

万家中证 500 指数增强型发起式证券投资  
基金  
2023 年中期报告

2023 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：2023 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>48</b>
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	70
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	70

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 .....	70
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 .....	70
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 .....	70
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	70
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	70
7.12 投资组合报告附注 .....	70
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>71</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	71
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	72
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 .....	72
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	72
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>72</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>73</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	73
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 .....	73
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	73
10.4 基金投资策略的改变 .....	73
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	73
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 .....	73
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	73
10.8 其他重大事件 .....	75
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>77</b>
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 .....	77
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>77</b>
12.1 备查文件目录 .....	77
12.2 存放地点 .....	77
12.3 查阅方式 .....	77

## § 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	2,749,820,243.14 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	1,298,811,780.08 份	1,451,008,463.06 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	郭明
	联系电话 021-38909626	010-66105799

电子邮箱	lanj@wjasset.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	4008880800	95588
传真	021-38909627	010-66105798
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区浦 电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	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(2023 年 1 月 1 日-2023 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
本期已实现收益	21,125,797.64	16,650,845.36
本期利润	-6,903,889.75	-31,391,095.23
加权平均基金份 额本期利润	-0.0130	-0.0478
本期加权平均净 值利润率	-0.91%	-3.40%
本期基金份额净 值增长率	3.82%	3.61%
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利	322,730,405.30	328,855,230.67

润		
期末可供分配基金份额利润	0.2485	0.2266
期末基金资产净值	1,621,542,185.38	1,779,863,693.73
期末基金份额净值	1.2485	1.2266
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	83.55%	80.03%

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	-1.31%	0.94%	-0.76%	0.89%	-0.55%	0.05%
过去三个月	-3.98%	0.79%	-5.09%	0.78%	1.11%	0.01%
过去六个月	3.82%	0.73%	2.23%	0.75%	1.59%	-0.02%
过去一年	1.73%	0.87%	-6.59%	0.91%	8.32%	-0.04%
过去三年	32.39%	1.14%	2.66%	1.13%	29.73%	0.01%
自基金合同生效起至今	83.55%	1.19%	20.25%	1.20%	63.30%	-0.01%

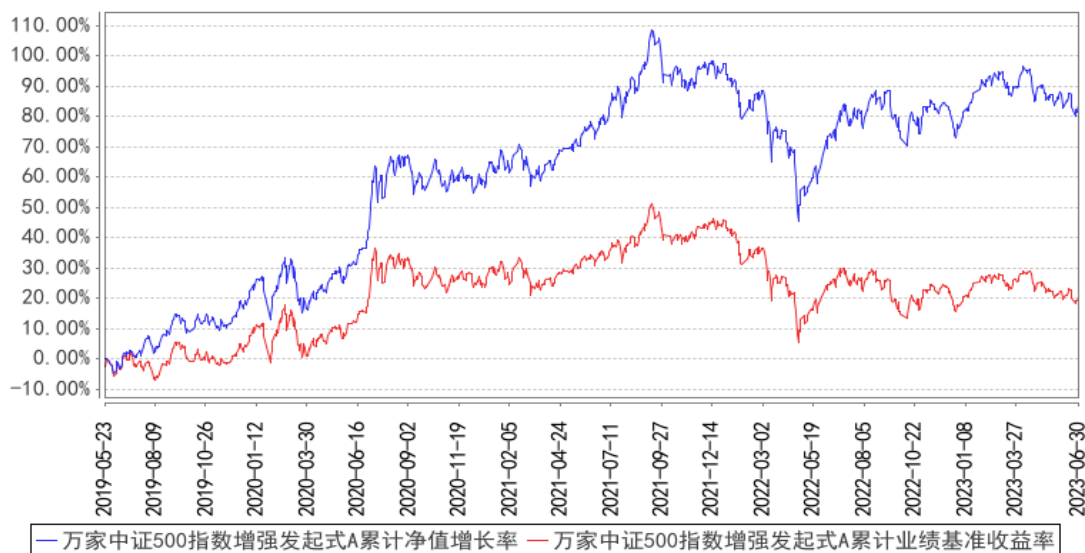
万家中证 500 指数增强发起式 C

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	-1.34%	0.94%	-0.76%	0.89%	-0.58%	0.05%

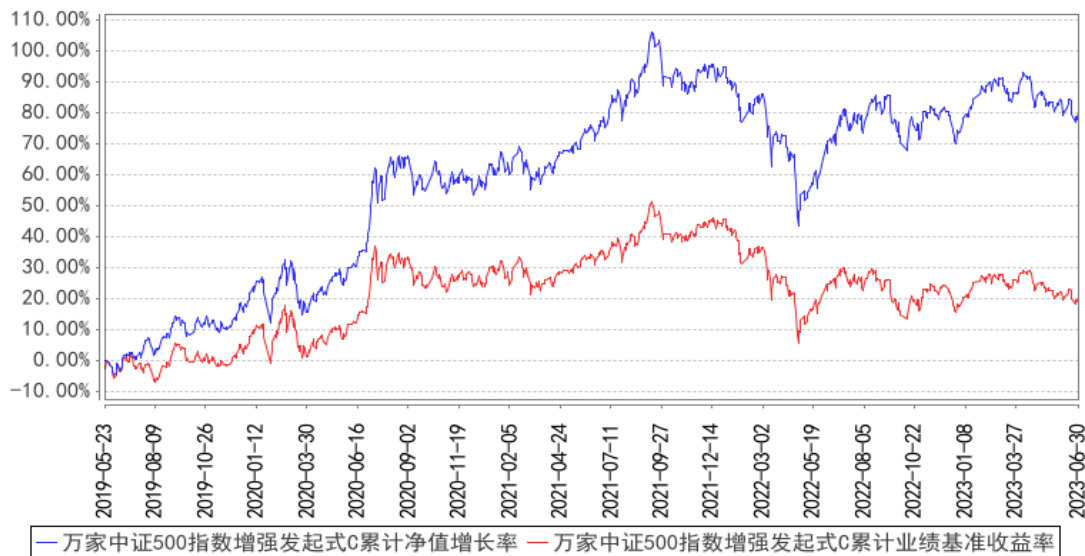
过去三个月	-4.08%	0.78%	-5.09%	0.78%	1.01%	0.00%
过去六个月	3.61%	0.73%	2.23%	0.75%	1.38%	-0.02%
过去一年	1.33%	0.87%	-6.59%	0.91%	7.92%	-0.04%
过去三年	30.82%	1.14%	2.66%	1.13%	28.16%	0.01%
自基金合同生效起 至今	80.03%	1.19%	20.25%	1.20%	59.78%	-0.01%

### 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：本基金于 2019 年 5 月 23 日成立，根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。



建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44号文批准设立。截至报告期末，公司的股东为中泰证券股份有限公司、山东省新动能基金管理有限公司，住所：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 楼（名义楼层 9 层），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。截至报告期末，公司共管理一百三十一只开放式基金，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基金中基金 (FOF)、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基金中基金 (FOF)、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、万家匠心致远一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫融纯债债券型证券投资基金、万家颐

远均衡一年持有期混合型发起式证券投资基金、万家鑫耀纯债债券型证券投资基金、万家欣远混合型证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家惠利债券型证券投资基金、万家鑫怡债券型证券投资基金、万家优享平衡混合型发起式证券投资基金、万家洞见进取混合型发起式证券投资基金、万家沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、万家中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金、万家沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家元贞量化选股股票型证券投资基金、万家 CFETS0-3 年期政策性金融债指数证券投资基金、万家中证软件服务指数型发起式证券投资基金、万家先进制造混合型发起式证券投资基金、万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金、万家颐德一年持有期混合型证券投资基金、万家北证 50 成份指数型发起式证券投资基金、万家恒生互联网科技业指数型发起式证券投资基金（QDII）、万家中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家欣优混合型证券投资基金、万家集利债券型发起式证券投资基金。

#### 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	公司领导 总经理助理；万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、万家元贞量化选股股票型证券投资基金、万家创业板指数增强型证券投资基金、万家家瑞债券	2019 年 9 月 6 日	-	16.5 年	国籍：中国；学历：美国斯坦福大学工商管理博士，2019 年 7 月入职万家基金管理有限公司，现任公司总经理助理、基金经理，历任量化投资部总监。曾任美国巴克莱国际投资管理公司投资部基金经理，加拿大退休基金国际投资管理公司量化投资部基金经理，南方基金管理有限公司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等职。

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

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《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

本报告期末，本基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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，执行交易系统内的公平交易程序；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，原则上按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；对于银行间交易，按照时间优先、价格优先的原则公平公

正的进行询价并完成交易。为保证公平交易原则的实现，通过制度规范、流程审批、系统风控参数设置等进行事前控制，通过对投资交易系统的实时监控进行事中控制，通过对异常交易的监控和分析实现事后控制。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 16 次，均为量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金在保持相对中证 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 1.2485 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.82%，同期业绩比较基准收益率为 2.23%；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 1.2266 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.61%，同期业绩比较基准收益率为 2.23%。基金报告期末 A 份额、C 份额日均跟踪偏离度分别为 0.1676%、0.1672%，年跟踪误差分别为 3.3173%、3.3145%，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

展望 2023 年下半年，国民经济将持续恢复、总体回升向好。疫情防控平稳后，经济恢复是一个波浪式发展、曲折式前进的过程，我国经济长期向好的基本面没有改变。7 月 24 日，中共中央政治局召开会议，分析研究当前经济形势，部署下半年经济工作。整体来看，政治局会议部署的政策偏积极，更多围绕“扩大内需、提振信心、防范风险”来展开。会议提出了一系列超越市场预期的政策，包括稳增长、稳信心、防风险的重要性提升、对房地产表态更积极、首提“通过终端需求带动有效供给”、首提“活跃资本市场”、首提“制定实施一揽子化债方案”等。就权益市场而言，随着 7 月政治局会议定调后，后续预计有一揽子稳增长政策细则跟随落实。在政策明确

定调的背景下，市场对国内经济过度悲观的预期将有望改善，叠加当前 A 股市场经过前期震荡调整，估值处于相对低位，性价比较高，A 股市场有望迎来震荡上行。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 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

2023 年 06 月 21 日万家中证 500 指数增强发起式 A 类每 10 份基金份额分红 1.7050 元，万家中证 500 指数增强发起式 C 类每 10 份基金份额分红 1.6760 元。万家中证 500 指数增强发起式 A 共计分配利润 198,387,450.17 元，万家中证 500 指数增强发起式 C 共计分配利润 245,281,199.75 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，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形。

## § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对万家基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	192,653,965.67	54,047,632.99
结算备付金		25,403,641.26	3,085,919.15
存出保证金		700,064.98	105,880.12
交易性金融资产	6.4.7.2	3,109,605,827.08	515,731,786.13
其中：股票投资		3,109,605,827.08	515,731,786.13
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		-	207,368.22
应收股利		-	-

应收申购款		103,925,245.49	2,261,729.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		3,432,288,744.48	575,440,316.09
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		15,747,109.82	-
应付赎回款		1,262,744.16	20,945,598.99
应付管理人报酬		2,965,196.89	473,100.52
应付托管费		593,039.37	94,620.13
应付销售服务费		657,506.78	83,899.70
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	9,657,268.35	2,600,354.82
负债合计		30,882,865.37	24,197,574.16
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	2,749,820,243.14	407,012,691.45
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	651,585,635.97	144,230,050.48
净资产合计		3,401,405,879.11	551,242,741.93
负债和净资产总计		3,432,288,744.48	575,440,316.09

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 2,749,820,243.14 份，其中万家中证 500 指数增强发起式 A 基金份额净值 1.2485 元，基金份额总额 1,298,811,780.08 份；万家中证 500 指数增强发起式 C 基金份额净值 1.2266 元，基金份额总额 1,451,008,463.06 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023 年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日
<b>一、营业总收入</b>		-26,481,608.95	33,147,964.76
1. 利息收入		314,755.61	38,201.82
其中：存款利息收入	6.4.7.10	314,755.61	38,201.82



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）		48,728,613.02	13,810,123.11
其中：股票投资收益	6.4.7.11	20,927,118.20	10,869,579.53
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	27,801,494.82	2,940,543.58
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	-76,071,627.98	18,849,033.90
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	546,650.40	450,605.93
<b>减：二、营业总支出</b>		11,813,376.03	1,362,926.41
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,185,118.36	909,759.95
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,637,023.66	181,951.93
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,790,209.49	196,324.56
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	201,024.52	74,889.97
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-38,294,984.98	31,785,038.35
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-38,294,984.98	31,785,038.35
<b>五、其他综合收益的税后</b>		-	-

净额			
六、综合收益总额		-38,294,984.98	31,785,038.35

### 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	407,012,691.45	-	144,230,050.48	551,242,741.93
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）	407,012,691.45	-	144,230,050.48	551,242,741.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,342,807,551.69	-	507,355,585.49	2,850,163,137.18
（一）、综合收益总额	-	-	-38,294,984.98	-38,294,984.98
（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）	2,342,807,551.69	-	989,319,220.39	3,332,126,772.08
其中：1. 基金申购款	2,802,024,504.92	-	1,182,148,433.41	3,984,172,938.33
2. 基金赎回款	-459,216,953.23	-	-192,829,213.02	-652,046,166.25
（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）	-	-	-443,668,649.92	-443,668,649.92
（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)	2,749,820,243.14	-	651,585,635.97	3,401,405,879.11
项目	上年度可比期间 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、本期期初净资产(基金净值)	54,989,197.26	-	47,675,138.69	102,664,335.95
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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

万家中证 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、存托凭证）、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》、《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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

本中期报告所采用的会计政策、会计估计与上年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### (一) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》的规定，基金通过深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

##### (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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

### （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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	192,653,965.67
等于：本金	192,631,682.68
加：应计利息	22,282.99
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	192,653,965.67

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,198,425,976.43	-	3,109,605,827.08	-88,820,149.35
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	3,198,425,976.43	-	3,109,605,827.08	-88,820,149.35

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有各项买入返售金融资产。



## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

## 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

## 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,000.39
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	9,489,208.35
其中：交易所市场	9,489,208.35
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	69,424.36
应付指数使用费	97,635.25
合计	9,657,268.35

## 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 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	229,523,608.99	229,523,608.99
本期申购	1,148,369,778.20	1,148,369,778.20
本期赎回（以“-”号填列）	-79,081,607.11	-79,081,607.11
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	1,298,811,780.08	1,298,811,780.08

## 万家中证 500 指数增强发起式 C

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	177,489,082.46	177,489,082.46
本期申购	1,653,654,726.72	1,653,654,726.72
本期赎回（以“-”号填列）	-380,135,346.12	-380,135,346.12
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	1,451,008,463.06	1,451,008,463.06

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
上年度末	130,525,386.75	-47,074,056.84	83,451,329.91
本期利润	21,125,797.64	-28,029,687.39	-6,903,889.75
本期基金份额交易产生的变动数	665,205,669.35	-220,635,254.04	444,570,415.31
其中：基金申购款	715,022,940.32	-233,643,374.06	481,379,566.26
基金赎回款	-49,817,270.97	13,008,120.02	-36,809,150.95
本期已分配利润	-198,387,450.17	-	-198,387,450.17
本期末	618,469,403.57	-295,738,998.27	322,730,405.30

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	96,734,309.82	-35,955,589.25	60,778,720.57
本期利润	16,650,845.36	-48,041,940.59	-31,391,095.23
本期基金份额交易产生的变动数	786,848,546.56	-242,099,741.48	544,748,805.08
其中：基金申购款	1,015,787,324.93	-315,018,457.78	700,768,867.15
基金赎回款	-228,938,778.37	72,918,716.30	-156,020,062.07
本期已分配利润	-245,281,199.75	-	-245,281,199.75
本期末	654,952,501.99	-326,097,271.32	328,855,230.67

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	240,193.18
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	71,441.18
其他	3,121.25
合计	314,755.61

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	20,927,118.20
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	20,927,118.20

##### 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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	6,178,725,594.54
减：卖出股票成本总额	6,137,245,014.09
减：交易费用	20,553,462.25
买卖股票差价收入	20,927,118.20

#### 6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	27,801,494.82
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	27,801,494.82

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-76,071,627.98
股票投资	-76,071,627.98
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	-76,071,627.98

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	542,659.06
基金转换费收入	3,991.34
合计	546,650.40

#### 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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	9,916.99
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	638.30
指数使用费	130,961.86
合计	201,024.52

#### 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

2023 年 1 月，中国证监会下发《关于核准万家基金管理有限公司变更实际控制人的批复》（证监许可[2023]215 号），核准山东能源集团有限公司成为万家基金实际控制人，对中泰证券股份有限公司依法受让齐河众鑫投资有限公司持有的万家基金 11% 股权无异议。2023 年 2 月，万家基金完成工商变更登记手续，万家基金股东变更为中泰证券和山东省新动能基金管理有限公司。

### 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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	4,833,405,559.29	32.29	-	-

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	4,332,212.87	32.84	2,835,304.06	29.88
关联方名称	上年度可比期间 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 (%)
中泰证券	-	-	-	-

#### 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
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,185,118.36	909,759.95
其中：支付销售机构的客户维护费	1,063,903.87	188,230.55

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
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,637,023.66	181,951.93

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。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	-	1,179,018.81	1,179,018.81
中泰证券	-	6,857.20	6,857.20
工商银行	-	15,738.02	15,738.02
合计	-	1,201,614.03	1,201,614.03
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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	-	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

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送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均未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均未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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	10,001,000.10	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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%	-

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	192,653,965.67	240,193.18	21,177,723.82	27,907.95

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

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方所承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间没有需作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

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	2023年6月21日	-	2023年6月21日	1.7050	135,651,756.31	62,735,693.86	198,387,450.17	-
合计	-	-	-	1.7050	135,651,756.31	62,735,693.86	198,387,450.17	-
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	2023 年 6 月 21 日	-	2023 年 6 月 21 日	1.6760	233,896,737.15	11,384,462.60	245,281,199.75	-
合计	-	-	-	1.6760	233,896,737.15	11,384,462.60	245,281,199.75	-

#### 6.4.12 期末（2023 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
001282	三联锻造	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	11.88	21.02	1,128	13,400.64	23,710.56	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
001380	华纬科	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-

	技	日								
300804	广康生化	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301202	朗威股份	2023年06月28日	1个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301203	国泰环保	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月	新股流通受限	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301232	飞沃科技	2023年6月8日	6个月	新股流通受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301260	格力博	2023年1月20日	6个月	新股流通受限	30.85	23.63	1,156	35,662.60	27,316.28	-

		日								
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	31.59	25.10	337	10,647.38	8,458.70	含转增股
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
301292	海科新源	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股流通受限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新股流通受限	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
301310	鑫宏业	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-

		日								
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新股流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股流通受限	23.77	42.89	764	18,160.28	32,767.96	-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月	新股流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-

	技	日								
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301383	天键股份	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	1个月内(含)	新股未上市	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
301397	潮联股份	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301399	英特科技	2023年5月16日	6个月	新股流通受限	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301419	阿莱德	2023年2月2日	6个月	新股流通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	-
301486	致尚科	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-

	技	日								
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	6.58	7.58	2,518	16,568.44	19,086.44	-
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	10.36	11.84	823	8,526.28	9,744.32	-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603135	中重科技	2023年3月29日	6个月	新股流通受限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	36.15	38.13	784	28,341.60	29,893.92	-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股流通受限	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股流通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688352	顾中科技	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688361	中科飞	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-

	测	日								
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023年4月7日	6个月	新股流通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688443	智翔金泰	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17	-
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	11.10	17.04	6,219	69,030.90	105,971.76	-
688478	晶升股份	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688484	南芯科技	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	39.99	36.71	806	32,231.94	29,588.26	-
688486	龙迅股份	2023年2月10日	6个月	新股流通受限	64.76	105.13	1,887	122,202.12	198,380.31	-
688507	索辰科	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	165.99	122.11	179	29,712.76	21,857.69	含转增股



	技	日								
688512	慧智微	2023年5月8日	6个月	新股流通受限	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新股流通受限	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688576	西山科技	2023年5月30日	6个月	新股流通受限	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股流通受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688603	天承科	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-

	技	日								
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601298	青岛港	2023年6月28日	重大事项停牌	6.97	2023年07月03日	7.40	519,300	3,697,282.04	3,619,521.00	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人将风险管理融入各业务层面，建立了三道防线：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%。

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

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。(2022 年 12 月 31 日：同)

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金期末持有的流通受限证券外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金资产的流动性风险进行管理，基金管理人建立了健全的流动性风险管理的内部控制体系，在申购赎回确认、投资交易、估值和信息披露等运作过程中专业审慎、勤勉尽责地管控基金的流动性风险，维护投资者的合法权益，公平对待投资者。本基金开放期间管理人对组合持仓集中度、短期变现能力、流动性受限资产比例、现金类资产比例等流动性指标进行持续的监测和分析，通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，对交易对手进行必要的尽职调查和准入，加强逆回购的流动性风险和交易对手风险的管理，并健全了逆回购交易质押品管理制度。

本基金所持有的证券大部分具有良好的流动性，部分证券流通暂时受限的情况参见附注 6.4.12 “期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券”，本报告期内本基金未出现因投资品种变现困难或投资集中而无法以合理价格及时变现基金资产以支付赎回款的情况。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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	192,653,965.67	-	-	-	-	-	192,653,965.67
结算备付金	25,403,641.26	-	-	-	-	-	25,403,641.26
存出保证金	700,064.98	-	-	-	-	-	700,064.98
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-3,109,605,827.08	3,109,605,827.08
应收申购款	34,728.62	-	-	-	-	103,890,516.87	103,925,245.49
资产总计	218,792,400.53	-	-	-	-	-3,213,496,343.95	3,432,288,744.48
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,262,744.16	1,262,744.16

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,965,196.89	2,965,196.89
应付托管费	-	-	-	-	-	593,039.37	593,039.37
应付清算款	-	-	-	-	-	15,747,109.82	15,747,109.82
应付销售服务费	-	-	-	-	-	657,506.78	657,506.78
其他负债	-	-	-	-	-	9,657,268.35	9,657,268.35
负债总计	-	-	-	-	-	30,882,865.37	30,882,865.37
利率敏感度缺口	218,792,400.53	-	-	-	-	-3,182,613,478.58	3,401,405,879.11
上年度末 2022 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	54,047,632.99	-	-	-	-	-	54,047,632.99
结算备付金	3,085,919.15	-	-	-	-	-	3,085,919.15
存出保证金	105,880.12	-	-	-	-	-	105,880.12
交易性金融资产	-	-	-	-	-	515,731,786.13	515,731,786.13
应收申购款	3,401.71	-	-	-	-	2,258,327.77	2,261,729.48
应收清算款	-	-	-	-	-	207,368.22	207,368.22
资产总计	57,242,833.97	-	-	-	-	518,197,482.12	575,440,316.09
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	20,945,598.99	20,945,598.99
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	473,100.52	473,100.52
应付托管费	-	-	-	-	-	94,620.13	94,620.13
应付销售服务费	-	-	-	-	-	83,899.70	83,899.70
其他负债	-	-	-	-	-	2,600,354.82	2,600,354.82
负债总计	-	-	-	-	-	24,197,574.16	24,197,574.16
利率敏感度缺口	57,242,833.97	-	-	-	-	493,999,907.96	551,242,741.93

注：该表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2022 年 12 月 31 日：同），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（2022 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022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	3,109,605,827.08	91.42	515,731,786.13	93.56
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	3,109,605,827.08	91.42	515,731,786.13	93.56

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除股票基准指数以外的其他市场变量保持不变		
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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）	
分析	1. 股票基准指数下降 100 个基点	-33,715,028.82	-5,179,770.22
	2. 股票基准指数上升 100 个基点	33,715,028.82	5,179,770.22

## 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	3,103,549,107.62	508,690,449.51
第二层次	4,380,811.14	5,630,832.00
第三层次	1,675,908.32	1,410,504.62
合计	3,109,605,827.08	515,731,786.13

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、新发未上市、涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产以及其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,109,605,827.08	90.60
	其中：股票	3,109,605,827.08	90.60
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	218,057,606.93	6.35
8	其他各项资产	104,625,310.47	3.05
9	合计	3,432,288,744.48	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	54,513,687.53	1.60
B	采矿业	194,715,945.65	5.72
C	制造业	1,596,218,457.62	46.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	57,353,255.76	1.69
E	建筑业	9,001,197.00	0.26
F	批发和零售业	63,861,657.60	1.88
G	交通运输、仓储和邮政业	39,782,503.40	1.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	212,965,393.10	6.26
J	金融业	189,311,893.05	5.57
K	房地产业	36,325,798.00	1.07
L	租赁和商务服务业	1,944,637.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	11,057,656.75	0.33
N	水利、环境和公共	-	-



	设施管理业		
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	66,011,445.00	1.94
S	综合	1,193,723.00	0.04
	合计	2,534,257,250.46	74.51

### 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	833,625.00	0.02
B	采矿业	5,332,064.00	0.16
C	制造业	306,643,997.08	9.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,648,980.95	1.11
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	2,405,482.20	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	15,107,562.00	0.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	48,076,518.43	1.41
J	金融业	135,334,236.14	3.98
K	房地产业	15,705,976.86	0.46
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	22,566.57	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	8,188,873.90	0.24
S	综合	-	-
	合计	575,348,576.62	16.92

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

## 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	601077	渝农商行	13,112,100	47,072,439.00	1.38
2	603858	步长制药	2,078,468	42,795,656.12	1.26
3	002326	永太科技	2,733,283	41,791,897.07	1.23
4	600095	湘财股份	4,978,674	38,833,657.20	1.14
5	000581	威孚高科	2,420,000	38,115,000.00	1.12
6	600259	广晟有色	1,034,843	37,399,226.02	1.10
7	600418	江淮汽车	2,928,100	36,864,779.00	1.08
8	000027	深圳能源	5,568,500	36,696,415.00	1.08
9	603885	吉祥航空	2,343,680	36,162,982.40	1.06
10	601233	桐昆股份	2,564,143	33,974,894.75	1.00
11	000629	钒钛股份	8,584,368	33,564,878.88	0.99
12	000987	越秀资本	5,168,963	32,822,915.05	0.96
13	300724	捷佳伟创	279,902	31,446,989.70	0.92
14	002926	华西证券	3,780,500	31,415,955.00	0.92
15	601179	中国西电	5,790,829	31,328,384.89	0.92
16	600166	福田汽车	8,930,100	30,362,340.00	0.89
17	603026	胜华新材	507,172	30,049,941.00	0.88
18	002465	海格通信	2,831,300	29,275,642.00	0.86
19	002299	圣农发展	1,516,328	29,037,681.20	0.85
20	300001	特锐德	1,371,155	28,492,600.90	0.84
21	002690	美亚光电	1,105,720	28,472,290.00	0.84
22	600535	天士力	1,925,207	27,934,753.57	0.82
23	002563	森马服饰	4,478,980	27,859,255.60	0.82
24	002152	广电运通	2,359,100	27,648,652.00	0.81
25	688390	固德威	161,546	26,955,565.56	0.79
26	601187	厦门银行	5,336,000	26,786,720.00	0.79
27	601969	海南矿业	4,051,298	26,657,540.84	0.78
28	002373	千方科技	1,923,783	26,240,400.12	0.77
29	603589	口子窖	525,869	25,951,635.15	0.76
30	688234	天岳先进	344,200	25,450,148.00	0.75
31	601168	西部矿业	2,418,357	25,416,932.07	0.75
32	000898	鞍钢股份	9,092,400	25,276,872.00	0.74
33	603444	吉比特	50,900	24,997,499.00	0.73
34	300558	贝达药业	520,400	24,994,812.00	0.73
35	603218	日月股份	1,306,010	24,801,129.90	0.73
36	603927	中科软	639,026	24,640,842.56	0.72
37	600859	王府井	1,235,906	24,458,579.74	0.72
38	688116	天奈科技	534,104	24,435,258.00	0.72

39	002624	完美世界	1,408,200	23,784,498.00	0.70
40	300383	光环新网	2,177,500	23,408,125.00	0.69
41	002025	航天电器	362,500	23,127,500.00	0.68
42	600380	健康元	1,760,424	22,374,989.04	0.66
43	002080	中材科技	1,086,700	22,299,084.00	0.66
44	688185	康希诺	271,200	22,102,800.00	0.65
45	002518	科士达	548,709	21,953,847.09	0.65
46	300253	卫宁健康	2,025,300	21,913,746.00	0.64
47	600968	海油发展	7,079,700	21,734,679.00	0.64
48	600497	驰宏锌锗	4,266,300	21,416,826.00	0.63
49	002901	大博医疗	677,936	21,070,250.88	0.62
50	688385	复旦微电	418,265	20,955,076.50	0.62
51	002155	湖南黄金	1,698,600	20,722,920.00	0.61
52	688779	长远锂科	1,830,400	20,628,608.00	0.61
53	002568	百润股份	564,178	20,507,870.30	0.60
54	601098	中南传媒	1,765,500	20,479,800.00	0.60
55	300136	信维通信	1,010,900	20,298,872.00	0.60
56	603893	瑞芯微	273,866	19,951,138.10	0.59
57	600153	建发股份	1,807,400	19,718,734.00	0.58
58	300285	国瓷材料	711,700	19,500,580.00	0.57
59	601869	长飞光纤	526,517	19,486,394.17	0.57
60	601717	郑煤机	1,532,800	19,083,360.00	0.56
61	600373	中文传媒	1,431,200	19,063,584.00	0.56
62	002745	木林森	2,067,200	19,018,240.00	0.56
63	002138	顺络电子	786,600	18,807,606.00	0.55
64	600998	九州通	1,800,047	18,684,487.86	0.55
65	300009	安科生物	1,853,290	18,532,900.00	0.54
66	002110	三钢闽光	4,266,100	18,002,942.00	0.53
67	300618	寒锐钴业	531,300	17,219,433.00	0.51
68	600663	陆家嘴	1,742,800	17,201,436.00	0.51
69	300308	中际旭创	115,755	17,068,074.75	0.50
70	300699	光威复材	532,060	16,414,051.00	0.48
71	002739	万达电影	1,308,400	16,407,336.00	0.48
72	688002	睿创微纳	360,114	16,133,107.20	0.47
73	600988	赤峰黄金	1,184,702	15,946,088.92	0.47
74	002925	盈趣科技	815,300	15,816,820.00	0.47
75	603160	汇顶科技	338,720	15,665,800.00	0.46
76	601636	旗滨集团	1,794,200	15,466,004.00	0.45
77	601139	深圳燃气	2,066,500	15,064,785.00	0.44
78	600316	洪都航空	619,973	14,538,366.85	0.43
79	000060	中金岭南	3,054,300	14,507,925.00	0.43
80	600392	盛和资源	1,111,375	14,303,396.25	0.42
81	000050	深天马 A	1,482,459	13,608,973.62	0.40

82	688521	芯原股份	173,227	12,458,485.84	0.37
83	000739	普洛药业	661,937	11,742,762.38	0.35
84	000807	云铝股份	905,500	11,527,015.00	0.34
85	600325	华发股份	1,158,400	11,410,240.00	0.34
86	002273	水晶光电	949,500	11,337,030.00	0.33
87	600489	中金黄金	1,085,300	11,211,149.00	0.33
88	300676	华大基因	184,325	11,057,656.75	0.33
89	002268	电科网安	385,598	10,746,616.26	0.32
90	688208	道通科技	346,536	10,503,506.16	0.31
91	300037	新宙邦	196,780	10,210,914.20	0.30
92	600598	北大荒	754,601	10,058,831.33	0.30
93	300604	长川科技	210,600	10,001,394.00	0.29
94	002850	科达利	71,800	9,495,550.00	0.28
95	000998	隆平高科	605,700	9,297,495.00	0.27
96	601928	凤凰传媒	811,200	9,247,680.00	0.27
97	300482	万孚生物	334,800	8,915,724.00	0.26
98	000960	锡业股份	567,300	8,821,515.00	0.26
99	688072	拓荆科技	20,207	8,607,575.79	0.25
100	600399	抚顺特钢	826,900	8,434,380.00	0.25
101	000738	航发控制	343,982	8,393,160.80	0.25
102	000831	中国稀土	276,600	8,187,360.00	0.24
103	300438	鹏辉能源	168,600	8,099,544.00	0.24
104	600481	双良节能	573,200	8,013,336.00	0.24
105	000975	银泰黄金	658,184	7,700,752.80	0.23
106	600867	通化东宝	734,600	7,669,224.00	0.23
107	300257	开山股份	504,400	7,651,748.00	0.22
108	600549	厦门钨业	384,800	7,322,744.00	0.22
109	600566	济川药业	245,396	7,126,299.84	0.21
110	002439	启明星辰	236,500	7,038,240.00	0.21
111	002738	中矿资源	137,700	7,014,438.00	0.21
112	600536	中国软件	149,087	6,989,198.56	0.21
113	603225	新凤鸣	629,600	6,957,080.00	0.20
114	600848	上海临港	571,200	6,825,840.00	0.20
115	002028	思源电气	140,600	6,568,832.00	0.19
116	603650	彤程新材	197,400	6,474,720.00	0.19
117	601966	玲珑轮胎	285,855	6,351,698.10	0.19
118	688777	中控技术	98,918	6,210,072.04	0.18
119	002531	天顺风能	405,500	6,175,765.00	0.18
120	601118	海南橡胶	1,366,000	6,119,680.00	0.18
121	688009	中国通号	1,042,200	6,044,760.00	0.18
122	688107	安路科技	108,600	6,015,354.00	0.18
123	000970	中科三环	447,400	5,735,668.00	0.17
124	002409	雅克科技	78,700	5,735,656.00	0.17

125	000783	长江证券	973,700	5,647,460.00	0.17
126	600563	法拉电子	40,500	5,560,650.00	0.16
127	002185	华天科技	588,200	5,411,440.00	0.16
128	603638	艾迪精密	251,100	5,152,572.00	0.15
129	600487	亨通光电	345,800	5,069,428.00	0.15
130	001203	大中矿业	456,100	5,067,271.00	0.15
131	002065	东华软件	711,000	5,019,660.00	0.15
132	300073	当升科技	91,200	4,590,096.00	0.13
133	600160	巨化股份	316,900	4,366,882.00	0.13
134	600498	烽火通信	213,700	4,353,069.00	0.13
135	002056	横店东磁	231,760	4,220,349.60	0.12
136	601611	中国核建	477,400	4,034,030.00	0.12
137	600372	中航电子	264,306	4,012,165.08	0.12
138	002131	利欧股份	1,718,000	3,951,400.00	0.12
139	688220	翱捷科技	51,700	3,897,663.00	0.11
140	603267	鸿远电子	59,600	3,891,880.00	0.11
141	002463	沪电股份	180,600	3,781,764.00	0.11
142	601298	青岛港	519,300	3,619,521.00	0.11
143	300418	昆仑万维	89,493	3,604,778.04	0.11
144	600079	人福医药	133,500	3,596,490.00	0.11
145	002092	中泰化学	547,200	3,529,440.00	0.10
146	600580	卧龙电驱	238,175	3,479,736.75	0.10
147	000547	航天发展	338,200	3,382,000.00	0.10
148	688772	珠海冠宇	167,800	3,381,170.00	0.10
149	002195	二三四五	1,117,300	3,228,997.00	0.09
150	601128	常熟银行	471,140	3,213,174.80	0.09
151	600718	东软集团	300,282	3,201,006.12	0.09
152	603712	七一二	103,400	3,123,714.00	0.09
153	600027	华电国际	463,700	3,102,153.00	0.09
154	000878	云南铜业	267,300	2,953,665.00	0.09
155	002508	老板电器	114,802	2,903,342.58	0.09
156	601106	中国一重	850,400	2,857,344.00	0.08
157	002407	多氟多	140,200	2,784,372.00	0.08
158	000400	许继电气	118,102	2,722,251.10	0.08
159	002384	东山精密	97,600	2,527,840.00	0.07
160	688029	南微医学	30,900	2,520,204.00	0.07
161	601577	长沙银行	320,800	2,489,408.00	0.07
162	002532	天山铝业	409,800	2,454,702.00	0.07
163	600507	方大特钢	502,680	2,327,408.40	0.07
164	002368	太极股份	56,100	2,309,637.00	0.07
165	601991	大唐发电	692,000	2,290,520.00	0.07
166	688281	华秦科技	11,300	2,288,250.00	0.07
167	600970	中材国际	176,300	2,247,825.00	0.07

168	300058	蓝色光标	201,100	1,944,637.00	0.06
169	301029	怡合达	41,500	1,854,220.00	0.05
170	688099	晶晨股份	21,758	1,834,634.56	0.05
171	600967	内蒙一机	180,500	1,823,050.00	0.05
172	000039	中集集团	262,100	1,805,869.00	0.05
173	600171	上海贝岭	98,900	1,804,925.00	0.05
174	600667	太极实业	235,100	1,706,826.00	0.05
175	300850	新强联	41,600	1,555,008.00	0.05
176	600315	上海家化	51,000	1,479,510.00	0.04
177	002683	广东宏大	49,000	1,442,560.00	0.04
178	600298	安琪酵母	39,600	1,433,916.00	0.04
179	688052	纳芯微	8,100	1,282,797.00	0.04
180	688169	石头科技	3,800	1,218,584.00	0.04
181	000009	中国宝安	98,900	1,193,723.00	0.04
182	603379	三美股份	50,100	1,177,851.00	0.03
183	600499	科达制造	93,000	1,056,480.00	0.03
184	600170	上海建工	376,400	1,012,516.00	0.03
185	600704	物产中大	202,400	999,856.00	0.03
186	000519	中兵红箭	54,700	989,523.00	0.03
187	600862	中航高科	37,600	951,656.00	0.03
188	600906	财达证券	128,100	922,320.00	0.03
189	000031	大悦城	242,700	888,282.00	0.03
190	600299	安迪苏	106,100	845,617.00	0.02
191	600271	航天信息	59,600	815,924.00	0.02
192	300251	光线传媒	100,500	813,045.00	0.02
193	601231	环旭电子	45,200	676,192.00	0.02
194	300861	美畅股份	15,000	650,550.00	0.02
195	300026	红日药业	104,000	563,680.00	0.02
196	002600	领益智造	78,200	540,362.00	0.02
197	600329	达仁堂	11,000	493,790.00	0.01
198	300474	景嘉微	5,050	454,449.50	0.01
199	600378	昊华科技	11,700	440,388.00	0.01
200	002572	索菲亚	15,100	263,042.00	0.01
201	688200	华峰测控	1,700	260,100.00	0.01
202	002985	北摩高科	5,000	220,600.00	0.01
203	600642	申能股份	28,524	199,382.76	0.01
204	600737	中粮糖业	20,410	164,300.50	0.00
205	601997	贵阳银行	20,900	107,844.00	0.00
206	300682	朗新科技	4,500	104,760.00	0.00
207	603737	三棵树	1,000	65,420.00	0.00
208	605358	立昂微	1,400	51,422.00	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	601688	华泰证券	2,105,782	28,996,618.14	0.85
2	000166	申万宏源	5,654,050	26,121,711.00	0.77
3	688660	电气风电	4,345,700	24,205,549.00	0.71
4	601939	建设银行	3,604,800	22,566,048.00	0.66
5	600030	中信证券	1,120,900	22,171,402.00	0.65
6	000593	德龙汇能	2,769,048	18,718,764.48	0.55
7	601169	北京银行	3,902,300	18,067,649.00	0.53
8	603808	歌力思	1,238,600	16,262,818.00	0.48
9	300206	理邦仪器	1,066,200	16,078,296.00	0.47
10	600185	格力地产	2,289,501	15,705,976.86	0.46
11	600029	南方航空	2,505,400	15,107,562.00	0.44
12	600989	宝丰能源	1,076,000	13,568,360.00	0.40
13	002527	新时达	933,600	12,696,960.00	0.37
14	300423	昇辉科技	991,700	12,118,574.00	0.36
15	300465	高伟达	1,192,900	11,845,497.00	0.35
16	002971	和远气体	454,100	11,647,665.00	0.34
17	688318	财富趋势	111,700	11,166,649.00	0.33
18	688239	航宇科技	157,065	10,986,696.75	0.32
19	688010	福光股份	445,000	10,858,000.00	0.32
20	600644	乐山电力	1,357,300	10,193,323.00	0.30
21	300719	安达维尔	679,200	9,590,304.00	0.28
22	688626	翔宇医疗	203,400	9,256,734.00	0.27
23	600817	宇通重工	766,310	8,575,008.90	0.25
24	600977	中国电影	582,838	8,188,873.90	0.24
25	300432	富临精工	680,600	7,908,572.00	0.23
26	603501	韦尔股份	74,738	7,327,313.52	0.22
27	300246	宝莱特	565,950	7,046,077.50	0.21
28	300803	指南针	137,000	6,656,830.00	0.20
29	000682	东方电子	683,400	6,642,648.00	0.20
30	688126	沪硅产业	295,000	6,165,500.00	0.18
31	600016	民生银行	1,639,400	6,147,750.00	0.18
32	002755	奥赛康	679,100	5,969,289.00	0.18
33	600550	保变电气	1,131,100	5,700,744.00	0.17
34	600917	重庆燃气	794,700	5,403,960.00	0.16
35	688981	中芯国际	105,100	5,309,652.00	0.16
36	002196	方正电机	751,400	5,289,856.00	0.16
37	600559	老白干酒	213,100	5,223,081.00	0.15
38	000603	盛达资源	388,400	4,695,756.00	0.14
39	601818	光大银行	1,500,400	4,606,228.00	0.14
40	601989	中国重工	941,700	4,538,994.00	0.13
41	002493	荣盛石化	371,600	4,325,424.00	0.13
42	300661	圣邦股份	51,770	4,251,870.10	0.13

43	688366	昊海生科	47,908	4,034,811.76	0.12
44	000800	一汽解放	473,800	3,965,706.00	0.12
45	688255	凯尔达	116,943	3,959,689.98	0.12
46	600961	株冶集团	488,900	3,955,201.00	0.12
47	600571	信雅达	405,400	3,705,356.00	0.11
48	000338	潍柴动力	279,500	3,482,570.00	0.10
49	688357	建龙微纳	51,900	3,357,411.00	0.10
50	600011	华能国际	356,100	3,297,486.00	0.10
51	002119	康强电子	251,100	3,256,767.00	0.10
52	002189	中光学	181,100	3,174,683.00	0.09
53	300077	国民技术	238,500	3,172,050.00	0.09
54	600276	恒瑞医药	65,200	3,123,080.00	0.09
55	000816	智慧农业	850,900	2,859,024.00	0.08
56	300773	拉卡拉	157,100	2,739,824.00	0.08
57	688005	容百科技	50,700	2,738,814.00	0.08
58	300158	振东制药	456,600	2,616,318.00	0.08
59	002651	利君股份	317,800	2,469,306.00	0.07
60	002197	证通电子	222,500	2,345,150.00	0.07
61	688508	芯朋微	40,200	2,331,198.00	0.07
62	688699	明微电子	42,786	2,152,991.52	0.06
63	688135	利扬芯片	94,318	2,068,393.74	0.06
64	000510	新金路	333,000	2,054,610.00	0.06
65	688798	艾为电子	33,320	1,970,878.00	0.06
66	002980	华盛昌	57,600	1,927,296.00	0.06
67	300566	激智科技	104,500	1,926,980.00	0.06
68	000759	中百集团	394,900	1,780,999.00	0.05
69	300327	中颖电子	62,700	1,753,092.00	0.05
70	002090	金智科技	125,900	1,572,491.00	0.05
71	300380	安硕信息	80,500	1,489,250.00	0.04
72	300581	晨曦航空	131,570	1,453,848.50	0.04
73	002724	海洋王	163,996	1,423,485.28	0.04
74	301219	腾远钴业	35,200	1,315,072.00	0.04
75	688173	希荻微	57,091	1,306,242.08	0.04
76	300093	金刚光伏	46,400	1,269,968.00	0.04
77	002036	联创电子	126,600	1,229,286.00	0.04
78	688595	芯海科技	36,300	1,160,874.00	0.03
79	603068	博通集成	40,200	1,150,524.00	0.03
80	000590	启迪药业	130,300	1,136,216.00	0.03
81	600572	康恩贝	154,500	1,058,325.00	0.03
82	601003	柳钢股份	254,800	1,029,392.00	0.03
83	002217	合力泰	272,000	960,160.00	0.03
84	002793	罗欣药业	155,900	840,301.00	0.02
85	002458	益生股份	67,500	833,625.00	0.02



86	688206	概伦电子	27,900	782,316.00	0.02
87	300379	东方通	36,200	744,634.00	0.02
88	002279	久其软件	113,200	727,876.00	0.02
89	002242	九阳股份	45,829	685,143.55	0.02
90	600346	恒力石化	46,300	663,479.00	0.02
91	600547	山东黄金	27,100	636,308.00	0.02
92	300758	七彩化学	63,400	629,562.00	0.02
93	300035	中科电气	49,635	596,612.70	0.02
94	000829	天音控股	63,300	572,232.00	0.02
95	002907	华森制药	32,300	491,606.00	0.01
96	002576	通达动力	22,300	445,777.00	0.01
97	300477	合纵科技	88,800	414,696.00	0.01
98	300894	火星号	13,900	355,006.00	0.01
99	600745	闻泰科技	6,900	337,410.00	0.01
100	603208	江山欧派	9,050	329,601.00	0.01
101	688235	百济神州	2,826	308,344.86	0.01
102	300708	聚灿光电	29,900	295,113.00	0.01
103	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.01
104	300048	合康新能	45,100	269,698.00	0.01
105	688486	龙迅股份	1,887	198,380.31	0.01
106	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.00
107	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.00
108	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.00
109	688472	阿特斯	6,219	105,971.76	0.00
110	688157	松井股份	2,000	105,200.00	0.00
111	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.00
112	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
113	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
114	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
115	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
116	600612	老凤祥	1,000	69,880.00	0.00
117	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
118	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
119	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
120	301358	湖南裕能	764	32,767.96	0.00
121	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
122	688146	中船特气	784	29,893.92	0.00
123	688484	南芯科技	806	29,588.26	0.00
124	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
125	688352	硕中科技	2,361	28,497.27	0.00
126	301260	格力博	1,156	27,316.28	0.00
127	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
128	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00

129	000953	河化股份	4,900	25,823.00	0.00
130	688680	海优新材	200	24,364.00	0.00
131	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
132	001287	中电港	1,128	23,710.56	0.00
133	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
134	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
135	688507	索辰科技	179	21,857.69	0.00
136	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
137	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
138	601061	中信金属	2,518	19,086.44	0.00
139	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
140	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
141	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
142	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
143	688623	二元科技	178	15,448.62	0.00
144	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
145	688213	思特威	300	15,342.00	0.00
146	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
147	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
148	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
149	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
150	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
151	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
152	301210	金杨股份	281	13,816.77	0.00
153	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
154	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
155	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
156	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
157	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
158	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
159	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
160	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
161	301315	威斯顿	226	11,553.12	0.00
162	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
163	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
164	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
165	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
166	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
167	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
168	601065	江盐集团	823	9,744.32	0.00
169	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
170	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
171	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00

172	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
173	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
174	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
175	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
176	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
177	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
178	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
179	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
180	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
181	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
182	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
183	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
184	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
185	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
186	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
187	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
188	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
189	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
190	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
191	001367	海森药业	55	2,171.40	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	601077	渝农商行	71,902,343.00	13.04
2	688521	芯原股份	65,676,665.80	11.91
3	603160	汇顶科技	63,412,038.90	11.50
4	002624	完美世界	61,985,786.90	11.24
5	002465	海格通信	61,891,195.00	11.23
6	601233	桐昆股份	57,975,666.03	10.52
7	601939	建设银行	57,153,356.00	10.37
8	603858	步长制药	56,329,243.72	10.22
9	603885	吉祥航空	54,040,642.00	9.80
10	002326	永太科技	53,287,602.58	9.67
11	000987	越秀资本	51,450,882.98	9.33
12	000581	威孚高科	51,402,744.91	9.32
13	002138	顺络电子	51,006,437.00	9.25
14	603893	瑞芯微	50,281,008.31	9.12
15	002056	横店东磁	49,195,228.47	8.92
16	002384	东山精密	49,015,726.50	8.89
17	000629	钒钛股份	48,935,804.80	8.88
18	688185	康希诺	47,962,771.05	8.70

19	002152	广电运通	47,571,667.00	8.63
20	688385	复旦微电	47,425,118.12	8.60
21	600535	天士力	46,917,898.07	8.51
22	300558	贝达药业	46,505,101.86	8.44
23	002925	盈趣科技	46,464,836.51	8.43
24	002299	圣农发展	45,474,736.71	8.25
25	600259	广晟有色	45,356,730.48	8.23
26	600511	国药股份	44,437,363.60	8.06
27	603026	胜华新材	44,144,563.67	8.01
28	600095	湘财股份	44,081,006.36	8.00
29	688002	睿创微纳	43,934,412.69	7.97
30	603589	口子窖	43,298,438.70	7.85
31	002568	百润股份	43,287,892.74	7.85
32	300001	特锐德	42,992,916.32	7.80
33	600418	江淮汽车	42,974,072.00	7.80
34	688234	天岳先进	42,957,219.58	7.79
35	601098	中南传媒	42,224,762.00	7.66
36	000027	深圳能源	41,182,977.00	7.47
37	300724	捷佳伟创	40,952,859.06	7.43
38	600489	中金黄金	40,907,077.41	7.42
39	002563	森马服饰	40,468,624.95	7.34
40	002242	九阳股份	39,920,624.36	7.24
41	300474	景嘉微	39,096,429.50	7.09
42	600968	海油发展	38,786,469.00	7.04
43	002155	湖南黄金	38,766,458.00	7.03
44	601187	厦门银行	38,567,608.00	7.00
45	002926	华西证券	38,462,650.00	6.98
46	600497	驰宏锌锗	38,300,882.00	6.95
47	603444	吉比特	38,119,043.00	6.92
48	601168	西部矿业	38,023,254.37	6.90
49	300253	卫宁健康	37,961,321.01	6.89
50	603927	中科软	37,910,103.42	6.88
51	000975	银泰黄金	37,699,927.66	6.84
52	600079	人福医药	37,560,699.12	6.81
53	688390	固德威	37,557,075.93	6.81
54	601869	长飞光纤	37,194,973.14	6.75
55	603218	日月股份	36,519,093.98	6.62
56	300699	光威复材	36,406,759.46	6.60
57	600166	福田汽车	36,370,365.00	6.60
58	600373	中文传媒	36,305,434.00	6.59
59	688116	天奈科技	36,209,469.42	6.57
60	002080	中材科技	35,652,193.00	6.47
61	600316	洪都航空	35,347,610.81	6.41

62	002745	木林森	34,920,342.00	6.33
63	601179	中国西电	34,443,408.53	6.25
64	600038	中直股份	34,367,707.12	6.23
65	600859	王府井	33,971,260.49	6.16
66	002373	千方科技	33,694,837.92	6.11
67	002690	美亚光电	32,992,243.54	5.99
68	000898	鞍钢股份	32,857,120.00	5.96
69	002025	航天电器	32,810,225.47	5.95
70	300463	迈克生物	32,800,198.60	5.95
71	601688	华泰证券	32,673,091.80	5.93
72	603225	新凤鸣	32,389,194.00	5.88
73	002223	鱼跃医疗	32,227,788.40	5.85
74	601969	海南矿业	32,126,153.20	5.83
75	300285	国瓷材料	31,805,144.69	5.77
76	603939	益丰药房	31,569,433.30	5.73
77	600988	赤峰黄金	31,564,011.00	5.73
78	603883	老百姓	30,942,611.06	5.61
79	600998	九州通	30,828,258.00	5.59
80	600486	扬农化工	30,227,059.65	5.48
81	002506	协鑫集成	29,752,055.00	5.40
82	601636	旗滨集团	29,316,972.00	5.32
83	300383	光环新网	29,092,165.00	5.28
84	600030	中信证券	28,968,350.14	5.26
85	688660	电气风电	28,668,009.24	5.20
86	300136	信维通信	27,926,210.06	5.07
87	601717	郑煤机	27,879,595.00	5.06
88	688779	长远锂科	27,629,281.35	5.01
89	002153	石基信息	27,558,864.68	5.00
90	600580	卧龙电驱	27,512,843.08	4.99
91	000166	申万宏源	27,429,359.00	4.98
92	600728	佳都科技	27,412,872.00	4.97
93	300618	寒锐钴业	27,397,353.44	4.97
94	300009	安科生物	27,155,619.20	4.93
95	600487	亨通光电	27,085,558.00	4.91
96	002603	以岭药业	26,812,142.00	4.86
97	002901	大博医疗	26,680,274.04	4.84
98	600808	马钢股份	26,620,302.48	4.83
99	600258	首旅酒店	26,590,022.68	4.82
100	002739	万达电影	26,379,914.15	4.79
101	600536	中国软件	26,311,919.64	4.77
102	600764	中国海防	26,132,893.00	4.74
103	000050	深天马 A	26,059,856.80	4.73
104	002518	科士达	25,997,423.97	4.72

105	600556	天下秀	25,836,681.00	4.69
106	600380	健康元	25,768,709.66	4.67
107	600989	宝丰能源	25,338,726.00	4.60
108	600153	建发股份	25,276,048.00	4.59
109	603317	天味食品	24,999,528.48	4.54
110	688208	道通科技	24,953,681.24	4.53
111	002531	天顺风能	24,415,666.00	4.43
112	601169	北京银行	24,267,023.00	4.40
113	000739	普洛药业	23,817,778.31	4.32
114	600663	陆家嘴	23,671,202.00	4.29
115	600566	济川药业	23,419,369.76	4.25
116	689009	九号公司	23,404,297.47	4.25
117	300146	汤臣倍健	23,394,052.00	4.24
118	300144	宋城演艺	23,390,228.72	4.24
119	002422	科伦药业	23,343,577.95	4.23
120	601928	凤凰传媒	23,092,655.00	4.19
121	601699	潞安环能	23,074,487.78	4.19
122	600667	太极实业	22,904,464.00	4.16
123	603737	三棵树	22,780,430.00	4.13
124	601128	常熟银行	22,727,121.80	4.12
125	600185	格力地产	22,712,655.73	4.12
126	603127	昭衍新药	22,685,457.57	4.12
127	300676	华大基因	22,575,441.07	4.10
128	600862	中航高科	22,255,811.00	4.04
129	002273	水晶光电	22,126,093.00	4.01
130	002131	利欧股份	21,445,092.00	3.89
131	002110	三钢闽光	21,302,298.00	3.86
132	000656	金科股份	21,249,875.00	3.85
133	000807	云铝股份	20,926,264.00	3.80
134	600867	通化东宝	20,905,488.91	3.79
135	000593	德龙汇能	20,557,859.40	3.73
136	600967	内蒙一机	20,535,880.00	3.73
137	603517	绝味食品	20,364,676.29	3.69
138	600707	彩虹股份	20,342,207.46	3.69
139	300308	中际旭创	20,263,341.75	3.68
140	688010	福光股份	19,615,411.33	3.56
141	002532	天山铝业	19,576,870.00	3.55
142	600516	方大炭素	19,420,822.26	3.52
143	300206	理邦仪器	19,415,885.00	3.52
144	688777	中控技术	19,365,799.14	3.51
145	300604	长川科技	19,103,686.88	3.47
146	000513	丽珠集团	19,063,157.60	3.46
147	601958	金钼股份	18,977,184.00	3.44

148	688289	圣湘生物	18,824,064.23	3.41
149	688519	南亚新材	18,803,531.43	3.41
150	688009	中国通号	18,731,028.94	3.40
151	603345	安井食品	18,567,871.56	3.37
152	000060	中金岭南	18,551,938.00	3.37
153	601106	中国一重	18,351,170.00	3.33
154	002429	兆驰股份	18,130,141.00	3.29
155	600688	上海石化	18,089,047.00	3.28
156	600027	华电国际	18,025,265.00	3.27
157	603808	歌力思	17,994,831.00	3.26
158	600029	南方航空	17,987,181.00	3.26
159	002683	广东宏大	17,968,476.00	3.26
160	601139	深圳燃气	17,841,306.00	3.24
161	002372	伟星新材	17,742,229.50	3.22
162	603688	石英股份	17,563,002.00	3.19
163	688567	孚能科技	17,509,290.02	3.18
164	688063	派能科技	17,471,536.51	3.17
165	300418	昆仑万维	17,470,357.37	3.17
166	600871	石化油服	17,272,216.84	3.13
167	600582	天地科技	17,165,510.00	3.11
168	600917	重庆燃气	17,002,184.90	3.08
169	002409	雅克科技	16,921,573.00	3.07
170	600705	中航产融	16,872,251.00	3.06
171	300096	易联众	16,845,274.00	3.06
172	300188	美亚柏科	16,834,891.00	3.05
173	601118	海南橡胶	16,765,406.00	3.04
174	603233	大参林	16,591,263.77	3.01
175	000830	鲁西化工	16,531,411.00	3.00
176	688561	奇安信	16,509,365.23	2.99
177	002468	申通快递	16,188,957.55	2.94
178	600392	盛和资源	16,123,354.50	2.92
179	300465	高伟达	15,747,967.00	2.86
180	002500	山西证券	15,711,590.88	2.85
181	300244	迪安诊断	15,625,722.91	2.83
182	000547	航天发展	15,622,428.00	2.83
183	002028	思源电气	15,504,419.60	2.81
184	000400	许继电气	15,490,654.90	2.81
185	600801	华新水泥	15,423,347.16	2.80
186	603658	安图生物	15,353,470.00	2.79
187	600399	抚顺特钢	15,299,575.00	2.78
188	600161	天坛生物	15,291,284.00	2.77
189	601000	唐山港	15,262,045.61	2.77
190	002268	电科网安	15,233,345.34	2.76

191	603712	七一二	15,145,215.66	2.75
192	601818	光大银行	15,008,100.00	2.72
193	600348	华阳股份	14,989,287.27	2.72
194	600325	华发股份	14,620,485.00	2.65
195	600195	中牧股份	14,611,066.58	2.65
196	688772	珠海冠宇	14,418,304.05	2.62
197	300850	新强联	14,377,271.00	2.61
198	600985	淮北矿业	14,268,652.50	2.59
199	300888	稳健医疗	14,246,855.20	2.58
200	600498	烽火通信	14,183,548.00	2.57
201	000997	新大陆	14,155,313.14	2.57
202	601991	大唐发电	14,097,756.00	2.56
203	601696	中银证券	13,982,281.50	2.54
204	688126	沪硅产业	13,966,664.72	2.53
205	300482	万孚生物	13,921,014.60	2.53
206	688072	拓荆科技	13,778,316.94	2.50
207	002831	裕同科技	13,593,946.00	2.47
208	000729	燕京啤酒	13,531,191.00	2.45
209	688088	虹软科技	13,519,365.53	2.45
210	002625	光启技术	13,393,527.00	2.43
211	600390	五矿资本	13,210,016.00	2.40
212	688030	山石网科	13,070,734.53	2.37
213	688029	南微医学	13,052,399.14	2.37
214	688318	财富趋势	12,996,570.52	2.36
215	002971	和远气体	12,987,094.00	2.36
216	300423	昇辉科技	12,926,355.00	2.34
217	300719	安达维尔	12,869,336.00	2.33
218	000998	隆平高科	12,861,441.04	2.33
219	600765	中航重机	12,781,039.27	2.32
220	600546	山煤国际	12,630,677.00	2.29
221	601611	中国核建	12,580,860.37	2.28
222	300035	中科电气	12,461,470.55	2.26
223	603267	鸿远电子	12,394,846.00	2.25
224	002423	中粮资本	12,313,650.00	2.23
225	600977	中国电影	12,304,663.88	2.23
226	002797	第一创业	12,290,645.00	2.23
227	600062	华润双鹤	12,251,824.08	2.22
228	603650	彤程新材	12,181,811.41	2.21
229	600598	北大荒	12,156,802.00	2.21
230	688099	晶晨股份	12,061,411.98	2.19
231	000425	徐工机械	11,997,759.00	2.18
232	002254	泰和新材	11,855,717.00	2.15
233	603501	韦尔股份	11,808,086.05	2.14



234	600481	双良节能	11,796,021.00	2.14
235	000831	中国稀土	11,788,847.00	2.14
236	603596	伯特利	11,759,018.00	2.13
237	002060	粤水电	11,720,383.00	2.13
238	601872	招商轮船	11,718,678.40	2.13
239	002493	荣盛石化	11,683,134.00	2.12
240	601966	玲珑轮胎	11,681,865.25	2.12
241	601598	中国外运	11,679,252.00	2.12
242	000825	太钢不锈	11,632,214.00	2.11
243	600521	华海药业	11,613,928.80	2.11
244	000932	华菱钢铁	11,434,146.52	2.07
245	300026	红日药业	11,414,629.00	2.07
246	000062	深圳华强	11,398,445.00	2.07
247	600644	乐山电力	11,397,999.00	2.07
248	002850	科达利	11,370,056.13	2.06
249	688256	寒武纪	11,369,908.49	2.06
250	600064	南京高科	11,356,855.40	2.06
251	000738	航发控制	11,334,727.40	2.06
252	000598	兴蓉环境	11,245,851.00	2.04
253	688239	航宇科技	11,135,388.38	2.02
254	003816	中国广核	11,131,132.00	2.02
255	002203	海亮股份	11,066,678.00	2.01

注：“买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	002384	东山精密	58,085,361.01	10.54
2	688521	芯原股份	54,619,680.76	9.91
3	300474	景嘉微	45,341,030.78	8.23
4	603160	汇顶科技	45,216,371.10	8.20
5	002056	横店东磁	45,019,185.57	8.17
6	600511	国药股份	44,571,220.22	8.09
7	002242	九阳股份	38,878,324.92	7.05
8	002624	完美世界	38,141,124.00	6.92
9	600038	中直股份	37,258,729.20	6.76
10	600489	中金黄金	37,081,231.00	6.73
11	600079	人福医药	34,607,972.00	6.28
12	002223	鱼跃医疗	34,596,804.10	6.28
13	600667	太极实业	34,485,937.06	6.26
14	002465	海格通信	33,656,041.00	6.11
15	603939	益丰药房	33,112,420.30	6.01
16	002506	协鑫集成	32,847,626.04	5.96

17	601939	建设银行	32,291,684.00	5.86
18	002138	顺络电子	32,025,087.69	5.81
19	002925	盈趣科技	31,953,685.39	5.80
20	300463	迈克生物	31,062,253.72	5.63
21	002153	石基信息	30,955,370.48	5.62
22	603883	老百姓	30,824,818.90	5.59
23	000975	银泰黄金	30,620,858.57	5.55
24	688002	睿创微纳	30,564,056.72	5.54
25	603893	瑞芯微	29,547,092.32	5.36
26	600728	佳都科技	29,519,941.00	5.36
27	600486	扬农化工	28,738,205.00	5.21
28	689009	九号公司	28,598,047.49	5.19
29	601233	桐昆股份	28,455,404.91	5.16
30	600556	天下秀	28,284,533.00	5.13
31	300144	宋城演艺	27,984,062.28	5.08
32	002429	兆驰股份	27,840,307.00	5.05
33	603225	新凤鸣	27,688,744.92	5.02
34	600764	中国海防	26,579,326.55	4.82
35	002603	以岭药业	26,485,184.00	4.80
36	601699	潞安环能	26,205,024.71	4.75
37	603127	昭衍新药	26,195,988.41	4.75
38	000987	越秀资本	25,968,395.32	4.71
39	600808	马钢股份	25,818,456.92	4.68
40	300146	汤臣倍健	25,758,901.00	4.67
41	600258	首旅酒店	24,928,630.13	4.52
42	603345	安井食品	24,758,121.00	4.49
43	600487	亨通光电	24,649,055.55	4.47
44	002131	利欧股份	24,491,008.00	4.44
45	002422	科伦药业	24,078,993.00	4.37
46	688385	复旦微电	24,005,567.80	4.35
47	002568	百润股份	23,996,194.10	4.35
48	600580	卧龙电驱	23,518,450.00	4.27
49	300188	美亚柏科	23,485,407.80	4.26
50	600027	华电国际	23,419,122.00	4.25
51	601869	长飞光纤	23,018,296.00	4.18
52	603737	三棵树	22,983,235.00	4.17
53	000513	丽珠集团	22,818,510.66	4.14
54	603317	天味食品	22,411,335.12	4.07
55	600862	中航高科	21,984,632.00	3.99
56	601098	中南传媒	21,606,699.93	3.92
57	002152	广电运通	21,533,240.00	3.91
58	600871	石化油服	21,412,321.82	3.88
59	688567	孚能科技	21,232,206.58	3.85

60	688519	南亚新材	20,998,692.53	3.81
61	600316	洪都航空	20,880,796.25	3.79
62	300253	卫宁健康	20,759,723.80	3.77
63	002372	伟星新材	20,699,108.55	3.75
64	600535	天士力	20,619,487.24	3.74
65	688185	康希诺	20,522,657.72	3.72
66	603233	大参林	20,411,329.31	3.70
67	002468	申通快递	20,259,936.00	3.68
68	601000	唐山港	20,199,366.56	3.66
69	600707	彩虹股份	20,066,368.12	3.64
70	000729	燕京啤酒	19,852,938.04	3.60
71	600118	中国卫星	19,690,015.43	3.57
72	603517	绝味食品	19,316,715.95	3.50
73	600161	天坛生物	19,251,659.80	3.49
74	688063	派能科技	19,231,900.42	3.49
75	688390	固德威	19,057,587.38	3.46
76	600967	内蒙一机	18,961,751.00	3.44
77	600516	方大炭素	18,916,237.40	3.43
78	600705	中航产融	18,888,127.00	3.43
79	603658	安图生物	18,761,565.62	3.40
80	601128	常熟银行	18,757,537.00	3.40
81	002531	天顺风能	18,706,656.00	3.39
82	600688	上海石化	18,593,491.00	3.37
83	600536	中国软件	18,571,658.03	3.37
84	300558	贝达药业	18,448,233.18	3.35
85	002831	裕同科技	18,445,220.00	3.35
86	603688	石英股份	18,304,037.00	3.32
87	002500	山西证券	18,289,947.00	3.32
88	600064	南京高科	18,280,168.80	3.32
89	688256	寒武纪	18,241,432.32	3.31
90	300096	易联众	18,179,865.03	3.30
91	300699	光威复材	18,179,230.02	3.30
92	002299	圣农发展	18,175,375.00	3.30
93	300724	捷佳伟创	17,909,140.00	3.25
94	002080	中材科技	17,870,548.00	3.24
95	600582	天地科技	17,710,185.00	3.21
96	002683	广东宏大	17,618,266.00	3.20
97	601077	渝农商行	17,595,722.00	3.19
98	000656	金科股份	17,357,454.46	3.15
99	688088	虹软科技	17,154,637.95	3.11
100	601958	金钼股份	17,144,535.00	3.11
101	002532	天山铝业	16,842,466.00	3.06
102	002155	湖南黄金	16,834,440.00	3.05

103	601991	大唐发电	16,674,303.00	3.02
104	002409	雅克科技	16,662,631.00	3.02
105	002745	木林森	16,503,209.00	2.99
106	603927	中科软	16,436,978.60	2.98
107	002273	水晶光电	16,436,723.72	2.98
108	000830	鲁西化工	16,242,164.00	2.95
109	600348	华阳股份	16,216,163.57	2.94
110	688561	奇安信	16,174,646.14	2.93
111	300676	华大基因	16,106,396.75	2.92
112	600566	济川药业	16,089,485.00	2.92
113	300244	迪安诊断	15,876,434.93	2.88
114	688234	天岳先进	15,787,969.64	2.86
115	002572	索菲亚	15,684,161.11	2.85
116	600497	驰宏锌锗	15,642,984.00	2.84
117	603444	吉比特	15,629,896.00	2.84
118	688289	圣湘生物	15,555,403.72	2.82
119	300009	安科生物	15,530,569.97	2.82
120	000997	新大陆	15,510,704.24	2.81
121	600998	九州通	15,499,301.20	2.81
122	688777	中控技术	15,343,080.49	2.78
123	601106	中国一重	14,974,574.00	2.72
124	300001	特锐德	14,934,536.00	2.71
125	600642	申能股份	14,932,912.41	2.71
126	601928	凤凰传媒	14,663,162.00	2.66
127	600968	海油发展	14,621,636.00	2.65
128	000400	许继电气	14,598,597.00	2.65
129	300776	帝尔激光	14,226,594.62	2.58
130	000629	钒钛股份	14,219,534.00	2.58
131	600985	淮北矿业	14,065,830.03	2.55
132	601636	旗滨集团	13,995,021.00	2.54
133	002563	森马服饰	13,954,112.00	2.53
134	600390	五矿资本	13,842,109.80	2.51
135	300285	国瓷材料	13,839,167.00	2.51
136	600195	中牧股份	13,808,464.08	2.50
137	600546	山煤国际	13,726,073.79	2.49
138	002423	中粮资本	13,719,191.60	2.49
139	603885	吉祥航空	13,626,808.00	2.47
140	688009	中国通号	13,608,420.81	2.47
141	688030	山石网科	13,590,304.16	2.47
142	600801	华新水泥	13,566,784.48	2.46
143	601696	中银证券	13,491,396.50	2.45
144	600867	通化东宝	13,395,527.00	2.43
145	603596	伯特利	13,376,567.00	2.43

146	600373	中文传媒	13,292,052.00	2.41
147	000547	航天发展	13,161,132.00	2.39
148	002025	航天电器	13,146,909.00	2.38
149	688772	珠海冠宇	13,128,287.73	2.38
150	000807	云铝股份	13,101,951.00	2.38
151	002625	光启技术	13,092,602.00	2.38
152	600988	赤峰黄金	13,049,237.00	2.37
153	300888	稳健医疗	13,008,431.00	2.36
154	000581	威孚高科	12,938,416.00	2.35
155	000825	太钢不锈	12,615,938.00	2.29
156	300115	长盈精密	12,539,169.00	2.27
157	600062	华润双鹤	12,489,329.72	2.27
158	300418	昆仑万维	12,433,251.00	2.26
159	000425	徐工机械	12,368,403.00	2.24
160	000050	深天马 A	12,303,317.00	2.23
161	601598	中国外运	12,210,260.00	2.22
162	002797	第一创业	12,177,945.00	2.21
163	688208	道通科技	12,156,668.06	2.21
164	002353	杰瑞股份	11,926,735.00	2.16
165	600839	四川长虹	11,808,789.70	2.14
166	601872	招商轮船	11,765,562.80	2.13
167	300850	新强联	11,761,581.85	2.13
168	002430	杭氧股份	11,760,325.93	2.13
169	000999	华润三九	11,751,586.14	2.13
170	300168	万达信息	11,742,797.00	2.13
171	000598	兴蓉环境	11,697,539.00	2.12
172	600498	烽火通信	11,664,443.00	2.12
173	000906	浙商中拓	11,630,132.27	2.11
174	002060	粤水电	11,434,384.00	2.07
175	603858	步长制药	11,408,103.75	2.07
176	688029	南微医学	11,385,825.40	2.07
177	603605	珀莱雅	11,246,948.60	2.04
178	000062	深圳华强	11,239,944.39	2.04
179	002444	巨星科技	11,218,570.80	2.04
180	603589	口子窖	11,215,968.00	2.03
181	600521	华海药业	11,195,833.70	2.03
182	000932	华菱钢铁	11,149,916.80	2.02
183	603712	七一二	11,097,429.82	2.01
184	600765	中航重机	11,091,795.00	2.01
185	002254	泰和新材	11,062,092.00	2.01
186	603026	胜华新材	11,050,391.55	2.00

注：“卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	8,807,190,683.02
卖出股票收入（成交）总额	6,178,725,594.54

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行交易，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地实现投资目标。

### 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

本基金可基于谨慎原则运用国债期货对基本投资组合进行管理，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

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

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

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	700,064.98
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	103,925,245.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	104,625,310.47

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
万家中证 500 指数增强发起式 A	122,725	10,583.11	1,061,568,667.69	81.73	237,243,112.39	18.27
万家中证 500 指数	18,793	77,210.05	1,320,265,550.85	90.99	130,742,912.21	9.01

增强发起 式 C						
合计	140,289	19,601.11	2,381,834,218.54	86.62	367,986,024.60	13.38

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	211,883.07	0.0163
	万家中证 500 指数增强发起式 C	114,567.11	0.0079
	合计	326,450.18	0.0119

## 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	0~10
	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	10~50
	万家中证 500 指数增强发起式 C	0
	合计	10~50

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金成立后有 10,001,000.10 份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为 2019 年 5 月 23 日（合同生效日）起 3 年。截至本报告期末，最低持有期限届满，发起资金持有份额为 0.00 份。

## § 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	229,523,608.99	177,489,082.46



本报告期基金总申购份额	1, 148, 369, 778. 20	1, 653, 654, 726. 72
减：本报告期基金总赎回份额	79, 081, 607. 11	380, 135, 346. 12
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1, 298, 811, 780. 08	1, 451, 008, 463. 06

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中泰证券	1	4, 833, 405, 55	32. 29	4, 332, 212. 87	32. 84	-

		9.29				
德邦证券	2	2,814,284,468.29	18.80	2,620,960.98	19.87	-
广发证券	2	2,728,810,534.38	18.23	2,541,369.68	19.26	-
民生证券	1	2,192,774,828.04	14.65	1,603,591.99	12.15	-
东方财富证券	1	1,002,197,429.45	6.69	934,368.90	7.08	-
第一创业证券	2	710,263,647.95	4.74	519,409.08	3.94	-
招商证券	1	497,186,927.55	3.32	463,044.06	3.51	-
上海证券	1	191,125,921.41	1.28	177,990.65	1.35	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	3	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-

注：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、基金专用交易席位的变更情况：

本报告期内，本基金新增中邮证券交易单元 1 个、广发证券交易单元 1 个，减少大同证券交易单元 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	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在红塔证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 01 月 17 日
2	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在东兴证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 01 月 18 日
3	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	指定媒介	2023 年 01 月 20 日
4	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在东莞证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 01 月 31 日
5	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在国元证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 02 月 09 日
6	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在民生证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 02 月 14 日
7	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在万联证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 02 月 16 日
8	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增民商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	2023 年 02 月 16 日
9	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在粤开证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 02 月 28 日
10	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在国元证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 03 月 01 日
11	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在华龙证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 03 月 03 日

12	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在兴业证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 03 月 08 日
13	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在华林证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 03 月 09 日
14	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2022 年年度报告	指定媒介	2023 年 03 月 30 日
15	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华夏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	2023 年 04 月 10 日
16	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在浙商证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 04 月 19 日
17	万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	指定媒介	2023 年 04 月 21 日
18	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增泉州银行为销售机构并开通转换、基金定投业务的公告	指定媒介	2023 年 04 月 26 日
19	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增杭州银行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	2023 年 05 月 17 日
20	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	2023 年 05 月 19 日
21	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在陆享基金开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 06 月 01 日
22	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在国盛证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 06 月 06 日
23	万家基金管理有限公司关于旗下基金在国泰君安证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 06 月 16 日
24	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	2023 年 06 月 20 日
25	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	2023 年 06 月 21 日
26	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在杭州银行开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 06 月 28 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20230301-20230417、20230522-20230601	69,467,870.79	558,635,532.37	112,361,204.21	515,742,198.95	18.76
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、《万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》。
- 4、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年中期报告原文。
- 5、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。
- 7、本报告期内在中国证监会指定媒介公开披露的基金净值、更新招募说明书及其他临时公告。

### 12.2 存放地点

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

2023 年 8 月 30 日