

万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资
基金
2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：江苏银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2026 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	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	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	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	53

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	53
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	53
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	56
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	56
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	万家沪深 300ETF
场内简称	沪深 300ETF 万家
基金主代码	159393
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 2 月 25 日
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	江苏银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	42, 046, 342. 00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易 所	深圳证券交易所
上市日期	2025 年 3 月 10 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	1、股票投资策略；2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、可转换债券与可交换债券投资策略；6、股指期货交易策略；7、国债期货交易策略；8、股票期权投资策略；9、参与融资与转融通证券出借业务策略；10、其他。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即沪深 300 指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪沪深 300 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		万家基金管理有限公司	江苏银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	兰剑	田作全
	联系电话	021-38909626	025-58588321
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	tianzuoquan@jsbchina.cn
客户服务电话		4008880800	95319
传真		021-38909627	025-58588155
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦 电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	南京市中华路 26 号
办公地址		上海市浦东新区浦电路 360 号陆 家嘴投资大厦 9 楼、15 楼、16 楼	南京市中华路 26 号
邮政编码		200122	210001
法定代表人		陈广益	袁军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.wjasset.com
基金中期报告置备地点	基金管理人办公场所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	27,486,729.53
本期利润	29,212,989.50
加权平均基金份额本期利润	0.5137
本期加权平均净值利润率	10.43%
本期基金份额净值增长率	10.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	43,974,129.51
期末可供分配基金份额利润	1.0458
期末基金资产净值	222,618,783.29
期末基金份额净值	5.2946
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	35.16%

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）。

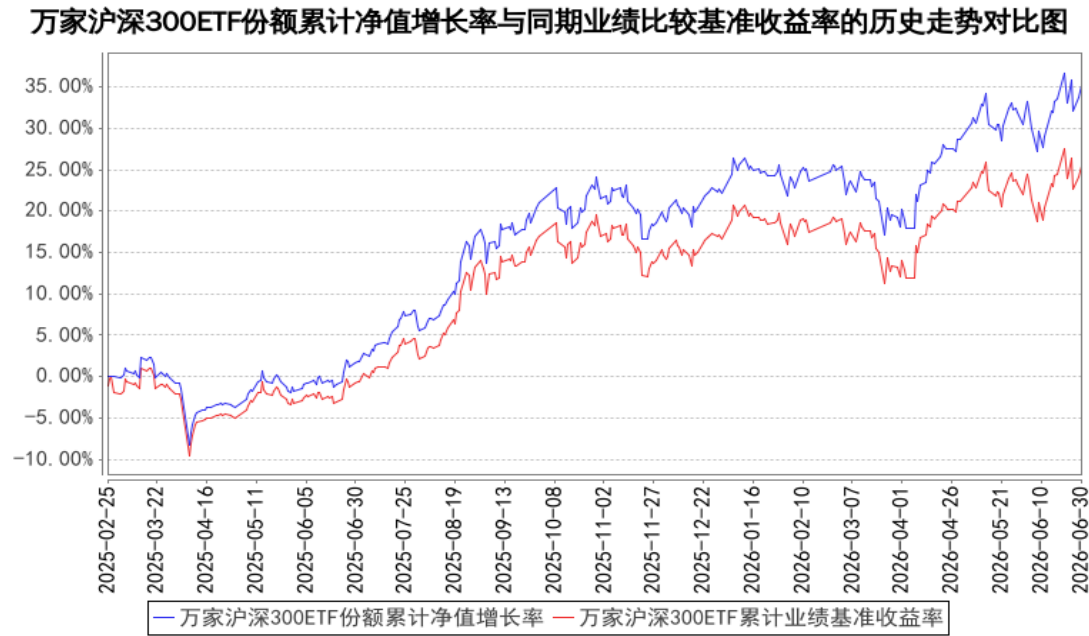
3.2 基金净值表现

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

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
过去三个月	14.39%	1.24%	11.90%	1.26%	2.49%	-0.02%
过去六个月	10.66%	1.12%	7.55%	1.13%	3.11%	-0.01%

过去一年	32.99%	1.01%	26.51%	1.02%	6.48%	-0.01%
自基金合同生效起至今	35.16%	1.00%	25.44%	1.02%	9.72%	-0.02%

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



注：本基金于 2025 年 2 月 25 日成立，根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44 号文批准设立。公司的股东为中泰证券股份有限公司、山东省新动能基金管理有限公司，住所：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 楼（名义楼层 9 层）。截至 2026 年 6 月 30 日，公司共管理 208 只开放式基金，其中包括 59 只股票型基金、80 只混合型基金、48 只债券型基金、5 只货币市场基金、4 只 QDII 基金、12 只基金中基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴宜	万家上证	2026 年 3	-	4 年	国籍：中国；学历：浙江大学产业经济学

蓉	50 交易型 开放式指 数证券投 资基金、 万家上证 科创板 50 成份交易 型开放式 指数证券 投资基 金、万家 上证科创 板成长交 易型开放 式指数证 券投资基 金、万家 中证全指 公用事业 交易型开 放式指数 证券投资 基金、万 家中证半 导体材料 设备主题 交易型开 放式指数 证券投资 基金、万 家中证工 程机械主 题指数型 发起式证 券投资基 金、万家 中证机器 人交易型 开放式指 数证券投资 基金、 万家中证 畜牧养殖 产业交易 型开放式	月 30 日			专业硕士，2025 年 7 月入职万家基金管理有限公司，现任量化投资部基金经理。曾任东方财富信息股份有限公司集团分析部分析师，平安资产管理有限公司 AI 实验室模型工程师，华宝基金管理有限公司指数研发投资部分析师、基金经理助理等职。
---	---	--------	--	--	--

	指数证券投资基金、万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金、万家沪深 300 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的基金经理。				
杨坤	万家中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金、万家中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家中证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家中证港股通央企红利交易型	2025 年 2 月 25 日	2026 年 3 月 30 日	11 年	国籍：中国；学历：法国南特国立高等矿业学校自动化与工业信息技术专业硕士，2015 年 6 月入职万家基金管理有限公司，现任量化投资部基金经理，历任量化投资部研究员。曾任 Fractabole 量化 IT 工程师等职。

开放式指数证券投资基金、万家中证港股通央企红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、万家中证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、万家创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、万家创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家北证 50 成份指数型发起式证券投				
---	--	--	--	--

资基金、 万家国证 2000 交易 型开放式 指数证券 投 资 基 金、万家 国证 2000 交易型开 放式指数 证券投资 基金发起 式联接基 金、万家 国证港股 通科技交 易型开放 式指数证 券投资基 金、万家 恒生互联 网科技业 交易型开 放式指数 证券投资 基 金 (QDII)、 万家恒生 互联网科 技业交易 型开放式 指数证券 投资基金 发起式联 接 基 金 (QDII)、 万家沪深 300 交易 型开放式 指数证券 投 资 基 金、万家 沪深 300 交易型开 放式指数				
--	--	--	--	--

	证券投资基金联接基金、万家纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) 的基金经理。				
--	--	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律、法规和监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋取最大利益，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，管理人制定了《公平交易管理办法》和《异常交易监控及报告管理办法》等规章制度,涵盖了研究、授权、投资决策和交易执行等投资管理活动的各个环节，确保公平对待不同投资组合，防范导致不公平交易以及利益输送的异常交易发生。

管理人制订了明确的投资授权制度，并建立了统一的投资管理平台，确保不同投资组合获得公平的投资决策机会。实行集中交易制度,对于交易所公开竞价交易，执行交易系统中的公平交易程序；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，管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 4 次，为量化投资组合或不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，国内经济延续温和修复态势。在 AI 周期驱动下，半导体需求增长强劲，科技行业维持较高景气，而传统周期行业 and 消费行业受制于产能出清和需求走弱，景气度持续低迷。出口方面，外需展现较强韧性，成为上半年经济增长的重要动能。内需层面，消费温和改善，依托以旧换新政策提质扩容，消费结构有所优化，但商品消费修复节奏偏缓。房地产市场持续调整，制造业与基建投资降幅边际收窄，显示稳投资政策效能逐步释放。政策方面，财政与货币政策保持适度宽松，流动性合理充裕。海外方面，全球地缘冲突反复推高能源价格，但随着地缘博弈趋于常态化，能源风险溢价逐步回落。上半年 A 股市场震荡上行，风格分化明显。中小盘风格相对占优，中证 1000 累计上涨 15.99%，而沪深 300 仅上涨 7.55%。成长风格表现突出，科创 50 累计上涨 64.25%，而中证红利累计下跌 8.75%。行业层面，电子、通信等科技板块表现强劲，消费者服务、农林牧渔等行业表现较弱。

本基金作为被动投资的指数基金，其投资目标是通过跟踪、复制指数，为投资者获取市场长期的平均收益。报告期内我们严格按照基金合同规定，原则上采取完全复制的方法进行投资管理，努力拟合标的指数，减小跟踪误差，将基金跟踪误差控制在较低范围之内。同时，本基金采用有效的量化跟踪技术，降低管理成本。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家沪深 300ETF 的基金份额净值为 5.2946 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.66%，同期业绩比较基准收益率为 7.55%。基金报告期内日跟踪偏离度为 0.0363%，年化跟踪误差为 0.8748%，符合基金合同中日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2% 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

展望下半年，国际贸易摩擦与全球货币政策环境仍存在不确定性，国内宏观政策有望持续发力，加大逆周期调节力度。财政端有望加快资金拨付与项目落地，货币端保持适度宽松，存量政策和增量政策协同共振，有效对冲外部风险，巩固经济回升基础。产业层面，新旧动能转换提速，

前沿技术突破有望推动新兴支柱产业发展。资本市场改革同步深化，投融资两端平衡发展将增强市场应对外部市场波动以及跨境风险传导的能力。随着政策效应逐步显现与中长期资金入市机制不断完善，市场底部支撑愈发坚实，A 股中长期配置价值凸显。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本基金托管人——江苏银行股份有限公司未发现万家基金管理有限公司在基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上存在损害基金份额持有人利益的行为，或违反《中华人民共和国证券投资基金法》等有关

法律法规、在各重要方面的运作违反基金合同规定的情况。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	373,558.80	1,088,248.71
结算备付金		4,863,253.29	4,800,446.93
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	220,451,999.98	369,559,784.78
其中：股票投资		220,451,999.98	369,559,784.78
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	60,492.63	-
资产总计		225,749,304.70	375,448,480.42
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2026 年 6 月 30 日	2025 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		3,002,428.32	1,820,483.44
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		26,562.44	49,527.49
应付托管费		8,854.15	16,509.15
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	92,676.50	146,217.97
负债合计		3,130,521.41	2,032,738.05
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	164,703,157.87	305,721,696.00
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	57,915,625.42	67,694,046.37
净资产合计		222,618,783.29	373,415,742.37
负债和净资产总计		225,749,304.70	375,448,480.42

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 5.2946 元，基金份额总额 42,046,342.00 份。

6.2 利润表

会计主体：万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 2 月 25 日（基金 合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		29,635,844.27	6,624,525.79
1. 利息收入		4,381.69	28,425.28
其中：存款利息收入	6.4.7.10	4,381.69	28,425.28
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”		27,411,767.88	1,535,314.56

填列)			
其中：股票投资收益	6.4.7.11	25,168,917.28	-1,320,919.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	2,242,850.60	2,856,233.81
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,726,259.97	5,384,109.57
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.18	493,434.73	-323,323.62
减：二、营业总支出		422,854.77	358,026.85
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	209,284.94	178,872.22
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	69,761.71	59,624.04
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.20	143,808.12	119,530.59
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		29,212,989.50	6,266,498.94
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		29,212,989.50	6,266,498.94
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		29,212,989.50	6,266,498.94

注：本基金合同生效日为 2025 年 2 月 25 日，上年度可比期间为 2025 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日。

6.3 净资产变动表

会计主体：万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	305,721,696.00	-	67,694,046.37	373,415,742.37
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	305,721,696.00	-	67,694,046.37	373,415,742.37
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-141,018,538.13	-	-9,778,420.95	-150,796,959.08
（一）、综合收益总额	-	-	29,212,989.50	29,212,989.50
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-141,018,538.13	-	-38,991,410.45	-180,009,948.58
其中：1. 基金申购款	260,884,295.58	-	69,489,158.01	330,373,453.59
2. 基金赎回款	-401,902,833.71	-	-108,480,568.46	-510,383,402.17
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	164,703,157.87	-	57,915,625.42	222,618,783.29
项目	上年度可比期间			

	2025 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	587,512,917.00	-	-	587,512,917.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-408,707,905.33	-	2,924,126.02	-405,783,779.31
（一）、综合收益总额	-	-	6,266,498.94	6,266,498.94
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-408,707,905.33	-	-3,342,372.92	-412,050,278.25
其中：1. 基金申购款	316,598,636.20	-	-10,279,527.93	306,319,108.27
2. 基金赎回款	-725,306,541.53	-	6,937,155.01	-718,369,386.52
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	178,805,011.67	-	2,924,126.02	181,729,137.69

注：本基金合同生效日为 2025 年 2 月 25 日，上年度可比期间为 2025 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日。

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：

陈广益莫海波尹超

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

万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2024]1884 号文《关于准予万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的核准，由万家基金管理有限公司作为基金管理人于 2025 年 2 月 10 日至 2025 年 2 月 20 日向社会公开募集，募集期结束经立信会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具信会师报字[2025]第 ZA30201 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2025 年 2 月 25 日生效，本基金为交易型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 587,467,000.00 元（现金部分），有效认购资金在基金验资确认日之前产生的利息为人民币 45,917.00 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 587,512,917.00 元，折合 587,512,917.00 份基金份额。本基金目前暂不开通网下股票认购业务。本基金的基金管理人为万家基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为江苏银行股份有限公司。

根据《万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《关于万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额折算及相关业务安排的公告》的有关规定，基金管理人万家基金管理有限公司对权益登记日在登记结算机构（中国证券登记结算有限责任公司）登记在册的本基金基金份额进行折算与变更登记，权益登记日为 2025 年 3 月 28 日，本基金折算前的基金份额总额为 429,112,917.00 份，基金份额净值为 0.9994 元，折算后基金份额总额为 109,546,342.00 份，基金份额净值为 3.9150 元。基金份额持有人持有的折算产生的小数点后基金份额按照“上进位”的原则进行取整，即小数点后基金份额均进位为 1 份，折算后的基金份额以登记结算机构最终确认的数据为准。

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

相关规定)。本基金可参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率,即沪深 300 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本中期报告所采用的会计政策、会计估计与上年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

(一) 印花税

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(二) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

根据 2026 年 1 月 1 日起施行的《中华人民共和国增值税法》的规定，取得存款利息收入不征收增值税；

根据 2026 年 1 月 1 日起施行的《中华人民共和国增值税法实施条例》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；

根据财政部、国家税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，公募证券投资基金（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、债券取得的收入免征增值税；金融同业往来利息收入免征增值税；资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税；

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

(三) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等

收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(四) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》的规定，对基金通过深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	373,558.80
等于：本金	373,478.28
加：应计利息	80.52
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	373,558.80

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		206,051,603.15	-	220,451,999.98	14,400,396.83
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		206,051,603.15	-	220,451,999.98	14,400,396.83

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	—
其他应收款	—
待摊费用	60,492.63
合计	60,492.63

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	—
其中：交易所市场	—
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	84,300.75
其他	8,375.75
合计	92,676.50

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	78,046,342.00	305,721,696.00
本期申购	66,600,000.00	260,884,295.58
本期赎回（以“-”号填列）	-102,600,000.00	-401,902,833.71
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	42,046,342.00	164,703,157.87

6.4.7.8 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	40,849,211.51	26,844,834.86	67,694,046.37
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	40,849,211.51	26,844,834.86	67,694,046.37
本期利润	27,486,729.53	1,726,259.97	29,212,989.50
本期基金份额交易产生的变动数	-24,361,811.53	-14,629,598.92	-38,991,410.45
其中：基金申购款	49,349,488.95	20,139,669.06	69,489,158.01
基金赎回款	-73,711,300.48	-34,769,267.98	-108,480,568.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	43,974,129.51	13,941,495.91	57,915,625.42

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,504.78
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	1,876.91
其他	-
合计	4,381.69

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	10,087,430.75
股票投资收益——赎回差价收入	15,081,486.53
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	25,168,917.28

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	326,931,411.38
减：卖出股票成本总额	316,537,717.60
减：交易费用	306,263.03
买卖股票差价收入	10,087,430.75

6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	510,383,402.17
减：现金支付赎回款总额	306,496,467.17
减：赎回股票成本总额	188,805,448.47
减：交易费用	—
赎回差价收入	15,081,486.53

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,242,850.60
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	2,242,850.60

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1. 交易性金融资产	1,726,259.97
股票投资	1,726,259.97
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	1,726,259.97

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	493,434.73
合计	493,434.73

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
中登登记结算服务费	59,507.37
IOPV 计算服务费	9,916.99
合计	143,808.12

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、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司（“万家基金”）	基金管理人
江苏银行股份有限公司（“江苏银行”）	基金托管人
中泰证券股份有限公司（“中泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构、基金证券经纪商
万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资	本基金的联接基金

基金联接基金（“万家沪深 300ETF 联接”）	
--------------------------	--

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年2月25日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
中泰证券	550,296,554.30	100.00	1,304,031,219.90	100.00

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 2026年1月1日至2026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	107,508.78	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年2月25日（基金合同生效日）至2025年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
中泰证券	253,153.89	100.00	-	-

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月
----	---------------------------------------	---

		30 日
当期发生的基金应支付的管理费	209,284.94	178,872.22
其中：应支付销售机构的客户维护费	42,428.94	44,479.78
应支付基金管理人的净管理费	166,856.00	134,392.44

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

$$H=E\times 0.15\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人和基金托管人核对一致后由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。基金管理人可选择在 3 个工作日内向基金托管人出具划款指令，也可授权基金托管人进行费用自动支付处理，如选择自动支付，基金管理人应确保支付当日账户余额充足，如因资金余额不足或其他原因造成自动支付无法进行，基金管理人应另行出具划款指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	69,761.71	59,624.04

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

$$H=E\times 0.05\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人和基金托管人核对一致后由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。基金管理人可选择在 3 个工作日内向基金托管人出具划款指令，也可授权基金托管人进行费用自动支付处理，如选择自动支付，基金管理人应确保支付当日账户余额充足，如因资金余额不足或其他原因造成自动支付无法进行，基金管理人应另行出具划款指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
万 家 沪 深 300ETF联接	7,012,300.00	16.6776	18,490,000.00	23.6911

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
江苏银行	373,558.80	2,504.78	493,932.62	12,492.53

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

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

为最大限度地降低本基金投资的跟踪误差，保护基金份额持有人的合法权益，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，经本基金基金托管人同意，且履行了基金合同规定的相关程序，在报告期内投资于基金管理人实际控制人山东能源集团有限公司控股的兖矿能源集团股份有限公司发行的 A 股兖矿能源、基金托管人江苏银行股份有限公司发行的 A 股江苏银行、控股股东中泰证券股份有限公司发行的 A 股中泰证券及与托管人江苏银行股份有限公司有重大利害关系的公司华泰证券股份有限公司发行的 A 股华泰证券。于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有兖矿能源 13,800.00 股（2025 年 12 月 31 日：25,900 股），占本基金资产净值比例为 0.1102%（2025 年 12 月 31 日：0.0912%）；持有江苏银行 112,976.00 股（2025 年 12 月 31 日：213,376 股），占本基金资产净值比例为 0.5471%（2025 年 12 月 31 日：0.5943%）；持有中泰证券 24,500.00 股（2025 年 12 月 31 日：46,300 股），占本基金资产净值比例为 0.0585%（2025 年 12 月 31 日：0.0806%）；持有华泰证券 45,000.00 股（2025 年 12 月 31 日：84,900 股），占本基金资产净值比例为 0.4168%（2025 年 12 月 31 日：0.5363%）。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2026 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
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	117	6,231.42	6,872.58	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	6,711	67,848.21	67,848.21	-
001248	华	2026	1 个月	新股	10.11	10.11	2,876	29,076.36	29,076.36	-

	润 新 能 源	年 6 月 24 日	内(含)	未上 市						
001257	盛 龙 股 份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	7.82	20.74	1,175	9,188.50	24,369.50	-
001312	福 恩 股 份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股 流通 受限	18.38	16.78	107	1,966.66	1,795.46	-
001365	天 海 电 子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股 流通 受限	27.19	31.31	285	7,749.15	8,923.35	-
001399	惠 科 股 份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股 流通 受限	10.12	27.73	1,162	11,759.44	32,222.26	-
301513	尚 水 智 能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新股 流通 受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春 光 集 团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股 流通 受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理 奇 智 能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股 流通 受限	13.91	32.47	358	4,979.78	11,624.26	-
301666	大 普 微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股 流通 受限	46.08	463.33	453	20,874.24	209,888.49	-
301669	高 特 电 子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股 流通 受限	7.08	28.40	472	3,341.76	13,404.80	-
301680	固 德 电 材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股 流通 受限	58.00	112.16	103	5,974.00	11,552.48	-

301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	283	19,713.78	45,296.98	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	63	4,937.94	7,671.51	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	198	4,886.64	17,186.40	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	348	3,890.64	6,121.32	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	53	1,774.97	1,798.29	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	204	3,610.80	17,201.28	-

688635	长进光子	2026年5月20日	6个月	新股流通受限	40.98	308.19	108	4,425.84	33,284.52	-
688712	北芯生命	2026年1月28日	6个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,483	25,982.16	53,269.36	-
688781	视涯科技	2026年3月18日	9个月	新股流通受限	22.68	42.16	2,806	63,640.08	118,300.96	-
688785	恒运昌	2026年1月20日	6个月	新股流通受限	92.18	463.15	93	8,572.74	43,072.95	-
688795	摩尔线程	2025年11月26日	9个月	新股流通受限	114.28	676.94	1,230	140,564.40	832,636.20	-
688797	臻宝科技	2026年6月16日	6个月	新股流通受限	44.56	468.67	87	3,876.72	40,774.29	-
688802	沐曦股份	2025年12月9日	9个月	新股流通受限	104.66	768.89	932	97,543.12	716,605.48	-
688808	联讯仪器	2026年4月16日	6个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	75	6,141.00	118,824.75	-
688811	有研复材	2026年4月1日	6个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026年3月24日	6个月	新股流通受限	26.28	172.09	215	5,650.20	36,999.35	-
688816	易思维	2026年2月4日	6个月	新股流通受限	55.95	57.10	157	8,784.15	8,964.70	-

688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,138	10,776.86	79,819.32	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	424	8,344.32	59,991.76	-

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
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	1,400	920,336.52	1,164,800.00	-

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 2026 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 2026 年 6 月 30 日止，本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人将风险管理融入各业务层面，建立了四道防线：以各岗位目标责任制为基础，形成第一道防线；合规风控部门通过完善的风险控制制度和手段对各一线部门的风险管理工作进行指导、管理和监督，形成第二道防线；独立的监察稽核部门对公司内部控制制度的总体执行情况

况和有效性进行监督、检查、评估和反馈，形成第三道防线；董事会及其风险管理委员会听取公司管理层对公司整体运营情况的报告，并提出指导性意见，形成第四道防线。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的货币资金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 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。(2025 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（2026 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 2026 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	373, 558. 80	-	-	-	-	-	373, 558. 80
结算备付金	4, 863, 253. 29	-	-	-	-	-	4, 863, 253. 29
交易性金融资产	-	-	-	-	-	220, 451, 999. 98	220, 451, 999. 98
其他资产	-	-	-	-	-	60, 492. 63	60, 492. 63
资产总计	5, 236, 812. 09	-	-	-	-	220, 512, 492. 61	225, 749, 304. 70
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	26, 562. 44	26, 562. 44
应付托管费	-	-	-	-	-	8, 854. 15	8, 854. 15
应付清算款	-	-	-	-	-	3, 002, 428. 32	3, 002, 428. 32
其他负债	-	-	-	-	-	92, 676. 50	92, 676. 50
负债总计	-	-	-	-	-	3, 130, 521. 41	3, 130, 521. 41
利率敏感度缺口	5, 236, 812. 09	-	-	-	-	217, 381, 971. 20	222, 618, 783. 29

上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,088,248.71	-	-	-	-	-	1,088,248.71
结算备付金	4,800,446.93	-	-	-	-	-	4,800,446.93
交易性金融资产	-	-	-	-	-	369,559,784.78	369,559,784.78
资产总计	5,888,695.64	-	-	-	-	369,559,784.78	375,448,480.42
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	49,527.49	49,527.49
应付托管费	-	-	-	-	-	16,509.15	16,509.15
应付清算款	-	-	-	-	-	1,820,483.44	1,820,483.44
其他负债	-	-	-	-	-	146,217.97	146,217.97
负债总计	-	-	-	-	-	2,032,738.05	2,032,738.05
利率敏感度缺口	5,888,695.64	-	-	-	-	367,527,046.73	373,415,742.37

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 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2025 年 12 月 31 日：同），货币资金、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2025 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，所面临的重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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025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	220,451,999.98	99.03	369,559,784.78	98.97
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	220,451,999.98	99.03	369,559,784.78	98.97

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除股票基准指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	股票基准指数上升 100 个基点	2,424,477.67	3,998,022.67
	股票基准指数下降 100 个基点	-2,424,477.67	-3,998,022.67

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	216,553,558.83	365,613,211.02
第二层次	1,261,724.57	2,580,171.00
第三层次	2,636,716.58	1,366,402.76
合计	220,451,999.98	369,559,784.78

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	220,451,999.98	97.65
	其中：股票	220,451,999.98	97.65
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	5,236,812.09	2.32
8	其他各项资产	60,492.63	0.03
9	合计	225,749,304.70	100.00

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

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,238,678.00	0.56
B	采矿业	9,109,971.00	4.09
C	制造业	139,433,371.53	62.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,410,064.00	2.43
E	建筑业	2,485,821.00	1.12
F	批发和零售业	322,116.00	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	5,279,594.42	2.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,821,215.00	5.31
J	金融业	38,119,855.98	17.12
K	房地产业	710,147.30	0.32
L	租赁和商务服务业	993,269.00	0.45
M	科学研究和技术服务业	2,373,160.60	1.07
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	295,708.00	0.13
R	文化、体育和娱乐业	125,317.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	217,718,288.83	97.80

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	24,369.50	0.01

C	制造业	2,610,763.62	1.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	96,924.57	0.04
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	2,733,641.15	1.23

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	8,600	10,922,000.00	4.91
2	300750	宁德时代	20,200	7,938,802.00	3.57
3	300502	新易盛	10,744	6,521,608.00	2.93
4	600519	贵州茅台	4,801	5,691,537.49	2.56
5	603986	兆易创新	5,200	4,238,000.00	1.90
6	688256	寒武纪	2,480	3,956,964.00	1.78
7	601318	中国平安	82,100	3,919,454.00	1.76
8	600036	招商银行	95,200	3,379,600.00	1.52
9	601899	紫金矿业	126,800	3,187,752.00	1.43
10	002371	北方华创	3,305	2,923,470.80	1.31

11	000333	美的集团	37,400	2,824,822.00	1.27
12	002475	立讯精密	39,200	2,759,680.00	1.24
13	688008	澜起科技	8,800	2,727,120.00	1.23
14	688012	中微公司	5,713	2,676,540.50	1.20
15	688041	海光信息	7,100	2,629,130.00	1.18
16	002384	东山精密	9,900	2,597,265.00	1.17
17	600900	长江电力	94,200	2,493,474.00	1.12
17	688981	中芯国际	15,700	2,493,474.00	1.12
18	000725	京东方 A	279,891	2,429,453.88	1.09
19	603259	药明康德	19,060	2,373,160.60	1.07
20	601138	工业富联	30,500	2,200,575.00	0.99
21	600030	中信证券	75,200	2,160,496.00	0.97
22	601166	兴业银行	130,200	2,156,112.00	0.97
23	300059	东方财富	97,400	1,985,012.00	0.89
24	600183	生益科技	11,300	1,959,420.00	0.88
25	600276	恒瑞医药	34,384	1,789,343.36	0.80
26	300274	阳光电源	11,200	1,781,024.00	0.80
27	601398	工商银行	249,000	1,760,430.00	0.79
28	300408	三环集团	10,300	1,719,070.00	0.77
29	002594	比亚迪	20,900	1,665,730.00	0.75
30	300476	胜宏科技	4,700	1,628,221.00	0.73
31	002463	沪电股份	10,400	1,589,120.00	0.71
32	601211	国泰海通	87,000	1,583,400.00	0.71
33	300394	天孚通信	5,020	1,519,453.60	0.68
34	000988	华工科技	7,700	1,421,497.00	0.64
35	301308	江波龙	2,000	1,407,600.00	0.63
36	600176	中国巨石	18,500	1,348,280.00	0.61
37	601288	农业银行	221,300	1,343,291.00	0.60
38	601328	交通银行	205,200	1,319,436.00	0.59
39	000651	格力电器	34,400	1,290,000.00	0.58
40	600522	中天科技	21,000	1,274,280.00	0.57
41	688521	芯原股份	3,300	1,224,762.00	0.55
42	600919	江苏银行	112,976	1,217,881.28	0.55
43	603019	中科曙光	11,328	1,214,701.44	0.55
44	603993	洛阳钼业	67,200	1,179,360.00	0.53
45	600150	中国船舶	34,719	1,173,155.01	0.53
46	600887	伊利股份	48,700	1,166,852.00	0.52
47	688072	拓荆科技	1,400	1,164,800.00	0.52
48	600584	长电科技	11,100	1,149,405.00	0.52
49	000338	潍柴动力	41,400	1,128,150.00	0.51
50	000858	五 粮 液	15,000	1,110,000.00	0.50
51	601816	京沪高铁	226,100	1,024,233.00	0.46
52	600309	万华化学	14,500	991,945.00	0.45

53	300124	汇川技术	14,603	968,616.99	0.44
54	002916	深南电路	2,110	966,169.00	0.43
55	002415	海康威视	28,200	964,440.00	0.43
56	600111	北方稀土	19,500	936,975.00	0.42
57	000100	TCL 科技	160,000	931,200.00	0.42
58	601688	华泰证券	45,000	927,900.00	0.42
59	000063	中兴通讯	24,837	898,851.03	0.40
60	600000	浦发银行	102,700	884,247.00	0.40
61	600089	特变电工	39,100	879,750.00	0.40
62	601857	中国石油	99,700	865,396.00	0.39
63	002028	思源电气	4,800	830,400.00	0.37
64	300433	蓝思科技	15,400	826,364.00	0.37
65	601088	中国神华	21,100	823,744.00	0.37
66	600031	三一重工	45,700	789,696.00	0.35
67	300014	亿纬锂能	11,700	760,851.00	0.34
68	002142	宁波银行	25,400	754,126.00	0.34
69	002050	三花智控	17,200	753,876.00	0.34
70	000001	平安银行	74,700	750,735.00	0.34
71	601601	中国太保	26,300	750,076.00	0.34
72	000792	盐湖股份	24,500	739,655.00	0.33
73	002714	牧原股份	21,000	734,790.00	0.33
74	600549	厦门钨业	8,500	724,200.00	0.33
75	002353	杰瑞股份	4,700	716,750.00	0.32
76	600406	国电南瑞	30,900	706,065.00	0.32
77	601668	中国建筑	159,100	690,494.00	0.31
78	000657	中钨高新	7,000	670,040.00	0.30
79	601229	上海银行	76,500	664,020.00	0.30
80	601919	中远海控	48,300	640,458.00	0.29
81	002602	世纪华通	45,300	638,730.00	0.29
82	300760	迈瑞医疗	4,700	638,401.00	0.29
83	601988	中国银行	110,300	630,916.00	0.28
84	601939	建设银行	65,300	628,839.00	0.28
85	603501	豪威集团	6,600	626,010.00	0.28
86	601728	中国电信	119,700	621,243.00	0.28
87	600660	福耀玻璃	12,300	620,412.00	0.28
88	600016	民生银行	191,100	615,342.00	0.28
89	601012	隆基绿能	46,780	613,753.60	0.28
90	601225	陕西煤业	29,800	606,430.00	0.27
91	002230	科大讯飞	14,800	604,432.00	0.27
92	600999	招商证券	28,600	603,460.00	0.27
93	600941	中国移动	6,900	594,297.00	0.27
94	600690	海尔智家	28,900	589,849.00	0.26
95	002352	顺丰控股	18,500	578,310.00	0.26

96	601985	中国核电	63,200	570,696.00	0.26
97	002938	鹏鼎控股	5,400	569,052.00	0.26
98	002460	赣锋锂业	8,700	568,980.00	0.26
99	002709	天赐材料	11,000	565,730.00	0.25
100	603799	华友钴业	11,700	564,642.00	0.25
101	600926	杭州银行	39,000	563,550.00	0.25
102	601169	北京银行	114,000	558,600.00	0.25
103	000977	浪潮信息	7,900	553,000.00	0.25
104	600160	巨化股份	10,400	551,304.00	0.25
105	300033	同花顺	2,260	544,660.00	0.24
106	000776	广发证券	22,700	531,180.00	0.24
107	300442	润泽科技	6,300	523,341.00	0.24
108	688126	沪硅产业	13,000	518,570.00	0.23
109	000425	徐工机械	63,100	510,479.00	0.23
110	000938	紫光股份	17,500	505,050.00	0.23
111	002202	金风科技	21,100	504,290.00	0.23
112	300498	温氏股份	40,900	503,888.00	0.23
113	601600	中国铝业	61,100	502,242.00	0.23
114	600028	中国石化	112,100	499,966.00	0.22
115	600938	中国海油	18,400	499,560.00	0.22
116	600460	士兰微	9,000	491,940.00	0.22
117	002600	领益智造	28,200	488,988.00	0.22
118	601766	中国中车	93,800	487,760.00	0.22
119	002466	天齐锂业	7,900	484,428.00	0.22
120	600050	中国联通	120,600	482,400.00	0.22
121	300661	圣邦股份	3,330	477,788.40	0.21
122	688082	盛美上海	1,100	475,200.00	0.21
123	601009	南京银行	47,600	470,764.00	0.21
124	002049	紫光国微	5,300	470,375.00	0.21
125	002837	英维克	5,900	469,404.00	0.21
126	002179	中航光电	9,800	452,760.00	0.20
127	601628	中国人寿	12,800	452,480.00	0.20
128	000568	泸州老窖	5,700	441,864.00	0.20
129	601100	恒立液压	4,100	440,996.00	0.20
130	601872	招商轮船	24,900	437,493.00	0.20
131	002241	歌尔股份	19,100	430,323.00	0.19
132	603288	海天味业	12,785	423,950.60	0.19
133	601006	大秦铁路	91,900	423,659.00	0.19
134	000408	藏格矿业	6,100	422,852.00	0.19
135	601658	邮储银行	84,900	418,557.00	0.19
136	601818	光大银行	143,100	413,559.00	0.19
137	605117	德业股份	3,860	409,854.80	0.18
138	600905	三峡能源	110,300	409,213.00	0.18

139	600809	山西汾酒	3,700	404,669.00	0.18
140	600489	中金黄金	22,400	404,320.00	0.18
141	002625	光启技术	13,300	403,256.00	0.18
142	601888	中国中免	7,500	402,825.00	0.18
143	600893	航发动力	10,300	394,902.00	0.18
144	000630	铜陵有色	61,800	393,048.00	0.18
145	688396	华润微	4,000	390,200.00	0.18
146	600010	包钢股份	174,100	388,243.00	0.17
147	601127	赛力斯	6,300	385,875.00	0.17
148	601689	拓普集团	6,800	383,656.00	0.17
149	688111	金山办公	1,800	383,490.00	0.17
150	601336	新华保险	6,400	381,824.00	0.17
151	600958	东方证券	40,200	379,488.00	0.17
152	002027	分众传媒	77,700	376,068.00	0.17
153	688271	联影医疗	3,700	374,551.00	0.17
154	600118	中国卫星	4,500	369,225.00	0.17
155	600019	宝钢股份	67,264	365,243.52	0.16
156	600760	中航沈飞	8,700	357,570.00	0.16
157	000807	云铝股份	15,950	353,133.00	0.16
158	601838	成都银行	19,611	347,114.70	0.16
159	600362	江西铜业	8,000	346,400.00	0.16
160	600104	上汽集团	35,300	344,528.00	0.15
161	688183	生益电子	2,600	344,240.00	0.15
162	600989	宝丰能源	16,900	343,577.00	0.15
163	300450	先导智能	8,400	342,048.00	0.15
164	601727	上海电气	48,600	340,200.00	0.15
165	600875	东方电气	11,700	336,609.00	0.15
166	002001	新 和 成	11,800	335,356.00	0.15
167	601825	沪农商行	44,400	332,556.00	0.15
168	002422	科伦药业	8,600	331,272.00	0.15
169	601390	中国中铁	79,100	329,847.00	0.15
170	000538	云南白药	6,900	326,853.00	0.15
171	601995	中金公司	9,000	325,350.00	0.15
172	603296	华勤技术	4,340	322,331.80	0.14
173	601377	兴业证券	53,200	321,328.00	0.14
174	600547	山东黄金	13,900	320,951.00	0.14
175	600795	国电电力	68,600	320,362.00	0.14
176	600585	海螺水泥	18,500	313,575.00	0.14
177	600015	华夏银行	48,900	312,471.00	0.14
178	601669	中国电建	66,200	311,140.00	0.14
179	300316	晶盛机电	5,100	308,040.00	0.14
180	000166	申万宏源	69,600	306,240.00	0.14
181	601916	浙商银行	116,400	306,132.00	0.14

182	002648	卫星化学	13,000	305,370.00	0.14
183	601698	中国卫通	9,800	296,450.00	0.13
184	300015	爱尔眼科	35,800	295,708.00	0.13
185	601066	中信建投	10,000	290,700.00	0.13
186	600346	恒力石化	16,300	288,673.00	0.13
187	601868	中国能建	108,000	288,360.00	0.13
188	002311	海大集团	6,400	285,504.00	0.13
189	600482	中国动力	8,700	285,360.00	0.13
190	601998	中信银行	40,800	282,744.00	0.13
191	603893	瑞芯微	1,500	282,540.00	0.13
192	002558	巨人网络	10,200	281,112.00	0.13
193	300418	昆仑万维	6,900	278,484.00	0.13
194	600066	宇通客车	10,300	276,143.00	0.12
195	600426	华鲁恒升	11,500	275,080.00	0.12
196	000625	长安汽车	38,200	273,894.00	0.12
197	600221	海航控股	198,200	267,570.00	0.12
198	002532	天山铝业	24,900	267,177.00	0.12
199	000157	中联重科	38,300	266,951.00	0.12
200	688036	传音控股	4,500	265,275.00	0.12
201	605499	东鹏饮料	2,140	264,140.20	0.12
202	600011	华能国际	34,000	258,060.00	0.12
203	300803	指南针	2,800	256,676.00	0.12
204	600048	保利发展	55,110	255,159.30	0.11
205	600436	片仔癀	2,300	251,344.00	0.11
206	600438	通威股份	20,700	250,677.00	0.11
207	601077	渝农商行	40,900	249,899.00	0.11
208	600115	中国东航	65,500	249,555.00	0.11
209	002236	大华股份	15,100	248,999.00	0.11
210	002493	荣盛石化	23,087	248,185.25	0.11
211	600886	国投电力	18,600	247,566.00	0.11
212	600570	恒生电子	11,600	245,804.00	0.11
213	600188	兖矿能源	13,800	245,226.00	0.11
214	002736	国信证券	23,700	236,763.00	0.11
215	003816	中国广核	60,500	236,555.00	0.11
216	601360	三六零	27,000	234,630.00	0.11
217	601058	赛轮轮胎	20,300	234,059.00	0.11
218	000301	东方盛虹	20,400	233,580.00	0.10
219	600026	中远海能	12,800	229,632.00	0.10
220	002074	国轩高科	8,300	228,333.00	0.10
221	601901	方正证券	31,600	227,520.00	0.10
222	600009	上海机场	9,600	221,760.00	0.10
223	600196	复星医药	9,800	220,206.00	0.10
224	000768	中航西飞	10,700	219,136.00	0.10

225	601788	光大证券	15,100	217,893.00	0.10
226	000975	山金国际	12,800	217,600.00	0.10
227	601111	中国国航	35,800	216,590.00	0.10
228	688047	龙芯中科	1,400	216,538.00	0.10
229	600029	南方航空	41,500	214,970.00	0.10
230	601456	国联民生	24,300	214,812.00	0.10
231	600415	小商品城	21,100	214,376.00	0.10
232	600674	川投能源	15,100	213,967.00	0.10
233	600219	南山铝业	52,800	210,672.00	0.09
234	601186	中国铁建	35,400	210,630.00	0.09
235	601881	中国银河	16,700	209,919.00	0.09
236	601877	正泰电器	8,300	208,081.00	0.09
237	600233	圆通速递	13,200	207,900.00	0.09
238	601117	中国化学	28,200	207,270.00	0.09
239	301236	软通动力	4,800	203,760.00	0.09
240	688506	百利天恒	692	203,468.76	0.09
241	301269	华大九天	1,700	203,014.00	0.09
242	600372	中航机载	18,600	201,810.00	0.09
243	601878	浙商证券	21,100	200,450.00	0.09
244	000963	华东医药	6,800	191,216.00	0.09
245	600741	华域汽车	12,100	187,792.00	0.08
246	002920	德赛西威	2,206	179,789.00	0.08
247	000895	双汇发展	8,000	179,200.00	0.08
248	001979	招商蛇口	27,800	178,754.00	0.08
249	300866	安克创新	1,700	177,650.00	0.08
250	002304	洋河股份	4,600	175,490.00	0.08
251	601021	春秋航空	3,799	173,158.42	0.08
252	601898	中煤能源	14,200	172,956.00	0.08
253	601319	中国人保	24,700	166,972.00	0.08
254	600023	浙能电力	31,000	163,060.00	0.07
255	600039	四川路桥	20,100	157,182.00	0.07
256	601800	中国交建	27,400	156,454.00	0.07
257	000002	万 科 A	52,500	155,400.00	0.07
258	302132	中航成飞	2,600	151,632.00	0.07
259	688223	晶科能源	31,700	150,575.00	0.07
260	600588	用友网络	15,900	145,962.00	0.07
261	601633	长城汽车	9,600	144,864.00	0.07
262	001965	招商公路	15,700	143,812.00	0.06
263	600600	青岛啤酒	2,700	141,021.00	0.06
264	603369	今世缘	5,800	137,518.00	0.06
265	600027	华电国际	30,400	135,280.00	0.06
266	601618	中国中冶	55,100	134,444.00	0.06
267	300628	亿联网络	3,900	131,898.00	0.06

268	601607	上海医药	8,500	130,900.00	0.06
269	600918	中泰证券	24,500	130,340.00	0.06
270	603260	合盛硅业	2,700	130,302.00	0.06
271	600061	国投资本	19,700	129,035.00	0.06
272	000617	中油资本	19,500	128,505.00	0.06
273	600025	华能水电	14,400	128,016.00	0.06
274	300832	新产业	3,000	126,000.00	0.06
275	300251	光线传媒	11,300	125,317.00	0.06
276	600085	同仁堂	5,300	122,483.00	0.06
277	600930	华电新能	25,500	121,635.00	0.05
278	688472	阿特斯	11,200	121,184.00	0.05
279	600515	海南机场	44,100	120,834.00	0.05
280	601059	信达证券	7,400	119,806.00	0.05
281	000999	华润三九	5,150	115,823.50	0.05
282	600803	新奥股份	7,100	112,180.00	0.05
283	600845	宝信软件	6,700	111,421.00	0.05
284	600018	上港集团	23,200	109,504.00	0.05
285	300122	智飞生物	9,300	108,717.00	0.05
286	300999	金龙鱼	4,600	106,996.00	0.05
287	300896	爱美客	1,200	104,640.00	0.05
288	000596	古井贡酒	1,300	103,740.00	0.05
289	000708	中信特钢	7,800	98,436.00	0.04
290	688009	中国通号	19,900	94,724.00	0.04
291	601018	宁波港	29,900	94,185.00	0.04
292	301165	锐捷网络	1,100	88,495.00	0.04
293	601238	广汽集团	17,200	87,376.00	0.04
294	001280	中国铀业	1,300	86,710.00	0.04
295	688303	大全能源	4,900	85,407.00	0.04
296	300413	芒果超媒	5,800	84,854.00	0.04
297	603392	万泰生物	2,900	78,213.00	0.04
298	601136	首创证券	4,100	57,195.00	0.03
299	001391	国货航	11,500	46,805.00	0.02

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	688795	摩尔线程	1,230	832,636.20	0.37
2	688802	沐曦股份	932	716,605.48	0.32
3	301666	大普微	453	209,888.49	0.09
4	688808	联讯仪器	75	118,824.75	0.05
5	688781	视涯科技	2,806	118,300.96	0.05
6	001248	华润新能源	9,587	96,924.57	0.04
7	688818	电科蓝天	1,138	79,819.32	0.04
8	688820	盛合晶微	424	59,991.76	0.03

9	688712	北芯生命	1,483	53,269.36	0.02
10	301682	宏明电子	283	45,296.98	0.02
11	688785	恒运昌	93	43,072.95	0.02
12	688797	臻宝科技	87	40,774.29	0.02
13	688813	泰金新能	215	36,999.35	0.02
14	688635	长进光子	108	33,284.52	0.01
15	001399	惠科股份	1,162	32,222.26	0.01
16	001257	盛龙股份	1,175	24,369.50	0.01
17	688811	有研复材	834	20,124.42	0.01
18	603459	红板科技	204	17,201.28	0.01
19	301696	三瑞智能	198	17,186.40	0.01
20	301687	新广益	195	15,167.10	0.01
21	301531	春光集团	290	14,952.40	0.01
22	301669	高特电子	472	13,404.80	0.01
23	301599	理奇智能	358	11,624.26	0.01
24	301680	固德电材	103	11,552.48	0.01
25	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
26	688816	易思维	157	8,964.70	0.00
27	001365	天海电子	285	8,923.35	0.00
28	301683	慧谷新材	63	7,671.51	0.00
29	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
30	001237	惠康科技	117	6,872.58	0.00
31	601112	振石股份	348	6,121.32	0.00
32	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
33	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
34	603293	埃泰克	53	1,798.29	0.00
35	001312	福恩股份	107	1,795.46	0.00
36	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
37	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	600519	贵州茅台	10,142,309.00	2.72
2	601318	中国平安	8,224,723.00	2.20
3	601899	紫金矿业	7,345,766.00	1.97
4	600036	招商银行	6,166,809.00	1.65
5	688041	海光信息	4,617,975.88	1.24
6	600900	长江电力	4,292,294.00	1.15
7	601166	兴业银行	4,131,280.25	1.11
8	601138	工业富联	3,571,552.00	0.96
9	600030	中信证券	3,510,294.00	0.94
10	600276	恒瑞医药	3,406,263.00	0.91

11	688008	澜起科技	3,115,812.24	0.83
12	601398	工商银行	3,074,381.00	0.82
13	603259	药明康德	3,042,726.00	0.81
14	603986	兆易创新	2,966,926.00	0.79
15	688981	中芯国际	2,845,835.73	0.76
16	601211	国泰海通	2,657,801.00	0.71
17	601288	农业银行	2,518,096.00	0.67
18	603993	洛阳钼业	2,383,866.00	0.64
19	601328	交通银行	2,356,810.00	0.63
20	600887	伊利股份	2,221,636.00	0.59

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	16,244,397.50	4.35
2	601318	中国平安	12,847,169.99	3.44
3	601899	紫金矿业	11,501,189.00	3.08
4	600036	招商银行	9,489,427.00	2.54
5	600900	长江电力	6,530,388.00	1.75
6	688041	海光信息	6,316,795.89	1.69
7	601166	兴业银行	6,305,035.00	1.69
8	600030	中信证券	5,324,540.00	1.43
9	601138	工业富联	5,273,453.00	1.41
10	600276	恒瑞医药	5,114,682.00	1.37
11	603259	药明康德	4,761,395.00	1.28
12	601398	工商银行	4,700,918.00	1.26
13	688008	澜起科技	4,566,793.84	1.22
14	688981	中芯国际	4,437,867.71	1.19
15	603986	兆易创新	4,367,977.00	1.17
16	601211	国泰海通	4,068,012.00	1.09
17	601288	农业银行	3,853,854.00	1.03
18	603993	洛阳钼业	3,685,194.00	0.99
19	601328	交通银行	3,600,146.00	0.96
20	600887	伊利股份	3,380,949.00	0.91

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	225,008,396.94
卖出股票收入（成交）总额	326,931,411.38

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	60,492.63
8	其他	-
9	合计	60,492.63

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688795	摩尔线程	832,636.20	0.37	新股流通受限
2	688802	沐曦股份	716,605.48	0.32	新股流通受限
3	301666	大普微	209,888.49	0.09	新股流通受限
4	688808	联讯仪器	118,824.75	0.05	新股流通受限
5	688781	视涯科技	118,300.96	0.05	新股流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构		
		机构投资者	个人投资者	万家沪深 300ETF 联接

(户)	额	持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
3,819	11,009.78	11,277,189.00	26.82	23,756,853.00	56.5	7,012,300.00	16.68

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.3 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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2025 年 2 月 25 日） 基金份额总额	587,512,917.00
本报告期期初基金份额总额	78,046,342.00
本报告期基金总申购份额	66,600,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	102,600,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	42,046,342.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

自 2026 年 4 月 16 日起，陈广益先生担任公司董事长，方一天先生不再担任公司董事长；
莫海波先生担任公司总经理，陈广益先生不再担任公司总经理；

自 2026 年 5 月 25 日起，王焱女士担任公司首席信息官，陈广益先生不再担任公司首席信息官。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
中泰证券	7	550,296,554.30	100.00	107,508.78	100.00	-

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准

为加强证券投资基金交易费用管理，管理人特制定《证券投资基金交易费用管理办法》。依据该办法，管理人设立合作证券公司备选库，并按照业务类型进行分类管理。备选库具体分为被动股票型基金合作证券公司备选库和其他类型基金合作证券公司备选库。纳入备选库内的证券经营机构方可参与管理人基金产品的证券交易服务。

选择证券公司参与证券交易的标准如下：

(1) 财务状况稳健：证券公司应具备良好的财务状况，经营行为符合相关法律法规及行业规范；

(2) 内控与风控能力强：证券公司合规管理和风险控制能力较强；

(3) 技术支持完善：具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需求；

(4) 专业能力与服务水平：具有较强的研究能力及金融服务水平，或在交易服务、券商结算等业务方面具备较强能力。

2、选择证券公司参与证券交易的程序

(1) 管理人从财务状况、研究服务能力、风险管理能力、合规管理能力、交易服务水平、交易信息技术能力等方面对证券公司进行评估考察，经内部审批完成后，最终确定入选合作证券公司的备选库。

(2) 与入选备选库证券公司达成合作意向后，双方签订协议，明确双方的权利义务，包括服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式等。

3、本基金使用券商结算模式，本报告期内管理人选择中泰证券作为证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。

10.7.2 基金租用或者通过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深交所 ETF 变更场内简称的公告	指定媒介	2026 年 1 月 20 日
2	万家基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	指定媒介	2026 年 1 月 21 日
3	万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	指定媒介	2026 年 1 月 21 日
4	万家基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金更新基金产品资料概要的提示性公告	指定媒介	2026 年 1 月 22 日
5	万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	指定媒介	2026 年 1 月 22 日
6	万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	指定媒介	2026 年 3 月 28 日
7	万家基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	指定媒介	2026 年 3 月 30 日
8	万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告	指定媒介	2026 年 3 月 30 日
9	万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2026 年第	指定媒介	2026 年 3 月 31 日

	1 号)		
10	万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	指定媒介	2026 年 3 月 31 日
11	万家基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金更新招募说明书和基金产品资料概要的提示性公告	指定媒介	2026 年 3 月 31 日
12	万家基金管理有限公司关于董事长、高级管理人员变更的公告	指定媒介	2026 年 4 月 17 日
13	万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	指定媒介	2026 年 4 月 21 日
14	万家基金管理有限公司关于旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	指定媒介	2026 年 4 月 21 日
15	万家基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	指定媒介	2026 年 5 月 27 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（%）
联接基金	1	20260101-20260111	18,490,000.00	529,500.00	12,007,200.00	7,012,300.00	16.68
产品特有风险							
报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

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

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》。
- 4、万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2026 年中期报告原文。
- 5、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。

6、万家基金管理有限公司董事会决议。

7、本报告期内在中国证监会指定媒介公开披露的基金净值、更新招募说明书及其他临时公告。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司

2026 年 8 月 29 日