出借业务投资策略。 |
| 业绩比较基准     | 国证 2000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |

|                 |                                                                                                                                                      |                    |
|-----------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|
|                 | × 5%                                                                                                                                                 |                    |
| 风险收益特征          | 本基金为指数增强型股票基金，其预期风险收益水平理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金可投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风<br>险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港<br>股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。 |                    |
| 基金管理人           | 万家基金管理有限公司                                                                                                                                           |                    |
| 基金托管人           | 中国工商银行股份有限公司                                                                                                                                         |                    |
| 下属分级基金的基金简称     | 万家国证 2000 指数增强 A                                                                                                                                     | 万家国证 2000 指数增强 C   |
| 下属分级基金的交易代码     | 018653                                                                                                                                               | 018654             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 98, 246, 186. 32 份                                                                                                                                   | 80, 947, 349. 65 份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2025 年 4 月 1 日-2025 年 6 月 30 日） |                  |
|-----------------|-------------------------------------|------------------|
|                 | 万家国证 2000 指数增强 A                    | 万家国证 2000 指数增强 C |
| 1. 本期已实现收益      | 4, 914, 188. 14                     | 4, 030, 588. 65  |
| 2. 本期利润         | 10, 965, 864. 29                    | 8, 968, 884. 52  |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0. 0899                             | 0. 0922          |
| 4. 期末基金资产净值     | 115, 395, 809. 81                   | 94, 409, 310. 10 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1. 1746                             | 1. 1663          |

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人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。

2、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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家国证 2000 指数增强 A

| 阶段    | 净值增长率①  | 净值增长率标准<br>差② | 业绩比较基准<br>收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①－③    | ②－④     |
|-------|---------|---------------|----------------|-----------------------|--------|---------|
| 过去三个月 | 9. 41%  | 1. 95%        | 4. 25%         | 1. 90%                | 5. 16% | 0. 05%  |
| 过去六个月 | 17. 80% | 1. 69%        | 10. 26%        | 1. 71%                | 7. 54% | -0. 02% |

|            |        |       |        |       |       |        |
|------------|--------|-------|--------|-------|-------|--------|
| 过去一年       | 41.93% | 1.92% | 35.04% | 1.98% | 6.89% | -0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 17.46% | 1.76% | 9.95%  | 1.88% | 7.51% | -0.12% |

万家国证 2000 指数增强 C

| 阶段         | 净值增长率① | 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      | 9.30%  | 1.95%     | 4.25%      | 1.90%         | 5.05% | 0.05%  |
| 过去六个月      | 17.57% | 1.70%     | 10.26%     | 1.71%         | 7.31% | -0.01% |
| 过去一年       | 41.35% | 1.92%     | 35.04%     | 1.98%         | 6.31% | -0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 16.63% | 1.76%     | 9.95%      | 1.88%         | 6.68% | -0.12% |

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

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



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



注：本基金于 2023 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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务                                                                                | 任本基金的基金经理期限     |      | 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 | 2023 年 9 月 26 日 | -    | 18.5 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。 |

|                                                                                                                                                                       |  |  |  |  |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|--|
| 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、万家家瑞债券型证券投资基金、万家沪深 300 指数增强型证券投资基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家颐达灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 |  |  |  |  |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|--|

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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《公平交易管理办法》和《异常交易监控及报告管理办法》等规章制度，涵盖了研究、授权、投资决策和交易执行等投资管理活动的各个环节，确保公平对待不同投资组合，防范导致不公平交易以及利益输送的异常交易发生。

本公司制订了明确的投资授权制度，并建立了统一的投资管理平台，确保不同投资组合获得公平的投资决策机会。实行集中交易制度，对于交易所公开竞价交易，执行交易系统内的公平交易程序；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，原则上按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；对于银行间交易，按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。为保证公平交易原则的实现，通过制度规范、流程审批、系统风控参数设置等进行事前控制，通过对投资交易系统的实时监控进行事中控制，通过对异常交易的监控和分析实现事后控制。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 0 次。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2025 年二季度，A 股市场呈现先抑后扬的走势。四月上旬受美国“对等关税”政策影响，A 股单日大幅下挫，但随后得益于政策维稳以及中美大幅调降关税，市场风险偏好提升，主要宽基指数走出反弹行情，6 月末在金融股带动下进一步走强，上证指数创出年内新高。从风格来看，中小盘占优；从中信一级行业来看，综合金融、国防军工、通信表现相对较好，而食品饮料、家

电表现相对一般。

展望后市，随着外部环境缓和，有助于缓释基本面及市场风险偏好的压力，中国权益市场的动力来自中国产业创新的不断涌现和利率的不断下移。今年以来，DeepSeek 横空出世带动 AI 大模型快速发展，文化潮流哪吒、新消费等陆续出圈，宏观政策在拖住传统产业的同时，也在支持创新、科技、消费等领域的长期发展，给经济预期带来了积极转变。6 月份制造业 PMI 为 49.7%，连续两个月回升，制造业景气水平继续改善。当前无风险利率降至低位，票息收益有限，权益市场的配置需求提升，中长期资金及居民配置资金逐步入市，有望带动市场整体上移。整体来看，国内稳增长政策延续，在消费以旧换新、工业抢出口带动下，经济整体平稳运行，同时利率下行，权益市场配置需求增加，市场有望延续震荡上涨。本基金为指数增强型股票基金，采取量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，在力求有效跟踪标的指数基础上，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

万家国证 2000 指数增强基金采用量化多因子选股策略，控制行业权重偏离度、个股集中度，通过量化多因子选股的方式选取一篮子股票组合。在行业和风格配置相对于业绩基准指数相对均衡，无重仓行业或具体风格，在量化选股方面精选行业内质优个股组合，持股较为分散。采用量化风险模型合理控制组合风险，保证较小的跟踪误差，投资目标是获取在既定跟踪误差下的超额收益最大化。本基金股票组合中 80%以上权重为国证 2000 成分股，保持了跟标的指数的风格基本一致。

后续投资运作继续坚持以量化多因子选股为策略基础，积极参与科创、创业板打新等事件性机会，追求长期稳健的超额收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家国证 2000 指数增强 A 的基金份额净值为 1.1746 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.41%，同期业绩比较基准收益率为 4.25%；截至本报告期末万家国证 2000 指数增强 C 的基金份额净值为 1.1663 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.30%，同期业绩比较基准收益率为 4.25%。基金报告期内 A 份额、C 份额日均跟踪偏离度分别为 0.1797%、0.1791%，年跟踪误差分别为 3.2594%、3.2557%。符合基金合同中日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%的规定。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 197,473,138.12 | 91.25        |
|    | 其中：股票             | 197,473,138.12 | 91.25        |
| 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      | 18,635,887.73  | 8.61         |
| 8  | 其他资产              | 301,618.88     | 0.14         |
| 9  | 合计                | 216,410,644.73 | 100.00       |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 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         | 763,444.00     | 0.36         |
| B  | 采矿业              | 1,244,767.00   | 0.59         |
| C  | 制造业              | 112,702,551.00 | 53.72        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,730,030.96   | 1.30         |
| E  | 建筑业              | 1,634,611.80   | 0.78         |
| F  | 批发和零售业           | 8,792,198.50   | 4.19         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,418,153.48   | 0.68         |
| H  | 住宿和餐饮业           | —              | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 16,569,037.26  | 7.90         |
| J  | 金融业              | 1,259,379.00   | 0.60         |
| K  | 房地产业             | 1,386,924.00   | 0.66         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 2,378,209.00   | 1.13         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 5,771,648.00   | 2.75         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 804,812.00     | 0.38         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | —              | —            |
| P  | 教育               | 481,500.00     | 0.23         |

|   |           |                |       |
|---|-----------|----------------|-------|
| Q | 卫生和社会工作   | 603,680.00     | 0.29  |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 3,167,230.80   | 1.51  |
| S | 综合        | —              | —     |
|   | 合计        | 161,708,176.80 | 77.08 |

### 5.2.2 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         | 199,825.00    | 0.10         |
| B  | 采矿业              | 324,195.00    | 0.15         |
| C  | 制造业              | 21,261,519.66 | 10.13        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 272,374.00    | 0.13         |
| E  | 建筑业              | 270,954.00    | 0.13         |
| F  | 批发和零售业           | 2,513,644.00  | 1.20         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 267,471.00    | 0.13         |
| H  | 住宿和餐饮业           | —             | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 3,836,187.46  | 1.83         |
| J  | 金融业              | 3,761,622.00  | 1.79         |
| K  | 房地产业             | 718,393.00    | 0.34         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 85,311.00     | 0.04         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 593,567.20    | 0.28         |
| 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               | 234,864.00    | 0.11         |
| Q  | 卫生和社会工作          | 92,352.00     | 0.04         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 1,332,682.00  | 0.64         |
| S  | 综合               | —             | —            |
|    | 合计               | 35,764,961.32 | 17.05        |

### 5.2.3 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。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告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前十名股票投资明细

| 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  | 002807 | 江阴银行 | 229,400 | 1,089,650.00 | 0.52         |
| 2  | 000420 | 吉林化纤 | 259,700 | 1,012,830.00 | 0.48         |
| 3  | 601126 | 四方股份 | 62,200  | 1,011,994.00 | 0.48         |
| 4  | 603667 | 五洲新春 | 29,700  | 995,247.00   | 0.47         |
| 5  | 000823 | 超声电子 | 83,100  | 984,735.00   | 0.47         |

|    |        |      |         |            |      |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 6  | 300232 | 洲明科技 | 135,800 | 983,192.00 | 0.47 |
| 7  | 601886 | 江河集团 | 159,500 | 980,925.00 | 0.47 |
| 8  | 300048 | 合康新能 | 166,400 | 976,768.00 | 0.47 |
| 9  | 600866 | 星湖科技 | 141,300 | 976,383.00 | 0.47 |
| 10 | 002004 | 华邦健康 | 233,800 | 974,946.00 | 0.46 |

### 5.3.2 报告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前五名股票投资明细

| 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  | 600410 | 华胜天成 | 81,900  | 785,421.00 | 0.37         |
| 2  | 300017 | 网宿科技 | 68,300  | 732,176.00 | 0.35         |
| 3  | 000757 | 浩物股份 | 154,600 | 700,338.00 | 0.33         |
| 4  | 000818 | 航锦科技 | 30,900  | 695,250.00 | 0.33         |
| 5  | 002362 | 汉王科技 | 30,500  | 683,810.00 | 0.33         |

### 5.4 报告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。

### 5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

### 5.7 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。

### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与股指期货交易，利用股指期货剥离部分多头股票资产的系统性风险。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等

因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

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

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | -          |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 301,618.88 |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 301,618.88 |

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告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。

5.11.5.2 报告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。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 万家国证 2000 指数增强 A | 万家国证 2000 指数增强 C |
|---------------------------|------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 137,222,549.06   | 103,823,718.16   |
| 报告期期间基金总申购份额              | 4,932,767.36     | 12,037,823.94    |
| 减:报告期期间基金总赎回份额            | 43,909,130.10    | 34,914,192.45    |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -                | -                |
| 报告期期末基金份额总额               | 98,246,186.32    | 80,947,349.65    |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申赎及买卖本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申赎及买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

§9 备查文件目录

## 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《万家国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家国证 2000 指数增强型证券投资基金托管协议》。
- 4、万家国证 2000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 2 季度报告原文。
- 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。

## 9.2 存放地点

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

## 9.3 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 7 月 18 日