

万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资
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：江苏银行股份有限公司

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。

基金托管人江苏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 2 月 25 日（基金合同生效日）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	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
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等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53

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	53
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	53
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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	54
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末上市基金前十名持有人	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
8.4 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	56
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	万家沪深 300ETF
场内简称	沪深 300 指数 ETF
基金主代码	159393
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 2 月 25 日
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	江苏银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	45,646,342.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易 所	深圳证券交易所
上市日期	2025 年 3 月 10 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	1、股票投资策略；2、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、股指期货交易策略；7、国债期货交易策略；8、股票期权投资策略；9、参与融资与转融通证券出借业务策略；10、其他。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即沪深 300 指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪沪深 300 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

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	江苏银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	兰剑	田作全
	联系电话	021-38909626	025-58588321
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	tianzuoquan@jsbchina.cn
客户服务电话		4008880800	95319
传真		021-38909627	025-58588155
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）	南京市中华路 26 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	南京市中华路 26 号
邮政编码		200122	210001
法定代表人		方一天	葛仁余

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.wjasset.com
基金中期报告备置地点	基金管理人办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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 2 月 25 日(基金合同生效日) – 2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	882,389.37
本期利润	6,266,498.94
加权平均基金份额本期利润	0.0310
本期加权平均净值利润率	1.76%
本期基金份额净值增长率	1.63%
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	1,173,225.86
期末可供分配基金份额利润	0.0257
期末基金资产净值	181,729,137.69
期末基金份额净值	3.9812
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	1.63%

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）。

4、本基金合同生效于 2025 年 2 月 25 日。

3.2 基金净值表现

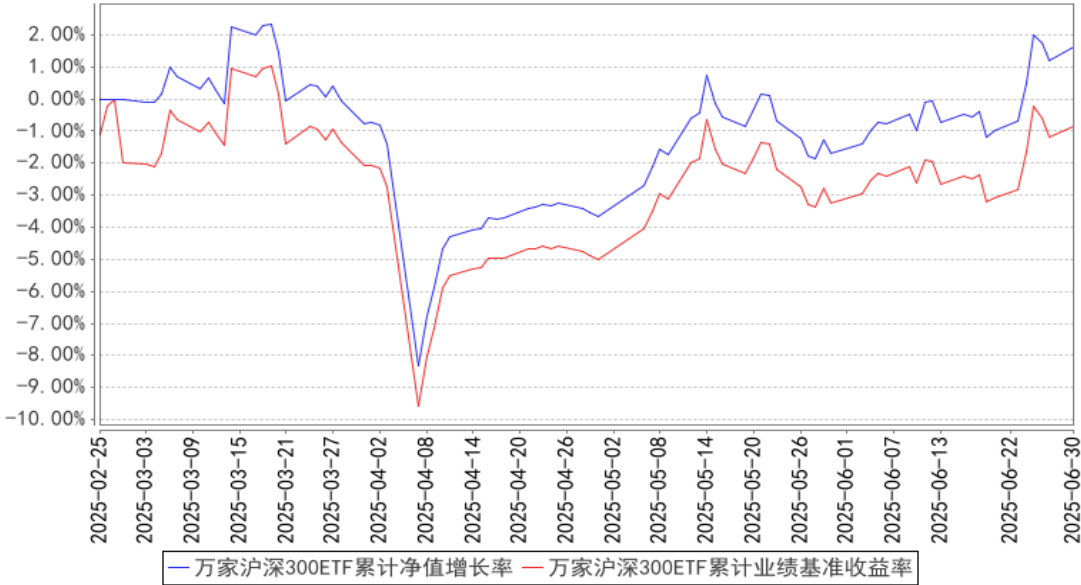
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

	率①	准差②		④		
过去一个月	3.41%	0.58%	2.50%	0.58%	0.91%	0.00%
过去三个月	2.41%	1.09%	1.25%	1.10%	1.16%	-0.01%
自基金合同生效起至今	1.63%	0.99%	-0.85%	1.03%	2.48%	-0.04%

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300ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日期为 2025 年 2 月 25 日，基金合同生效未满一年。

2、根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。截至报告期末本基金尚处于建仓期。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44 号文批准设立。公司的股东为中泰证券股份有限公司、山东省新动能基金管理有限公司，住所：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 楼（名义楼层 9 层）。截至 2025 年 6 月 30 日，公司共管理 173 只开放式基金，其中包括 42 只股票型基金、73 只混合型基金、41 只债券型基金、5 只货币市场基金、4 只 QDII 基金、8 只基金中基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

		任职日期	离任日期		
杨坤	万家中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金、万家中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家中证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金、万家中证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家中证港股通央企红利交易型开放式指数证券投资基金、万家中证港股通央企红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、万家中证红利交易型开放式	2025 年 2 月 25 日	-	10 年	国籍：中国；学历：法国南特国立高等矿业学校自动化与工业信息技术专业硕士，2015 年 6 月入职万家基金管理有限公司，现任量化投资部基金经理，历任量化投资部研究员。曾任 Fractabole 量化 IT 工程师等职。

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

	金、万家 国证 2000 交易型开 放式指数 证券投资 基金、万 家 国 证 2000 交 易型开放 式指数证 券投资基 金发起式 联接基金 、 万家恒生 互联网科 技业交易 型开放式 指数证券 投资基金 (QDII)、 万家恒生 互联网科 技业交易 型开放式 指数证券 投资基金 发起式联 接 基 金 (QDII)、 万家沪深 300 交 易型开放 式指数证 券投 资 基 金、万家 纳斯达克 100 指数 型发起式 证券投资 基 金 (QDII) 的 基 金 经 理。				
--	---	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

4.2 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

本基金作为被动投资的指数基金，其投资目标是通过跟踪、复制指数，为投资者获取市场长期的平均收益。报告期内我们严格按照基金合同规定，原则上采取完全复制的方法进行投资管理，

努力拟合标的指数,减小跟踪误差,将基金跟踪误差控制在较低范围之内。同时,本基金采用有效的量化跟踪技术,降低管理成本。导致跟踪误差的主要原因是基金申购现金替代、禁止投资成分股替代、标的指数成分股调整、成分股分红和基金费用等因素。

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 300ETF 的基金份额净值为 3.9812 元,本报告期基金份额净值增长率为 1.63%,同期业绩比较基准收益率为-0.85%。基金报告期内日跟踪偏离度为 0.0794%,年化跟踪误差为 4.3415%,报告期内该基金处于建仓期。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾上半年,A 股市场在复杂多变的宏观环境中展现出较强的韧性。尽管受到地缘政治冲突和特朗普关税政策反复等外部不确定性的冲击,但在科技创新驱动和政策托底的双重支撑下,A 股配置价值持续提升。分阶段看,春节后,以 DeepSeek 和机器人为代表的新兴产业主题率先发力,带动小盘风格显著走强;3 月两会政策定调符合预期,市场延续震荡上行趋势;4 月受特朗普对等关税政策超预期影响出现阶段性调整,但随着贸易摩擦边际缓和及地缘风险溢价逐步消化,主要指数重拾升势。从风格层面来看,小盘风格占优,大盘与红利走势相对震荡。具体而言,国证 2000 指数上半年累计上涨 10.71%,沪深 300 指数微涨 0.03%,而中证红利指数则下跌 3.07%,凸显中小盘股在反弹阶段的相对优势。行业表现上,有色金属、银行、国防军工、通信和传媒板块领涨,而煤炭、食品饮料、地产、石油石化、建筑装饰等行业则跌幅居前。与此同时,新兴产业主题行情显著活跃,稳定币、数字货币、创新药等概念板块表现强劲。经济基本面方面,二季度实际 GDP 同比增长 5.2%,基本符合市场预期,主要受益于新质生产力领域的高增长。

展望未来,我们认为国内经济内生动能的持续修复仍是 A 股走势的关键变量。近期中央财经委员会提出加快推进全国统一大市场建设,供给侧改革预期增强,通胀预期偏弱有望得到边际改善。同时,在地产驱动经济增长逐步让位于新质生产力引领的经济转型期,完善社会民生保障体系的重要性愈发凸显。近期密集出台的消费补贴、生育支持等政策组合拳,有助于通过稳定居民收入预期来提振消费信心,为经济转型提供坚实的需求侧支撑。海外方面,美联储降息预期为国内政策提供更多空间,弱美元中长期亦有助于推升中国在内的新兴市场估值。叠加美国自身财政宽松导致债务问题突出,美元和美债的安全资产属性边际下降,全球货币体系面临重构,A 股市场由此迎来机遇与挑战并存的新格局。综上,我们认为下半年 A 股有望呈现震荡上行的局面,上行的空间取决于政策发力能否持续支持复苏态势延续。

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——江苏银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定以及《托管协议》的约定，尽职尽责履行了托管人应尽的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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，本基金托管人——江苏银行股份有限公司未发现万家基金管理有限公司在基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上存在损害基金份额持有人利益的行为，或违反《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、在各重要方面的运作违反基金合同规定的情况。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由基金管理人所编制和披露的定期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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 交易型开放式指数证券投资基金

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
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	493,932.62
结算备付金		7,437,208.94
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	179,995,325.20
其中：股票投资		179,995,325.20
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		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	81,877.50
资产总计		188,008,344.26
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 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		6,168,430.44
应付赎回款		-

应付管理人报酬		31,429.97
应付托管费		10,476.64
应付销售服务费		-
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	68,869.52
负债合计		6,279,206.57
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	178,805,011.67
其他综合收益	6.4.7.8	-
未分配利润	6.4.7.9	2,924,126.02
净资产合计		181,729,137.69
负债和净资产总计		188,008,344.26

注：1、报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.9812 元，基金份额总额 45,646,342.00 份。

2、本基金基金合同生效日为 2025 年 2 月 25 日，无上年度末对比数据。

6.2 利润表

会计主体：万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 2 月 25 日（基金合同 生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		6,624,525.79
1. 利息收入		28,425.28
其中：存款利息收入	6.4.7.10	28,425.28
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）		1,535,314.56
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-1,320,919.25
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.12	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	2,856,233.81
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	5, 384, 109. 57
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	-323, 323. 62
减：二、营业总支出		358, 026. 85
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	178, 872. 22
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	59, 624. 04
3. 销售服务费		-
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	119, 530. 59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6, 266, 498. 94
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6, 266, 498. 94
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		6, 266, 498. 94

注：1、本财务报表的实际编制期间为 2025 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日。

2、本基金合同生效日为 2025 年 2 月 25 日，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2025 年 2 月 25 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	587,512,917.00	-	-	587,512,917.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-408,707,905.33	-	2,924,126.02	-405,783,779.31
(一)、综合收益总额	-	-	6,266,498.94	6,266,498.94
(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)	-408,707,905.33	-	-3,342,372.92	-412,050,278.25
其中：1. 基金申购款	316,598,636.20	-	-10,279,527.93	306,319,108.27
2. 基金赎回款	-725,306,541.53	-	6,937,155.01	-718,369,386.52
(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	178,805,011.67	-	2,924,126.02	181,729,137.69

注：1、本财务报表的实际编制期间为 2025 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日。

2、本基金合同生效日为 2025 年 2 月 25 日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

方一天

基金管理人负责人

陈广益

主管会计工作负责人

尹超

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 交易型开放式指数证券投资基金（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[2024]1884 号文《关于准予万家沪深 300 交易型开放式指数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 2025 年 2 月 10 日至 2025 年 2 月 20 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[2025]第 ZA30201 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 2025 年 2 月 25 日生效，本基金为交易型开放式，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 587,467,000.00 元（现金部分），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 45,917.00 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 587,512,917.00 元，折合 587,512,917.00 份基金份额。本基金目前暂不开通网下股票认购业务。本基金的基金管理人为万家基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为江苏银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券等）、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货、股票期权、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可参与融资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标的指数收益率，即沪深 300 指数收益率。

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 2 月 25 日（基金合同生效日）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 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2025 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

1、金融资产分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的以摊余成本计量的金融资产，包括货币资金、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

2、金融负债分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和以摊余成本计量的金融负债。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期

损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在债券投资的账面价值中。对于其他金融资产和以摊余成本计量的金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于其他金融资产和以摊余成本计量的金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，按照未来 12 个月内（若预期存续期少于 12 个月，则为预期存续期内）的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者（3）该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认

为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率或者合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

其他金融资产在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金的收益分配方式为现金分红；

3、基金管理人定期对基金相对标的指数的超额收益率进行评估，当基金收益评价日核定的基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率时，可进行收益分配。在收益评价日，基金管理人基金份额净值增长率和标的指数同期增长率进行计算，计算方法详见《招募说明书》；

4、本基金收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；

5、每一基金份额享有同等分配权；

6、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。证券交易所或基金登记机构对收益分配另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为

人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中基协字[2022]566 号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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	493,932.62
等于：本金	493,832.92
加：应计利息	99.70
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	493,932.62

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		174,611,215.63	-	179,995,325.20	5,384,109.57
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		174,611,215.63	-	179,995,325.20	5,384,109.57

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

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日
应收利息		-
其他应收款		-
待摊费用		81,877.50
合计		81,877.50

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		-
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	63,908.09
其他	4,961.43
合计	68,869.52

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	587,512,917.00	587,512,917.00
本期申购	136,800,000.00	136,800,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-295,200,000.00	-295,200,000.00
2025 年 03 月 28 日 基金拆分/份额折算前	429,112,917.00	429,112,917.00
基金拆分/份额折算调整	-319,566,575.00	-
本期申购	45,900,000.00	179,798,636.20
本期赎回（以“-”号填列）	-109,800,000.00	-430,106,541.53
本期末	45,646,342.00	178,805,011.67

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	882,389.37	5,384,109.57	6,266,498.94
本期基金份额交易产生的变动数	290,836.49	-3,633,209.41	-3,342,372.92
其中：基金申购款	-1,708,369.36	-8,571,158.57	-10,279,527.93
基金赎回款	1,999,205.85	4,937,949.16	6,937,155.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,173,225.86	1,750,900.16	2,924,126.02

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	12,492.53
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	15,932.75
其他	-
合计	28,425.28

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2月25日（基金合同生效日）至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,425,824.06
股票投资收益——赎回差价收入	-3,746,743.31
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	-1,320,919.25

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2月25日（基金合同生效日）至2025年6月30日
卖出股票成交总额	490,067,332.26
减：卖出股票成本总额	487,059,746.59
减：交易费用	581,761.61
买卖股票差价收入	2,425,824.06

6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年2月25日（基金合同生效日）至2025年6月30日
赎回基金份额对价总额	718,369,386.52
减：现金支付赎回款总额	466,458,769.52
减：赎回股票成本总额	255,657,360.31
减：交易费用	-
赎回差价收入	-3,746,743.31

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 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,856,233.81
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	2,856,233.81

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 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	5,384,109.57
股票投资	5,384,109.57
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	5,384,109.57

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
募集期利息	1,724.19
替代损益	-328,068.25
其他	3,020.44
合计	-323,323.62

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 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	13,006.98
信息披露费	44,709.84
证券出借违约金	-
中登登记结算服务费	55,622.50
IOPV 计算服务费	6,191.27
合计	119,530.59

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
江苏银行股份有限公司（“江苏银行”）	基金托管人
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	
	2025 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
中泰证券	1,304,031,219.90	100.00

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

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 2025年2月25日（基金合同生效日）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	253,153.89	100.00	—	—

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年2月25日（基金合同生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	178,872.22
其中：应支付销售机构的客户维护费	44,479.78
应支付基金管理人的净管理费	134,392.44

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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。经基金管理人和基金托管人核对一致后由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。基金管理人可选择在 3 个工作日内向基金托管人出具划款指令，也可授权基金托管人进行费用自动支付处理，如选择自动支付，基金管理人应确保支付当日账户余额充足，如因资金余额不足或其他原因造成自动支付无法进行，

基金管理人应另行出具划款指令。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。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	59,624.04

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.05\%\div \text{当年天数}$$

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。经基金管理人和基金托管人核对一致后由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。基金管理人可选择在 3 个工作日内向基金托管人出具划款指令，也可授权基金托管人进行费用自动支付处理，如选择自动支付，基金管理人应确保支付当日账户余额充足，如因资金余额不足或其他原因造成自动支付无法进行，基金管理人应另行出具划款指令。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。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期末未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末无除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

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 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
江苏银行	493,932.62	12,492.53

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

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方所承销的证券。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

为最大限度地降低本基金投资的跟踪误差，保护基金份额持有人的合法权益，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，经本基金基金托管人同意，且履行了基金合同规定的相关程序，在报告期内投资于基金管理人实际控制人山东能源集团有限公司控股的兖矿能源集团股份有限公司发行的 A 股兖矿能源、基金托管人江苏银行股份有限公司发行的 A 股江苏银行、控股股东中泰证券股份有限公司发行的 A 股中泰证券及与托管人江苏银行股份有限公司有重大利害关系的公司华泰证券股份有限公司发行的 A 股华泰证券。于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有兖矿能源 15,400.00 股，占本基金资产净值比例为 0.1031%；持有江苏银行 126,800.00 股，占本基金资产净值比例为 0.8331%；持有中泰证券 23,900.00 股，占本基金资产净值比例为 0.0846%；持有华泰证券 44,200.00 股，占本基金资产净值比例为 0.4332%。

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
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	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
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	-
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	69	6,182.40	9,624.12	-
301595	太力科技	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
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	-
301678	新恒汇	2025 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
603014	威高	2025 年 5 月	6 个月	新股流通	26.50	32.68	153	4,054.50	5,000.04	-

	血 净	12 日		受限						
603049	中 策 橡 胶	2025 年 5 月 27 日	6 个月	新股 流通 受限	46.50	42.85	136	6,324.00	5,827.60	-
603120	肯 特 催 化	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	-
603202	天 有 为	2025 年 4 月 16 日	6 个月	新股 流通 受限	93.50	90.66	65	6,077.50	5,892.90	-
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	-
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	-
688775	影 石 创 新	2025 年 6 月 4 日	6 个月	新股 流通 受限	47.27	124.16	225	10,635.75	27,936.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 6 月 30 日止，本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。

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	493,932.62	-	-	-	-	-	493,932.62
结算备付金	7,437,208.94	-	-	-	-	-	7,437,208.94
交易性金融资产	-	-	-	-	-	179,995,325.20	179,995,325.20
其他资产	-	-	-	-	-	81,877.50	81,877.50
资产总计	7,931,141.56	-	-	-	-	180,077,202.70	188,008,344.26
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	31,429.97	31,429.97

应付托管费	-	-	-	-	-	10,476.64	10,476.64
应付清算款	-	-	-	-	-	6,168,430.44	6,168,430.44
其他负债	-	-	-	-	-	68,869.52	68,869.52
负债总计	-	-	-	-	-	6,279,206.57	6,279,206.57
利率敏感度缺口	7,931,141.56	-	-	-	-	-173,797,996.13	181,729,137.69

注：1、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。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

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，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。

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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	179,995,325.20	99.05
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	179,995,325.20	99.05

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

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）
	股票基准指数上升 100 个基点	1,801,610.48
	股票基准指数下降 100 个基点	-1,801,610.48

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

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
第一层次	179,873,420.32
第二层次	15,385.54
第三层次	106,519.34
合计	179,995,325.20

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

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	179,995,325.20	95.74
	其中：股票	179,995,325.20	95.74
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	7,931,141.56	4.22
8	其他各项资产	81,877.50	0.04
9	合计	188,008,344.26	100.00

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项中不含可退替代款估值增值。

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	1,775,408.00	0.98
B	采矿业	8,998,778.00	4.95
C	制造业	90,116,297.97	49.59

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,510,040.00	3.58
E	建筑业	3,382,051.00	1.86
F	批发和零售业	437,260.00	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	6,335,467.35	3.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,509,693.00	4.68
J	金融业	48,408,444.00	26.64
K	房地产业	1,329,087.00	0.73
L	租赁和商务服务业	1,639,554.00	0.90
M	科学研究和技术服务业	1,928,396.00	1.06
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	502,944.00	0.28
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	179,873,420.32	98.98

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	121,904.88	0.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	121,904.88	0.07

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	600519	贵州茅台	5,401	7,612,817.52	4.19
2	300750	宁德时代	22,800	5,750,616.00	3.16
3	601318	中国平安	92,900	5,154,092.00	2.84
4	600036	招商银行	106,800	4,907,460.00	2.70
5	601166	兴业银行	143,400	3,346,956.00	1.84
6	600900	长江电力	105,600	3,182,784.00	1.75
7	000333	美的集团	42,500	3,068,500.00	1.69
8	601899	紫金矿业	142,100	2,770,950.00	1.52
9	002594	比亚迪	7,800	2,588,898.00	1.42
10	300059	东方财富	109,100	2,523,483.00	1.39
11	600030	中信证券	84,300	2,328,366.00	1.28
12	601398	工商银行	302,500	2,295,975.00	1.26
13	600276	恒瑞医药	38,540	2,000,226.00	1.10
14	000858	五粮液	16,800	1,997,520.00	1.10
15	601211	国泰海通	97,500	1,868,100.00	1.03
16	601328	交通银行	230,300	1,842,400.00	1.01
17	000651	格力电器	38,700	1,738,404.00	0.96
18	601288	农业银行	275,600	1,620,528.00	0.89
19	600887	伊利股份	54,600	1,522,248.00	0.84
20	002475	立讯精密	43,800	1,519,422.00	0.84
21	688981	中芯国际	17,200	1,516,524.00	0.83
22	600919	江苏银行	126,800	1,513,992.00	0.83
23	603259	药明康德	21,560	1,499,498.00	0.83

24	601816	京沪高铁	253,400	1,457,050.00	0.80
25	600000	浦发银行	101,400	1,407,432.00	0.77
26	000725	京东方 A	317,091	1,265,193.09	0.70
27	002371	北方华创	2,800	1,238,188.00	0.68
28	300760	迈瑞医疗	5,200	1,168,700.00	0.64
29	601088	中国神华	28,500	1,155,390.00	0.64
30	688041	海光信息	8,000	1,130,320.00	0.62
31	300308	中际旭创	7,700	1,123,122.00	0.62
32	601601	中国太保	29,600	1,110,296.00	0.61
33	300502	新易盛	8,560	1,087,291.20	0.60
34	688256	寒武纪	1,800	1,082,700.00	0.60
35	300124	汇川技术	16,300	1,052,491.00	0.58
36	601728	中国电信	134,000	1,038,500.00	0.57
37	601668	中国建筑	178,400	1,029,368.00	0.57
38	600016	民生银行	214,300	1,017,925.00	0.56
39	002352	顺丰控股	20,800	1,014,208.00	0.56
40	000001	平安银行	83,800	1,011,466.00	0.56
41	002714	牧原股份	23,600	991,436.00	0.55
42	601127	赛力斯	7,100	953,672.00	0.52
43	002230	科大讯飞	19,900	952,812.00	0.52
44	603501	豪威集团	7,300	931,845.00	0.51
45	600031	三一重工	51,200	919,040.00	0.51
46	601229	上海银行	85,900	911,399.00	0.50
47	000063	中兴通讯	27,800	903,222.00	0.50
48	603019	中科曙光	12,628	889,011.20	0.49
49	002415	海康威视	31,900	884,587.00	0.49
50	600309	万华化学	16,300	884,438.00	0.49
51	600941	中国移动	7,800	877,890.00	0.48
52	601169	北京银行	127,800	872,874.00	0.48
53	300274	阳光电源	12,500	847,125.00	0.47
54	601857	中国石油	97,800	836,190.00	0.46
55	601919	中远海控	54,400	818,176.00	0.45
56	688008	澜起科技	9,900	811,800.00	0.45
57	600690	海尔智家	32,400	802,872.00	0.44
58	601688	华泰证券	44,200	787,202.00	0.43
59	601012	隆基绿能	52,400	787,048.00	0.43
60	600660	福耀玻璃	13,800	786,738.00	0.43
61	300498	温氏股份	45,900	783,972.00	0.43
62	002142	宁波银行	28,500	779,760.00	0.43
63	600406	国电南瑞	34,700	777,627.00	0.43
64	600809	山西汾酒	4,200	740,838.00	0.41
65	601766	中国中车	104,900	738,496.00	0.41
66	601138	工业富联	34,300	733,334.00	0.40

67	603986	兆易创新	5,700	721,221.00	0.40
68	600050	中国联通	134,900	720,366.00	0.40
69	000338	潍柴动力	46,700	718,246.00	0.40
70	000568	泸州老窖	6,300	714,420.00	0.39
71	600028	中国石化	125,900	710,076.00	0.39
72	000100	TCL 科技	162,100	701,893.00	0.39
73	601988	中国银行	123,400	693,508.00	0.38
74	688012	中微公司	3,800	692,740.00	0.38
75	601006	大秦铁路	104,300	688,380.00	0.38
76	600926	杭州银行	39,700	667,754.00	0.37
77	601818	光大银行	160,100	664,415.00	0.37
78	601985	中国核电	70,900	660,788.00	0.36
79	601225	陕西煤业	33,500	644,540.00	0.35
80	600104	上汽集团	40,000	642,000.00	0.35
81	002027	分众传媒	87,300	637,290.00	0.35
82	600150	中国船舶	19,300	628,022.00	0.35
83	601628	中国人寿	14,400	593,136.00	0.33
84	601009	南京银行	50,800	590,296.00	0.32
85	605499	东鹏饮料	1,800	565,290.00	0.31
86	600999	招商证券	32,100	564,639.00	0.31
87	603288	海天味业	14,400	560,304.00	0.31
88	688111	金山办公	2,000	560,100.00	0.31
89	600760	中航沈飞	9,500	556,890.00	0.31
90	000425	徐工机械	71,000	551,670.00	0.30
91	688271	联影医疗	4,300	549,282.00	0.30
92	000625	长安汽车	42,900	547,404.00	0.30
93	601939	建设银行	57,900	546,576.00	0.30
94	000792	盐湖股份	32,000	546,560.00	0.30
95	600111	北方稀土	21,900	545,310.00	0.30
96	600938	中国海油	20,600	537,866.00	0.30
97	600905	三峡能源	123,600	526,536.00	0.29
98	601658	邮储银行	95,100	520,197.00	0.29
99	600089	特变电工	43,600	520,148.00	0.29
100	600436	片仔癀	2,600	520,026.00	0.29
101	300033	同花顺	1,900	518,719.00	0.29
102	601888	中国中免	8,400	512,148.00	0.28
103	603993	洛阳钼业	60,600	510,252.00	0.28
104	002050	三花智控	19,300	509,134.00	0.28
105	600048	保利发展	62,110	503,091.00	0.28
106	300015	爱尔眼科	40,300	502,944.00	0.28
107	600019	宝钢股份	75,764	499,284.76	0.27
108	600547	山东黄金	15,600	498,108.00	0.27
109	601390	中国中铁	88,600	497,046.00	0.27

110	002463	沪电股份	11,600	493,928.00	0.27
111	002241	歌尔股份	21,100	492,052.00	0.27
112	600415	小商品城	23,700	490,116.00	0.27
113	300014	亿纬锂能	10,600	485,586.00	0.27
114	601825	沪农商行	49,900	484,030.00	0.27
115	601600	中国铝业	68,400	481,536.00	0.26
116	601989	中国重工	98,400	456,576.00	0.25
117	000977	浪潮信息	8,900	452,832.00	0.25
118	600585	海螺水泥	20,700	444,429.00	0.24
119	002179	中航光电	11,000	443,960.00	0.24
120	600893	航发动力	11,500	443,210.00	0.24
121	601916	浙商银行	130,200	441,378.00	0.24
122	601838	成都银行	21,900	440,190.00	0.24
123	600570	恒生电子	13,100	439,374.00	0.24
124	603799	华友钴业	11,800	436,836.00	0.24
125	600958	东方证券	45,100	436,568.00	0.24
126	600015	华夏银行	54,900	434,259.00	0.24
127	000538	云南白药	7,700	429,583.00	0.24
128	000776	广发证券	25,500	428,655.00	0.24
129	002311	海大集团	7,200	421,848.00	0.23
130	601336	新华保险	7,200	421,200.00	0.23
131	600584	长电科技	12,400	417,756.00	0.23
132	000938	紫光股份	17,300	415,027.00	0.23
133	002028	思源电气	5,400	393,714.00	0.22
134	600438	通威股份	23,300	390,275.00	0.21
135	000166	申万宏源	77,700	390,054.00	0.21
136	002049	紫光国微	5,900	388,574.00	0.21
137	601998	中信银行	45,700	388,450.00	0.21
138	300408	三环集团	11,600	387,440.00	0.21
139	300433	蓝思科技	17,200	383,560.00	0.21
140	601077	渝农商行	53,400	381,276.00	0.21
141	000002	万科A	58,800	377,496.00	0.21
142	600795	国电电力	76,800	371,712.00	0.20
143	601377	兴业证券	59,600	368,924.00	0.20
144	600489	中金黄金	25,100	367,213.00	0.20
145	601669	中国电建	74,500	362,815.00	0.20
146	601995	中金公司	10,100	357,136.00	0.20
147	601689	拓普集团	7,500	354,375.00	0.20
148	600010	包钢股份	195,300	349,587.00	0.19
149	002422	科伦药业	9,600	344,832.00	0.19
150	600009	上海机场	10,800	343,116.00	0.19
151	002304	洋河股份	5,200	335,660.00	0.18
152	600160	巨化股份	11,700	335,556.00	0.18

153	601100	恒立液压	4,600	331,200.00	0.18
154	002460	赣锋锂业	9,800	330,946.00	0.18
155	000768	中航西飞	12,000	328,080.00	0.18
156	601881	中国银河	18,700	320,705.00	0.18
157	300394	天孚通信	4,000	319,360.00	0.18
158	601186	中国铁建	39,800	318,798.00	0.18
159	600183	生益科技	10,500	316,575.00	0.17
160	002252	上海莱士	45,700	313,959.00	0.17
161	688036	传音控股	3,900	310,830.00	0.17
162	000157	中联重科	42,900	310,167.00	0.17
163	601360	三六零	30,200	308,040.00	0.17
164	000963	华东医药	7,600	306,736.00	0.17
165	600989	宝丰能源	19,000	306,660.00	0.17
166	002074	国轩高科	9,400	305,124.00	0.17
167	600886	国投电力	20,700	305,118.00	0.17
168	601788	光大证券	16,800	302,064.00	0.17
169	601058	赛轮轮胎	22,700	297,824.00	0.16
170	600115	中国东航	73,800	297,414.00	0.16
171	300442	润泽科技	5,900	292,227.00	0.16
172	000408	藏格矿业	6,800	290,156.00	0.16
173	002736	国信证券	24,900	286,848.00	0.16
174	000807	云铝股份	17,950	286,841.00	0.16
175	600066	宇通客车	11,500	285,890.00	0.16
176	002466	天齐锂业	8,900	285,156.00	0.16
177	002001	新 和 成	13,300	282,891.00	0.16
178	601901	方正证券	35,600	281,596.00	0.15
179	000661	长春高新	2,800	277,704.00	0.15
180	600426	华鲁恒升	12,800	277,376.00	0.15
181	600196	复星医药	11,000	275,990.00	0.15
182	688169	石头科技	1,760	275,528.00	0.15
183	600029	南方航空	46,400	273,760.00	0.15
184	001979	招商蛇口	31,200	273,624.00	0.15
185	601800	中国交建	30,700	272,923.00	0.15
186	000975	山金国际	14,400	272,736.00	0.15
187	002236	大华股份	17,100	271,548.00	0.15
188	300661	圣邦股份	3,730	271,432.10	0.15
189	600011	华能国际	37,900	270,606.00	0.15
190	600674	川投能源	16,800	269,472.00	0.15
191	601066	中信建投	11,200	269,360.00	0.15
192	301236	软通动力	4,900	267,736.00	0.15
193	688126	沪硅产业	14,200	265,824.00	0.15
194	600346	恒力石化	18,200	259,532.00	0.14
195	601878	浙商证券	23,700	258,567.00	0.14

196	601111	中国国航	32,400	255,636.00	0.14
197	300418	昆仑万维	7,600	255,588.00	0.14
198	603369	今世缘	6,500	253,045.00	0.14
199	600372	中航机载	20,900	252,054.00	0.14
200	002648	卫星化学	14,500	251,285.00	0.14
201	600460	士兰微	10,100	250,682.00	0.14
202	601868	中国能建	112,100	249,983.00	0.14
203	002916	深南电路	2,310	249,041.10	0.14
204	003816	中国广核	67,700	246,428.00	0.14
205	002920	德赛西威	2,406	245,724.78	0.14
206	601117	中国化学	31,800	243,906.00	0.13
207	601319	中国人保	27,600	240,396.00	0.13
208	600741	华域汽车	13,600	240,040.00	0.13
209	300347	泰格医药	4,500	239,940.00	0.13
210	600176	中国巨石	20,700	235,980.00	0.13
211	301269	华大九天	1,900	235,372.00	0.13
212	600588	用友网络	17,600	235,312.00	0.13
213	002601	龙佰集团	14,500	235,045.00	0.13
214	601021	春秋航空	4,199	233,674.35	0.13
215	600219	南山铝业	60,300	230,949.00	0.13
216	000786	北新建材	8,700	230,376.00	0.13
217	601633	长城汽车	10,700	229,836.00	0.13
218	300782	卓胜微	3,200	228,384.00	0.13
219	300896	爱美客	1,300	227,253.00	0.13
220	600482	中国动力	9,700	223,779.00	0.12
221	600039	四川路桥	22,500	222,750.00	0.12
222	000630	铜陵有色	66,100	220,774.00	0.12
223	302132	中航成飞	2,500	219,850.00	0.12
224	000895	双汇发展	9,000	219,690.00	0.12
225	688396	华润微	4,600	216,936.00	0.12
226	002493	荣盛石化	26,187	216,828.36	0.12
227	600600	青岛啤酒	3,100	215,326.00	0.12
228	002129	TCL 中环	27,800	213,504.00	0.12
229	600085	同仁堂	5,900	212,754.00	0.12
230	001965	招商公路	17,600	211,200.00	0.12
231	600362	江西铜业	9,000	210,870.00	0.12
232	601877	正泰电器	9,300	210,831.00	0.12
233	002709	天赐材料	11,600	210,192.00	0.12
234	603296	华勤技术	2,600	209,768.00	0.12
235	002600	领益智造	24,200	207,878.00	0.11
236	688506	百利天恒	692	204,915.04	0.11
237	300122	智飞生物	10,300	201,777.00	0.11
238	603392	万泰生物	3,300	201,300.00	0.11

239	600161	天坛生物	10,300	197,657.00	0.11
240	002180	纳思达	8,603	197,352.82	0.11
241	300832	新产业	3,400	192,848.00	0.11
242	002938	鹏鼎控股	6,000	192,180.00	0.11
243	600233	圆通速递	14,900	192,061.00	0.11
244	000301	东方盛虹	22,900	190,757.00	0.10
245	300759	康龙化成	7,700	188,958.00	0.10
246	600188	兖矿能源	15,400	187,418.00	0.10
247	688047	龙芯中科	1,400	186,746.00	0.10
248	000596	古井贡酒	1,400	186,410.00	0.10
249	601618	中国中冶	61,900	184,462.00	0.10
250	600023	浙能电力	34,800	184,440.00	0.10
251	000876	新希望	19,600	183,848.00	0.10
252	688223	晶科能源	34,700	180,093.00	0.10
253	000999	华润三九	5,750	179,860.00	0.10
254	600875	东方电气	10,500	175,770.00	0.10
255	600515	海南机场	49,400	174,876.00	0.10
256	600845	宝信软件	7,400	174,788.00	0.10
257	601872	招商轮船	27,800	174,028.00	0.10
258	600027	华电国际	31,600	172,852.00	0.10
259	601898	中煤能源	15,700	171,758.00	0.09
260	002459	晶澳科技	17,100	170,658.00	0.09
261	600061	国投资本	22,100	166,192.00	0.09
262	688599	天合光能	11,300	164,189.00	0.09
263	605117	德业股份	3,100	163,246.00	0.09
264	600332	白云山	6,100	160,796.00	0.09
265	000617	中油资本	21,700	158,410.00	0.09
266	000983	山西焦煤	24,600	157,440.00	0.09
267	600918	中泰证券	23,900	153,677.00	0.08
268	300316	晶盛机电	5,600	152,040.00	0.08
269	600803	新奥股份	8,000	151,200.00	0.08
270	300999	金龙鱼	5,100	150,603.00	0.08
271	601799	星宇股份	1,200	150,000.00	0.08
272	300628	亿联网络	4,300	149,468.00	0.08
273	601698	中国卫通	7,300	149,431.00	0.08
274	600025	华能水电	15,400	147,070.00	0.08
275	603260	合盛硅业	3,100	146,940.00	0.08
276	601238	广汽集团	19,200	143,808.00	0.08
277	601059	信达证券	8,400	143,640.00	0.08
278	300413	芒果超媒	6,500	141,830.00	0.08
279	600018	上港集团	24,000	137,040.00	0.08
280	601607	上海医药	7,300	130,524.00	0.07
281	600026	中远海能	12,000	123,960.00	0.07

282	688303	大全能源	5,600	119,392.00	0.07
283	688472	阿特斯	12,800	117,120.00	0.06
284	603806	福斯特	9,000	116,640.00	0.06
285	688009	中国通号	22,300	114,622.00	0.06
286	603195	公牛集团	2,340	112,905.00	0.06
287	601699	潞安环能	10,300	108,665.00	0.06
288	601236	红塔证券	12,100	102,487.00	0.06
289	000708	中信特钢	8,700	102,312.00	0.06
290	601865	福莱特	6,600	100,386.00	0.06
291	688187	时代电气	2,200	93,830.00	0.05
292	601136	首创证券	4,700	93,436.00	0.05
293	688082	盛美上海	800	91,152.00	0.05
294	603833	欧派家居	1,600	90,320.00	0.05
295	601808	中海油服	5,100	70,176.00	0.04
296	300979	华利集团	1,300	68,341.00	0.04
297	600377	宁沪高速	4,300	65,962.00	0.04
298	000800	一汽解放	8,400	57,624.00	0.03
299	001391	国货航	7,400	49,802.00	0.03
300	001289	龙源电力	1,300	21,034.00	0.01

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	688775	影石创新	225	27,936.00	0.02
2	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.01
3	001388	信通电子	937	15,385.54	0.01
4	301590	优优绿能	69	9,624.12	0.01
5	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
6	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
7	603202	天有为	65	5,892.90	0.00
8	603049	中策橡胶	136	5,827.60	0.00
9	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
10	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
11	603014	威高血净	153	5,000.04	0.00
12	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
13	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
14	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
15	603120	肯特催化	65	2,172.95	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	40,194,958.92	22.12

2	601318	中国平安	23,959,502.00	13.18
3	600036	招商银行	23,209,086.00	12.77
4	300750	宁德时代	21,600,419.58	11.89
5	600900	长江电力	14,814,338.00	8.15
6	601166	兴业银行	14,080,675.00	7.75
7	601899	紫金矿业	11,772,426.00	6.48
8	600030	中信证券	11,683,105.00	6.43
9	002594	比亚迪	11,633,228.00	6.40
10	601398	工商银行	10,520,944.00	5.79
11	000333	美的集团	10,084,654.00	5.55
12	600276	恒瑞医药	9,475,966.20	5.21
13	601211	国泰海通	8,661,146.00	4.77
14	300059	东方财富	8,556,420.00	4.71
15	600887	伊利股份	7,855,405.00	4.32
16	688981	中芯国际	7,850,016.99	4.32
17	601328	交通银行	7,796,281.00	4.29
18	688041	海光信息	7,542,036.49	4.15
19	601816	京沪高铁	7,269,769.00	4.00
20	000858	五 粮 液	7,256,705.00	3.99
21	601288	农业银行	7,238,153.00	3.98
22	002371	北方华创	6,820,532.00	3.75
23	002475	立讯精密	6,676,001.00	3.67
24	603259	药明康德	6,357,131.20	3.50
25	600919	江苏银行	6,076,304.00	3.34
26	601088	中国神华	5,564,315.00	3.06
27	000651	格力电器	5,538,503.00	3.05
28	601728	中国电信	5,510,575.00	3.03
29	600941	中国移动	5,387,067.00	2.96
30	600309	万华化学	5,338,587.00	2.94
31	600000	浦发银行	5,305,865.00	2.92
32	603019	中科曙光	5,196,210.24	2.86
33	601988	中国银行	5,150,876.00	2.83
34	600809	山西汾酒	5,120,319.00	2.82
35	601668	中国建筑	4,961,843.00	2.73
36	600031	三一重工	4,942,851.00	2.72
37	600436	片仔癀	4,914,712.00	2.70
38	000725	京东方 A	4,862,689.58	2.68
39	300124	汇川技术	4,853,438.00	2.67
40	688256	寒武纪	4,763,679.01	2.62
41	603501	豪威集团	4,736,846.00	2.61
42	601601	中国太保	4,734,659.00	2.61
43	600016	民生银行	4,500,756.00	2.48
44	601012	隆基绿能	4,437,740.00	2.44

45	600690	海尔智家	4,310,640.00	2.37
46	600050	中国联通	4,254,570.00	2.34
47	600660	福耀玻璃	4,247,829.94	2.34
48	300760	迈瑞医疗	4,200,016.00	2.31
49	601229	上海银行	4,152,828.00	2.29
50	600406	国电南瑞	4,134,037.00	2.27
51	601127	赛力斯	4,033,015.00	2.22
52	601766	中国中车	3,961,608.00	2.18
53	601688	华泰证券	3,945,721.00	2.17
54	688008	澜起科技	3,868,277.70	2.13
55	601919	中远海控	3,847,264.00	2.12
56	601169	北京银行	3,843,096.00	2.11
57	601857	中国石油	3,832,963.00	2.11
58	000063	中兴通讯	3,707,144.00	2.04
59	600028	中国石化	3,679,440.00	2.02

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	32,694,870.00	17.99
2	601318	中国平安	19,730,801.00	10.86
3	600036	招商银行	19,067,739.28	10.49
4	600900	长江电力	12,248,483.00	6.74
5	601166	兴业银行	11,301,297.00	6.22
6	601899	紫金矿业	10,112,171.00	5.56
7	600030	中信证券	9,305,767.67	5.12
8	601398	工商银行	8,578,880.00	4.72
9	600276	恒瑞医药	8,033,760.56	4.42
10	601211	国泰海通	6,860,291.00	3.78
11	600887	伊利股份	6,413,208.00	3.53
12	601328	交通银行	6,283,556.00	3.46
13	688041	海光信息	6,205,134.06	3.41
14	601816	京沪高铁	5,981,253.00	3.29
15	601288	农业银行	5,968,779.00	3.28
16	688981	中芯国际	5,953,927.79	3.28
17	603259	药明康德	5,240,443.00	2.88
18	600919	江苏银行	5,139,557.16	2.83
19	601088	中国神华	4,706,721.00	2.59
20	600941	中国移动	4,580,675.00	2.52
21	600000	浦发银行	4,509,507.00	2.48
22	601988	中国银行	4,507,159.00	2.48
23	600436	片仔癀	4,408,974.00	2.43
24	601728	中国电信	4,386,987.00	2.41

25	600809	山西汾酒	4,357,139.60	2.40
26	603019	中科曙光	4,232,892.00	2.33
27	600309	万华化学	4,035,989.00	2.22
28	601668	中国建筑	4,018,927.00	2.21
29	601601	中国太保	3,973,792.00	2.19
30	600031	三一重工	3,968,889.00	2.18
31	600016	民生银行	3,651,147.00	2.01

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	814,566,019.53
卖出股票收入（成交）总额	490,067,332.26

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业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福建监管局的处罚，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到深圳市交通运输局的处罚，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	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	81,877.50
8	其他	-
9	合计	81,877.50

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公 允价值	占基金资产净 值比例（%）	流通受限情况说 明
1	688775	影石创新	27,936.00	0.02	新股流通受限
2	301678	新恒汇	17,014.28	0.01	新股流通受限
3	001388	信通电子	15,385.54	0.01	新股未上市
4	301590	优优绿能	9,624.12	0.01	新股流通受限
5	688755	汉邦科技	7,983.99	0.00	新股流通受限

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

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 （%）
2,275	20,064.33	28,621,543.00	62.70	17,024,799.00	37.30

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	上海惠澄资产管理有 限公司－惠澄曲盈二 号私募证券投资基金	6,900,000.00	15.12
2	长江养老保险股份有 限公司－中国太平洋 人寿权益基金型投资 产品（财富管家）委托 专户	3,890,566.00	8.52
3	广发证券股份有限公 司	3,117,723.00	6.83
4	招商证券股份有限公 司	3,116,955.00	6.83
5	华泰证券股份有限公 司	3,116,512.00	6.83
6	邹本礼	1,967,267.00	4.31
7	方正证券股份有限公 司	1,527,683.00	3.35
8	山东和晟元投资有限 公司	1,276,581.00	2.80

9	长江养老保险股份有限公司—中国太平洋人寿权益基金型投资产品（万能险 A2）委托专户	847,800.00	1.86
10	宋平	672,881.00	1.47

注：上述持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2025 年 2 月 25 日）基金份额总额	587,512,917.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	182,700,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	405,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-319,566,575.00
本报告期期末基金份额总额	45,646,342.00

§ 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

自基金合同生效日起由立信会计师事务所（特殊普通合伙）为基金进行审计。

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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 (%)	
中泰证券	7	1,304,031,219.90	100.00	253,153.89	100.00	-

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中泰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	万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同	指定媒介	2025 年 1 月 20 日
2	万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	指定媒介	2025 年 1 月 20 日
3	万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议	指定媒介	2025 年 1 月 20 日
4	万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书	指定媒介	2025 年 1 月 20 日
5	万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要	指定媒介	2025 年 1 月 20 日
6	万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告	指定媒介	2025 年 1 月 20 日
7	关于万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金提前结束募集的公告	指定媒介	2025 年 2 月 21 日
8	万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	指定媒介	2025 年 2 月 26 日
9	关于万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金投资关联方证券的公告	指定媒介	2025 年 3 月 1 日
10	万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	指定媒介	2025 年 3 月 5 日
11	万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	指定媒介	2025 年 3 月 5 日
12	万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	指定媒介	2025 年 3 月 5 日
13	关于万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	指定媒介	2025 年 3 月 10 日
14	万家沪深 300 交易型开放式指数证券	指定媒介	2025 年 3 月 10 日

	投资基金上市交易提示性公告		
15	关于万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	指定媒介	2025 年 3 月 13 日
16	关于万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额折算及相关业务安排的公告	指定媒介	2025 年 3 月 25 日
17	关于万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算结果的公告	指定媒介	2025 年 3 月 29 日
18	万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	指定媒介	2025 年 4 月 21 日
19	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 4 月 21 日
20	关于万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金新增长江证券等机构为申购赎回代办券商的公告	指定媒介	2025 年 5 月 26 日
21	万家基金管理有限公司关于指定证券投资基金主流动性服务商的公告	指定媒介	2025 年 6 月 3 日
22	万家基金管理有限公司关于增加财通证券为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告	指定媒介	2025 年 6 月 5 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20250311-20250313、20250318-20250401	100,004,861.00	-	100,004,861.00	-	-
	2	20250408-20250626	-	25,839,800.00	25,839,800.00	-	-
产品特有风险							
报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。 未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

注：上述申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

§ 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 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》。
- 4、万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 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