

万家中证 500 指数增强型发起式证券投资
基金
2021 年中期报告

2021 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：2021 年 8 月 30 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 2021 年 8 月 27 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 2021 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	54
§8 基金份额持有人信息.....	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
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的情况.....	56
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	57
§9 开放式基金份额变动.....	58
§10 重大事件揭示.....	59
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
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.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
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.....	62

§12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录.....	63
12.2 存放地点.....	63
12.3 查阅方式.....	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	万家中证 500 指数增强发起式	
基金主代码	006729	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 5 月 23 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	22,630,124.87 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	万家中证 500 指数增强发起式 A	万家中证 500 指数增强发起式 C
下属分级基金的交易代码:	006729	006730
报告期末下属分级基金的份额总额	17,383,784.86 份	5,246,340.01 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金，采取量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，在力求有效跟踪标的指数基础上，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%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。
投资策略	本基金为增强型指数产品，在标的指数成份股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。具体策略包括：1、股票投资策略；2、债券投资策略；3、中小企业私募债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、可转换债券投资策略；6、证券公司短期公司债券投资策略；7、衍生产品投资策略：（1）权证投资策略；（2）股指期货投资策略；（3）国债期货投资策略；（4）股票期权投资策略；（5）其他金融衍生产品；8、融资及转融通证券出借业务投资策略；9、其他。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+一年期人民币定期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	万家基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑
	联系电话	021-38909626
	电子邮箱	lanj@wjasset.com
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	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
邮政编码	200122	100140
法定代表人	方一天	陈四清

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	中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）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	中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）

§ 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

基金级别	万家中证 500 指数增强发起式 A	万家中证 500 指数增强发起式 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	3,225,174.60	860,677.44
本期利润	3,430,249.67	1,037,700.21
加权平均基金份额本期利润	0.1898	0.2119
本期加权平均净值利润率	11.90%	13.40%
本期基金份额净值增长率	12.32%	12.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	12,518,864.82	3,684,837.15
期末可供分配基金份额利润	0.7201	0.7024
期末基金资产净值	29,902,649.68	8,931,177.16
期末基金份额净值	1.7201	1.7024
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	80.52%	78.48%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,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

万家中证 500 指数增强发起式 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	2.74%	0.70%	1.13%	0.69%	1.61%	0.01%
过去三个月	11.14%	0.67%	8.43%	0.65%	2.71%	0.02%
过去六个月	12.32%	0.95%	6.64%	0.94%	5.68%	0.01%
过去一年	30.20%	1.22%	15.42%	1.19%	14.78%	0.03%
自基金合同	80.52%	1.28%	35.20%	1.29%	45.32%	-0.01%

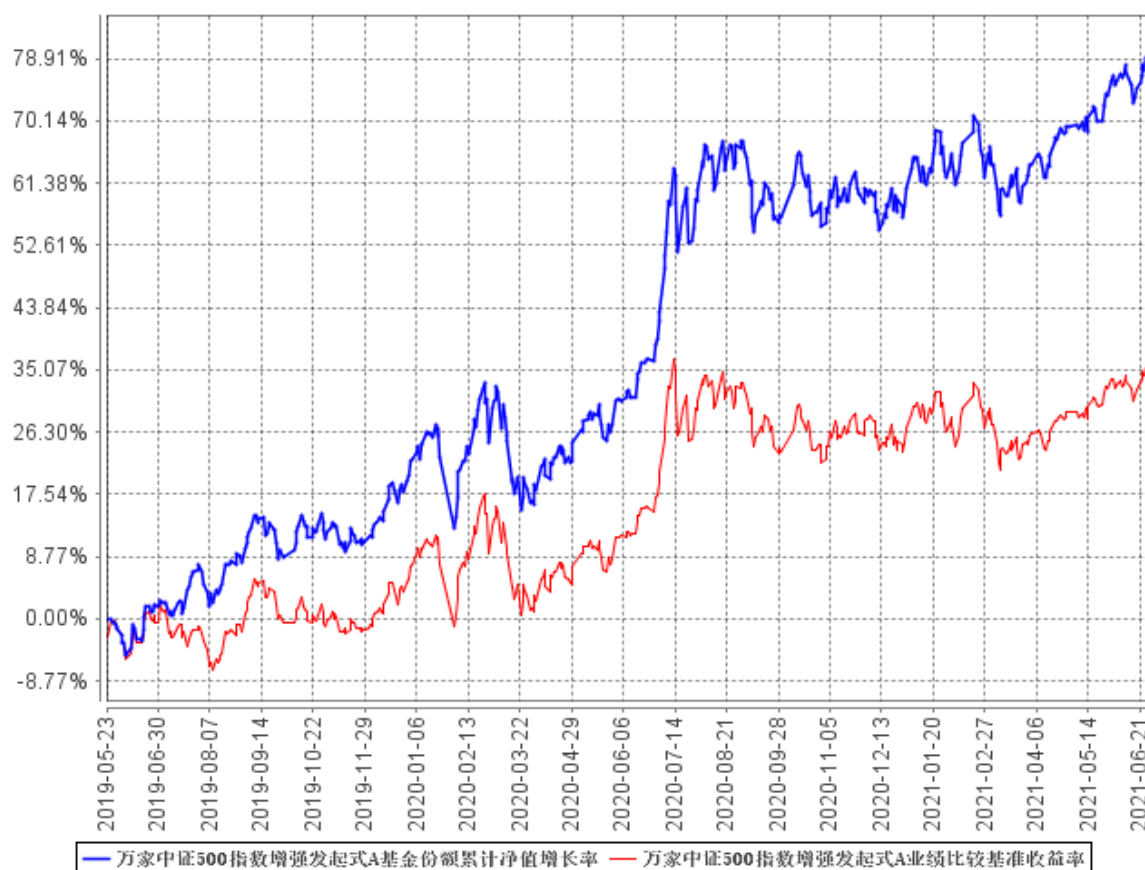
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

万家中证 500 指数增强发起式 C

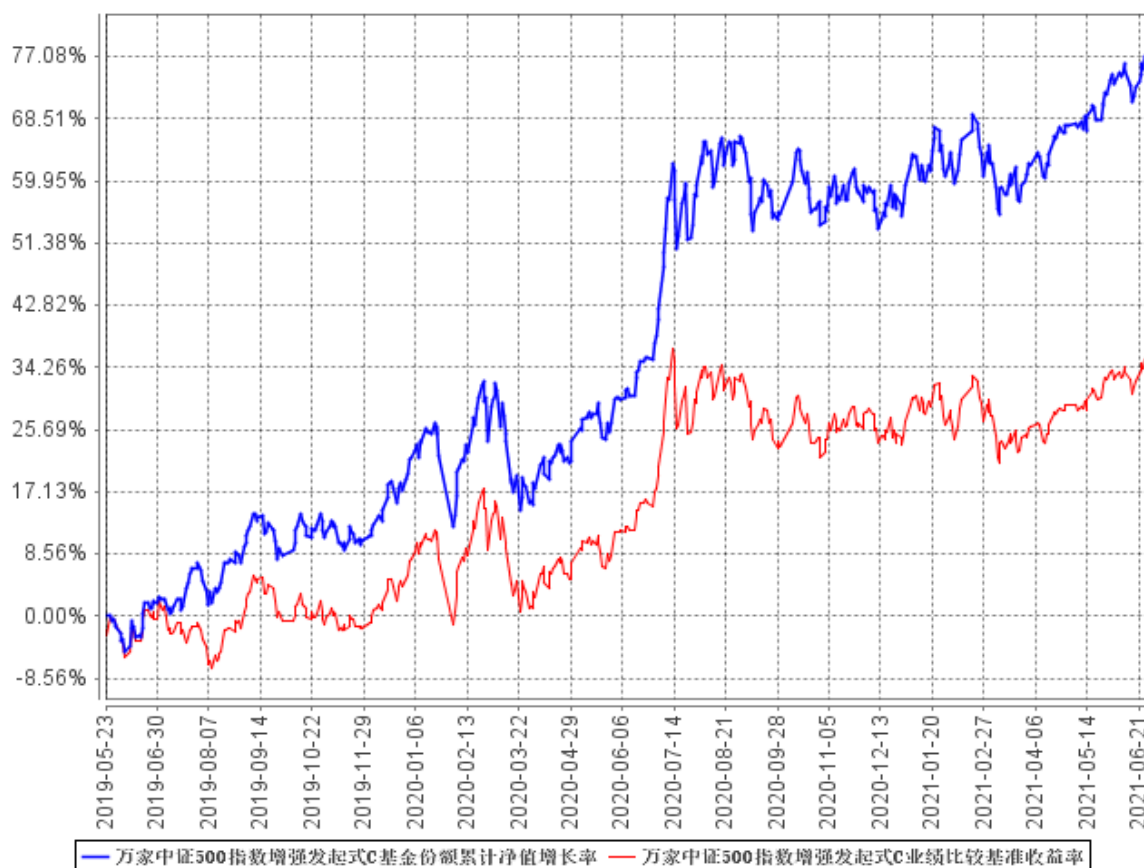
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.72%	0.70%	1.13%	0.69%	1.59%	0.01%
过去三个月	11.04%	0.67%	8.43%	0.65%	2.61%	0.02%
过去六个月	12.10%	0.95%	6.64%	0.94%	5.46%	0.01%
过去一年	29.69%	1.22%	15.42%	1.19%	14.27%	0.03%
自基金合同生效起至今	78.48%	1.28%	35.20%	1.29%	43.28%	-0.01%

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

万家中证500指数增强发起式A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



万家中证500指数增强发起式C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同生效日期为2019年5月23日，本基金建仓期为基金合同生效后6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。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。公司现股东为中泰证券股份有限公司、新疆国际实业股份有限公司和齐河众鑫投资有限公司,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),办公地点:上海市浦东新区浦电路 360 号 9 楼,注册资本 3 亿元人民币。目前管理九十一只开放式基金,分别为万家 180 指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选混合型证券投资基金(LOF)、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金(LOF)、万家添利债券型证券投资基金(LOF)、万家新机遇价值驱动灵活配置混合型证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家上证 50 交易型开放式指数证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞和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、万家颐和灵活配置混合型证券投资基金、万家恒瑞 18 个月定期开放债券型证券投资基金、万家 3-5 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家鑫安纯债债券型证券投资基金、万家鑫璟纯债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、万家家享中短债债券型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家 1-3 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家瑞隆混合型证券投资基金、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家现金增利货币市场基金、万家消费成长股票型证券投资基金、万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家玖盛纯债 9 个月定期开放债券型证券投资基金、万家天添宝货币市场基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、万家家瑞债券型证券投资基金、万家臻选混合型证券投资基金、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金、万家成长优选灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金、万家

经济新动能混合型证券投资基金、万家潜力价值灵活配置混合型证券投资基金、万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家新机遇龙头企业灵活配置混合型证券投资基金、万家智造优势混合型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型证券投资基金、万家人工智能混合型证券投资基金、万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金 (LOF)、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、万家平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫盛纯债债券型证券投资基金、万家民安增利 12 个月定期开放债券型证券投资基金、万家汽车新趋势混合型证券投资基金、万家惠享 39 个月定期开放债券型证券投资基金、万家科技创新混合型证券投资基金、万家自主创新混合型证券投资基金、万家民丰回报一年持有期混合型证券投资基金、万家可转债债券型证券投资基金、万家民瑞祥和 6 个月持有期债券型证券投资基金、万家价值优势一年持有期混合型证券投资基金、万家养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、万家鑫动力月月购一年滚动持有混合型证券投资基金、万家科创板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家创业板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家周期优势企业混合型证券投资基金、万家健康产业混合型证券投资基金、万家互联互通中国优势量化策略混合型证券投资基金、万家战略发展产业混合型证券投资基金、万家创业板指数增强型证券投资基金、万家陆家嘴金融城金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家内需增长一年持有期混合型证券投资基金、万家互联互通核心资产量化策略混合型证券投资基金、万家民瑞祥明 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家瑞泽回报一年持有期混合型证券投资基金、万家惠裕回报 6 个月持有期混合型证券投资基金。

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	万家量化睿选灵活配置混合型基金、万家中证 1000 指数增强型发起式基	2019 年 9 月 6 日	-	14 年	曾任美国巴克莱国际投资管理公司基金经理，加拿大退休基金国际投资管理公司基金经理，南方基金管理有限公司量化投资部基金经理，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

	金、万家 沪深 300 指 数 增 强 型 基 金、万家 互 联 互 通 核 心 资 产 量 化 策 略 混 合 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 中 证 500 指 数 增 强 型 基 金 的 基 金 经 理			理有限公司量化投资部 投资总监。2019 年 7 月加入 万家基金管理有限公司， 担任公司总经理助理。
--	--	--	--	--

注：1、任职日期以及离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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

本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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》、《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》，公司制定了《公平交易管理办法》和《异常交易监控及报告管理办法》等规章制度，涵盖了研究、授权、投资决策和交易执行等投资管理活动的各个环节，确保公平对待不同投资组合，防范导致不公平交易以及利益输送的异常交易发生。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 1 次，为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，有关基金经理按规定履行了审批程序。

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

万家中证 500 指数增强型证券投资基金采用中证 500 指数增强的投资策略，运用量化多因子选股模型，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

万家中证 500 指数增强型证券投资基金在保持相对中证 500 指数较小跟踪误差情况下，控制行业权重偏离度、个股集中度，通过量化多因子选股的方式选取一篮子股票组合。在组合的行业和风格上相对于中证 500 指数保持了均衡的配置，在量化选股方面精选行业内质优个股，持股较为分散。本基金采用量化风险模型来合理控制组合风险，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% 以上权重为中证 500 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中证 500 指数增强发起式 A 基金份额净值为 1.7201 元,本报告期基金份额净值增长率为 12.32%;截至本报告期末万家中证 500 指数增强发起式 C 基金份额净值为 1.7024 元,本报告期基金份额净值增长率为 12.10%;同期业绩比较基准收益率为 6.64%。基金报告期末 A 份额、C 份额日均跟踪偏离度分别为 0.1855%、0.1848%,年跟踪误差分别为 2.3775%、2.3848%,截止报告期末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

回顾 2021 年上半年,在一季度中,春节前后 A 股市场经历了快速的上涨与调整。在年初的市场上,A 股在核心资产的带动下一路高歌猛进,叠加大量新发基金进场导致市场过去两年热门赛道上的股票估值进一步扩张。春节后在美债收益率快速上升以及通胀预期等各种因素催化下,核心资产迎来大幅度回调。在此过程中,一些前期不太受市场关注的低估值顺周期板块表现较好。二季度,美债收益率在经历了一季度的飙升之后逐渐企稳,经济复苏进入实质阶段。中国市场仍得到海外资金的青睐,上半年北向资金累计净流入超两千亿元。市场在修复了一季度的大起大落后表现平稳,期间各类题材主题不断轮动,市场成交活跃。市场风格在经历了一季度严重的分化与波动后,在二季度中整体表现更加均衡,并且随着市场逐步的企稳以及一些高景气板块共识的达成,成长风格稳步占优。

展望 2021 年下半年,我们认为市场将整体呈现震荡格局,但会存在结构性机会,后续来看,无论是核心资产还是中小市值个股,核心抓手都是业绩增速。流动性方面,全球新冠疫苗大规模接种持续推进,中国接种率快速上升,全球疫情逐渐好转。美联储论调虽偏鹰,目前仍未实施收紧政策,海外流动性保持整体宽松。中国经济复苏走向中后期阶段,生产端有所回落,需求端增速下行,出口仍保持较高增速。信贷额度以及地产调控可能继续趋紧,PPI 高位震荡,核心 CPI 处于低位。在经济持续复苏背景下,货币政策虽难系统性放松,但伴随央行本次降准等操作,市场流动性总量仍将保持基本稳定。同时,股市资金面也整体向好,二季度以来股市成交量持续回升,融资融券余额、新基金发行份额也反映出市场活跃度提升。上半年北向资金累计净流入超过 2200 亿元,已超过去年全年的水平。预计下半年仍将保持平稳净流入的节奏,全年净流入规模有望超过 2019 年的水平。从企业盈利上来看,行业业绩增速同比也全面上行。在盈利驱动仍为行情主线的当前时点,我们认为有业绩支撑,景气度持续较高,并且符合政策倾斜方向,时代发展趋

势的细分行业会有结构性的机会。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了估值委员会, 定期评价现行估值政策和程序, 在发生了影响估值政策和程序有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。估值委员会由总经理、基金运营部负责人、合规稽核部负责人、权益投资部负责人、固定收益部负责人等组成。估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关从业资格, 精通各自领域的理论知识, 熟悉政策法规, 并具有丰富的实践经验。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论, 但不介入基金日常估值业务。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中债金融估值中心有限公司签署了《中债信息产品服务协议》，本基金管理人与中证指数有限公司签署了《中证债券估值数据服务协议》、《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本基金为发起式基金，不适用本项说明。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金的托管过程中，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，万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金的管理人——万家基金管理有限公司在万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金的投资运作、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，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2021 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：万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,716,209.70	2,810,458.29
结算备付金		50,801.13	156,009.60
存出保证金		5,024.66	14,740.70
交易性金融资产	6.4.7.2	36,510,309.12	40,444,883.36
其中：股票投资		36,510,309.12	40,444,883.36
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	1,729,788.54
应收利息	6.4.7.5	246.35	382.86
应收股利		-	-
应收申购款		147,957.08	17,910.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		39,430,548.04	45,174,173.88
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		5,653.52	-
应付赎回款		314,306.76	1,943,394.06
应付管理人报酬		31,110.17	38,380.95
应付托管费		6,222.01	7,676.20
应付销售服务费		2,734.65	4,440.66
应付交易费用	6.4.7.7	72,031.69	118,868.75
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	164,662.40	190,435.70
负债合计		596,721.20	2,303,196.32
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	22,630,124.87	28,056,932.48
未分配利润	6.4.7.10	16,203,701.97	14,814,045.08
所有者权益合计		38,833,826.84	42,870,977.56
负债和所有者权益总计		39,430,548.04	45,174,173.88

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，万家中证 500 指数增强发起式 A 基金份额净值 1.7201 元，基金份额总额 17,383,784.86 份；万家中证 500 指数增强发起式 C 基金份额净值 1.7024 元，基金份额总额 5,246,340.01 份。万家中证 500 指数增强发起式份额总额合计为 22,630,124.87 份。

6.2 利润表

会计主体：万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		4,989,118.80	14,117,908.89
1.利息收入		5,151.01	28,055.13
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,151.01	28,055.13
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,570,998.14	18,796,845.52
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,322,753.47	18,268,852.15
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
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	248,244.67	527,993.37
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	382,097.84	-4,898,109.83
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	30,871.81	191,118.07
减：二、费用		521,168.92	1,554,802.45
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	181,458.52	567,967.03
2. 托管费	6.4.10.2.2	36,291.69	113,593.43
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	15,370.84	94,698.72
4. 交易费用	6.4.7.19	213,267.90	676,146.03
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	74,779.97	102,397.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,467,949.88	12,563,106.44
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,467,949.88	12,563,106.44

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	28,056,932.48	14,814,045.08	42,870,977.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,467,949.88	4,467,949.88
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-5,426,807.61	-3,078,292.99	-8,505,100.60
其中：1.基金申购款	7,922,231.89	4,726,373.17	12,648,605.06
2.基金赎回款	-13,349,039.50	-7,804,666.16	-21,153,705.66
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的	-	-	-

基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	22,630,124.87	16,203,701.97	38,833,826.84
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	134,186,486.55	24,810,038.62	158,996,525.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,563,106.44	12,563,106.44
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-88,436,214.29	-20,614,475.10	-109,050,689.39
其中：1.基金申购款	37,941,813.38	7,971,797.80	45,913,611.18
2.基金赎回款	-126,378,027.67	-28,586,272.90	-154,964,300.57
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	45,750,272.26	16,758,669.96	62,508,942.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

方一天	陈广益	尹超
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（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[2018]1931 号文《关于准予万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》的批准，由万家基金管理有限公司作为基金管理人于

2019 年 5 月 6 日至 2019 年 5 月 17 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[2019]第 ZA30669 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 2019 年 5 月 23 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 215,969,733.39 元，有效认购资金在募集期间内产生的利息为人民币 31,846.50 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 216,001,579.89 元，折合 216,001,579.89 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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股、备选成份股、其他股票（包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中小企业私募债券、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、债券回购、银行存款、同业存单、资产支持证券、金融衍生品（包括权证、股指期货、国债期货、股票期权等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可参与融资业务和转融通证券出借交易。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，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：中证 500 指数收益率*95%+一年期人民币定期存款利率（税后）*5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法（2020 年修订）》、《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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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 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。

(二) 增值税

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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	2,716,209.70
定期存款	-
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	-
合计：	2,716,209.70

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	34,968,245.83	36,510,309.12	1,542,063.29
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		34,968,245.83	36,510,309.12	1,542,063.29

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

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	223.67
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	20.61
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	2.07
合计	246.35

6.4.7.6 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	72,031.69
银行间市场应付交易费用	-
合计	72,031.69

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	114.43
应付证券出借违约金	-
预提费用	164,547.97
合计	164,662.40

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

万家中证 500 指数增强发起式 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	20,660,822.08	20,660,822.08
本期申购	2,800,719.60	2,800,719.60
本期赎回(以“-”号填列)	-6,077,756.82	-6,077,756.82
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	17,383,784.86	17,383,784.86

金额单位：人民币元

万家中证 500 指数增强发起式 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,396,110.40	7,396,110.40
本期申购	5,121,512.29	5,121,512.29
本期赎回(以“-”号填列)	-7,271,282.68	-7,271,282.68
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	5,246,340.01	5,246,340.01

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

万家中证 500 指数增强发起式 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	12,438,736.55	-1,460,204.08	10,978,532.47
本期利润	3,225,174.60	205,075.07	3,430,249.67
本期基金份额交易产生的变动数	-2,072,652.01	182,734.69	-1,889,917.32
其中：基金申购款	1,864,558.18	-184,038.56	1,680,519.62
基金赎回款	-3,937,210.19	366,773.25	-3,570,436.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,591,259.14	-1,072,394.32	12,518,864.82

单位：人民币元

万家中证 500 指数增强发起式 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,352,621.02	-517,108.41	3,835,512.61
本期利润	860,677.44	177,022.77	1,037,700.21
本期基金份额交易产生的变动数	-1,208,334.28	19,958.61	-1,188,375.67
其中：基金申购款	3,402,246.02	-356,392.47	3,045,853.55
基金赎回款	-4,610,580.30	376,351.08	-4,234,229.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,004,964.18	-320,127.03	3,684,837.15

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,305.93
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	754.18
其他	90.90
合计	5,151.01

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	73,981,154.28
减：卖出股票成本总额	69,658,400.81
买卖股票差价收入	4,322,753.47

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.1 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

本基金本报告期末无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	248,244.67
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	248,244.67

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	382,097.84
——股票投资	382,097.84
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——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	382,097.84

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	30,713.96
转换费收入 006729	157.43
转换费收入 006730	0.42
合计	30,871.81

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	213,267.90
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	213,267.90

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
指数费用	20,000.00
银行费用	232.00
回购手续费	-
合计	74,779.97

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	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”）	基金管理人股东、基金销售机构

注：以下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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
中泰证券	68,649,697.12	49.42%	174,054,952.36	42.67%

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方席位进行债券交易。

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未通过关联方席位进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总	期末应付佣金余额	占期末应付佣金

		量的比例		总额的比例
中泰证券	61,531.57	48.47%	31,855.90	44.22%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	156,007.28	41.74%	55,286.35	36.99%

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	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	181,458.52	567,967.03
其中：支付销售机构的客户维护费	43,809.17	95,675.67

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，经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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 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	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	36,291.69	113,593.43

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

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付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家中证 500 指数增强发起式 A	万家中证 500 指数增强发起式 C	合计
	万家基金管理有限公司	-	103.31
中泰证券	-	436.71	436.71
工商银行	-	4,028.98	4,028.98
合计	-	4,569.00	4,569.00
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家中证 500 指数增强发起式 A	万家中证 500 指数增强发起式 C	合计
	万家基金管理有限公司	-	74,743.38
中泰证券	-	11.95	11.95
工商银行	-	5,055.99	5,055.99
合计	-	79,811.32	79,811.32

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%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。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销售

服务费划款指令，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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 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无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。

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无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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	万家中证 500 指数增强发起式 A	万家中证 500 指数增强发起式 C
基金合同生效日（2019 年 5 月 23 日）持有的基金份额	10,001,000.10	-

报告期初持有的基金份额	10,001,000.10	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,000.10	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	57.5306%	-

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	万家中证 500 指数增强发起式 A	万家中证 500 指数增强发起式 C
基金合同生效日(2019 年 5 月 23 日) 持有的基金份额	10,001,000.10	-
报告期初持有的基金份额	10,001,000.10	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,000.10	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	32.6653%	-

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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	2,716,209.70	4,305.93	3,763,835.95	25,059.61

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，活期存款按银行同业利率计息。

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未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021 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	可流通日	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
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股流通受限	31.56	31.56	240	7,574.40	7,574.40	-

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 2021 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证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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，建立了三道防线：以各岗位目标责任制为基础，形成第一道防线；通过相关部门、相关岗位之间相互监督制衡，形成第二道防线；由监察稽核部门、督察长对各岗位、各部门、各机构、各项业务实施监督反馈，形成第三道防线。

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%。

于 2021 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。

本基金所持大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，本期末本基金的资产均能及时变现。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（2021 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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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							

银行存款	2,716,209.70	-	-	-	-	-	2,716,209.70
结算备付金	50,801.13	-	-	-	-	-	50,801.13
存出保证金	5,024.66	-	-	-	-	-	5,024.66
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-36,510,309.12	36,510,309.12
应收利息	-	-	-	-	-	246.35	246.35
应收申购款	-	-	-	-	-	147,957.08	147,957.08
资产总计	2,772,035.49	-	-	-	-	-36,658,512.55	39,430,548.04
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	5,653.52	5,653.52
应付赎回款	-	-	-	-	-	314,306.76	314,306.76
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	31,110.17	31,110.17
应付托管费	-	-	-	-	-	6,222.01	6,222.01
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,734.65	2,734.65
应付交易费用	-	-	-	-	-	72,031.69	72,031.69
其他负债	-	-	-	-	-	164,662.40	164,662.40
负债总计	-	-	-	-	-	596,721.20	596,721.20
利率敏感度缺口	2,772,035.49	-	-	-	-	-36,061,791.35	38,833,826.84
上年度末 2020 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							
银行存款	2,810,458.29	-	-	-	-	-	2,810,458.29
结算备付金	156,009.60	-	-	-	-	-	156,009.60
存出保证金	14,740.70	-	-	-	-	-	14,740.70
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-40,444,883.36	40,444,883.36
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,729,788.54	1,729,788.54
应收利息	-	-	-	-	-	382.86	382.86
应收申购款	-	-	-	-	-	17,910.53	17,910.53
资产总计	2,981,208.59	-	-	-	-	-42,192,965.29	45,174,173.88
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,943,394.06	1,943,394.06
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	38,380.95	38,380.95
应付托管费	-	-	-	-	-	7,676.20	7,676.20
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,440.66	4,440.66

费							
应付交易费用	-	-	-	-	-	118,868.75	118,868.75
其他负债	-	-	-	-	-	190,435.70	190,435.70
负债总计	-	-	-	-	-	2,303,196.32	2,303,196.32
利率敏感度缺口	2,981,208.59	-	-	-	-	-39,889,768.97	42,870,977.56

注：该表统计了本基金资产和负债的利率风险敞口。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者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，银行存款、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

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	36,510,309.12	94.02	40,444,883.36	94.34
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	36,510,309.12	94.02	40,444,883.36	94.34

注：本基金股票资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；权证投资占基金资产净值的 0-3%。每个交易日日终，在扣除股指期货、股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上表。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	若股票基准指数发生变动而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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 股票基准指数下降 100 个基点	-413,036.18	-396,004.56
2. 股票基准指数上升 100 个基点	413,036.18	396,004.56	

注：本基金管理人运用资本-资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。表中为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 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	36,510,309.12	92.59
	其中：股票	36,510,309.12	92.59
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	2,767,010.83	7.02
8	其他各项资产	153,228.09	0.39
9	合计	39,430,548.04	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	344,021.00	0.89
B	采矿业	518,512.00	1.34
C	制造业	23,130,379.90	59.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	328,514.00	0.85
E	建筑业	281,556.00	0.73
F	批发和零售业	1,012,803.00	2.61
G	交通运输、仓储和邮政业	632,129.00	1.63
H	住宿和餐饮业	106,899.00	0.28
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,387,475.85	3.57
J	金融业	557,449.00	1.44
K	房地产业	184,548.00	0.48
L	租赁和商务服务业	198,011.00	0.51

M	科学研究和技术服务业	204,255.00	0.53
N	水利、环境和公共设施管理业	348,311.00	0.90
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	95,903.20	0.25
R	文化、体育和娱乐业	470,578.00	1.21
S	综合	-	-
	合计	29,801,344.95	76.74

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	1,511.00	0.00
B	采矿业	92,303.00	0.24
C	制造业	4,840,617.24	12.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,752.80	0.01
E	建筑业	152,824.40	0.39
F	批发和零售业	90,139.00	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	21,770.00	0.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	364,650.12	0.94
J	金融业	240,549.41	0.62
K	房地产业	61,070.00	0.16
L	租赁和商务服务业	74,339.00	0.19
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	9,704.00	0.02
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	756,734.20	1.95
S	综合	-	-
	合计	6,708,964.17	17.28

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	占基金资产净值比例（%）
1	000799	酒鬼酒	2,900	741,240.00	1.91
2	002709	天赐材料	5,800	618,164.00	1.59
3	002078	太阳纸业	44,100	588,735.00	1.52
4	688099	晶晨股份	5,200	583,440.00	1.50
5	601689	拓普集团	14,200	531,506.00	1.37
6	600884	杉杉股份	20,400	475,728.00	1.23
7	603486	科沃斯	2,000	456,160.00	1.17
8	600460	士兰微	7,700	433,895.00	1.12
9	600549	厦门钨业	20,100	418,683.00	1.08
10	300207	欣旺达	12,200	397,232.00	1.02
11	002056	横店东磁	30,100	391,300.00	1.01
12	600038	中直股份	7,300	385,002.00	0.99
13	300223	北京君正	3,800	383,496.00	0.99
14	600398	海澜之家	52,600	380,824.00	0.98
15	002281	光迅科技	15,100	371,460.00	0.96
16	601598	中国外运	73,200	369,660.00	0.95
17	300168	万达信息	25,200	367,920.00	0.95
18	601233	桐昆股份	15,200	366,168.00	0.94
19	000039	中集集团	20,100	365,418.00	0.94
20	603077	和邦生物	175,600	365,248.00	0.94
21	600201	生物股份	20,400	355,980.00	0.92
22	002603	以岭药业	12,200	355,752.00	0.92
23	600282	南钢股份	97,800	348,168.00	0.90
24	002946	新乳业	22,200	336,330.00	0.87
25	300463	迈克生物	7,900	332,511.00	0.86
26	000830	鲁西化工	17,700	331,521.00	0.85
27	000960	锡业股份	19,800	317,394.00	0.82
28	601139	深圳燃气	48,300	316,848.00	0.82
29	600779	水井坊	2,500	315,875.00	0.81
30	002815	崇达技术	25,300	315,744.00	0.81
31	603638	艾迪精密	7,102	304,462.74	0.78
32	002203	海亮股份	28,500	303,240.00	0.78
33	600862	中航高科	9,800	301,644.00	0.78

34	603225	新凤鸣	14,800	300,440.00	0.77
35	002092	中泰化学	29,200	299,884.00	0.77
36	000898	鞍钢股份	67,100	298,595.00	0.77
37	000012	南玻A	28,400	290,816.00	0.75
38	002185	华天科技	18,600	286,254.00	0.74
39	600497	驰宏锌锗	65,400	281,874.00	0.73
40	600729	重庆百货	10,200	279,990.00	0.72
41	603260	合盛硅业	3,600	276,876.00	0.71
42	600885	宏发股份	4,400	275,880.00	0.71
43	603568	伟明环保	12,000	273,960.00	0.71
44	603589	口子窖	4,000	270,760.00	0.70
45	002966	苏州银行	36,700	269,745.00	0.69
46	600859	王府井	9,200	265,696.00	0.68
47	601636	旗滨集团	14,000	259,840.00	0.67
48	000528	柳工	31,600	259,120.00	0.67
49	600409	三友化工	25,300	255,783.00	0.66
50	002563	森马服饰	21,200	253,340.00	0.65
51	601928	凤凰传媒	35,300	252,042.00	0.65
52	002382	蓝帆医疗	11,800	246,030.00	0.63
53	300072	三聚环保	42,800	245,672.00	0.63
54	300474	景嘉微	2,300	225,216.00	0.58
55	002408	齐翔腾达	18,000	223,560.00	0.58
56	300037	新宙邦	2,200	220,220.00	0.57
57	601801	皖新传媒	46,300	218,536.00	0.56
58	600707	彩虹股份	23,000	216,430.00	0.56
59	002572	索菲亚	8,900	215,380.00	0.55
60	000488	晨鸣纸业	26,200	213,268.00	0.55
61	600377	宁沪高速	21,600	210,816.00	0.54
62	600315	上海家化	3,500	210,490.00	0.54
63	600827	百联股份	10,400	209,560.00	0.54
64	603198	迎驾贡酒	4,700	208,210.00	0.54
65	600645	中源协和	8,900	204,255.00	0.53
66	000519	中兵红箭	18,800	201,536.00	0.52
67	000970	中科三环	20,100	191,955.00	0.49
68	002074	国轩高科	4,400	191,664.00	0.49
69	002458	益生股份	18,900	188,433.00	0.49
70	600039	四川路桥	30,000	188,100.00	0.48
71	002294	信立泰	5,700	187,530.00	0.48
72	000930	中粮科技	20,796	187,371.96	0.48

73	002340	格林美	19,700	184,195.00	0.47
74	600089	特变电工	14,300	183,755.00	0.47
75	600500	中化国际	22,700	178,422.00	0.46
76	002839	张家港行	32,600	177,344.00	0.46
77	002183	怡亚通	29,700	170,181.00	0.44
78	600256	广汇能源	51,000	169,830.00	0.44
79	600623	华谊集团	19,000	167,390.00	0.43
80	000998	隆平高科	9,700	155,588.00	0.40
81	002138	顺络电子	4,000	155,080.00	0.40
82	000869	张裕A	4,100	152,274.00	0.39
83	002080	中材科技	5,800	151,786.00	0.39
84	600166	福田汽车	43,500	150,075.00	0.39
85	600435	北方导航	18,800	149,272.00	0.38
86	002648	卫星石化	3,580	140,300.20	0.36
87	600160	巨化股份	15,800	139,672.00	0.36
88	300009	安科生物	9,360	139,464.00	0.36
89	600801	华新水泥	7,900	138,803.00	0.36
90	300316	晶盛机电	2,700	136,350.00	0.35
91	603156	养元饮品	4,500	128,610.00	0.33
92	603515	欧普照明	5,000	128,350.00	0.33
93	603888	新华网	6,000	127,020.00	0.33
94	603858	步长制药	5,600	125,944.00	0.32
95	600875	东方电气	11,300	123,961.00	0.32
96	603868	飞科电器	2,900	121,974.00	0.31
97	688002	睿创微纳	1,200	119,796.00	0.31
98	002180	纳思达	3,700	119,140.00	0.31
99	300180	华峰超纤	23,400	115,830.00	0.30
100	000825	太钢不锈	15,300	114,597.00	0.30
101	002244	滨江集团	27,300	114,387.00	0.29
102	601128	常熟银行	17,800	110,360.00	0.28
103	600808	马钢股份	24,300	104,247.00	0.27
104	300271	华宇软件	5,400	103,950.00	0.27
105	600316	洪都航空	2,700	103,896.00	0.27
106	300296	利亚德	12,700	99,314.00	0.26
107	300002	神州泰岳	20,381	98,847.85	0.25
108	600141	兴发集团	5,100	96,033.00	0.25
109	603290	斯达半导	300	96,000.00	0.25
110	300244	迪安诊断	2,504	95,903.20	0.25
111	601005	重庆钢铁	35,600	95,052.00	0.24

112	600879	航天电子	12,500	94,000.00	0.24
113	002081	金螳螂	11,800	93,456.00	0.24
114	002925	盈趣科技	2,400	93,384.00	0.24
115	600597	光明乳业	6,000	86,460.00	0.22
116	600754	锦江酒店	1,500	85,425.00	0.22
117	603256	宏和科技	8,700	79,518.00	0.20
118	002266	浙富控股	14,900	74,351.00	0.19
119	002444	巨星科技	2,100	71,568.00	0.18
120	000540	中天金融	25,700	70,161.00	0.18
121	600546	山煤国际	9,500	68,210.00	0.18
122	601168	西部矿业	5,600	66,808.00	0.17
123	688029	南微医学	200	62,338.00	0.16
124	002250	联化科技	2,200	61,380.00	0.16
125	002419	天虹股份	9,300	61,008.00	0.16
126	000738	航发控制	2,800	58,324.00	0.15
127	000062	深圳华强	3,300	55,803.00	0.14
128	300618	寒锐钴业	700	55,188.00	0.14
129	300010	豆神教育	9,400	53,298.00	0.14
130	300699	光威复材	700	53,165.00	0.14
131	603444	吉比特	100	53,000.00	0.14
132	000028	国药一致	1,400	52,976.00	0.14
133	603056	德邦股份	4,700	51,653.00	0.13
134	000887	中鼎股份	4,100	49,528.00	0.13
135	600563	法拉电子	300	47,508.00	0.12
136	603605	珀莱雅	200	39,342.00	0.10
137	002396	星网锐捷	1,700	36,295.00	0.09
138	002013	中航机电	3,300	33,231.00	0.09
139	600329	中新药业	1,100	30,899.00	0.08
140	600060	海信视像	1,800	30,420.00	0.08
141	300058	蓝色光标	4,600	27,830.00	0.07
142	603355	莱克电气	400	24,892.00	0.06
143	300285	国瓷材料	500	24,375.00	0.06
144	600258	首旅酒店	900	21,474.00	0.06
145	000078	海王生物	6,000	19,560.00	0.05
146	600380	健康元	1,200	16,476.00	0.04
147	603983	丸美股份	300	15,633.00	0.04
148	600006	东风汽车	2,100	15,330.00	0.04
149	600835	上海机电	900	14,625.00	0.04
150	603893	瑞芯微	100	13,946.00	0.04

151	600642	申能股份	1,900	11,666.00	0.03
152	600216	浙江医药	700	11,207.00	0.03
153	002152	广电运通	800	10,424.00	0.03
154	002745	木林森	700	9,380.00	0.02
155	002557	洽洽食品	200	8,620.00	0.02
156	002511	中顺洁柔	300	8,265.00	0.02
157	002385	大北农	900	6,120.00	0.02
158	603707	健友股份	100	4,175.00	0.01
159	000723	美锦能源	500	3,780.00	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	占基金资产净值比例（%）
1	600809	山西汾酒	800	358,400.00	0.92
2	002739	万达电影	21,100	333,169.00	0.86
3	688180	君实生物	3,500	284,235.00	0.73
4	002920	德赛西威	2,200	242,176.00	0.62
5	600741	华域汽车	8,800	231,176.00	0.60
6	603103	横店影视	14,585	214,691.20	0.55
7	300769	德方纳米	1,000	206,690.00	0.53
8	603186	华正新材	5,600	204,176.00	0.53
9	603369	今世缘	3,500	189,560.00	0.49
10	601211	国泰君安	10,700	183,398.00	0.47
11	002636	金安国纪	10,900	176,798.00	0.46
12	603337	杰克股份	6,200	165,726.00	0.43
13	300434	金石亚药	17,900	163,964.00	0.42
14	300124	汇川技术	2,100	155,946.00	0.40
15	000048	京基智农	8,060	148,707.00	0.38
16	300465	高伟达	12,000	145,680.00	0.38
17	300506	名家汇	25,000	145,250.00	0.37
18	600977	中国电影	10,800	135,324.00	0.35
19	000100	TCL 科技	17,400	133,110.00	0.34
20	300319	麦捷科技	10,700	128,935.00	0.33
21	600869	远东股份	26,500	127,995.00	0.33
22	600664	哈药股份	43,900	126,871.00	0.33
23	300633	开立医疗	4,000	126,320.00	0.33
24	688111	金山办公	300	118,440.00	0.30

25	002129	中环股份	3,000	115,800.00	0.30
26	000725	京东方 A	17,800	111,072.00	0.29
27	688388	嘉元科技	1,200	109,152.00	0.28
28	002932	明德生物	900	87,813.00	0.23
29	600688	上海石化	22,600	84,976.00	0.22
30	300639	凯普生物	2,378	78,497.78	0.20
31	300773	拉卡拉	2,700	76,221.00	0.20
32	002027	分众传媒	7,900	74,339.00	0.19
33	002905	金逸影视	8,900	73,247.00	0.19
34	002852	道道全	4,800	69,648.00	0.18
35	603026	石大胜华	400	64,820.00	0.17
36	603100	川仪股份	3,500	61,285.00	0.16
37	000573	粤宏远 A	19,700	61,070.00	0.16
38	600338	西藏珠峰	4,300	60,931.00	0.16
39	300294	博雅生物	1,600	57,840.00	0.15
40	600110	诺德股份	4,600	56,028.00	0.14
41	601882	海天精工	3,500	54,425.00	0.14
42	002850	科达利	600	52,440.00	0.14
43	600545	卓郎智能	16,200	51,030.00	0.13
44	603606	东方电缆	2,500	50,350.00	0.13
45	300691	联合光电	3,100	49,073.00	0.13
46	603877	太平鸟	800	42,704.00	0.11
47	300685	艾德生物	400	41,632.00	0.11
48	000550	江铃汽车	1,700	39,831.00	0.10
49	300721	怡达股份	1,000	36,790.00	0.09
50	601377	兴业证券	3,800	36,708.00	0.09
51	300145	中金环境	11,900	36,176.00	0.09
52	300748	金力永磁	1,120	35,425.60	0.09
53	300073	当升科技	600	33,714.00	0.09
54	600711	盛屯矿业	4,400	31,372.00	0.08
55	300610	晨化股份	2,200	28,820.00	0.07
56	300755	华致酒行	700	28,567.00	0.07
57	300650	太龙照明	1,200	28,116.00	0.07
58	603043	广州酒家	1,040	26,748.80	0.07
59	603429	集友股份	800	26,000.00	0.07
60	600184	光电股份	2,300	25,001.00	0.06
61	688116	天奈科技	200	23,600.00	0.06
62	000568	泸州老窖	100	23,594.00	0.06
63	603658	安图生物	300	22,731.00	0.06

64	300240	飞力达	3,500	21,770.00	0.06
65	603738	泰晶科技	600	20,712.00	0.05
66	601528	瑞丰银行	1,313	20,443.41	0.05
67	600778	友好集团	4,800	19,248.00	0.05
68	688561	奇安信	192	17,723.52	0.05
69	300783	三只松鼠	300	14,208.00	0.04
70	600378	昊华科技	500	11,015.00	0.03
71	600661	昂立教育	800	9,704.00	0.02
72	300395	菲利华	200	9,644.00	0.02
73	001208	华菱线缆	1,122	8,673.06	0.02
74	603517	绝味食品	100	8,429.00	0.02
75	605287	德才股份	240	7,574.40	0.02
76	603171	税友股份	343	6,585.60	0.02
77	688177	百奥泰	200	5,248.00	0.01
78	300705	九典制药	100	3,805.00	0.01
79	605011	杭州热电	310	2,752.80	0.01
80	002773	康弘药业	100	2,313.00	0.01
81	002840	华统股份	200	1,802.00	0.00
82	002041	登海种业	100	1,511.00	0.00
83	002011	盾安环境	200	1,174.00	0.00
84	600715	文投控股	100	303.00	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	000799	酒鬼酒	752,410.00	1.76
2	002078	太阳纸业	653,723.00	1.52
3	002709	天赐材料	622,268.00	1.45
4	300285	国瓷材料	600,686.00	1.40
5	601799	星宇股份	589,422.51	1.37
6	688099	晶晨股份	558,164.12	1.30
7	000898	鞍钢股份	552,227.00	1.29
8	600884	杉杉股份	548,937.00	1.28
9	600089	特变电工	505,643.00	1.18
10	601598	中国外运	496,104.00	1.16

11	603345	安井食品	492,660.00	1.15
12	600497	驰宏锌锗	461,332.00	1.08
13	600549	厦门钨业	458,990.00	1.07
14	600708	光明地产	445,986.00	1.04
15	000825	太钢不锈	441,320.00	1.03
16	300168	万达信息	435,630.00	1.02
17	600398	海澜之家	431,566.00	1.01
18	000012	南玻 A	431,101.00	1.01
19	600256	广汇能源	422,612.00	0.99
20	300316	晶盛机电	422,142.00	0.98

注：“买入金额”按买卖成交金额（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	300274	阳光电源	1,739,146.00	4.06
2	300012	华测检测	1,518,862.58	3.54
3	600426	华鲁恒升	1,312,907.70	3.06
4	002821	凯莱英	1,258,558.00	2.94
5	300207	欣旺达	1,004,789.00	2.34
6	600845	宝信软件	961,911.00	2.24
7	002416	爱施德	748,309.00	1.75
8	002423	中粮资本	745,181.80	1.74
9	300115	长盈精密	717,414.00	1.67
10	000898	鞍钢股份	715,749.00	1.67
11	600708	光明地产	700,748.00	1.63
12	600350	山东高速	667,129.00	1.56
13	600507	方大特钢	638,777.00	1.49
14	600388	龙净环保	627,320.00	1.46
15	002867	周大生	616,797.00	1.44
16	002155	湖南黄金	614,003.00	1.43
17	600039	四川路桥	601,391.85	1.40
18	601689	拓普集团	587,905.00	1.37
19	601799	星宇股份	586,458.00	1.37
20	002078	太阳纸业	568,308.00	1.33

注：“卖出金额”按买卖成交金额(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	65,341,728.73
卖出股票收入（成交）总额	73,981,154.28

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货持仓。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	5,024.66
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	246.35
5	应收申购款	147,957.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	153,228.09
---	----	------------

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金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
万家中证 500 指数增强发起式 A	1,667	10,428.19	10,001,000.10	57.53%	7,382,784.76	42.47%
万家中证 500 指数增强发起式 C	1,681	3,120.96	0.00	0.00%	5,246,340.01	100.00%
合计	3,204	7,063.09	10,001,000.10	44.19%	12,629,124.77	55.81%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	万家中证 500 指数增强发起式 A	88,187.37	0.5073%
	万家中证 500 指数增强发起式 C	20,708.45	0.3947%
	合计	108,895.82	0.4812%

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的情况

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	万家中证 500 指数增强发起式 A	0~10

有本开放式基金	万家中证 500 指数增强发起式 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	万家中证 500 指数增强发起式 A	0
	万家中证 500 指数增强发起式 C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,000.10	44.19	10,001,000.10	44.19	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,000.10	44.19	10,001,000.10	44.19	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家中证 500 指数 增强发起式 A	万家中证 500 指数 增强发起式 C
基金合同生效日（2019 年 5 月 23 日）基金 份额总额	193,620,037.68	22,381,542.21
本报告期期初基金份额总额	20,660,822.08	7,396,110.40
本报告期基金总申购份额	2,800,719.60	5,121,512.29
减：本报告期基金总赎回份额	6,077,756.82	7,271,282.68
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以 “-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	17,383,784.86	5,246,340.01

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

2021 年 3 月 16 日，公司聘任陈广益先生担任公司总经理。

基金托管人：

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

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

本报告期内管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或者处罚。

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	
上海证券	1	70,252,240.06	50.58%	65,427.17	51.53%	-
中泰证券	1	68,649,697.12	49.42%	61,531.57	48.47%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	3	-	-	-	-	-
西藏东方财	1	-	-	-	-	-

富证券						
湘财证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
东亚前海证 券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
第一创业证 券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48 号）的有关规定要求，我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 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要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

3、报告期内基金租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期内，本基金新增第一创业证券交易单元 2 个，东亚前海证券交易单元 2 个，山西证券交易单元 2 个，德邦证券交易单元 2 个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

§ 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	20210101 - 20210630	10,001,000.10	-	-	10,001,000.10	44.19%
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p>							

§ 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、《万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》。
- 3、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 4、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金净值、更新招募说明书及其他临时公告。
- 5、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2021 年中期报告原文。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。
- 7、《万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，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

2021 年 8 月 30 日