

万家国证 2000 指数增强型证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	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	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
10.8 其他重大事件	63
§ 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	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家国证 2000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	万家国证 2000 指数增强	
基金主代码	018653	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 9 月 26 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	179,193,535.97 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	万家国证 2000 指数增强 A	万家国证 2000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	018653	018654
报告期末下属分级基金的份额总额	98,246,186.32 份	80,947,349.65 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金，采取量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，在力求有效跟踪标的指数的基础上，实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强投资策略，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。具体策略包括：1、大类资产配置策略；2、股票投资策略：（1）指数化投资策略；（2）指数增强策略；（3）港股通标的股票投资策略；（4）存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、可转换债券与可交换债券投资策略；6、证券公司短期公司债券投资策略；7、金融衍生产品投资策略：（1）股指期货交易策略；（2）国债期货交易策略；（3）股票期权投资策略；8、信用衍生品投资策略；9、融资及转融通证券出借业务投资策略。
业绩比较基准	国证 2000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为指数增强型股票基金，其预期风险收益水平理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 本基金可投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		万家基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	兰剑	郭明
	联系电话	021-38909626	010-66105799
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008880800	95588
传真		021-38909627	010-66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦 电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200122	100140
法定代表人		方一天	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网 址	http://www.wjasset.com
基金中期报告备置地点	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(2025年1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
本期已实现收益	19,010,133.74	14,689,918.76
本期利润	27,697,653.50	22,023,263.95
加权平均基金份 额本期利润	0.1808	0.1843
本期加权平均净 值利润率	17.18%	17.61%
本期基金份额净	17.80%	17.57%

值增长率		
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	17,149,623.49	13,461,960.45
期末可供分配基金份额利润	0.1746	0.1663
期末基金资产净值	115,395,809.81	94,409,310.10
期末基金份额净值	1.1746	1.1663
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	17.46%	16.63%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家国证 2000 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.85%	0.96%	5.71%	1.00%	2.14%	-0.04%
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	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①—③	②—④
----	-----	------	-------	--------	-----	-----

	值增长率①	增长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	7.80%	0.96%	5.71%	1.00%	2.09%	-0.04%
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份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



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



注：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		
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 指数增强型证券投资基金、万家中证 500 指数增强型发起式	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。

	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 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 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。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金为指数增强型股票基金，采取量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，在力求有效跟踪标的指数基础上，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75% 的基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

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

股票组合中 80%以上权重为国证 2000 成分股，保持了跟标的指数的风格基本一致。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家国证 2000 指数增强 A 的基金份额净值为 1.1746 元，本报告期基金份额净值增长率为 17.80%，同期业绩比较基准收益率为 10.26%；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 17.57%，同期业绩比较基准收益率为 10.26%。基金报告期内 A 份额、C 份额日均跟踪偏离度分别为 0.2079%、0.2073%，年跟踪误差分别为 4.0681%、4.0660%。符合基金合同中日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%的规定。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年上半年，A 股市场虽有波折，但整体呈现震荡上行走势，年初至 1 月中旬受风险情绪压制快速下跌，春节之后至 3 月中旬，以 Deepseek 引领 TMT 板块走出“中国资产价值重估”行情；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，主要宽基指数稳步上涨，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。

展望后市，7 月政治局会议更加强调存量政策的落地，弱化增量预期，落实与细化存量的确定性更高，会议指出，“当前我国经济运行依然面临不少风险挑战，要正确把握形势，增强忧患意识，坚持底线思维，用好发展机遇、潜力和优势，巩固拓展经济回升向好势头”，因此对于下半年的经济工作，会议强调要“保持政策连续性稳定性，增强灵活性预见性，着力稳就业、稳企业、稳市场、稳预期，有力促进国内国际双循环。从 5 月份关税纠纷缓和以来，A 股各板块“轮动上涨、低位补涨”的特征明显，赚钱效应的持续性更好，同时市场增量资金来源较为广泛，在低利率市场环境下以及资产配置荒格局下，后续“居民配置资金入市与股市慢涨”的正反馈效应有望加强，A 股市场有望震荡上行。

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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对万家基金管理有限公司编制和披露的本基金 2025 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：万家国证 2000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：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	720,765.75	1,438,838.45
结算备付金		17,915,121.98	29,157,198.61
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	197,473,138.12	363,211,444.33
其中：股票投资		197,473,138.12	363,211,444.33
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		301,618.88	62,271.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		216,410,644.73	393,869,752.67
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		6,158,113.93	6,185,135.99
应付管理人报酬		179,749.84	374,711.40
应付托管费		26,962.47	56,206.70
应付销售服务费		32,394.37	63,622.49
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	208,304.21	150,182.25
负债合计		6,605,524.82	6,829,858.83
净资产：			

实收基金	6.4.7.7	179,193,535.97	389,022,309.79
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	30,611,583.94	-1,982,415.95
净资产合计		209,805,119.91	387,039,893.84
负债和净资产总计		216,410,644.73	393,869,752.67

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额总额 179,193,535.97 份，其中万家国证 2000 指数增强 A 基金份额净值 1.1746 元，基金份额总额 98,246,186.32 份；万家国证 2000 指数增强 C 基金份额净值 1.1663 元，基金份额总额 80,947,349.65 份。

6.2 利润表

会计主体：万家国证 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期：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		51,703,242.84	-153,618,187.79
1. 利息收入		26,410.00	83,214.76
其中：存款利息收入	6.4.7.10	26,410.00	83,214.76
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		35,590,696.55	-127,658,787.29
其中：股票投资收益	6.4.7.11	33,928,434.49	-135,780,960.78
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
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	1,662,262.06	8,122,173.49
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	16,020,864.95	-26,310,109.98
4. 汇兑收益（损失以“-”		-	-

号填列)			
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6. 4. 7. 18	65, 271. 34	267, 494. 72
减: 二、营业总支出		1, 982, 325. 39	5, 127, 961. 12
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	1, 433, 191. 35	3, 813, 887. 74
其中: 暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	214, 978. 72	572, 083. 19
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	250, 435. 56	662, 996. 19
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 19	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 20	83, 719. 76	78, 994. 00
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		49, 720, 917. 45	-158, 746, 148. 91
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		49, 720, 917. 45	-158, 746, 148. 91
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		49, 720, 917. 45	-158, 746, 148. 91

6.3 净资产变动表

会计主体: 万家国证 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期: 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	389, 022, 309. 79	-	-1, 982, 415. 95	387, 039, 893. 84
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	389, 022, 309. 79	-	-1, 982, 415. 95	387, 039, 893. 84
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-209, 828, 773. 8 2	-	32, 593, 999. 89	-177, 234, 773. 93

(一)、综合收益总额	-	-	49,720,917.45	49,720,917.45
(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)	-209,828,773.8 2	-	-17,126,917.56	-226,955,691.38
其中：1. 基金申购款	40,960,217.44	-	1,900,143.65	42,860,361.09
2. 基金赎回款	-250,788,991.2 6	-	-19,027,061.21	-269,816,052.47
(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	179,193,535.97	-	30,611,583.94	209,805,119.91
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	1,048,393,167. 28	-	-9,085,320.01	1,039,307,847.2 7
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,048,393,167. 28	-	-9,085,320.01	1,039,307,847.2 7
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-282,940,169.3 2	-	-123,680,688.9 2	-406,620,858.24
(一)、综合收益总额	-	-	-158,746,148.9 1	-158,746,148.91

(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-282,940,169.32	-	35,065,459.99	-247,874,709.33
其中：1. 基金申购款	35,805,203.28	-	-5,350,658.51	30,454,544.77
2. 基金赎回款	-318,745,372.60	-	40,416,118.50	-278,329,254.10
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	765,452,997.96	-	-132,766,008.93	632,686,989.03

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

万家国证 2000 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2023]1138 号文《关于准予万家国证 2000 指数增强型证券投资基金注册的批复》的核准，由万家基金管理有限公司作为基金管理人于 2023 年 9 月 1 日至 2023 年 9 月 22 日向社会公开募集，募集期结束经立信会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具信会师报字[2023]第 ZA31748 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2023 年 9 月 26 日生效，本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 1,116,462,284.91 元，有效认购资金在基金验资确认日之前产生的利息为人民币 320,158.23 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,116,782,443.14 元，折合

1,116,782,443.14 份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为万家基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的主要投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板以及其他中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、证券公司短期公司债、政府支持机构债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资业务和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：国证 2000 指数收益率 \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。

(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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	720,765.75
等于：本金	720,472.49
加：应计利息	293.26
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	720,765.75

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	194,060,824.64	-	197,473,138.12	3,412,313.48
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	194,060,824.64	-	197,473,138.12	3,412,313.48

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	50.45
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	194,383.76
其他	13,870.00
合计	208,304.21

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

万家国证 2000 指数增强 A

项目	本期 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	221,481,369.03	221,481,369.03
本期申购	9,662,682.45	9,662,682.45
本期赎回（以“-”号填列）	-132,897,865.16	-132,897,865.16
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	98,246,186.32	98,246,186.32

万家国证 2000 指数增强 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	167,540,940.76	167,540,940.76
本期申购	31,297,534.99	31,297,534.99
本期赎回（以“-”号填列）	-117,891,126.10	-117,891,126.10
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	80,947,349.65	80,947,349.65

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

万家国证 2000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	17,972,510.50	-18,621,423.95	-648,913.45
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

其他	-	-	-
本期期初	17,972,510.50	-18,621,423.95	-648,913.45
本期利润	19,010,133.74	8,687,519.76	27,697,653.50
本期基金份额交易产生的变动数	-15,476,483.31	5,577,366.75	-9,899,116.56
其中：基金申购款	1,330,979.24	-817,896.11	513,083.13
基金赎回款	-16,807,462.55	6,395,262.86	-10,412,199.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,506,160.93	-4,356,537.44	17,149,623.49

万家国证 2000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	12,678,174.32	-14,011,676.82	-1,333,502.50
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	12,678,174.32	-14,011,676.82	-1,333,502.50
本期利润	14,689,918.76	7,333,345.19	22,023,263.95
本期基金份额交易产生的变动数	-10,331,724.98	3,103,923.98	-7,227,801.00
其中：基金申购款	3,841,676.83	-2,454,616.31	1,387,060.52
基金赎回款	-14,173,401.81	5,558,540.29	-8,614,861.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,036,368.10	-3,574,407.65	13,461,960.45

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	9,165.15
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	17,244.10
其他	0.75
合计	26,410.00

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	33,928,434.49
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	33,928,434.49

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	1,579,787,744.88
减：卖出股票成本总额	1,544,305,940.55
减：交易费用	1,553,369.84
买卖股票差价收入	33,928,434.49

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,662,262.06
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	1,662,262.06

6.4.7.17 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	16,020,864.95
股票投资	16,020,864.95
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	16,020,864.95

6.4.7.18 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	63,713.37
基金转换费收入	1,557.97
合计	65,271.34

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
	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	336.00
账户维护费	9,000.00
合计	83,719.76

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
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金销售机构

中泰证券股份有限公司(“中泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
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

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 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

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	1,433,191.35	3,813,887.74
其中：应支付销售机构的客户维护费	632,599.65	1,514,746.91
应支付基金管理人的净管理费	800,591.70	2,299,140.83

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

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	214,978.72	572,083.19

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

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		
	万家国证 2000 指数增强 A	万家国证 2000 指数增强 C	合计
工商银行	-	11,252.08	11,252.08
万家财富	-	1.82	1.82
万家基金	-	6.63	6.63
中泰证券	-	5,943.85	5,943.85
合计	-	17,204.38	17,204.38
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		
	万家国证 2000 指数增强 A	万家国证 2000 指数增强 C	合计
工商银行	-	26,799.14	26,799.14
万家基金	-	0.60	0.60

中泰证券	-	15,212.87	15,212.87
合计	-	42,012.61	42,012.61

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

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 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
工商银行	720,765.75	9,165.15	6,154,184.49	19,014.62

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

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

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
001335	信凯科技	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001356	富岭股份	2025 年 1 月 16 日	6 个月	新股流通受限	5.30	14.44	709	3,757.70	10,237.96	-
001382	新亚电缆	2025 年 3 月 13 日	6 个月	新股流通受限	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通	2025 年 6 月	6 个月	新股流通	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-

	电子	24 日		受限						
001390	古麒绒材	2025 年 5 月 21 日	6 个月	新股流通受限	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
001395	亚联机械	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301173	毓恬冠佳	2025 年 2 月 24 日	6 个月	新股流通受限	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
301275	汉朔科技	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股流通受限	27.50	56.19	326	8,965.00	18,317.94	-
301458	钧崮电子	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股流通受限	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
301479	弘景光电	2025 年 3 月 6 日	6 个月	新股流通受限	29.93	77.87	182	5,447.00	14,172.34	含转增股
301501	恒鑫生活	2025 年 3 月 11 日	6 个月	新股流通受限	27.48	45.22	276	7,584.80	12,480.72	含转增股
301535	浙江华远	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301560	众捷汽车	2025 年 4 月 17 日	6 个月	新股流通受限	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优绿能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	新股流通受限	89.60	139.48	59	5,286.40	8,229.32	-
301595	太力	2025 年 5 月	6 个月	新股流通	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-

	科技	12 日		受限						
301601	惠通科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
301602	超研股份	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新股流通受限	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301636	泽润新能	2025 年 4 月 30 日	6 个月	新股流通受限	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首航新能	2025 年 3 月 26 日	6 个月	新股流通受限	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301662	宏工科技	2025 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301665	泰禾股份	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301678	新恒汇	2025 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	12.80	44.54	357	4,569.60	15,900.78	-
603014	威高血净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	26.50	32.68	128	3,392.00	4,183.04	-
603049	中策橡胶	2025 年 5 月 27 日	6 个月	新股流通受限	46.50	42.85	119	5,533.50	5,099.15	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-
603120	肯特催	2025 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-

	化									
603124	江南新材	2025年3月12日	6个月	新股流通受限	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603202	天有为	2025年4月16日	6个月	新股流通受限	93.50	90.66	39	3,646.50	3,535.74	-
603210	泰鸿万立	2025年4月1日	6个月	新股流通受限	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603257	中国瑞林	2025年3月28日	6个月	新股流通受限	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603271	永杰新材	2025年3月4日	6个月	新股流通受限	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
603382	海阳科技	2025年6月5日	6个月	新股流通受限	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603400	华之杰	2025年6月12日	6个月	新股流通受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603409	汇通控股	2025年2月25日	6个月	新股流通受限	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
688545	兴福电子	2025年1月15日	6个月	新股流通受限	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	-
688583	思看科技	2025年1月8日	6个月	新股流通受限	25.80	79.68	227	5,855.50	18,087.36	含转增股
688755	汉邦科技	2025年5月9日	6个月	新股流通受限	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
688757	胜	2025	6个月	新股	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-

	科纳米	2025年3月18日		流通受限						
688758	赛分科技	2025年1月2日	6个月	新股流通受限	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
688775	影石创新	2025年6月4日	6个月	新股流通受限	47.27	124.16	199	9,406.73	24,707.84	-

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
000633	合金投资	2025年6月24日	重大事项停牌	6.15	2025年7月1日	6.77	39,400	231,414.57	242,310.00	-

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

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

于 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	720,765.75	-	-	-	-	-	720,765.75
结算备付金	17,915,121.98	-	-	-	-	-	17,915,121.98
交易性金融资产	-	-	-	-	-	197,473,138.12	197,473,138.12
应收申购款	-	-	-	-	-	301,618.88	301,618.88
资产总计	18,635,887.73	-	-	-	-	197,774,757.00	216,410,644.73
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,158,113.93	6,158,113.93
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	179,749.84	179,749.84
应付托管费	-	-	-	-	-	26,962.47	26,962.47
应付销售服务费	-	-	-	-	-	32,394.37	32,394.37
其他负债	-	-	-	-	-	208,304.21	208,304.21
负债总计	-	-	-	-	-	6,605,524.82	6,605,524.82
利率敏感度缺口	18,635,887.73	-	-	-	-	-191,169,232.18	209,805,119.91
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	1,438,838.45	-	-	-	-	-	1,438,838.45
结算备付金	29,157,198.61	-	-	-	-	-	29,157,198.61
交易性金融资产	-	-	-	-	-363,211,444.33	363,211,444.33	363,211,444.33
应收申购款	0.59	-	-	-	-	62,270.69	62,271.28
资产总计	30,596,037.65	-	-	-	-363,273,715.02	393,869,752.67	393,869,752.67
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,185,135.99	6,185,135.99
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	374,711.40	374,711.40
应付托管费	-	-	-	-	-	56,206.70	56,206.70
应付销售服务费	-	-	-	-	-	63,622.49	63,622.49
其他负债	-	-	-	-	-	150,182.25	150,182.25
负债总计	-	-	-	-	-	6,829,858.83	6,829,858.83
利率敏感度缺口	30,596,037.65	-	-	-	-356,443,856.19	387,039,893.84	387,039,893.84

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

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	197,473,138.12	94.12	363,211,444.33	93.84
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	197,473,138.12	94.12	363,211,444.33	93.84

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（2025年6月30日）	上年度末（2024年12月31日）
	1. 股票基准指数上升 100 个基点	1,937,440.52	6,009,557.30
2. 股票基准指数下降 100 个基点	-1,937,440.52	-6,009,557.30	

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	196,842,281.68	362,636,400.08

第二层次	257,695.54	27,736.50
第三层次	373,160.90	547,307.75
合计	197,473,138.12	363,211,444.33

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	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	其他各项资产	301,618.88	0.14

9	合计	216,410,644.73	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	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

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	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

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	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
11	002706	良信股份	108,400	965,844.00	0.46
12	300369	绿盟科技	123,900	962,703.00	0.46
13	002284	亚太股份	86,700	958,035.00	0.46

14	000957	中通客车	86,200	942,166.00	0.45
15	002523	天桥起重	257,600	940,240.00	0.45
16	002296	辉煌科技	84,000	936,600.00	0.45
17	002489	浙江永强	254,900	932,934.00	0.44
18	600237	铜峰电子	128,600	932,350.00	0.44
19	300288	朗玛信息	61,300	926,243.00	0.44
20	600103	青山纸业	416,200	923,964.00	0.44
21	002454	松芝股份	119,200	920,224.00	0.44
22	002587	奥拓电子	142,200	917,190.00	0.44
23	600351	亚宝药业	151,000	916,570.00	0.44
24	300206	理邦仪器	76,200	915,924.00	0.44
25	300241	瑞丰光电	160,500	914,850.00	0.44
26	300105	龙源技术	118,500	913,635.00	0.44
27	002885	京泉华	64,500	912,675.00	0.44
28	002782	可立克	70,300	912,494.00	0.43
29	000551	创元科技	71,000	912,350.00	0.43
30	002419	天虹股份	169,600	909,056.00	0.43
31	002404	嘉欣丝绸	140,200	907,094.00	0.43
32	000779	甘咨询	97,100	900,117.00	0.43
33	002953	日丰股份	86,200	894,756.00	0.43
34	002441	众业达	98,500	893,395.00	0.43
35	301060	兰卫医学	92,200	889,730.00	0.42
36	600758	辽宁能源	237,800	889,372.00	0.42
37	002297	博云新材	110,300	882,400.00	0.42
38	600429	三元股份	195,200	880,352.00	0.42
39	688238	和元生物	140,700	872,340.00	0.42
40	002695	煌上煌	91,700	861,980.00	0.41
41	002036	联创电子	79,200	856,152.00	0.41
42	003020	立方制药	38,300	854,856.00	0.41
43	600195	中牧股份	114,836	841,747.88	0.40
44	300420	五洋自控	240,500	827,320.00	0.39
45	002455	百川股份	110,600	827,288.00	0.39
46	603313	梦百合	96,300	818,550.00	0.39
47	002545	东方铁塔	91,900	816,991.00	0.39
48	000962	东方钨业	49,600	813,936.00	0.39
49	603466	风语筑	79,700	804,173.00	0.38
50	600746	江苏索普	102,600	801,306.00	0.38
51	300973	立高食品	16,400	799,828.00	0.38
52	688327	云从科技	57,800	797,062.00	0.38
53	002225	濮耐股份	160,700	795,465.00	0.38
54	300768	迪普科技	46,300	794,045.00	0.38
55	300421	力星股份	52,800	790,944.00	0.38
56	300249	依米康	57,700	787,028.00	0.38

57	300602	飞荣达	36,600	776,286.00	0.37
58	603219	富佳股份	53,200	771,932.00	0.37
59	002881	美格智能	16,600	770,240.00	0.37
60	601116	三江购物	69,500	756,855.00	0.36
61	002245	蔚蓝锂芯	58,400	749,272.00	0.36
62	002452	长高电新	107,800	749,210.00	0.36
63	300188	国投智能	54,100	746,580.00	0.36
64	001339	智微智能	15,200	734,616.00	0.35
65	301348	蓝箭电子	31,102	731,830.06	0.35
66	603901	永创智能	68,800	725,152.00	0.35
67	300456	赛微电子	41,200	708,228.00	0.34
68	300507	苏奥传感	92,200	708,096.00	0.34
69	603126	中材节能	114,200	706,898.00	0.34
70	600626	申达股份	189,000	686,070.00	0.33
71	301069	凯盛新材	42,400	683,064.00	0.33
72	603628	清源股份	55,800	681,318.00	0.32
73	300168	万达信息	88,800	681,096.00	0.32
74	300825	阿尔特	62,100	671,301.00	0.32
75	002445	中南文化	263,000	670,650.00	0.32
76	300702	天宇股份	28,800	669,888.00	0.32
77	600267	海正药业	72,300	668,775.00	0.32
78	301215	中汽股份	107,400	665,880.00	0.32
79	300691	联合光电	34,300	656,845.00	0.31
80	002761	浙江建投	73,600	652,832.00	0.31
81	603612	索通发展	35,500	652,490.00	0.31
82	300363	博腾股份	38,200	652,456.00	0.31
83	300667	必创科技	41,200	650,548.00	0.31
84	600305	恒顺醋业	83,600	646,228.00	0.31
85	300322	硕贝德	43,200	645,840.00	0.31
86	300471	厚普股份	60,400	642,656.00	0.31
87	600266	城建发展	140,700	638,778.00	0.30
88	301270	汉仪股份	13,300	633,878.00	0.30
89	002560	通达股份	80,100	632,790.00	0.30
90	000560	我爱我家	212,600	631,422.00	0.30
91	688202	美迪西	17,200	617,996.00	0.29
92	002876	三利谱	24,500	617,155.00	0.29
93	300365	恒华科技	93,200	614,188.00	0.29
94	300374	中铁装配	38,600	613,740.00	0.29
95	002970	锐明技术	12,400	612,560.00	0.29
96	603966	法兰泰克	65,800	610,624.00	0.29
97	603520	司太立	62,200	609,560.00	0.29
98	300648	星云股份	17,500	604,800.00	0.29
99	301239	普瑞眼科	15,400	603,680.00	0.29

100	000906	浙商中拓	94,700	603,239.00	0.29
101	002728	特一药业	71,700	602,997.00	0.29
102	002758	浙农股份	67,200	600,096.00	0.29
103	300788	中信出版	18,700	599,896.00	0.29
104	688690	纳微科技	26,214	598,465.62	0.29
105	300499	高澜股份	33,600	598,080.00	0.29
106	600335	国机汽车	92,500	596,625.00	0.28
107	600163	中闽能源	116,500	596,480.00	0.28
108	300119	瑞普生物	30,700	596,194.00	0.28
109	002772	众兴菌业	76,300	595,903.00	0.28
110	300134	大富科技	48,600	594,378.00	0.28
111	688128	中国电研	24,200	592,900.00	0.28
112	603103	横店影视	36,600	587,430.00	0.28
113	603128	华贸物流	94,300	584,660.00	0.28
114	688381	帝奥微	26,900	582,654.00	0.28
115	002697	红旗连锁	106,600	570,310.00	0.27
116	603566	普莱柯	41,500	564,815.00	0.27
117	600218	全柴动力	62,400	559,728.00	0.27
118	002332	仙琚制药	61,000	559,370.00	0.27
119	002815	崇达技术	49,300	558,569.00	0.27
120	300592	华凯易佰	49,500	556,875.00	0.27
121	301260	格力博	28,200	556,104.00	0.27
122	600664	哈药股份	151,000	555,680.00	0.26
123	001338	永顺泰	46,600	555,472.00	0.26
124	300110	华仁药业	171,400	553,622.00	0.26
125	601579	会稽山	27,700	551,507.00	0.26
126	600420	国药现代	51,600	549,540.00	0.26
127	300933	中辰股份	72,300	548,757.00	0.26
128	600728	佳都科技	100,000	545,000.00	0.26
129	603708	家家悦	52,900	539,580.00	0.26
130	300510	金冠股份	117,600	538,608.00	0.26
131	300684	中石科技	22,500	537,300.00	0.26
132	688343	云天励飞	10,800	533,736.00	0.25
133	002783	凯龙股份	61,800	533,334.00	0.25
134	301116	益客食品	48,200	532,610.00	0.25
135	688001	华兴源创	20,700	523,089.00	0.25
136	000727	冠捷科技	215,200	522,936.00	0.25
137	603206	嘉环科技	30,400	522,272.00	0.25
138	688609	九联科技	49,300	516,171.00	0.25
139	000534	万泽股份	34,500	514,740.00	0.25
140	688401	路维光电	14,800	513,560.00	0.24
141	688508	芯朋微	9,200	513,544.00	0.24
142	300739	明阳电路	34,100	506,044.00	0.24

143	300733	西菱动力	27,700	491,121.00	0.23
144	002646	天佑德酒	52,800	489,984.00	0.23
145	301259	艾布鲁	10,000	488,800.00	0.23
146	601811	新华文轩	33,200	483,724.00	0.23
147	300192	科德教育	32,100	481,500.00	0.23
148	603081	大丰实业	44,100	477,162.00	0.23
149	002567	唐人神	99,100	471,716.00	0.22
150	600742	富维股份	49,400	469,794.00	0.22
151	002655	共达电声	35,900	465,264.00	0.22
152	300656	民德电子	17,400	465,102.00	0.22
153	002746	仙坛股份	79,300	461,526.00	0.22
154	002154	报喜鸟	121,000	454,960.00	0.22
155	002215	诺普信	43,900	453,487.00	0.22
156	002434	万里扬	61,600	451,528.00	0.22
157	002483	润邦股份	71,800	448,750.00	0.21
158	002344	海宁皮城	102,800	446,152.00	0.21
159	600628	新世界	59,800	437,736.00	0.21
160	002611	东方精工	35,900	432,954.00	0.21
161	605218	伟时电子	19,300	431,934.00	0.21
162	000404	长虹华意	60,700	430,970.00	0.21
163	688365	光云科技	27,900	424,638.00	0.20
164	688173	希荻微	30,600	417,996.00	0.20
165	603299	苏盐井神	43,900	415,733.00	0.20
166	002843	泰嘉股份	18,700	414,953.00	0.20
167	002034	旺能环境	24,700	414,713.00	0.20
168	300381	溢多利	55,100	414,352.00	0.20
169	300593	新雷能	30,800	412,720.00	0.20
170	300170	汉得信息	23,900	411,319.00	0.20
171	603267	鸿远电子	8,100	407,187.00	0.19
172	002823	凯中精密	28,800	404,064.00	0.19
173	002577	雷柏科技	19,400	401,968.00	0.19
174	688590	新致软件	19,200	394,368.00	0.19
175	600226	亨通股份	141,124	393,735.96	0.19
176	300582	英飞特	30,600	392,292.00	0.19
177	300687	赛意信息	14,100	391,698.00	0.19
178	300079	数码视讯	65,300	382,005.00	0.18
179	603067	振华股份	25,040	381,609.60	0.18
180	002206	海利得	74,100	378,651.00	0.18
181	688233	神工股份	11,900	378,063.00	0.18
182	300494	盛天网络	27,700	377,828.00	0.18
183	002985	北摩高科	12,400	375,100.00	0.18
184	688150	莱特光电	15,000	370,800.00	0.18
185	300821	东岳硅材	46,300	363,918.00	0.17

186	600572	康恩贝	83,000	363,540.00	0.17
187	688179	阿拉丁	28,500	362,520.00	0.17
188	300446	航天智造	20,900	361,988.00	0.17
189	688262	国芯科技	13,530	360,845.10	0.17
190	688660	电气风电	41,200	357,616.00	0.17
191	300353	东土科技	16,400	350,140.00	0.17
192	601801	皖新传媒	51,200	349,696.00	0.17
193	600216	浙江医药	23,600	349,044.00	0.17
194	603881	数据港	13,600	347,480.00	0.17
195	688261	东微半导	8,400	346,500.00	0.17
196	603085	天成自控	30,100	346,451.00	0.17
197	002649	博彦科技	23,800	345,814.00	0.16
198	002919	名臣健康	20,300	342,867.00	0.16
199	603229	奥翔药业	39,200	341,824.00	0.16
200	002979	雷赛智能	7,700	340,956.00	0.16
201	300439	美康生物	32,500	340,925.00	0.16
202	300612	宣亚国际	22,400	338,240.00	0.16
203	300203	聚光科技	15,200	336,376.00	0.16
204	600789	鲁抗医药	33,500	335,335.00	0.16
205	600640	国脉文化	27,400	332,088.00	0.16
206	300755	华致酒行	17,000	328,100.00	0.16
207	688668	鼎通科技	5,235	326,978.10	0.16
208	002255	海陆重工	38,800	326,696.00	0.16
209	603629	利通电子	14,300	321,750.00	0.15
210	688007	光峰科技	22,200	321,012.00	0.15
211	300292	吴通控股	65,900	320,933.00	0.15
212	601200	上海环境	39,800	316,012.00	0.15
213	688549	中巨芯	40,300	311,922.00	0.15
214	300738	奥飞数据	14,900	311,857.00	0.15
215	600409	三友化工	64,100	311,526.00	0.15
216	300441	鲍斯股份	38,000	310,080.00	0.15
217	300194	福安药业	73,300	310,059.00	0.15
218	300183	东软载波	18,400	309,304.00	0.15
219	688352	颀中科技	27,500	308,825.00	0.15
220	603368	柳药集团	18,200	307,762.00	0.15
221	600268	国电南自	39,200	306,544.00	0.15
222	600987	航民股份	43,200	305,424.00	0.15
223	300404	博济医药	33,100	305,182.00	0.15
224	300219	鸿利智汇	45,400	305,088.00	0.15
225	003000	劲仔食品	23,000	304,290.00	0.15
226	603227	雪峰科技	36,300	304,194.00	0.14
227	688432	有研硅	27,500	303,600.00	0.14
228	688588	凌志软件	20,800	303,056.00	0.14

229	603890	春秋电子	26,100	302,760.00	0.14
230	688389	普门科技	23,400	302,328.00	0.14
231	002662	峰璟股份	88,100	301,302.00	0.14
232	601038	一拖股份	23,000	300,610.00	0.14
233	603012	创力集团	54,300	300,279.00	0.14
234	601949	中国出版	44,600	296,144.00	0.14
235	002462	嘉事堂	22,100	295,477.00	0.14
236	600587	新华医疗	19,500	295,230.00	0.14
237	601096	宏盛华源	71,300	295,182.00	0.14
238	000061	农产品	46,000	293,940.00	0.14
239	688418	震有科技	11,100	293,706.00	0.14
240	002478	常宝股份	55,900	293,475.00	0.14
241	300705	九典制药	18,800	292,716.00	0.14
242	301085	亚康股份	4,900	291,305.00	0.14
243	300039	上海凯宝	48,000	290,880.00	0.14
244	300320	海达股份	29,100	289,254.00	0.14
245	603357	设计总院	33,400	289,244.00	0.14
246	601208	东材科技	30,500	289,140.00	0.14
247	002578	闽发铝业	86,200	288,770.00	0.14
248	300873	海晨股份	14,300	288,717.00	0.14
249	000601	韶能股份	59,400	288,684.00	0.14
250	002258	利尔化学	25,700	283,728.00	0.14
251	000848	承德露露	30,700	280,291.00	0.13
252	002880	卫光生物	9,800	279,398.00	0.13
253	688488	艾迪药业	19,900	275,615.00	0.13
254	600422	昆药集团	19,200	274,752.00	0.13
255	000028	国药一致	11,000	274,230.00	0.13
256	601101	昊华能源	37,000	267,880.00	0.13
257	300830	金现代	28,900	263,857.00	0.13
258	002886	沃特股份	14,000	263,480.00	0.13
259	002957	科瑞技术	16,000	263,040.00	0.13
260	002378	章源钨业	33,200	262,612.00	0.13
261	000862	银星能源	47,900	262,013.00	0.12
262	000882	华联股份	130,700	256,172.00	0.12
263	603698	航天工程	14,500	255,490.00	0.12
264	002516	旷达科技	49,000	252,350.00	0.12
265	002322	理工能科	20,800	251,680.00	0.12
266	688586	江航装备	22,000	247,500.00	0.12
267	600479	千金药业	23,700	246,480.00	0.12
268	300662	科锐国际	8,100	240,651.00	0.11
269	000791	甘肃能源	36,600	233,508.00	0.11
270	002349	精华制药	31,700	227,923.00	0.11
271	600618	氯碱化工	23,600	227,268.00	0.11

272	300083	创世纪	27,300	224,406.00	0.11
273	300066	三川智慧	50,600	223,652.00	0.11
274	000837	秦川机床	18,400	221,168.00	0.11
275	003006	百亚股份	8,000	219,040.00	0.10
276	300520	科大国创	8,700	215,760.00	0.10
277	605300	佳禾食品	15,400	215,754.00	0.10
278	301078	孩子王	16,200	211,734.00	0.10
279	605009	豪悦护理	5,100	202,878.00	0.10
280	002139	拓邦股份	14,300	197,483.00	0.09
281	300451	创业慧康	34,200	193,230.00	0.09
282	300434	金石亚药	19,900	191,438.00	0.09
283	300641	正丹股份	8,400	191,436.00	0.09
284	600179	安通控股	69,200	190,992.00	0.09
285	000045	深纺织 A	17,100	189,639.00	0.09
286	600694	大商股份	10,170	188,653.50	0.09
287	600780	通宝能源	31,800	188,574.00	0.09
288	300403	汉宇集团	12,400	188,356.00	0.09
289	300049	福瑞股份	5,800	188,094.00	0.09
290	300940	南极光	7,440	187,860.00	0.09
291	688400	凌云光	6,800	187,476.00	0.09
292	002791	坚朗五金	8,600	184,040.00	0.09
293	002292	奥飞娱乐	18,700	181,764.00	0.09
294	688595	芯海科技	4,800	179,472.00	0.09
295	301039	中集车辆	21,900	178,047.00	0.08
296	300299	富春股份	23,000	176,640.00	0.08
297	002469	三维化学	20,800	172,848.00	0.08
298	600278	东方创业	23,900	171,841.00	0.08
299	003038	鑫铂股份	8,500	165,665.00	0.08
300	600458	时代新材	12,000	164,640.00	0.08
301	000099	中信海直	7,500	163,350.00	0.08
302	603477	巨星农牧	7,700	158,466.00	0.08
303	002267	陕天然气	20,600	155,942.00	0.07
304	002174	游族网络	12,700	154,051.00	0.07
305	002328	新朋股份	26,400	153,648.00	0.07
306	603583	捷昌驱动	4,200	153,384.00	0.07
307	300740	水羊股份	9,100	152,425.00	0.07
308	300737	科顺股份	31,600	152,312.00	0.07
309	002170	芭田股份	14,400	147,600.00	0.07
310	002090	金智科技	15,400	147,532.00	0.07
311	688035	德邦科技	3,524	143,144.88	0.07
312	603063	禾望电气	4,200	142,212.00	0.07
313	001208	华菱线缆	13,200	140,580.00	0.07
314	600020	中原高速	27,100	129,538.00	0.06

315	300011	鼎汉技术	17,300	129,231.00	0.06
316	688066	航天宏图	6,500	127,270.00	0.06
317	603306	华懋科技	2,900	126,150.00	0.06
318	000993	闽东电力	12,200	119,194.00	0.06
319	002016	世荣兆业	21,300	116,724.00	0.06
320	688319	欧林生物	7,400	115,884.00	0.06
321	300762	上海瀚讯	5,000	113,150.00	0.05
322	300624	万兴科技	1,800	111,690.00	0.05
323	603328	依顿电子	11,200	109,872.00	0.05
324	300795	米奥会展	7,300	108,405.00	0.05
325	002892	科力尔	7,700	107,261.00	0.05
326	603319	美湖股份	3,000	106,260.00	0.05
327	002534	西子洁能	9,300	104,532.00	0.05
328	002668	TCL 智家	10,600	103,562.00	0.05
329	688658	悦康药业	5,433	103,444.32	0.05
330	300858	科拓生物	6,600	102,894.00	0.05
331	002250	联化科技	9,200	101,200.00	0.05
332	002897	意华股份	2,600	100,854.00	0.05
333	000521	长虹美菱	14,500	100,630.00	0.05
334	002827	高争民爆	3,000	98,340.00	0.05
335	002801	微光股份	3,000	97,110.00	0.05
336	600864	哈投股份	16,000	95,520.00	0.05
337	688315	诺禾致源	6,700	94,604.00	0.05
338	600550	保变电气	11,000	94,600.00	0.05
339	002666	德联集团	18,200	92,638.00	0.04
340	300577	开润股份	4,500	92,205.00	0.04
341	000058	深赛格	11,000	91,410.00	0.04
342	301297	富乐德	2,200	90,926.00	0.04
343	603191	望变电气	7,200	90,864.00	0.04
344	301381	赛维时代	4,500	89,775.00	0.04
345	300729	乐歌股份	6,000	85,920.00	0.04
346	002612	朗姿股份	5,100	85,884.00	0.04
347	301096	百诚医药	1,900	85,310.00	0.04
348	300846	首都在线	4,300	83,678.00	0.04
349	600750	江中药业	3,800	82,954.00	0.04
350	300342	天银机电	4,700	82,908.00	0.04
351	688302	海创药业	1,733	81,104.40	0.04
352	300548	长芯博创	1,200	80,124.00	0.04
353	002398	垒知集团	15,800	78,052.00	0.04
354	688208	道通科技	2,519	77,081.40	0.04
355	300231	银信科技	6,100	75,091.00	0.04
356	300475	香农芯创	2,100	74,823.00	0.04
357	688166	博瑞医药	1,385	74,388.35	0.04

358	300797	钢研纳克	5,200	72,072.00	0.03
359	000025	特力A	4,100	70,520.00	0.03
360	600908	无锡银行	10,900	68,779.00	0.03
361	301367	瑞迈特	800	67,280.00	0.03
362	300840	酷特智能	3,000	66,900.00	0.03
363	002947	恒铭达	2,000	66,380.00	0.03
364	600336	澳柯玛	9,600	65,472.00	0.03
365	300463	迈克生物	5,400	64,260.00	0.03
366	603662	柯力传感	1,000	63,930.00	0.03
367	002757	南兴股份	3,300	62,568.00	0.03
368	002204	大连重工	10,400	62,088.00	0.03
369	301525	儒竞科技	800	61,784.00	0.03
370	002095	生意宝	3,000	60,840.00	0.03
371	002428	云南锗业	3,000	59,700.00	0.03
372	688158	优刻得	2,600	58,812.00	0.03
373	300848	美瑞新材	3,400	58,412.00	0.03
374	688553	汇宇制药	3,280	53,431.20	0.03
375	600125	铁龙物流	9,400	53,204.00	0.03
376	002698	博实股份	3,300	51,282.00	0.02
377	600345	长江通信	1,919	49,529.39	0.02
378	002045	国光电器	3,100	49,476.00	0.02
379	002479	富春环保	9,500	47,595.00	0.02
380	600301	华锡有色	2,300	45,931.00	0.02
381	300133	华策影视	6,100	45,811.00	0.02
382	002708	光洋股份	4,000	44,120.00	0.02
383	601020	华钰矿业	2,300	41,584.00	0.02
384	300522	世名科技	3,000	41,340.00	0.02
385	600507	方大特钢	8,800	38,192.00	0.02
386	300416	苏试试验	2,600	37,258.00	0.02
387	605376	博迁新材	900	34,497.00	0.02
388	002838	道恩股份	1,900	34,029.00	0.02
389	688258	卓易信息	700	33,901.00	0.02
390	603105	芯能科技	3,600	29,592.00	0.01
391	605136	丽人丽妆	2,700	29,025.00	0.01
392	603070	万控智造	2,000	26,580.00	0.01
393	300358	楚天科技	3,200	24,960.00	0.01
394	603220	中贝通信	900	19,323.00	0.01
395	301149	隆华新材	1,400	16,016.00	0.01
396	300709	精研科技	400	15,620.00	0.01
397	300031	宝通科技	600	15,018.00	0.01
398	300481	濮阳惠成	900	12,879.00	0.01
399	300785	值得买	400	12,732.00	0.01
400	002246	北化股份	800	11,696.00	0.01

401	300634	彩讯股份	400	10,840.00	0.01
402	600975	新五丰	1,500	9,075.00	0.00
403	601188	龙江交通	2,100	7,371.00	0.00
404	300905	宝丽迪	200	6,390.00	0.00
405	601963	重庆银行	500	5,430.00	0.00
406	300278	华昌达	800	4,368.00	0.00
407	600449	宁夏建材	200	2,632.00	0.00
408	688165	埃夫特	99	2,526.48	0.00
409	688601	力芯微	59	2,357.05	0.00
410	688206	概伦电子	72	2,093.76	0.00
411	300563	神宇股份	50	2,028.00	0.00
412	688661	和林微纳	50	1,988.50	0.00
413	688636	智明达	50	1,689.50	0.00
414	001288	运机集团	80	1,666.40	0.00
415	605016	百龙创园	80	1,650.40	0.00
416	688025	杰普特	23	1,644.50	0.00
417	603158	腾龙股份	200	1,592.00	0.00
418	301339	通行宝	80	1,370.40	0.00
419	300787	海能实业	80	1,108.00	0.00
420	605598	上海港湾	40	854.80	0.00
421	300581	晨曦航空	40	818.80	0.00
422	002029	七匹狼	100	674.00	0.00
423	688559	海目星	17	559.30	0.00
424	600480	凌云股份	30	365.10	0.00
425	600551	时代出版	40	356.80	0.00
426	000900	现代投资	76	321.48	0.00
427	688108	赛诺医疗	10	112.20	0.00
428	688176	亚虹医药	11	97.57	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	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
6	600785	新华百货	56,700	665,091.00	0.32
7	300150	世纪瑞尔	122,300	613,946.00	0.29
8	300279	和晶科技	87,900	609,147.00	0.29
9	600299	安迪苏	62,200	600,230.00	0.29
10	600262	北方股份	25,200	574,560.00	0.27
11	603500	祥和实业	62,300	570,668.00	0.27
12	600030	中信证券	20,400	563,448.00	0.27

13	002999	天禾股份	80,600	562,588.00	0.27
14	600668	尖峰集团	39,620	560,623.00	0.27
15	601077	渝农商行	78,500	560,490.00	0.27
16	000783	长江证券	80,400	557,172.00	0.27
17	002739	万达电影	47,600	544,068.00	0.26
18	300888	稳健医疗	13,000	534,300.00	0.25
19	002905	金逸影视	57,100	529,888.00	0.25
20	002863	今飞凯达	102,800	521,196.00	0.25
21	000063	中兴通讯	15,900	516,591.00	0.25
22	002926	华西证券	56,700	506,898.00	0.24
23	603990	麦迪科技	30,800	500,500.00	0.24
24	603617	君禾股份	66,500	476,805.00	0.23
25	300980	祥源新材	17,500	409,850.00	0.20
26	603278	大业股份	44,800	407,680.00	0.19
27	603259	药明康德	5,800	403,390.00	0.19
28	601375	中原证券	96,900	403,104.00	0.19
29	002009	天奇股份	24,800	381,672.00	0.18
30	002686	亿利达	57,500	374,325.00	0.18
31	600010	包钢股份	204,700	366,413.00	0.17
32	002725	跃岭股份	27,100	357,178.00	0.17
33	688280	精进电动	45,800	332,966.00	0.16
34	603528	多伦科技	39,800	331,932.00	0.16
35	002600	领益智造	38,600	331,574.00	0.16
36	688039	当虹科技	10,100	331,482.00	0.16
37	603777	来伊份	25,100	329,563.00	0.16
38	688288	鸿泉物联	11,300	327,813.00	0.16
39	603138	海量数据	22,700	327,334.00	0.16
40	000659	珠海中富	107,900	319,384.00	0.15
41	688162	巨一科技	11,600	315,984.00	0.15
42	603703	盛洋科技	30,400	315,248.00	0.15
43	688266	泽璟制药	2,900	311,779.00	0.15
44	300871	回盛生物	14,000	292,600.00	0.14
45	688235	百济神州	1,238	289,246.32	0.14
46	301013	利和兴	16,800	284,760.00	0.14
47	002475	立讯精密	8,200	284,458.00	0.14
48	603739	蔚蓝生物	21,200	282,384.00	0.13
49	603660	苏州科达	38,900	281,247.00	0.13
50	300154	瑞凌股份	31,200	280,800.00	0.13
51	300534	陇神戎发	28,900	279,174.00	0.13
52	600222	太龙药业	49,700	277,823.00	0.13
53	601688	华泰证券	15,500	276,055.00	0.13
54	603019	中科曙光	3,900	274,560.00	0.13
55	688981	中芯国际	3,100	273,327.00	0.13

56	000623	吉林敖东	16,100	272,895.00	0.13
57	002054	德美化工	39,400	271,072.00	0.13
58	601111	中国国航	33,900	267,471.00	0.13
59	000573	粤宏远 A	66,500	267,330.00	0.13
60	601788	光大证券	14,800	266,104.00	0.13
61	601717	郑煤机	15,800	262,596.00	0.13
62	601921	浙版传媒	32,100	258,726.00	0.12
63	601933	永辉超市	51,800	253,820.00	0.12
64	002042	华孚时尚	55,300	252,168.00	0.12
65	603192	汇得科技	12,000	250,800.00	0.12
66	600315	上海家化	11,700	246,519.00	0.12
67	000938	紫光股份	10,200	244,698.00	0.12
68	002244	滨江集团	25,000	243,750.00	0.12
69	000932	华菱钢铁	55,300	243,320.00	0.12
70	000633	合金投资	39,400	242,310.00	0.12
71	000100	TCL 科技	55,500	240,315.00	0.11
72	002384	东山精密	6,300	237,951.00	0.11
73	002745	木林森	29,900	235,612.00	0.11
74	002659	凯文教育	46,600	234,864.00	0.11
75	002625	光启技术	5,800	231,884.00	0.11
76	603221	爱丽家居	21,100	231,256.00	0.11
77	003025	思进智能	16,918	229,069.72	0.11
78	600036	招商银行	4,900	225,155.00	0.11
79	601991	大唐发电	71,000	225,070.00	0.11
80	601939	建设银行	23,600	222,784.00	0.11
81	603116	红蜻蜓	36,800	216,384.00	0.10
82	300296	利亚德	35,000	213,500.00	0.10
83	600383	金地集团	54,700	207,313.00	0.10
84	603089	正裕工业	15,800	206,506.00	0.10
85	601600	中国铝业	27,400	192,896.00	0.09
86	601988	中国银行	32,100	180,402.00	0.09
87	605166	聚合顺	15,400	172,326.00	0.08
88	600354	敦煌种业	27,500	170,225.00	0.08
89	002286	保龄宝	14,500	164,285.00	0.08
90	301230	泓博医药	4,700	161,774.00	0.08
91	000975	山金国际	8,500	160,990.00	0.08
92	601868	中国能建	70,600	157,438.00	0.08
93	301119	正强股份	4,300	152,048.00	0.07
94	603379	三美股份	3,000	144,360.00	0.07
95	002249	大洋电机	21,500	141,470.00	0.07
96	301256	华融化学	12,400	131,316.00	0.06
97	603626	科森科技	15,400	129,668.00	0.06
98	002598	山东章鼓	11,000	122,320.00	0.06

99	000528	柳工	12,500	120,125.00	0.06
100	600489	中金黄金	8,100	118,503.00	0.06
101	601117	中国化学	14,800	113,516.00	0.05
102	600062	华润双鹤	5,400	100,764.00	0.05
103	600215	派斯林	13,200	100,056.00	0.05
104	300015	爱尔眼科	7,400	92,352.00	0.04
105	300496	中科创达	1,600	91,552.00	0.04
106	002915	中欣氟材	4,700	84,036.00	0.04
107	301076	新瀚新材	2,400	83,472.00	0.04
108	300879	大叶股份	2,000	78,560.00	0.04
109	603682	锦和商管	13,300	75,411.00	0.04
110	300026	红日药业	20,300	74,907.00	0.04
111	300002	神州泰岳	6,300	74,340.00	0.04
112	600793	宜宾纸业	2,800	72,156.00	0.03
113	603518	锦泓集团	7,100	70,148.00	0.03
114	600380	健康元	6,000	66,180.00	0.03
115	603586	金麒麟	2,900	53,128.00	0.03
116	000421	南京公用	7,200	47,304.00	0.02
117	003033	征和工业	1,100	46,629.00	0.02
118	600547	山东黄金	1,400	44,702.00	0.02
119	300652	雷迪克	600	35,334.00	0.02
120	000677	恒天海龙	5,900	33,335.00	0.02
121	300452	山河药辅	2,700	33,129.00	0.02
122	600685	中船防务	1,200	32,628.00	0.02
123	300967	晓鸣股份	1,600	29,600.00	0.01
124	600050	中国联通	5,100	27,234.00	0.01
125	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.01
126	688775	影石创新	199	24,707.84	0.01
127	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.01
128	000717	中南股份	9,600	23,424.00	0.01
129	600160	巨化股份	800	22,944.00	0.01
130	605080	浙江自然	700	19,460.00	0.01
131	002527	新时达	1,300	18,967.00	0.01
132	301275	汉朔科技	326	18,317.94	0.01
133	688583	思看科技	227	18,087.36	0.01
134	301602	超研股份	658	16,318.40	0.01
135	301678	新恒汇	357	15,900.78	0.01
136	002264	新华都	2,500	15,875.00	0.01
137	001388	信通电子	937	15,385.54	0.01
138	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.01
139	000988	华工科技	300	14,103.00	0.01
140	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.01
141	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.01

142	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.01
143	301501	恒鑫生活	276	12,480.72	0.01
144	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.01
145	600418	江淮汽车	300	12,027.00	0.01
146	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.01
147	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.01
148	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
149	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
150	300805	电声股份	900	9,900.00	0.00
151	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
152	301590	优优绿能	59	8,229.32	0.00
153	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
154	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
155	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
156	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
157	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
158	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
159	603049	中策橡胶	119	5,099.15	0.00
160	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
161	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
162	688213	思特威	43	4,395.46	0.00
163	603014	威高血净	128	4,183.04	0.00
164	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
165	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
166	603202	天有为	39	3,535.74	0.00
167	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
168	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
169	688516	奥特维	96	3,191.04	0.00
170	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
171	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
172	688220	翱捷科技	31	2,427.30	0.00
173	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
174	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
175	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
176	301379	天山电子	80	2,153.60	0.00
177	688028	沃尔德	97	2,104.90	0.00
178	002837	英维克	70	2,079.70	0.00
179	300573	兴齐眼药	40	2,071.60	0.00
180	688312	燕麦科技	86	2,066.58	0.00
181	688393	安必平	71	2,040.54	0.00
182	688607	康众医疗	95	1,781.25	0.00
183	688349	三一重能	68	1,695.92	0.00
184	688551	科威尔	44	1,293.16	0.00

185	688234	天岳先进	19	1,112.45	0.00
186	688005	容百科技	43	959.76	0.00
187	688080	映翰通	18	916.02	0.00
188	688135	利扬芯片	40	828.40	0.00
189	300557	理工光科	30	810.00	0.00
190	688580	伟思医疗	17	790.33	0.00
191	300432	富临精工	60	784.20	0.00
192	603037	凯众股份	60	746.40	0.00
193	688571	杭华股份	89	686.19	0.00
194	688170	德龙激光	25	630.00	0.00
195	688079	美迪凯	48	481.92	0.00
196	300932	三友联众	40	458.00	0.00
197	300697	电工合金	30	432.90	0.00
198	603499	翔港科技	20	329.80	0.00
199	000970	中科三环	15	176.55	0.00
200	600308	华泰股份	20	68.40	0.00
201	600585	海螺水泥	1	21.47	0.00
202	001227	兰州银行	4	10.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002649	博彦科技	4,935,847.00	1.28
2	300745	欣锐科技	4,449,918.00	1.15
3	300047	天源迪科	4,108,754.00	1.06
4	300319	麦捷科技	3,565,555.00	0.92
5	300502	新易盛	3,522,217.44	0.91
6	601616	广电电气	3,479,309.00	0.90
7	002284	亚太股份	3,445,442.00	0.89
8	001208	华菱线缆	3,426,944.00	0.89
9	300942	易瑞生物	3,377,925.00	0.87
10	002885	京泉华	3,243,841.00	0.84
11	600367	红星发展	3,175,967.00	0.82
12	603032	德新科技	3,160,657.00	0.82
13	603527	众源新材	3,150,916.00	0.81
14	002344	海宁皮城	3,115,439.00	0.80
15	002562	兄弟科技	3,094,416.00	0.80
16	300369	绿盟科技	3,093,992.00	0.80
17	300035	中科电气	3,091,134.00	0.80
18	002676	顺威股份	3,073,712.00	0.79
19	300113	顺网科技	3,055,497.00	0.79
20	002303	美盈森	3,002,908.00	0.78

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	300047	天源迪科	5,147,465.80	1.33
2	002649	博彦科技	5,118,416.00	1.32
3	300745	欣锐科技	4,956,022.00	1.28
4	688313	仕佳光子	4,907,133.63	1.27
5	002284	亚太股份	4,497,541.00	1.16
6	300502	新易盛	4,485,718.20	1.16
7	600367	红星发展	4,400,980.00	1.14
8	001208	华菱线缆	4,320,987.00	1.12
9	301017	漱玉平民	4,277,565.00	1.11
10	300975	商络电子	4,252,216.00	1.10
11	300184	力源信息	4,230,714.00	1.09
12	300083	创世纪	4,226,853.00	1.09
13	002546	新联电子	4,168,807.00	1.08
14	603527	众源新材	4,148,620.00	1.07
15	002562	兄弟科技	4,099,782.00	1.06
16	603032	德新科技	3,926,755.61	1.01
17	002250	联化科技	3,824,476.00	0.99
18	300035	中科电气	3,687,291.00	0.95
19	300113	顺网科技	3,645,161.00	0.94
20	601616	广电电气	3,631,265.00	0.94

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	1,362,546,769.39
卖出股票收入（成交）总额	1,579,787,744.88

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	301,618.88
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	301,618.88

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 (%)
万家国证 2000 指数增强 A	2,455	40,018.81	3,173,641.91	3.23	95,072,544.41	96.77
万家国证 2000 指数增强 C	5,071	15,962.80	1,000,233.33	1.24	79,947,116.32	98.76
合计	7,428	24,124.06	4,173,875.24	2.33	175,019,660.73	97.67

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	万家国证 2000 指数增强 A	226,263.31	0.2303

理人所有从业人员持有本基金	万家国证 2000 指数增强 C	41,274.35	0.0510
	合计	267,537.66	0.1493

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	万家国证 2000 指数增强 A	10~50
	万家国证 2000 指数增强 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	万家国证 2000 指数增强 A	10~50
	万家国证 2000 指数增强 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家国证 2000 指数增强 A	万家国证 2000 指数增强 C
基金合同生效日 (2023 年 9 月 26 日) 基金份额总额	623,505,338.37	493,277,104.77
本报告期期初基金份额总额	221,481,369.03	167,540,940.76
本报告期基金总申购份额	9,662,682.45	31,297,534.99
减：本报告期基金总赎回份额	132,897,865.16	117,891,126.10
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	98,246,186.32	80,947,349.65

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	1,859,739,672.26	63.24	364,419.35	63.39	-
中国中金财富	2	874,137,592.49	29.72	171,293.93	29.79	-
中信证券	3	206,880,307.96	7.03	39,215.36	6.82	-

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、本基金使用券商结算模式，本报告期内管理人选择国信证券、中国中金财富证券和中信证券作为证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。

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新增江苏银行为销售机构并开通转换、基金定投业务的公告	指定媒介	2025 年 1 月 8 日
2	万家国证 2000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	指定媒介	2025 年 1 月 21 日
3	万家基金管理有限公司旗下基金季度报告提示性公告	指定媒介	2025 年 1 月 21 日
4	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增顺德农商银行为销售机构并开通转换、基金定投业务的公告	指定媒介	2025 年 3 月 12 日
5	万家基金管理有限公司旗下基金年度报告提示性公告	指定媒介	2025 年 3 月 29 日
6	万家国证 2000 指数增强型证券投资基金 2024 年年度报告	指定媒介	2025 年 3 月 29 日
7	万家基金管理有限公司关于增加华西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 4 月 7 日
8	万家基金管理有限公司旗下基金季度	指定媒介	2025 年 4 月 21 日

	报告提示性公告		
9	万家国证 2000 指数增强型证券投资基金 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广发银行为旗下部分基金销售机构并开通定投业务及参加其费率优惠活动的公告	指定媒介	2025 年 5 月 6 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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