

万家中证 500 指数增强型发起式证券投资
基金
2022 年中期报告

2022 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：2022 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 2022 年 8 月 29 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 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
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	66

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	66
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	66
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	66
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
7.12 投资组合报告附注	67
§ 8 基金份额持有人信息	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	68
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	69
§ 9 开放式基金份额变动	69
§ 10 重大事件揭示	69
10.1 基金份额持有人大会决议	69
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	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
10.4 基金投资策略的改变	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
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	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
10.8 其他重大事件	71
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	73
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	73
§ 12 备查文件目录	73
12.1 备查文件目录	73
12.2 存放地点	74
12.3 查阅方式	74

§ 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	267,913,244.23 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	154,846,458.66 份	113,066,785.57 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
		郭明
		010-66105799

电子邮箱	lanj@wjasset.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	4008880800	95588
传真	021-38909627	010-66105798
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区浦 电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	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

3.1.1 期间数据 和指标	报告期(2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 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
本期已实现收益	9,572,572.25	3,363,432.20
本期利润	19,174,284.17	12,610,754.18
加权平均基金份 额本期利润	0.3329	0.1880
本期加权平均净 值利润率	21.68%	12.33%
本期基金份额净 值增长率	-8.60%	-8.78%
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	

期末可供分配利润	60,632,501.62	42,142,840.37
期末可供分配基金份额利润	0.3916	0.3727
期末基金资产净值	215,478,960.28	155,209,625.94
期末基金份额净值	1.3916	1.3727
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	80.43%	77.68%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家中证 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	9.19%	1.20%	6.75%	1.05%	2.44%	0.15%
过去三个月	3.51%	1.69%	2.00%	1.66%	1.51%	0.03%
过去六个月	-8.60%	1.54%	-11.62%	1.55%	3.02%	-0.01%
过去一年	-0.05%	1.30%	-4.78%	1.26%	4.73%	0.04%
过去三年	77.24%	1.28%	29.36%	1.28%	47.88%	0.00%

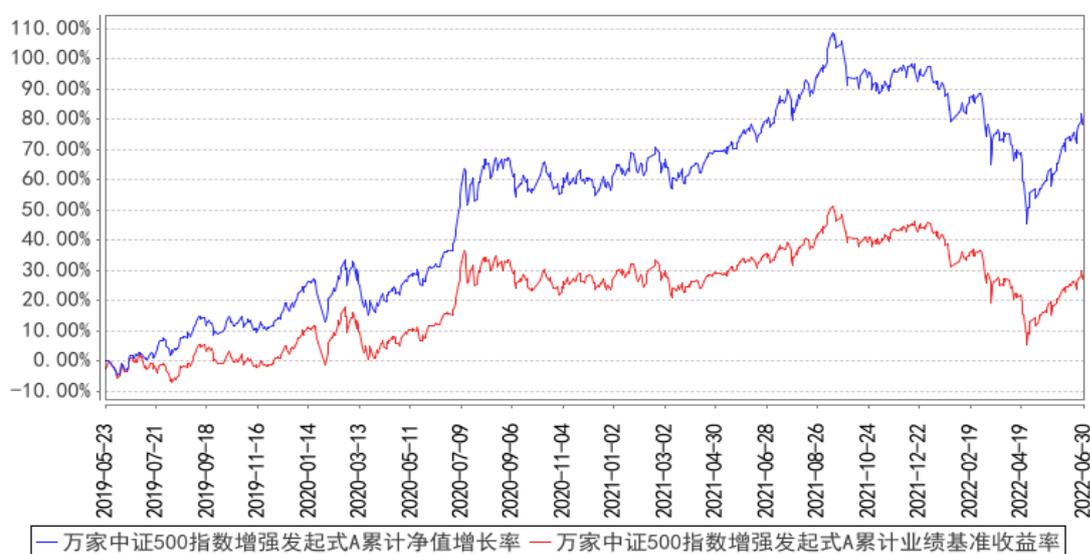
自基金合同生效起 至今	80.43%	1.28%	28.74%	1.28%	51.69%	0.00%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

万家中证 500 指数增强发起式 C

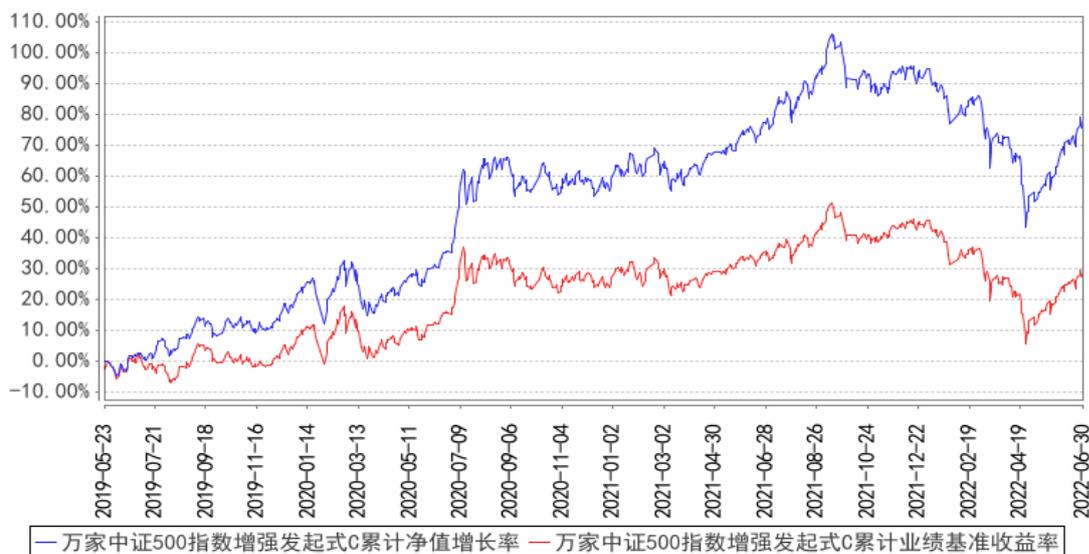
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	9.15%	1.20%	6.75%	1.05%	2.40%	0.15%
过去三个月	3.40%	1.69%	2.00%	1.66%	1.40%	0.03%
过去六个月	-8.78%	1.54%	-11.62%	1.55%	2.84%	-0.01%
过去一年	-0.45%	1.30%	-4.78%	1.26%	4.33%	0.04%
过去三年	74.60%	1.28%	29.36%	1.28%	45.24%	0.00%
自基金合同生效起 至今	77.68%	1.28%	28.74%	1.28%	48.94%	0.00%

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、山东省新动能基金管理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。目前管理一百零九只开放式基金,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、万家科创主题灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、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、万家悦兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金、万家稳鑫 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、万家全球成长一年持有期混合型证券投资基金(QDII)、万家瑞泰混合型证券投资基金、万家沪港深蓝筹混合型证券投资基金、万家北交所慧选两年定期开放混合型证券投资基金、万家鼎鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家新机遇成长一年持有期混合型发起式证券投资基金、万家港股通精选混合型证券投资基金、万家景气驱动混合型证券投资基金、万家安恒纯债 3 个月持有期债券型发起式证券投资基金、万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫橙纯债债券型证券投资基金、万家聚优稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、万家新能源主题混合型发起式证券投资基金、万家中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金。

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	2019 年 9 月 6 日	-	15.5 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。

	指数增强型基金的基金经理				
--	--------------	--	--	--	--

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》、《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》,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,执行交易系统中的公平交易程序;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易,原则上按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;对于银行间交易,按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。为保证公平交易原则的实现,通过制度规范、流程审批、系统风控参数设置等进行事前控制,通过对投资交易系统的实时监控进行事中控制,通过对异常交易的监控和分析实现事后控制。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 2 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

本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 的基金份额净值为 1.3916 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.60%，同期业绩比较基准收益率为-11.62%，截至本报告期末万家中证 500 指数增强发起式 C 的基金份额净值为 1.3727 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.78%，同期业绩比较基准收益率为-11.62%。基金报告期末 A 份额、C 份额日均跟踪偏离度分别为 0.1792%、0.1806%，年跟踪误差分别为 3.6858%、3.6987%，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 2022 上半年，整体上，A 股市场表现受到多重因素的扰动，外围市场有地缘政治冲突、通胀高企、部分海外央行开启加息周期的影响，国内受到疫情反复影响，投资者信心不足，投资者避险情绪升温，制约包括 A 股在内的全球风险资产表现。具体而言，在一季度中，A 股整体呈现震荡下跌态势，行业风格从热门赛道切换到传统价值蓝筹；在二季度中，A 股市场二次探底，随后在稳增长政策大力加码下，市场开启反弹，整体呈现 V 型反弹态势。尤其是 5 月以来在海外市场大幅下跌的环境下走出独立反弹行情，反应出 A 股市场和中国经济的强劲韧性。

展望 2022 下半年，A 股已从情绪驱动回归基本面驱动的常态并将进入政策的关键发力期。稳增长政策正逐步进入执行落地阶段，下半年中国经济将进一步修复。货币政策方面，资金面持续宽松充裕。流动性方面，上半年流动性宽松起因财政投放，下半年流动性依然不可忽视财政的作用。通胀方面，今年上半年海外（尤其美国）通胀上行幅度历史罕见，下半年 PPI 通胀有望稳步下行，但下行空间受到供求关系制约。CPI 上行空间和节奏主要由猪价确定，全球“滞胀”向我国的传导构成最大的不确定性。需求端，内需贡献有望在 2022 下半年回升，其中投资先行，消费次之。生产端，二、三产业增长在 2022 年下半年均将有所回升。但总体而言，原材料成本高昂、外需增长减速等因素可能在一定程度上抑制制造业增加值和盈利反弹的“高度”，以及总体制造业产能扩张的力度。

配置层面，下半年 A 股主要的投资主线是市场风格和政策催化，特别是稳增长政策及预期较低的板块带来的投资机会，不同行业和投资主题的高低轮动将会是未来的主旋律。具体来看，一高景气优势成长板块，如新能源车、风光电、军工、计算机。二是疫后修复，消费聚焦出清、反转逻辑，如白酒、生猪、酒店、汽车零部件、大众消费品。三是稳增长板块，如基建、房地产。

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。估值委员会由负责估值业务的分管领导、合规稽核部负责人、基金运营部负责人、相关估值业务岗位人员、相关风控人员等组成。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

根据基金合同规定：“本基金每年收益分配次数最少为 1 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。”

2022 年 01 月 14 日，本基金进行了利润分配，万家中证 500 指数增强发起式 A 类每 10 份基金份额分红 0.881 元，万家中证 500 指数增强发起式 C 类每 10 份基金份额分红 0.858 元，共计分配利润 4,892,964.66 元，符合基金合同的规定。

2022 年 06 月 24 日，本基金进行了利润分配，万家中证 500 指数增强发起式 A 类每 10 份基金份额分红 2.376 元，万家中证 500 指数增强发起式 C 类每 10 份基金份额分红 2.344 元，共计分配利润 61,925,625.87 元，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，本基金没有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况。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本基金的管理人——万家基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上，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本基金 2022 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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	21,177,723.82	6,049,943.16
结算备付金		4,317,328.78	526,585.31
存出保证金		94,114.72	14,911.18
交易性金融资产	6.4.7.2	349,359,695.18	96,912,244.86
其中：股票投资		349,359,695.18	96,912,244.86
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		11,696,826.09	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,080,653.59	194,399.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	897.77
资产总计		387,726,342.18	103,698,981.81
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		14,968,436.73	455,253.32
应付管理人报酬		351,353.03	73,253.93
应付托管费		70,270.59	14,650.76
应付销售服务费		65,235.49	15,469.64
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	1,582,460.12	476,018.21
负债合计		17,037,755.96	1,034,645.86
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	267,913,244.23	54,989,197.26
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	102,775,341.99	47,675,138.69
净资产合计		370,688,586.22	102,664,335.95
负债和净资产总计		387,726,342.18	103,698,981.81

注：1、报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 267,913,244.23 份，其中万家中证 500 指数增强发起式 A 基金份额净值 1.3916 元，基金份额总额 154,846,458.66；万家中证 500 指数增强发起式 C 基金份额净值 1.3727 元，基金份额总额 113,066,785.57。

2、比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的

“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		33,147,964.76	4,989,118.80
1. 利息收入		38,201.82	5,151.01
其中：存款利息收入	6.4.7.10	38,201.82	5,151.01
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）		13,810,123.11	4,570,998.14
其中：股票投资收益	6.4.7.11	10,869,579.53	4,322,753.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	2,940,543.58	248,244.67
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	18,849,033.90	382,097.84
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	450,605.93	30,871.81
减：二、营业总支出		1,362,926.41	521,168.92
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	909,759.95	181,458.52

2. 托管费	6.4.10.2.2	181,951.93	36,291.69
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	196,324.56	15,370.84
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	74,889.97	288,047.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		31,785,038.35	4,467,949.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		31,785,038.35	4,467,949.88
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		31,785,038.35	4,467,949.88

注：比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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(基金净值)	54,989,197.26	-	47,675,138.69	102,664,335.95
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净	54,989,197.26	-	47,675,138.69	102,664,335.95

资产(基金净值)				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	212,924,046.97	-	55,100,203.30	268,024,250.27
(一)、综合收益总额	-	-	31,785,038.35	31,785,038.35
(二)、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)	212,924,046.97	-	90,133,755.48	303,057,802.45
其中:1.基金申购款	355,632,080.56	-	160,122,415.22	515,754,495.78
2.基金赎回款	-142,708,033.59	-	-69,988,659.74	-212,696,693.33
(三)、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)	-	-	-66,818,590.53	-66,818,590.53
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-

四、本期期末净资产(基金净值)	267,913,244.23	-	102,775,341.99	370,688,586.22
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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(基金净值)	28,056,932.48	-	14,814,045.08	42,870,977.56
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	28,056,932.48	-	14,814,045.08	42,870,977.56
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-5,426,807.61	-	1,389,656.89	-4,037,150.72
(一)、综合收益总额	-	-	4,467,949.88	4,467,949.88
(二)、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
(三)、 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)	-	-	-	-
(四)、 其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	22,630,124.87	-	16,203,701.97	38,833,826.84

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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本中期报告所采用的在金融工具相关会计准则上与上年度报告不一致，其他会计政策、会计估计与上年度报告一致。

会计政策变更：

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》（财会〔2017〕7 号）、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》（财会〔2017〕8 号）、《企业会计准则第 24 号——套期会计》（财

会（2017）9号）、《企业会计准则第37号——金融工具列报》（财会〔2017〕14号）（以下简称新金融工具相关会计准则）和《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》（财会〔2020〕22号），自2022年1月1日起，本基金开始执行新金融工具相关会计准则，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新准则与现行准则的差异追溯调整报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：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。本基金需考虑自身业务模式以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金在编制2022年中期财务报表时已采用上述准则，对本基金财务报表的影响具体请参见附注6.4.5.1会计政策变更的说明。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

自2022年1月1日起适用

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商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金目前暂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。

本基金目前以交易目的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。

本基金持有的其他金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

2022年1月1日前适用

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、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金以交易目的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。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债的分类

自 2022 年 1 月 1 日起适用

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。本基金目前暂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。

2022 年 1 月 1 日前适用

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其他金融负债。本基金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。本基金持有的其他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。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

自 2022 年 1 月 1 日起适用

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。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。其他金融资产和以摊余成本计量的金融负债的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。在考虑有关过去事项、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的基础上，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。对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失，应当分别进行计量。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。本基金确定金融工具在估值日只具有较低的信用风险的，可以假设该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加（即处于第一阶段）。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取金融资产现金流量的合同权利终止；（2）金融资产已转移，且已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；（3）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，但是未保留对金融资产的控制。

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。

2022 年 1 月 1 日前适用

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。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，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的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；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

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。

6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

自 2022 年 1 月 1 日起适用

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。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债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。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除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。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

公允价值与初始确认金额之间的差额扣除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。

2022 年 1 月 1 日前适用

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.4 费用的确认和计量

自 2022 年 1 月 1 日起适用

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。

2022 年 1 月 1 日前适用

- (1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 的年费率逐日计提；
- (2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率逐日计提；
- (3) 本基金的 A 类基金份额不收取销售服务费；本基金的 C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 的年费率逐日计提；
- (4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；
- (5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

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

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》（财会〔2017〕7 号）、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》（财会〔2017〕8 号）、《企业会计准则第 24 号——套期会计》（财会〔2017〕9 号）、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（财会〔2017〕14 号）（以下简称新金融工具相关会计准则）和《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》（财会〔2020〕22 号），自 2022 年 1 月 1 日起，本基金开始执行新金融工具相关会计准则，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新准则与现行准则的差异追溯调整报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：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。本基金需考虑自身业务模式以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

2022 年 1 月 1 日各项金融资产和金融负债按照修订前后金融工具确认计量准则的规定进行分类和计量结果对比如下：

金融资产/负债类别	修订前的金融工具确认计量准则		修订后的金融工具确认计量准则	
	计量类别	账面价值	计量类别	账面价值
金融资产				

银行存款	摊余成本（应收款项）	6,049,943.16	摊余成本	6,050,597.23
结算备付金	摊余成本（应收款项）	526,585.31	摊余成本	526,822.31
存出保证金	摊余成本（应收款项）	14,911.18	摊余成本	14,917.88
交易性金融资产	以公允价值计量且其变动计入当期损益	96,912,244.86	以公允价值计量且其变动计入当期损益	96,912,244.86
应收利息	摊余成本（应收款项）	897.77	—	—
应收申购款	摊余成本（应收款项）	194,399.53	摊余成本	194,399.53
金融负债				
应付赎回款	摊余成本	455,253.32	摊余成本	455,253.32
应付管理人报酬	摊余成本	73,253.93	摊余成本	73,253.93
应付托管费	摊余成本	14,650.76	摊余成本	14,650.76
应付销售服务费	摊余成本	15,469.64	摊余成本	15,469.64
应付交易费用	摊余成本	345,713.50	—	—
其他负债	摊余成本	130,304.71	摊余成本	476,018.21

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。

(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；

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收增值税。

(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；

目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内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；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税。

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	
	2022 年 6 月 30 日	
活期存款		21,177,723.82
等于：本金		21,174,953.16
加：应计利息		2,770.66
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		21,177,723.82

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	330,319,534.84	-	349,359,695.18	19,040,160.34
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	330,319,534.84	-	349,359,695.18	19,040,160.34

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 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	100.67
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,417,811.48
其中：交易所市场	1,417,811.48
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	164,547.97
合计	1,582,460.12

6.4.7.7 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	21,939,024.41	21,939,024.41
本期申购	148,120,910.20	148,120,910.20
本期赎回（以“-”号填列）	-15,213,475.95	-15,213,475.95
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	154,846,458.66	154,846,458.66

万家中证 500 指数增强发起式 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	33,050,172.85	33,050,172.85
本期申购	207,511,170.36	207,511,170.36

本期赎回（以“-”号填列）	-127,494,557.64	-127,494,557.64
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	113,066,785.57	113,066,785.57

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

万家中证 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
本期期初	21,130,933.35	-1,804,780.66	19,326,152.69
本期利润	9,572,572.25	9,601,711.92	19,174,284.17
本期基金份额交易产生的变动数	80,630,256.84	-20,813,348.18	59,816,908.66
其中：基金申购款	92,024,595.81	-23,397,063.52	68,627,532.29
基金赎回款	-11,394,338.97	2,583,715.34	-8,810,623.63
本期已分配利润	-37,684,843.90	-	-37,684,843.90
本期末	73,648,918.54	-13,016,416.92	60,632,501.62

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
本期期初	31,038,507.09	-2,689,521.09	28,348,986.00
本期利润	3,363,432.20	9,247,321.98	12,610,754.18
本期基金份额交易产生的变动数	46,287,415.43	-15,970,568.61	30,316,846.82
其中：基金申购款	124,677,197.98	-33,182,315.05	91,494,882.93
基金赎回款	-78,389,782.55	17,211,746.44	-61,178,036.11
本期已分配利润	-29,133,746.63	-	-29,133,746.63
本期末	51,555,608.09	-9,412,767.72	42,142,840.37

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	27,907.95
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	10,007.39
其他	286.48
合计	38,201.82

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 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	10,869,579.53
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	10,869,579.53

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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	935,367,130.66
减：卖出股票成本总额	921,646,269.48
减：交易费用	2,851,281.65
买卖股票差价收入	10,869,579.53

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 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,940,543.58
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	2,940,543.58

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	18,849,033.90
股票投资	18,849,033.90
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	18,849,033.90

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	449,961.10
基金转换费收入	644.83
合计	450,605.93

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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 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	-
银行费用	342.00
指数使用费	20,000.00
合计	74,889.97

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，中国证监会核准新疆国际实业股份有限公司将其持有的万家基金 40%股权转让给山东省新动能基金管理有限公司。股权变更后，万家基金股东变更为中泰证券股份有限公司（49%），山东省新动能基金管理有限公司（40%），齐河众鑫投资有限公司（11%）。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司（“万家基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
中泰证券股份有限公司（“中泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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

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 2022年1月1日至2022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(%)
-	-	-	-	-

关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	61,531.57	48.47	31,855.90	44.22

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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	909,759.95	181,458.52
其中：支付销售机构的客户维护费	188,230.55	43,809.17

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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	181,951.93	36,291.69

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	-	35,892.17	35,892.17
中泰证券	-	5,167.48	5,167.48
工商银行	-	4,980.89	4,980.89
合计	-	46,040.54	46,040.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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	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

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 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	-	-
报告期初持有的基金份额	10,001,000.10	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/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	6.4587%	-
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	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	-	-

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%	-

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	21,177,723.82	27,907.95	2,716,209.70	4,305.93

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

单位：人民币元

万家中证 500 指数增强发起式 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
		场内	场外					
1	2022年1月14日	-	2022年1月14日	0.8810	1,702,360.35	242,043.49	1,944,403.84	-
2	2022年6月24日	-	2022年6月24日	2.3760	29,926,118.21	5,814,321.85	35,740,440.06	-
合计	-	-	-	3.2570	31,628,478.56	6,056,365.34	37,684,843.90	-
万家中证 500 指数增强发起式 C								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
		场内	场外					
1	2022年1	-	2022年1月	0.8580	1,049,05	1,899,500.	2,948,56	-

	月 14 日		14 日		9.94	88	0.82	
2	2022 年 6 月 24 日	-	2022 年 6 月 24 日	2.3440	13,656,716.24	12,528,469.57	26,185,185.81	-
合计	-	-	-	3.2020	14,705,776.18	14,427,970.45	29,133,746.63	-

6.4.12 期末(2022 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
301112	信邦智能	2022 年 6 月 20 日	6 个月	新股流通受限	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-
301175	中科环保	2022 年 6 月 30 日	1 个月内(含)	新股未上市	3.82	3.82	40,986	156,566.52	156,566.52	-
301175	中科环保	2022 年 06 月 30 日	6 个月	新股流通受限	3.82	3.82	4,555	17,400.10	17,400.10	-
301220	亚香股份	2022 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通受限	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-
301233	盛帮股份	2022 年 6 月 24 日	1 个月内(含)	新股未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301233	盛帮股份	2022 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-
301238	瑞泰新材	2022 年 6 月 10 日	6 个月	新股流通受限	19.18	32.07	1,332	25,547.76	42,717.24	-
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	1 个月内(含)	新股未上市	33.65	33.65	4,957	166,803.05	166,803.05	-
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	6 个月	新股流通受限	33.65	33.65	551	18,541.15	18,541.15	-
301286	侨源股份	2022 年 6 月 6 日	6 个月	新股流通受限	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	-
301302	华如	2022 年	6 个月	新股流	52.03	56.42	402	20,916.06	22,680.84	-

	科技	6 月 16 日		通受限						
688400	凌云光	2022 年 6 月 27 日	1 个月内(含)	新股未上市	21.93	21.93	7,911	173,488.23	173,488.23	-

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 2022 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 2022 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 2022 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(2022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、存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	21,177,723.82	-	-	-	-	-	21,177,723.82
结算备付金	4,317,328.78	-	-	-	-	-	4,317,328.78
存出保证金	94,114.72	-	-	-	-	-	94,114.72
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-349,359,695.18	-349,359,695.18
应收申购款	221.77	-	-	-	-	1,080,431.82	1,080,653.59
应收清算款	-	-	-	-	-	11,696,826.09	11,696,826.09
资产总计	25,589,389.09	-	-	-	-	-362,136,953.09	387,726,342.18
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	14,968,436.73	14,968,436.73
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	351,353.03	351,353.03
应付托管费	-	-	-	-	-	70,270.59	70,270.59
应付销售服务费	-	-	-	-	-	65,235.49	65,235.49
其他负债	-	-	-	-	-	1,582,460.12	1,582,460.12
负债总计	-	-	-	-	-	17,037,755.96	17,037,755.96
利率敏感度缺口	25,589,389.09	-	-	-	-	-345,099,197.13	370,688,586.22
上年度末 2021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	6,049,943.16	-	-	-	-	-	6,049,943.16
结算备付金	526,585.31	-	-	-	-	-	526,585.31
存出保证金	14,911.18	-	-	-	-	-	14,911.18
交易性金融资产	-	-	-	-	-	96,912,244.86	96,912,244.86
其他资产	-	-	-	-	-	897.77	897.77
应收申购款	-	-	-	-	-	194,399.53	194,399.53
资产总计	6,591,439.65	-	-	-	-	97,107,542.16	103,698,981.81
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	455,253.32	455,253.32
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	73,253.93	73,253.93
应付托管费	-	-	-	-	-	14,650.76	14,650.76
应付销售服务费	-	-	-	-	-	15,469.64	15,469.64
其他负债	-	-	-	-	-	476,018.21	476,018.21
负债总计	-	-	-	-	-	1,034,645.86	1,034,645.86
利率敏感度缺口	6,591,439.65	-	-	-	-	-96,072,896.30	102,664,335.95

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 2022 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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	349,359,695.18	94.25	96,912,244.86	94.40
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	349,359,695.18	94.25	96,912,244.86	94.40

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，在扣除股票期权、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		
	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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	1. 股票基准指数下降 100 个基点	-3,626,759.48	-949,482.93
	2. 股票基准指数上升 100 个基点	3,626,759.48	949,482.93

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 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	348,651,418.46	96,906,740.37
第二层次	598,234.57	5,504.49
第三层次	110,042.15	-
合计	349,359,695.18	96,912,244.86

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。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本期末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银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息以及其他金融负债，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	349,359,695.18	90.10
	其中：股票	349,359,695.18	90.10
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	25,495,052.60	6.58
8	其他各项资产	12,871,594.40	3.32
9	合计	387,726,342.18	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	4,175,469.60	1.13

B	采矿业	22,635,781.16	6.11
C	制造业	174,407,345.10	47.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,163,461.00	1.66
E	建筑业	2,787,217.00	0.75
F	批发和零售业	4,470,749.80	1.21
G	交通运输、仓储和邮政业	14,087,248.70	3.80
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,638,264.10	5.57
J	金融业	18,308,647.03	4.94
K	房地产业	9,399,912.75	2.54
L	租赁和商务服务业	2,826,775.00	0.76
M	科学研究和技术服务业	546,240.00	0.15
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	2,245,420.00	0.61
R	文化、体育和娱乐业	3,670,099.00	0.99
S	综合	2,132,532.00	0.58
	合计	288,495,162.24	77.83

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,833,767.00	0.49
B	采矿业	732,498.00	0.20
C	制造业	36,001,735.23	9.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,055,932.00	0.82
E	建筑业	7,375,140.00	1.99
F	批发和零售业	1,795,098.00	0.48
G	交通运输、仓储和邮政业	611,690.00	0.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,631,433.84	0.71

J	金融业	2,127,001.60	0.57
K	房地产业	2,850,547.00	0.77
L	租赁和商务服务业	20,739.45	0.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,322,330.62	0.36
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	6,416.00	0.00
Q	卫生和社会工作	368,079.20	0.10
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	132,125.00	0.04
	合计	60,864,532.94	16.42

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002240	盛新锂能	100,300	6,054,108.00	1.63
2	000970	中科三环	299,071	5,616,553.38	1.52
3	600392	盛和资源	222,500	5,028,500.00	1.36
4	688819	天能股份	143,700	4,969,146.00	1.34
5	002156	通富微电	304,364	4,687,205.60	1.26
6	002756	永兴材料	30,400	4,627,184.00	1.25
7	000402	金融街	752,800	4,479,160.00	1.21
8	600256	广汇能源	417,300	4,398,342.00	1.19
9	600985	淮北矿业	295,600	4,303,936.00	1.16
10	603613	国联股份	47,802	4,235,257.20	1.14
11	300618	寒锐钴业	72,800	4,216,576.00	1.14
12	688521	芯原股份	84,571	4,177,807.40	1.13
13	600486	扬农化工	31,000	4,131,680.00	1.11
14	300017	网宿科技	756,900	4,056,984.00	1.09
15	601869	长飞光纤	128,324	3,967,778.08	1.07
16	002468	申通快递	307,000	3,659,440.00	0.99
17	601128	常熟银行	469,800	3,589,272.00	0.97
18	603605	珀莱雅	21,600	3,567,888.00	0.96

19	600141	兴发集团	80,200	3,527,998.00	0.95
20	600160	巨化股份	266,700	3,507,105.00	0.95
21	002506	协鑫集成	899,900	3,347,628.00	0.90
22	600380	健康元	267,700	3,306,095.00	0.89
23	300001	特锐德	188,000	3,254,280.00	0.88
24	603379	三美股份	146,100	3,250,725.00	0.88
25	603650	彤程新材	98,800	3,218,904.00	0.87
26	002249	大洋电机	522,000	3,205,080.00	0.86
27	600967	内蒙一机	344,900	3,145,488.00	0.85
28	002128	电投能源	219,300	3,140,376.00	0.85
29	600879	航天电子	475,800	3,087,942.00	0.83
30	603317	天味食品	107,300	3,054,831.00	0.82
31	600376	首开股份	609,800	2,994,118.00	0.81
32	688099	晶晨股份	29,600	2,989,600.00	0.81
33	601098	中南传媒	316,600	2,988,704.00	0.81
34	000878	云南铜业	258,800	2,947,732.00	0.80
35	601872	招商轮船	493,700	2,843,712.00	0.77
36	603719	良品铺子	98,800	2,828,644.00	0.76
37	600415	小商品城	507,500	2,826,775.00	0.76
38	600233	圆通速递	133,110	2,714,112.90	0.73
39	600120	浙江东方	671,257	2,691,740.57	0.73
40	000559	万向钱潮	447,624	2,658,886.56	0.72
41	601298	青岛港	480,400	2,627,788.00	0.71
42	601696	中银证券	197,500	2,626,750.00	0.71
43	601577	长沙银行	330,200	2,618,486.00	0.71
44	000983	山西焦煤	194,800	2,608,372.00	0.70
45	000869	张裕 A	87,700	2,608,198.00	0.70
46	300257	开山股份	173,200	2,591,072.00	0.70
47	300308	中际旭创	82,900	2,574,045.00	0.69
48	002444	巨星科技	136,200	2,566,008.00	0.69
49	300363	博腾股份	32,700	2,550,273.00	0.69
50	000831	五矿稀土	80,100	2,503,125.00	0.68
51	600236	桂冠电力	411,000	2,502,990.00	0.68
52	688390	固德威	7,780	2,435,217.80	0.66
53	002124	天邦食品	356,680	2,396,889.60	0.65
54	600039	四川路桥	225,300	2,372,409.00	0.64
55	000553	安道麦 A	194,200	2,351,762.00	0.63
56	300244	迪安诊断	72,200	2,245,420.00	0.61
57	600435	北方导航	257,500	2,219,650.00	0.60
58	600959	江苏有线	677,400	2,208,324.00	0.60
59	300482	万孚生物	52,500	2,137,275.00	0.58
60	601456	国联证券	173,600	2,130,072.00	0.57

61	600079	人福医药	128,900	2,062,400.00	0.56
62	300769	德方纳米	5,000	2,043,400.00	0.55
63	600126	杭钢股份	394,300	2,018,816.00	0.54
64	688321	微芯生物	77,200	1,944,668.00	0.52
65	600863	内蒙华电	531,900	1,941,435.00	0.52
66	601718	际华集团	625,700	1,939,670.00	0.52
67	002945	华林证券	126,400	1,927,600.00	0.52
68	600522	中天科技	83,100	1,919,610.00	0.52
69	600549	厦门钨业	87,900	1,900,398.00	0.51
70	002797	第一创业	294,600	1,888,386.00	0.51
71	002653	海思科	116,500	1,876,815.00	0.51
72	600166	福田汽车	659,079	1,865,193.57	0.50
73	600673	东阳光	206,000	1,851,940.00	0.50
74	601699	潞安环能	126,500	1,849,430.00	0.50
75	002382	蓝帆医疗	188,300	1,798,265.00	0.49
76	000629	攀钢钒钛	472,500	1,795,500.00	0.48
77	300037	新宙邦	33,920	1,782,835.20	0.48
78	600598	北大荒	120,500	1,778,580.00	0.48
79	600118	中国卫星	85,300	1,712,824.00	0.46
80	600885	宏发股份	39,600	1,657,260.00	0.45
81	000898	鞍钢股份	499,200	1,607,424.00	0.43
82	000937	冀中能源	192,300	1,434,558.00	0.39
83	300072	海新能科	274,400	1,388,464.00	0.37
84	300073	当升科技	15,300	1,382,202.00	0.37
85	600153	建发股份	104,700	1,368,429.00	0.37
86	002244	滨江集团	147,300	1,274,145.00	0.34
87	600732	爱旭股份	36,400	1,201,928.00	0.32
88	601156	东航物流	60,656	1,200,988.80	0.32
89	601958	金钼股份	133,900	1,183,676.00	0.32
90	605117	德业股份	4,200	1,175,538.00	0.32
91	600956	新天绿能	91,800	1,130,976.00	0.31
92	600316	洪都航空	32,800	991,872.00	0.27
93	600418	江淮汽车	57,800	991,848.00	0.27
94	300212	易华录	56,700	986,580.00	0.27
95	002497	雅化集团	29,300	956,645.00	0.26
96	603589	口子窖	16,300	955,343.00	0.26
97	600566	济川药业	32,600	885,416.00	0.24
98	002155	湖南黄金	72,200	876,508.00	0.24
99	600563	法拉电子	4,171	855,722.36	0.23
100	600862	中航高科	30,300	851,430.00	0.23
101	002901	大博医疗	21,740	850,903.60	0.23
102	002203	海亮股份	73,600	850,080.00	0.23

103	600499	科达制造	40,300	831,792.00	0.22
104	601717	郑煤机	57,600	830,016.00	0.22
105	300724	捷佳伟创	9,287	829,793.45	0.22
106	000738	航发控制	29,100	817,710.00	0.22
107	600096	云天化	25,500	802,740.00	0.22
108	300376	易事特	97,600	792,512.00	0.21
109	000960	锡业股份	46,100	773,097.00	0.21
110	600026	中远海能	71,400	737,562.00	0.20
111	300285	国瓷材料	20,400	732,768.00	0.20
112	601615	明阳智能	21,500	726,700.00	0.20
113	002212	天融信	67,300	683,095.00	0.18
114	601928	凤凰传媒	95,300	681,395.00	0.18
115	600699	均胜电子	43,100	677,101.00	0.18
116	300699	光威复材	11,200	659,344.00	0.18
117	603026	石大胜华	4,500	654,075.00	0.18
118	600348	华阳股份	41,496	641,528.16	0.17
119	688256	寒武纪	9,905	640,853.50	0.17
120	002019	亿帆医药	45,300	633,294.00	0.17
121	000830	鲁西化工	36,300	627,627.00	0.17
122	601991	大唐发电	242,000	588,060.00	0.16
123	601058	赛轮轮胎	51,400	579,278.00	0.16
124	603127	昭衍新药	4,800	546,240.00	0.15
125	600536	中国软件	13,400	543,906.00	0.15
126	002683	广东宏大	19,500	542,685.00	0.15
127	600765	中航重机	16,680	536,762.40	0.14
128	002180	纳思达	10,500	531,510.00	0.14
129	600901	江苏租赁	102,600	526,338.00	0.14
130	002603	以岭药业	19,100	464,130.00	0.13
131	000975	银泰黄金	45,500	443,170.00	0.12
132	601168	西部矿业	34,100	403,403.00	0.11
133	002326	永太科技	11,600	381,988.00	0.10
134	600399	抚顺特钢	21,000	375,900.00	0.10
135	600507	方大特钢	51,800	362,082.00	0.10
136	000537	广宇发展	27,825	361,446.75	0.10
137	002399	海普瑞	20,500	360,390.00	0.10
138	600801	华新水泥	17,600	343,376.00	0.09
139	002081	金螳螂	65,800	334,264.00	0.09
140	002281	光迅科技	18,700	328,746.00	0.09
141	002745	木林森	31,700	309,709.00	0.08
142	002353	杰瑞股份	7,500	302,250.00	0.08
143	002004	华邦健康	53,200	296,856.00	0.08
144	002422	科伦药业	15,500	289,850.00	0.08

145	000519	中兵红箭	9,900	288,585.00	0.08
146	600968	海油发展	111,500	287,670.00	0.08
147	688180	君实生物	3,800	286,292.00	0.08
148	000009	中国宝安	20,800	280,592.00	0.08
149	600006	东风汽车	36,600	276,330.00	0.07
150	002572	索菲亚	9,800	269,500.00	0.07
151	002625	光启技术	15,400	265,958.00	0.07
152	600546	山煤国际	13,500	262,710.00	0.07
153	300474	景嘉微	3,650	249,623.50	0.07
154	600529	山东药玻	8,900	248,755.00	0.07
155	600409	三友化工	29,800	244,062.00	0.07
156	001914	招商积余	13,500	242,595.00	0.07
157	601228	广州港	64,600	237,082.00	0.06
158	002250	联化科技	13,000	212,810.00	0.06
159	600497	驰宏锌锗	39,800	206,562.00	0.06
160	600298	安琪酵母	4,100	199,875.00	0.05
161	000807	云铝股份	20,100	198,588.00	0.05
162	600259	广晟有色	3,900	197,535.00	0.05
163	300390	天华超净	2,000	174,800.00	0.05
164	601992	金隅集团	60,400	167,308.00	0.05
165	603868	飞科电器	2,200	166,650.00	0.04
166	000987	越秀金控	23,530	165,415.90	0.04
167	603198	迎驾贡酒	2,100	136,794.00	0.04
168	600487	亨通光电	8,700	126,498.00	0.03
169	600988	赤峰黄金	7,400	118,030.00	0.03
170	601005	重庆钢铁	61,700	117,847.00	0.03
171	002268	卫士通	2,700	115,857.00	0.03
172	600705	中航产融	30,600	105,876.00	0.03
173	603786	科博达	1,600	98,512.00	0.03
174	000060	中金岭南	21,300	94,998.00	0.03
175	002705	新宝股份	3,900	85,761.00	0.02
176	688122	西部超导	900	82,980.00	0.02
177	601611	中国核建	9,600	80,544.00	0.02
178	002409	雅克科技	1,400	77,714.00	0.02
179	603885	吉祥航空	3,700	66,563.00	0.02
180	000778	新兴铸管	12,900	62,178.00	0.02
181	002985	北摩高科	1,020	59,751.60	0.02
182	000717	韶钢松山	16,700	58,450.00	0.02
183	600325	华发股份	6,400	48,448.00	0.01
184	600516	方大炭素	6,200	47,120.00	0.01
185	002092	中泰化学	5,800	45,008.00	0.01
186	001227	兰州银行	7,868	38,710.56	0.01

187	603456	九洲药业	500	25,850.00	0.01
188	600056	中国医药	740	10,966.80	0.00
189	000988	华工科技	300	6,951.00	0.00
190	600177	雅戈尔	300	1,989.00	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601390	中国中铁	685,100	4,206,514.00	1.13
2	600578	京能电力	871,400	2,727,482.00	0.74
3	688008	澜起科技	38,100	2,308,098.00	0.62
4	300647	超频三	201,300	2,262,612.00	0.61
5	002405	四维图新	147,800	2,227,346.00	0.60
6	300393	中来股份	119,100	2,024,700.00	0.55
7	002340	格林美	216,600	1,971,060.00	0.53
8	688520	神州细胞	36,700	1,898,491.00	0.51
9	002947	恒铭达	102,610	1,888,024.00	0.51
10	688567	孚能科技	65,400	1,858,014.00	0.50
11	603968	醋化股份	86,900	1,790,140.00	0.48
12	300389	艾比森	164,500	1,709,155.00	0.46
13	603586	金麒麟	131,400	1,697,688.00	0.46
14	300233	金城医药	58,200	1,660,446.00	0.45
15	600604	市北高新	280,700	1,639,288.00	0.44
16	603959	百利科技	132,700	1,608,324.00	0.43
17	601668	中国建筑	268,500	1,428,420.00	0.39
18	300761	立华股份	33,300	1,323,675.00	0.36
19	300816	艾可蓝	37,800	1,148,364.00	0.31
20	002085	万丰奥威	154,900	831,813.00	0.22
21	300194	福安药业	219,900	824,625.00	0.22
22	600383	金地集团	57,700	775,488.00	0.21
23	601881	中国银河	79,900	772,633.00	0.21
24	002032	苏泊尔	13,500	760,590.00	0.21
25	688981	中芯国际	16,000	722,720.00	0.19
26	300429	强力新材	74,700	708,903.00	0.19
27	002229	鸿博股份	106,400	708,624.00	0.19
28	002277	友阿股份	142,100	659,344.00	0.18
29	603538	美诺华	19,805	630,789.25	0.17
30	002413	雷科防务	107,510	596,680.50	0.16
31	000166	申万宏源	137,000	587,730.00	0.16
32	002303	美盈森	156,200	538,890.00	0.15
33	603993	洛阳钼业	90,100	516,273.00	0.14
34	300068	南都电源	32,500	498,550.00	0.13

35	600919	江苏银行	69,030	491,493.60	0.13
36	002458	益生股份	50,600	474,122.00	0.13
37	002120	韵达股份	26,000	443,560.00	0.12
38	300131	英唐智控	84,400	442,256.00	0.12
39	300735	光弘科技	35,464	370,598.80	0.10
40	002733	雄韬股份	20,800	362,128.00	0.10
41	300890	翔丰华	6,000	331,920.00	0.09
42	600639	浦东金桥	24,100	327,519.00	0.09
43	000034	神州数码	20,100	305,922.00	0.08
44	002840	华统股份	17,300	305,345.00	0.08
45	300706	阿石创	11,600	301,252.00	0.08
46	002258	利尔化学	12,320	290,998.40	0.08
47	688005	容百科技	2,016	260,951.04	0.07
48	603186	华正新材	9,300	249,984.00	0.07
49	601238	广汽集团	16,300	248,412.00	0.07
50	600107	美尔雅	38,400	236,160.00	0.06
51	002669	康达新材	17,500	233,800.00	0.06
52	603799	华友钴业	2,400	229,488.00	0.06
53	300035	中科电气	7,800	218,010.00	0.06
54	601808	中海油服	15,500	216,225.00	0.06
55	601933	永辉超市	46,800	200,304.00	0.05
56	002074	国轩高科	4,300	196,080.00	0.05
57	300346	南大光电	5,400	194,292.00	0.05
58	600929	雪天盐业	20,500	190,240.00	0.05
59	002561	徐家汇	16,200	187,272.00	0.05
60	301239	普瑞眼科	5,508	185,344.20	0.05
61	300143	盈康生命	16,100	182,735.00	0.05
62	600165	新日恒力	18,000	182,700.00	0.05
63	300657	弘信电子	15,100	175,462.00	0.05
64	301175	中科环保	45,541	173,966.62	0.05
65	688400	凌云光	7,911	173,488.23	0.05
66	600029	南方航空	23,000	168,130.00	0.05
67	600688	上海石化	51,600	164,088.00	0.04
68	601865	福莱特	4,300	163,830.00	0.04
69	300666	江丰电子	2,600	158,600.00	0.04
70	002182	云海金属	6,200	155,496.00	0.04
71	300382	斯莱克	9,700	151,999.00	0.04
72	002805	丰元股份	2,400	148,560.00	0.04
73	000627	天茂集团	43,300	147,653.00	0.04
74	600370	三房巷	41,100	144,261.00	0.04
75	000601	韶能股份	28,600	144,144.00	0.04
76	002433	太安堂	29,500	137,175.00	0.04

77	002009	天奇股份	7,300	135,050.00	0.04
78	600770	综艺股份	15,100	132,125.00	0.04
79	603861	白云电器	16,200	132,030.00	0.04
80	300712	永福股份	2,300	131,882.00	0.04
81	600640	新国脉	11,600	121,684.00	0.03
82	600795	国电电力	30,200	118,082.00	0.03
83	688037	芯源微	800	115,976.00	0.03
84	603078	江化微	4,000	114,280.00	0.03
85	688589	力合微	2,500	112,050.00	0.03
86	600048	保利发展	6,200	108,252.00	0.03
87	300607	拓斯达	8,160	107,875.20	0.03
88	300910	瑞丰新材	1,700	107,474.00	0.03
89	300763	锦浪科技	500	106,500.00	0.03
90	603063	禾望电气	2,600	99,970.00	0.03
91	688596	正帆科技	4,500	89,190.00	0.02
92	600636	国新文化	11,900	87,584.00	0.02
93	000567	海德股份	5,900	87,320.00	0.02
94	002459	晶澳科技	1,100	86,790.00	0.02
95	688518	联赢激光	2,500	84,975.00	0.02
96	603500	祥和实业	4,700	69,372.00	0.02
97	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.02
98	300130	新国都	5,300	64,978.00	0.02
99	603306	华懋科技	1,800	61,020.00	0.02
100	688339	亿华通	580	57,060.40	0.02
101	002466	天齐锂业	400	49,920.00	0.01
102	300267	尔康制药	13,400	46,498.00	0.01
103	300181	佐力药业	4,300	42,742.00	0.01
104	301238	瑞泰新材	1,332	42,717.24	0.01
105	601236	红塔证券	4,400	40,172.00	0.01
106	300436	广生堂	1,100	39,501.00	0.01
107	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
108	002298	中电兴发	5,600	36,736.00	0.01
109	603477	巨星农牧	1,500	35,970.00	0.01
110	600509	天富能源	6,800	34,544.00	0.01
111	600011	华能国际	4,500	31,680.00	0.01
112	300341	麦克奥迪	3,400	30,906.00	0.01
113	001323	慕思股份	573	28,111.38	0.01
114	603191	望变电气	1,149	26,197.20	0.01
115	688155	先惠技术	243	25,320.60	0.01
116	001318	阳光乳业	1,142	25,249.62	0.01
117	603206	嘉环科技	1,210	23,353.00	0.01
118	301302	华如科技	402	22,680.84	0.01

119	300373	扬杰科技	300	21,375.00	0.01
120	001228	永泰运	383	20,739.45	0.01
121	001308	康冠科技	667	19,456.39	0.01
122	600686	金龙汽车	2,600	18,096.00	0.00
123	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
124	603070	万控智造	775	16,197.50	0.00
125	300900	广联航空	600	16,020.00	0.00
126	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
127	001319	铭科精技	536	15,474.32	0.00
128	001313	粤海饲料	1,232	15,104.32	0.00
129	603097	江苏华辰	577	13,617.20	0.00
130	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
131	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
132	001266	宏英智能	197	9,808.63	0.00
133	603272	联翔股份	443	9,723.85	0.00
134	001234	泰慕士	333	9,017.64	0.00
135	300772	运达股份	300	7,632.00	0.00
136	600997	开滦股份	1,000	7,620.00	0.00
137	000526	学大教育	400	6,416.00	0.00
138	603668	天马科技	200	4,098.00	0.00
139	603676	卫信康	300	3,024.00	0.00
140	300739	明阳电路	100	1,602.00	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	600256	广汇能源	10,471,499.00	10.20
2	000738	航发控制	10,463,128.00	10.19
3	002340	格林美	8,731,271.00	8.50
4	600316	洪都航空	8,183,946.00	7.97
5	601390	中国中铁	8,062,636.00	7.85
6	002156	通富微电	7,795,073.04	7.59
7	300618	寒锐钴业	7,759,408.00	7.56
8	600376	首开股份	7,652,536.00	7.45
9	600233	圆通速递	7,588,129.60	7.39
10	002240	盛新锂能	7,582,386.00	7.39
11	688005	容百科技	7,453,988.84	7.26
12	601128	常熟银行	7,422,022.00	7.23
13	002506	协鑫集成	7,402,317.00	7.21
14	600549	厦门钨业	7,295,840.00	7.11
15	601992	金隅集团	7,291,151.00	7.10

16	300001	特锐德	7,146,625.97	6.96
17	600380	健康元	6,986,858.00	6.81
18	600392	盛和资源	6,962,932.00	6.78
19	600879	航天电子	6,937,247.00	6.76
20	000090	天健集团	6,893,966.00	6.72
21	600259	广晟有色	6,666,847.90	6.49
22	000878	云南铜业	6,586,979.00	6.42
23	002249	大洋电机	6,381,466.00	6.22
24	600985	淮北矿业	6,374,710.47	6.21
25	688819	天能股份	6,347,047.31	6.18
26	000402	金融街	6,334,205.00	6.17
27	000629	攀钢钒钛	6,241,509.00	6.08
28	601228	广州港	6,073,131.00	5.92
29	603379	三美股份	6,068,826.00	5.91
30	600967	内蒙一机	6,053,509.00	5.90
31	000401	冀东水泥	6,025,821.00	5.87
32	600118	中国卫星	5,989,051.00	5.83
33	000970	中科三环	5,965,672.36	5.81
34	002468	申通快递	5,944,701.00	5.79
35	601699	潞安环能	5,901,823.00	5.75
36	688521	芯原股份	5,846,395.64	5.69
37	600486	扬农化工	5,808,689.00	5.66
38	002180	纳思达	5,722,867.00	5.57
39	601098	中南传媒	5,708,062.00	5.56
40	601298	青岛港	5,701,149.00	5.55
41	601872	招商轮船	5,652,591.00	5.51
42	002756	永兴材料	5,611,601.00	5.47
43	601718	际华集团	5,566,626.00	5.42
44	300363	博腾股份	5,505,891.00	5.36
45	300017	网宿科技	5,374,489.00	5.24
46	600862	中航高科	5,359,777.00	5.22
47	600497	驰宏锌锗	5,343,206.00	5.20
48	002128	电投能源	5,303,947.00	5.17
49	601869	长飞光纤	5,295,081.40	5.16
50	600325	华发股份	5,260,940.00	5.12
51	002124	天邦食品	5,244,678.60	5.11
52	002497	雅化集团	5,220,776.00	5.09
53	300761	立华股份	5,177,669.00	5.04
54	600639	浦东金桥	5,169,567.63	5.04
55	600765	中航重机	5,134,198.60	5.00
56	688321	微芯生物	5,097,326.63	4.97
57	600863	内蒙华电	5,097,196.00	4.96

58	600141	兴发集团	5,089,943.00	4.96
59	600160	巨化股份	5,041,752.00	4.91
60	600522	中天科技	5,028,362.00	4.90
61	000960	锡业股份	5,005,998.00	4.88
62	603589	口子窖	4,989,875.00	4.86
63	600039	四川路桥	4,944,486.00	4.82
64	601577	长沙银行	4,897,937.00	4.77
65	603290	斯达半导	4,824,995.00	4.70
66	603613	国联股份	4,820,648.01	4.70
67	000733	振华科技	4,804,521.26	4.68
68	688099	晶晨股份	4,803,635.99	4.68
69	601865	福莱特	4,800,008.00	4.68
70	688536	思瑞浦	4,740,980.96	4.62
71	600166	福田汽车	4,703,115.92	4.58
72	603605	珀莱雅	4,604,089.40	4.48
73	600673	东阳光	4,581,621.00	4.46
74	600383	金地集团	4,547,113.00	4.43
75	300724	捷佳伟创	4,494,526.08	4.38
76	300073	当升科技	4,486,122.00	4.37
77	600415	小商品城	4,472,218.00	4.36
78	600236	桂冠电力	4,443,952.00	4.33
79	603198	迎驾贡酒	4,424,191.00	4.31
80	002268	卫士通	4,420,785.00	4.31
81	000983	山西焦煤	4,386,436.00	4.27
82	002405	四维图新	4,355,865.00	4.24
83	600970	中材国际	4,335,873.00	4.22
84	600959	江苏有线	4,332,224.00	4.22
85	002244	滨江集团	4,332,107.00	4.22
86	601689	拓普集团	4,327,981.20	4.22
87	002085	万丰奥威	4,313,748.00	4.20
88	601456	国联证券	4,308,001.00	4.20
89	000937	冀中能源	4,306,836.00	4.20
90	603968	醋化股份	4,303,576.00	4.19
91	600667	太极实业	4,297,996.00	4.19
92	002155	湖南黄金	4,277,442.00	4.17
93	600435	北方导航	4,258,680.00	4.15
94	603719	良品铺子	4,249,779.00	4.14
95	600546	山煤国际	4,249,327.00	4.14
96	000831	五矿稀土	4,187,338.00	4.08
97	603650	彤程新材	4,186,920.00	4.08
98	603127	昭衍新药	4,076,702.00	3.97
99	002413	雷科防务	3,992,611.60	3.89

100	002947	恒铭达	3,990,025.00	3.89
101	600529	山东药玻	3,989,071.00	3.89
102	300244	迪安诊断	3,986,755.00	3.88
103	300223	北京君正	3,911,423.00	3.81
104	000559	万向钱潮	3,909,365.84	3.81
105	601077	渝农商行	3,878,871.00	3.78
106	600348	华阳股份	3,867,654.04	3.77
107	600885	宏发股份	3,866,262.00	3.77
108	603708	家家悦	3,836,304.00	3.74
109	002204	大连重工	3,806,875.00	3.71
110	600604	市北高新	3,791,574.00	3.69
111	300037	新宙邦	3,737,363.20	3.64
112	600598	北大荒	3,713,217.00	3.62
113	000553	安道麦 A	3,708,295.00	3.61
114	688008	澜起科技	3,681,217.16	3.59
115	300429	强力新材	3,635,200.00	3.54
116	000869	张裕 A	3,635,071.00	3.54
117	600282	南钢股份	3,619,764.00	3.53
118	688065	凯赛生物	3,605,504.25	3.51
119	601696	中银证券	3,602,687.00	3.51
120	601117	中国化学	3,585,005.00	3.49
121	600026	中远海能	3,583,404.00	3.49
122	603317	天味食品	3,509,472.00	3.42
123	002444	巨星科技	3,474,982.00	3.38
124	603568	伟明环保	3,455,725.00	3.37
125	300009	安科生物	3,319,421.88	3.23
126	300257	开山股份	3,276,113.00	3.19
127	300647	超频三	3,266,546.00	3.18
128	600754	锦江酒店	3,262,418.00	3.18
129	002131	利欧股份	3,247,342.00	3.16
130	000898	鞍钢股份	3,234,724.00	3.15
131	600120	浙江东方	3,231,943.30	3.15
132	600578	京能电力	3,209,882.00	3.13
133	002120	韵达股份	3,193,704.00	3.11
134	300308	中际旭创	3,181,149.00	3.10
135	601156	东航物流	3,172,121.84	3.09
136	600908	无锡银行	3,116,671.00	3.04
137	600580	卧龙电驱	3,101,980.00	3.02
138	600188	兖矿能源	3,082,302.00	3.00
139	300482	万孚生物	3,064,588.00	2.99
140	000768	中航西飞	3,056,799.00	2.98
141	300769	德方纳米	3,011,958.78	2.93

142	300763	锦浪科技	2,995,745.50	2.92
143	300890	翔丰华	2,964,215.00	2.89
144	300072	海新能科	2,876,602.00	2.80
145	300498	温氏股份	2,861,056.00	2.79
146	002603	以岭药业	2,783,970.00	2.71
147	603866	桃李面包	2,782,163.33	2.71
148	000729	燕京啤酒	2,777,237.00	2.71
149	002865	钧达股份	2,769,561.00	2.70
150	601933	永辉超市	2,757,174.00	2.69
151	600153	建发股份	2,739,177.00	2.67
152	600801	华新水泥	2,720,091.07	2.65
153	002557	洽洽食品	2,697,889.22	2.63
154	603959	百利科技	2,653,361.00	2.58
155	600956	新天绿能	2,625,303.00	2.56
156	300902	国安达	2,592,711.80	2.53
157	688516	奥特维	2,568,348.05	2.50
158	603983	丸美股份	2,558,880.00	2.49
159	605358	立昂微	2,540,712.68	2.47
160	002185	华天科技	2,540,132.00	2.47
161	600126	杭钢股份	2,539,764.00	2.47
162	300181	佐力药业	2,512,350.00	2.45
163	002948	青岛银行	2,501,739.00	2.44
164	600079	人福医药	2,498,517.00	2.43
165	002281	光迅科技	2,492,837.00	2.43
166	002797	第一创业	2,492,702.00	2.43
167	002669	康达新材	2,484,860.00	2.42
168	600563	法拉电子	2,458,546.93	2.39
169	300681	英搏尔	2,456,560.00	2.39
170	603098	森特股份	2,442,640.00	2.38
171	000987	越秀金控	2,437,493.00	2.37
172	300382	斯莱克	2,425,728.00	2.36
173	688589	力合微	2,419,924.20	2.36
174	601881	中国银河	2,418,820.00	2.36
175	300389	艾比森	2,409,001.00	2.35
176	002945	华林证券	2,405,220.00	2.34
177	000975	银泰黄金	2,397,412.00	2.34
178	600372	中航电子	2,394,833.00	2.33
179	300700	岱勒新材	2,390,091.00	2.33
180	688390	固德威	2,383,715.34	2.32
181	000060	中金岭南	2,351,110.00	2.29
182	603456	九洲药业	2,347,145.00	2.29
183	600418	江淮汽车	2,323,710.00	2.26

184	601958	金钼股份	2,310,583.00	2.25
185	002258	利尔化学	2,309,968.00	2.25
186	300393	中来股份	2,278,405.00	2.22
187	002653	海思科	2,237,406.00	2.18
188	601198	东兴证券	2,204,512.00	2.15
189	688550	瑞联新材	2,183,312.66	2.13
190	601698	中国卫通	2,178,818.00	2.12
191	603586	金麒麟	2,107,950.00	2.05
192	600298	安琪酵母	2,100,643.00	2.05
193	000998	隆平高科	2,089,576.00	2.04
194	300233	金城医药	2,084,048.00	2.03
195	688560	明冠新材	2,083,626.56	2.03
196	000988	华工科技	2,081,444.00	2.03
197	002382	蓝帆医疗	2,081,235.00	2.03
198	600572	康恩贝	2,074,095.00	2.02
199	600663	陆家嘴	2,073,938.00	2.02
200	002299	圣农发展	2,066,848.00	2.01

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	000738	航发控制	9,812,865.05	9.56
2	688005	容百科技	8,915,969.70	8.68
3	600316	洪都航空	8,397,396.00	8.18
4	600259	广晟有色	8,300,931.00	8.09
5	002340	格林美	7,914,653.00	7.71
6	002180	纳思达	7,390,492.00	7.20
7	600497	驰宏锌锗	7,040,358.00	6.86
8	601992	金隅集团	7,033,269.00	6.85
9	000090	天健集团	6,901,275.00	6.72
10	600256	广汇能源	6,900,199.00	6.72
11	600549	厦门钨业	6,881,701.60	6.70
12	000401	冀东水泥	6,003,665.05	5.85
13	601228	广州港	5,958,789.00	5.80
14	600233	圆通速递	5,741,606.54	5.59
15	600546	山煤国际	5,728,833.21	5.58
16	601689	拓普集团	5,699,845.00	5.55
17	002506	协鑫集成	5,686,429.00	5.54
18	603589	口子窖	5,597,118.00	5.45
19	688536	思瑞浦	5,417,470.15	5.28
20	600765	中航重机	5,345,939.00	5.21

21	600862	中航高科	5,325,282.00	5.19
22	600970	中材国际	5,281,490.00	5.14
23	000733	振华科技	5,244,765.00	5.11
24	600325	华发股份	5,143,185.00	5.01
25	600639	浦东金桥	5,107,333.00	4.97
26	603290	斯达半导	5,081,907.00	4.95
27	601872	招商轮船	4,920,733.00	4.79
28	600376	首开股份	4,889,763.00	4.76
29	000629	攀钢钒钛	4,738,058.00	4.62
30	601128	常熟银行	4,735,493.00	4.61
31	603198	迎驾贡酒	4,682,771.80	4.56
32	002268	卫士通	4,641,717.00	4.52
33	601699	潞安环能	4,608,146.81	4.49
34	002204	大连重工	4,559,700.00	4.44
35	600118	中国卫星	4,553,511.76	4.44
36	601865	福莱特	4,540,113.00	4.42
37	600667	太极实业	4,464,904.00	4.35
38	300724	捷佳伟创	4,379,932.17	4.27
39	000960	锡业股份	4,262,206.00	4.15
40	600879	航天电子	4,246,826.00	4.14
41	300223	北京君正	4,209,937.00	4.10
42	002497	雅化集团	4,114,540.00	4.01
43	300761	立华股份	4,074,260.00	3.97
44	000987	越秀金控	4,073,076.10	3.97
45	300618	寒锐钴业	4,051,435.32	3.95
46	300001	特锐德	4,014,574.00	3.91
47	600529	山东药玻	4,008,399.00	3.90
48	600885	宏发股份	3,989,900.00	3.89
49	601117	中国化学	3,964,418.00	3.86
50	603127	昭衍新药	3,946,736.12	3.84
51	600348	华阳股份	3,910,021.00	3.81
52	300363	博腾股份	3,905,471.00	3.80
53	000878	云南铜业	3,876,771.00	3.78
54	601077	渝农商行	3,863,628.00	3.76
55	002155	湖南黄金	3,845,654.00	3.75
56	601718	际华集团	3,812,418.00	3.71
57	600522	中天科技	3,807,901.70	3.71
58	603708	家家悦	3,805,533.00	3.71
59	002249	大洋电机	3,800,091.00	3.70
60	600383	金地集团	3,774,711.00	3.68
61	600380	健康元	3,756,079.02	3.66
62	002413	雷科防务	3,714,338.00	3.62

63	688065	凯赛生物	3,701,543.31	3.61
64	600673	东阳光	3,696,543.00	3.60
65	600372	中航电子	3,691,916.00	3.60
66	600188	兖矿能源	3,688,895.00	3.59
67	002085	万丰奥威	3,658,351.00	3.56
68	600392	盛和资源	3,614,858.00	3.52
69	002865	钧达股份	3,596,585.00	3.50
70	000709	河钢股份	3,535,694.00	3.44
71	601958	金钼股份	3,515,364.00	3.42
72	000768	中航西飞	3,496,660.00	3.41
73	002156	通富微电	3,485,869.00	3.40
74	601390	中国中铁	3,480,237.00	3.39
75	600282	南钢股份	3,471,779.00	3.38
76	600754	锦江酒店	3,466,386.00	3.38
77	603379	三美股份	3,418,400.00	3.33
78	000877	天山股份	3,369,364.00	3.28
79	300700	岱勒新材	3,327,755.00	3.24
80	002124	天邦食品	3,325,842.00	3.24
81	002131	利欧股份	3,305,502.00	3.22
82	300073	当升科技	3,297,044.00	3.21
83	600580	卧龙电驱	3,293,995.00	3.21
84	603568	伟明环保	3,267,603.20	3.18
85	000729	燕京啤酒	3,254,706.00	3.17
86	600026	中远海能	3,251,067.00	3.17
87	300009	安科生物	3,231,915.92	3.15
88	600160	巨化股份	3,191,229.00	3.11
89	002244	滨江集团	3,171,478.80	3.09
90	002185	华天科技	3,155,038.13	3.07
91	002468	申通快递	3,152,159.00	3.07
92	300890	翔丰华	3,138,314.00	3.06
93	000937	冀中能源	3,137,122.00	3.06
94	600166	福田汽车	3,131,653.00	3.05
95	600863	内蒙华电	3,078,264.00	3.00
96	300429	强力新材	3,076,796.00	3.00
97	300763	锦浪科技	3,065,553.00	2.99
98	000988	华工科技	3,059,452.00	2.98
99	688321	微芯生物	3,040,605.88	2.96
100	601298	青岛港	3,019,267.00	2.94
101	600908	无锡银行	2,993,358.00	2.92
102	605358	立昂微	2,992,480.96	2.91
103	603456	九洲药业	2,901,624.00	2.83
104	600141	兴发集团	2,897,500.00	2.82

105	000970	中科三环	2,875,898.85	2.80
106	688521	芯原股份	2,866,673.99	2.79
107	600967	内蒙一机	2,819,855.00	2.75
108	603866	桃李面包	2,810,619.00	2.74
109	300498	温氏股份	2,806,354.00	2.73
110	002557	洽洽食品	2,800,616.00	2.73
111	601456	国联证券	2,796,217.00	2.72
112	603983	丸美股份	2,791,404.00	2.72
113	300902	国安达	2,782,335.00	2.71
114	688516	奥特维	2,738,866.55	2.67
115	601098	中南传媒	2,702,746.00	2.63
116	603098	森特股份	2,688,224.00	2.62
117	688099	晶晨股份	2,670,562.03	2.60
118	601933	永辉超市	2,667,237.00	2.60
119	002120	韵达股份	2,661,937.00	2.59
120	300037	新宙邦	2,655,627.00	2.59
121	603968	醋化股份	2,625,871.00	2.56
122	600039	四川路桥	2,601,137.00	2.53
123	300681	英搏尔	2,551,037.00	2.48
124	002603	以岭药业	2,524,658.00	2.46
125	002405	四维图新	2,522,727.00	2.46
126	600487	亨通光电	2,522,309.20	2.46
127	300382	斯莱克	2,484,314.00	2.42
128	002294	信立泰	2,479,509.00	2.42
129	002669	康达新材	2,477,497.00	2.41
130	300181	佐力药业	2,468,940.00	2.40
131	000998	隆平高科	2,448,785.00	2.39
132	601577	长沙银行	2,440,134.00	2.38
133	000060	中金岭南	2,438,329.00	2.38
134	002948	青岛银行	2,434,916.00	2.37
135	000997	新大陆	2,409,911.00	2.35
136	688589	力合微	2,386,584.13	2.32
137	002281	光迅科技	2,362,308.00	2.30
138	688550	瑞联新材	2,356,002.34	2.29
139	600604	市北高新	2,340,895.00	2.28
140	002947	恒铭达	2,322,867.05	2.26
141	002946	新乳业	2,251,809.00	2.19
142	002299	圣农发展	2,241,881.00	2.18
143	300399	天利科技	2,240,998.00	2.18
144	600801	华新水泥	2,224,706.00	2.17
145	600435	北方导航	2,215,057.00	2.16
146	600623	华谊集团	2,197,966.00	2.14

147	688560	明冠新材	2,186,952.03	2.13
148	300244	迪安诊断	2,182,311.00	2.13
149	600985	淮北矿业	2,179,988.00	2.12
150	002939	长城证券	2,179,371.00	2.12
151	601698	中国卫通	2,159,426.00	2.10
152	600959	江苏有线	2,137,405.00	2.08
153	002258	利尔化学	2,122,522.40	2.07
154	000975	银泰黄金	2,121,893.00	2.07
155	000983	山西焦煤	2,121,247.00	2.07
156	300607	拓斯达	2,066,307.00	2.01
157	300474	景嘉微	2,064,663.00	2.01
158	600663	陆家嘴	2,055,377.00	2.00

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	1,155,244,685.90
卖出股票收入（成交）总额	935,367,130.66

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投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	94,114.72
2	应收清算款	11,696,826.09
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,080,653.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,871,594.40

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	3,600	43,012.91	135,076,441.28	87.23	19,770,017.38	12.77
万家中证 500 指数增强发起式 C	7,573	14,930.25	85,528,008.53	75.64	27,538,777.04	24.36
合计	10,764	24,889.75	220,604,449.81	82.34	47,308,794.42	17.66

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	万家中证 500 指数增强发起式 A	155,415.18	0.1004
	万家中证 500 指数增强发起式 C	25,854.71	0.0229
	合计	181,269.89	0.0677

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	万家中证 500 指数增强发起式 A	10~50
	万家中证 500 指数增强发起式 C	0
	合计	10~50
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	0~10
	万家中证 500 指数增强发起式 C	0
	合计	0~10

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	3.73	10,001,000.10	3.73	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	3.73	10,001,000.10	3.73	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	21,939,024.41	33,050,172.85
本报告期基金总申购份额	148,120,910.20	207,511,170.36
减：本报告期基金总赎回份额	15,213,475.95	127,494,557.64
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	154,846,458.66	113,066,785.57

§ 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

本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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 (%)	
东亚前海证券	2	602,684,562.91	28.87	561,266.85	32.26	-
山西证券	2	529,324,599.71	25.35	387,095.08	22.25	-
国元证券	3	481,423,321.37	23.06	352,068.23	20.23	-
湘财证券	1	240,097,744.80	11.50	223,597.84	12.85	-
财通证券	1	234,356,891.89	11.22	215,914.03	12.41	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
第一创业	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-

东方财富证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	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，本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，本基金新增广发证券交易单元 1 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。

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	关于万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）的公告	指定媒介	2022-01-05
2	关于万家基金管理有限公司旗下部分基金参加中国工商银行申购及定投优惠活动公告	指定媒介	2022-01-05
3	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金分红公告	指定媒介	2022-01-12
4	关于万家中证 500 指数增强型发起式	指定媒介	2022-01-14

	证券投资基金恢复大额申购（含转换转入、定期定额投资）的公告		
5	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	指定媒介	2022-01-21
6	关于新增爱建证券及中天证券等机构为万家中证 500 指数增强基金销售机构的公告	指定媒介	2022-02-17
7	万家基金管理有限公司关于旗下基金新增新浪仓石等机构为销售机构并开通转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-02-21
8	万家基金管理有限公司关于旗下基金在华泰证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-02-25
9	万家基金管理有限公司关于旗下基金在恒泰证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-03-01
10	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在泰信财富开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-03-07
11	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金调整最低申购金额的公告	指定媒介	2022-03-22
12	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宜信普泽为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-03-24
13	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2021 年年度报告	指定媒介	2022-03-30
14	万家基金管理有限公司关于旗下基金在国金证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-04-06
15	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增攀赢基金为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-04-12
16	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	指定媒介	2022-04-21
17	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增日照银行股份有限公司为销售机构并开通相关业务的公告	指定媒介	2022-05-13
18	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中欧财富为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-05-26

19	关于万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	指定媒介	2022-06-01
20	万家基金管理有限公司关于旗下基金在九州证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-06-18
21	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金分红公告	指定媒介	2022-06-22
22	关于万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金恢复大额申购（含转换转入、定期定额投资）的公告	指定媒介	2022-06-25

§ 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	20220510 - 20220517 20220517 - 20220630	-	83,579,817.07	14,111,946.28	69,467,870.79	25.93
	2	20220101 - 20220118、 20220126 - 20220213	11,345,221.53	36,134,326.76	18,317,619.51	29,161,928.78	10.88
	3	20220511 - 20220511	-	23,883,757.47	3,900,000.00	19,983,757.47	7.46
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媒介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 2022 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

2022 年 8 月 30 日