

万家中证红利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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46

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	47
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	47
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	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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	49
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	50
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	50
10.8 其他重大事件	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家中证红利交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	万家中证红利 ETF
场内简称	红利 ETF 万家
基金主代码	159581
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 3 月 6 日
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,460,225,708.00 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	2024 年 3 月 15 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、股指期货投资策略；7、国债期货投资策略；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，即中证红利指数收益率。
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中证红利指数，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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	兰剑	王小飞
	联系电话	021-38909626	021-60637103
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		4008880800	021-60637228
传真		021-38909627	021-60635778
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）	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200122	100033
法定代表人		陈广益	张金良

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	41,008,533.41
本期利润	-121,723,022.56
加权平均基金份额本期利润	-0.1052
本期加权平均净值利润率	-9.81%
本期基金份额净值增长率	-6.72%
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	-58,613,814.99
期末可供分配基金份额利润	-0.0401
期末基金资产净值	1,401,611,893.01
期末基金份额净值	0.9599
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	4.39%

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

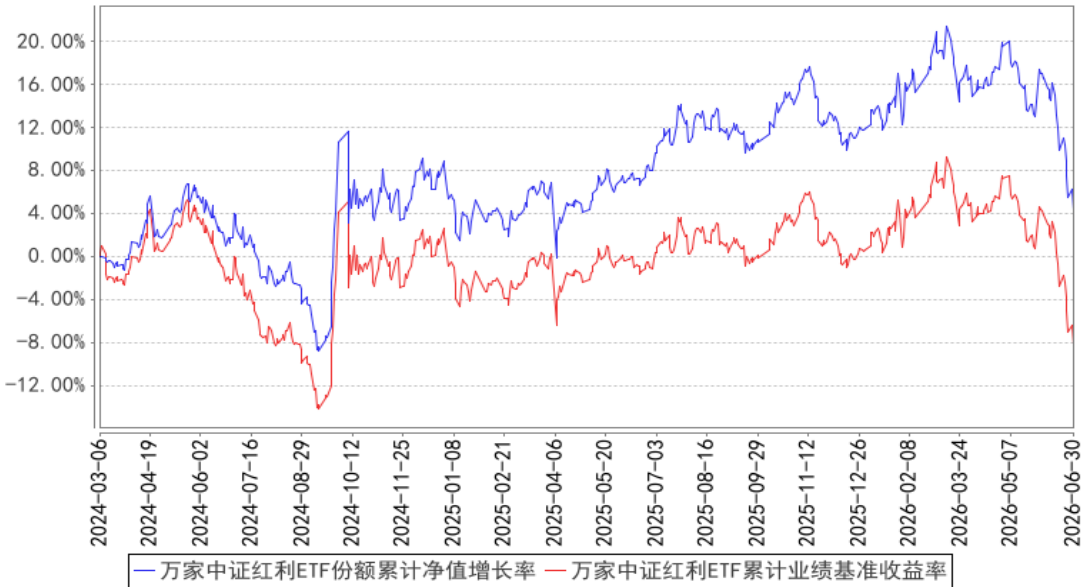
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-10.39%	0.89%	-12.32%	0.92%	1.93%	-0.03%
过去六个月	-6.72%	0.96%	-8.75%	0.99%	2.03%	-0.03%

过去一年	-3.34%	0.80%	-7.17%	0.82%	3.83%	-0.02%
自基金合同生效起至今	4.39%	0.97%	-8.17%	0.99%	12.56%	-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

万家中证红利ETF份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2024 年 3 月 6 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		
杨坤	万家中证	2024 年 3	-	11 年	国籍：中国；学历：法国南特国立高等矿

	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、万家中证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、	月 6 日			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。
--	--	-------	--	--	--

万家创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金、万家创业板 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》，管理人制定了《公平交易管理办法》和《异常交易监控及报告管理办法》等规章制度，涵盖了研究、授权、投资决策和交易执行等投资管理活动的各个环节，确保公平对待不同投资组合，防范导致不公平交易以及利益输送的异常交易发生。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 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，A 股市场整体波动较大，行情主线清晰但结构分化显著。指数层面，科创 50 指数以 64.25% 的涨幅领涨，创业板 50 上涨 37.01%，国证 2000 和沪深 300 分别上涨 13.86% 和 7.55%，上证综指则收涨 3.16%。行业层面上，以电子、通信为代表的 AI 硬件及基建方向凭借高景气度吸引了市场较多资金，而传统周期行业则表现相对疲弱。

分季度来看，一季度市场经历了从“开门红”到震荡筑底的过程。年初市场延续了前期的上涨势头，但随后美联储主席提名人选凯文·沃什的鹰派立场引发流动性担忧，股市出现回调。此后虽然情绪一度企稳，上证指数触及 4197.23 点，但 3 月美伊冲突超预期爆发，伊朗封锁霍尔木兹海峡导致能源价格大幅攀升，通胀与衰退预期交织，美债收益率上行压制估值，上证指数一度

下探至 3794.68 点。一季度主要指数整体收跌，仅煤炭、石油石化等避险板块表现较好。

进入二季度，市场在震荡中展现出明显的结构性分化行情。全球 AI 算力需求的爆发驱动 AI 硬件产业链成为清晰的主线，半导体设备、通信设备等板块持续获得资金青睐，带动科创 50 在二季度单季实现显著上涨，沪深 300 和国证 2000 也震荡收涨。然而，资金的高度集中导致非主线资产出现一定程度的失血，中证红利等传统方向出现明显调整。外部环境方面，尽管地缘局势有所缓和，但美国超预期的就业数据推升了美联储偏鹰派的政策预期，10 年期美债收益率震荡上行，对全球风险资产估值形成持续压制。

7 月初以来，A 股指数出现明显回调，这主要是多重内外扰动共振的结果。前期强势的科技板块估值处于历史高位，交易拥挤度较高。Meta 出租算力引发市场对算力过剩的担忧，全球半导体产业链出现明显调整。其次，在增量资金不足的存量博弈环境下，巨型 IPO 上市对二级市场产生了一定的流动性虹吸效应。最后，美伊冲突再度反复，叠加美联储鹰派立场，推动 10 年期美债利率升至 4.69% 的年内新高，全球流动性收紧进一步压制了市场估值。

本基金作为被动投资的指数基金，其投资目标是通过跟踪、复制指数，为投资者获取市场长期的平均收益。报告期内我们严格按照基金合同规定，原则上采取完全复制的方法进行投资管理，努力拟合标的指数，减小跟踪误差，将基金跟踪误差控制在较低范围之内。同时，本基金采用有效的量化跟踪技术，降低管理成本。导致跟踪误差的主要原因是基金申购现金替代、禁止投资成分股替代、标的指数成分股调整、成分股分红和基金费用等因素。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家中证红利 ETF 的基金份额净值为 0.9599 元，本报告期基金份额净值增长率为 -6.72%，同期业绩比较基准收益率为 -8.75%。基金报告期内日跟踪偏离度为 0.0322%，年化跟踪误差为 0.7731%，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

展望未来，经过 7 月以来的快速调整，市场前期的估值压力和拥挤度已经得到一定程度的释放，大盘下行空间整体有限，对后市的态度可以适当转向积极。虽然短期内海外宏观环境和地缘政治仍有扰动，但科技创新的产业趋势依然明确，国内基本面也受益于科技相关的出口与投资改善而有所回升。随着经济预期改善和企业盈利预期逐步修复，前期调整较多、估值具备性价比且基本面边际改善的板块，也有望获得资金重新关注。整体来看，后续 A 股或仍以结构性机会为主，板块轮动和阶段性反弹机会值得关注。

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 2026 年 1 月 20 日每 10 份基金份额分红 0.0300 元；2026 年 2 月 10 日每 10 份基金份额分红 0.0300 元；2026 年 3 月 10 日每 10 份基金份额分红 0.0300 元；2026 年 4 月 14 日每 10 份基金份额分红 0.0300 元；2026 年 5 月 19 日每 10 份基金份额分红 0.0400 元；2026 年 6 月 16 日每 10 份基金份额分红 0.0400 元。共计分配利润 22,484,513.29 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：万家中证红利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	17,501,728.94	11,661,883.06
结算备付金		728,207.43	695,641.81
存出保证金		285,250.11	257,005.33
交易性金融资产	6.4.7.2	1,387,189,864.86	1,108,702,415.42
其中：股票投资		1,387,189,864.86	1,108,702,415.42
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		-	188,704.89
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,405,705,051.34	1,121,505,650.51
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 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		3,111,307.67	287,896.65
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		583,996.44	605,627.14
应付托管费		116,799.30	121,125.41
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	281,054.92	580,944.81
负债合计		4,093,158.33	1,595,594.01
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,460,225,708.00	1,068,225,708.00
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	-58,613,814.99	51,684,348.50
净资产合计		1,401,611,893.01	1,119,910,056.50
负债和净资产总计		1,405,705,051.34	1,121,505,650.51

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9599 元，基金份额总额 1,460,225,708.00 份。

6.2 利润表

会计主体：万家中证红利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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-117,964,139.38	-8,979,091.91
1. 利息收入		26,358.07	56,490.73
其中：存款利息收入	6.4.7.10	26,358.07	56,490.73
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		43,441,541.09	86,400,990.87
其中：股票投资收益	6.4.7.11	16,521,702.37	14,223,327.12
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	26,919,838.72	72,177,663.75
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	-162,731,555.97	-96,430,826.67
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	1,299,517.43	994,253.16
减：二、营业总支出		3,758,883.18	7,802,076.92
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,050,003.06	6,421,415.52
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	610,000.57	1,284,283.09
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	98,879.55	96,378.31
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-121,723,022.56	-16,781,168.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-121,723,022.56	-16,781,168.83
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		-121,723,022.56	-16,781,168.83

6.3 净资产变动表

会计主体：万家中证红利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	1,068,225,708.00	-	51,684,348.50	1,119,910,056.50
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,068,225,708.00	-	51,684,348.50	1,119,910,056.50
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	392,000,000.00	-	-110,298,163.49	281,701,836.51
（一）、综合收益总额	-	-	-121,723,022.56	-121,723,022.56
（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）	392,000,000.00	-	33,909,372.36	425,909,372.36
其中：1. 基金申购款	753,000,000.00	-	62,254,366.62	815,254,366.62
2. 基金赎回款	-361,000,000.00	-	-28,344,994.26	-389,344,994.26
（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）	-	-	-22,484,513.29	-22,484,513.29
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,460,225,708.00	-	-58,613,814.99	1,401,611,893.01
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 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	2,713,225,708.00	-	141,599,777.22	2,854,825,485.22
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,713,225,708.00	-	141,599,777.22	2,854,825,485.22
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-264,000,000.00	-	-70,839,417.39	-334,839,417.39
（一）、综合收益总额	-	-	-16,781,168.83	-16,781,168.83
（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）	-264,000,000.00	-	-5,109,961.46	-269,109,961.46
其中：1. 基金申购款	747,000,000.00	-	7,625,574.26	754,625,574.26
2. 基金赎回款	-1,011,000,000.00	-	-12,735,535.72	-1,023,735,535.72
（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）	-	-	-48,948,287.10	-48,948,287.10
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,449,225,708.00	-	70,760,359.83	2,519,986,067.83

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

万家中证红利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[2023]2905 号文《关于准予万家中证红利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 2024 年 2 月 26 日至 2024 年 3 月 1 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[2024]第 ZA30139 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 2024 年 3 月 6 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 317,208,000.00 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 17,708.00 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 317,225,708.00 元，折合 317,225,708.00 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券等）、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货、股票期权、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资股指期货或其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即中证红利指数收益率。

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	17,501,728.94
等于：本金	17,500,021.28
加：应计利息	1,707.66
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-

加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	17,501,728.94

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		1,531,913,320.46	-	1,387,189,864.86	-144,723,455.60
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		1,531,913,320.46	-	1,387,189,864.86	-144,723,455.60

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 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	66,835.37
其中：交易所市场	66,835.37

银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	214,219.55
合计	281,054.92

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	1,068,225,708.00	1,068,225,708.00
本期申购	753,000,000.00	753,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-361,000,000.00	-361,000,000.00
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	1,460,225,708.00	1,460,225,708.00

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	195,366,760.00	-143,682,411.50	51,684,348.50
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	195,366,760.00	-143,682,411.50	51,684,348.50
本期利润	41,008,533.41	-162,731,555.97	-121,723,022.56
本期基金份额交易产生的变动数	75,497,081.99	-41,587,709.63	33,909,372.36
其中：基金申购款	143,214,413.70	-80,960,047.08	62,254,366.62
基金赎回款	-67,717,331.71	39,372,337.45	-28,344,994.26
本期已分配利润	-22,484,513.29	-	-22,484,513.29
本期末	289,387,862.11	-348,001,677.10	-58,613,814.99

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	22,272.42
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	3,554.80
其他	530.85
合计	26,358.07

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	14,208,520.75
股票投资收益——赎回差价收入	2,313,181.62
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	16,521,702.37

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	351,198,739.03
减：卖出股票成本总额	336,542,484.02
减：交易费用	447,734.26
买卖股票差价收入	14,208,520.75

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	389,344,994.26
减：现金支付赎回款总额	312,239,754.26
减：赎回股票成本总额	74,792,058.38
减：交易费用	-
赎回差价收入	2,313,181.62

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	26,919,838.72
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	26,919,838.72

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	-162,731,555.97
股票投资	-162,731,555.97
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	-162,731,555.97

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	1,299,517.43
合计	1,299,517.43

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	160.00
账户维护费	4,500.00
IOPV 计算服务费	9,916.99
合计	98,879.55

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

根据相关法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2026 年 7 月 13 日止登记在册的全体基金份额持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.040 元；本基金向截至 2026 年 8 月 17 日止登记在册的全体基金份额持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.040 元。

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
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人
万家中证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“万家中证红利 ETF 联接”）	本基金的联接基金

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

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股票交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,050,003.06	6,421,415.52
其中：应支付销售机构的客户维护费	490,434.20	362,437.21
应支付基金管理人的净管理费	2,559,568.86	6,058,978.31

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初首日起 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	610,000.57	1,284,283.09

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自

动在月初首日起 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

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（%）
万家中证红利 ETF联接	502,532,000.00	34.4147	550,020,000.00	51.4891

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 1 月 1 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
建设银行	17,501,728.94	22,272.42	25,350,312.95	50,247.66

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设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 股兖矿能源和基金托管人中国建设银行股份有限公司发行的 A 股建设银行。于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有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 1,499,410 股（2025 年 12 月 31 日：1,094,910 股），占本基金资产净值比例为 1.90%（2025 年 12 月 31 日：1.29%）；持有中国建设银行股份有限公司发行的 A 股建设银行 1,529,300 股（2025 年 12 月 31 日：1,118,000 股），占本基金资产净值比例为 1.05%（2025 年 12 月 31 日：0.93%）。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

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	2026 年 01 月 19 日	2026 年 01 月 20 日	-	0.0300	2,826,676.96	-	2,826,676.96	-
2	2026 年 02 月 09 日	2026 年 02 月 10 日	-	0.0300	2,613,676.97	-	2,613,676.97	-
3	2026 年 03 月 09 日	2026 年 03 月 10 日	-	0.0300	2,463,676.96	-	2,463,676.96	-
4	2026 年 04 月 13 日	2026 年 04 月 14 日	-	0.0300	3,858,676.95	-	3,858,676.95	-
5	2026 年 05 月 18 日	2026 年 05 月 19 日	-	0.0400	5,324,902.72	-	5,324,902.72	-

6	2026 年 06 月 15 日	2026 年 06 月 16 日	-	0.0400	5,396,902.73	-	5,396,902.73	-
合计	-	-	-	0.2000	22,484,513.29	-	22,484,513.29	-

注：根据相关法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2026 年 7 月 13 日止登记在册的全体基金份额持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.040 元；本基金向截至 2026 年 8 月 17 日止登记在册的全体基金份额持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.040 元。

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	285	15,179.10	16,740.90	-
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	44,233	447,195.63	447,195.63	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	18,957	191,655.27	191,655.27	-
001257	盛	2026	6 个月	新	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-

	龙股份	年 3 月 24 日		股流通受限						
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
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	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股流	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-

		日		通受限						
301669	高特电子	2026年6月2日	6个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026年2月27日	6个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026年3月18日	6个月	新股流通受限	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301683	慧谷新材	2026年3月24日	6个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
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	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026年1月21日	6个月	新股流通受限	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-

				限						
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	72	2,411.28	2,442.96	-
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	330	5,841.00	27,825.60	-
688795	摩尔线程	2025年11月26日	9个月	新股流通受限	114.28	676.94	6,251	714,364.28	4,231,551.94	-
688802	沐	2025	9个月	新	104.66	768.89	3,994	418,012.04	3,070,946.66	-

	曦 股 份	年 12 月 9 日		股 流 通 受 限						
--	-------------	------------------	--	-----------------------	--	--	--	--	--	--

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 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	17,501,728.94	-	-	-	-	-	17,501,728.94
结算备付金	728,207.43	-	-	-	-	-	728,207.43
存出保证金	285,250.11	-	-	-	-	-	285,250.11
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,387,189,864.86	1,387,189,864.86
资产总计	18,515,186.48	-	-	-	-	1,387,189,864.86	1,405,705,051.34
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	583,996.44	583,996.44
应付托管费	-	-	-	-	-	116,799.30	116,799.30
应付清算款	-	-	-	-	-	3,111,307.67	3,111,307.67
其他负债	-	-	-	-	-	281,054.92	281,054.92
负债总计	-	-	-	-	-	4,093,158.33	4,093,158.33
利率敏感度缺口	18,515,186.48	-	-	-	-	1,383,096,706.53	1,401,611,893.01
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	11,661,883.06	-	-	-	-	-	11,661,883.06
结算备付金	695,641.81	-	-	-	-	-	695,641.81
存出保证金	257,005.33	-	-	-	-	-	257,005.33
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,108,702,415.42	1,108,702,415.42
应收清算款	-	-	-	-	-	188,704.89	188,704.89
资产总计	12,614,530.2	-	-	-	-	1,108,891,	1,121,505,65

	0					120.31	0.51
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-605,627.14	605,627.14
应付托管费	-	-	-	-	-	-121,125.41	121,125.41
应付清算款	-	-	-	-	-	-287,896.65	287,896.65
其他负债	-	-	-	-	-	-580,944.81	580,944.81
负债总计	-	-	-	-	-	1,595,594.01	1,595,594.01
利率敏感度缺口	12,614,530.20	-	-	-	-	1,107,295,526.30	1,119,910,056.50

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	1,387,189,864.86	98.97	1,108,702,415.42	99.00
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	1,387,189,864.86	98.97	1,108,702,415.42	99.00

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	13,338,860.33	11,482,558.75
	股票基准指数下降100个基点	-13,338,860.33	-11,482,558.75

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	1,378,136,258.83	1,101,696,079.69
第二层次	638,850.90	-
第三层次	8,414,755.13	7,006,335.73
合计	1,387,189,864.86	1,108,702,415.42

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	1,387,189,864.86	98.68
	其中：股票	1,387,189,864.86	98.68
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	18,229,936.37	1.30
8	其他各项资产	285,250.11	0.02
9	合计	1,405,705,051.34	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	-	-
B	采矿业	330,389,609.55	23.57
C	制造业	341,885,817.08	24.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,408,143.02	1.81
E	建筑业	37,976,892.00	2.71
F	批发和零售业	31,809,820.00	2.27
G	交通运输、仓储和邮政业	157,744,934.28	11.25
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	340,761,121.92	24.31
K	房地产业	11,212,866.16	0.80
L	租赁和商务服务业	37,883,080.92	2.70
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	12,631,948.00	0.90
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	50,432,025.90	3.60
S	综合	-	-
	合计	1,378,136,258.83	98.33

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	36,149.82	0.00
C	制造业	8,377,021.85	0.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	638,850.90	0.05
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	9,053,606.03	0.65

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	601919	中远海控	2,957,300	39,213,798.00	2.80
2	000672	上峰材料	1,321,700	31,297,856.00	2.23
3	603565	中谷物流	2,794,190	27,411,003.90	1.96
4	601699	潞安环能	1,874,700	26,770,716.00	1.91
5	600188	兖矿能源	1,499,410	26,644,515.70	1.90
6	600256	广汇能源	5,284,600	26,105,924.00	1.86
7	600546	山煤国际	2,191,320	23,951,127.60	1.71
8	600985	淮北矿业	1,565,428	21,994,263.40	1.57
9	601101	昊华能源	1,970,440	20,807,846.40	1.48
10	601666	平煤股份	2,814,100	20,120,815.00	1.44
11	601225	陕西煤业	964,287	19,623,240.45	1.40
12	601168	西部矿业	717,000	19,459,380.00	1.39
13	600177	雅戈尔	2,556,428	19,249,902.84	1.37
14	000983	山西焦煤	3,268,106	18,955,014.80	1.35
15	600295	鄂尔多斯	1,752,692	18,788,858.24	1.34
16	601001	晋控煤业	1,078,000	18,746,420.00	1.34
17	600350	山东高速	1,564,130	17,408,766.90	1.24
18	002756	永兴材料	302,400	17,127,936.00	1.22
19	600919	江苏银行	1,586,530	17,102,793.40	1.22
20	600348	华阳股份	2,195,950	16,799,017.50	1.20

21	601838	成都银行	947,801	16,776,077.70	1.20
22	000408	藏格矿业	239,000	16,567,480.00	1.18
23	601857	中国石油	1,800,100	15,624,868.00	1.11
24	600153	建发股份	1,965,500	15,586,415.00	1.11
25	000651	格力电器	413,100	15,491,250.00	1.11
26	600015	华夏银行	2,419,200	15,458,688.00	1.10
27	601077	渝农商行	2,529,000	15,452,190.00	1.10
28	600398	海澜之家	2,944,100	15,397,643.00	1.10
29	601000	唐山港	3,649,990	15,147,458.50	1.08
30	601229	上海银行	1,739,892	15,102,262.56	1.08
31	000429	粤高速 A	1,096,000	14,960,400.00	1.07
32	600901	江苏金租	2,596,900	14,932,175.00	1.07
33	601088	中国神华	381,300	14,885,952.00	1.06
34	600039	四川路桥	1,888,800	14,770,416.00	1.05
35	601939	建设银行	1,529,300	14,727,159.00	1.05
36	601988	中国银行	2,557,600	14,629,472.00	1.04
37	601169	北京银行	2,948,600	14,448,140.00	1.03
38	600096	云天化	472,500	14,364,000.00	1.02
39	002867	周大生	1,280,200	14,274,230.00	1.02
40	600938	中国海油	524,522	14,240,772.30	1.02
41	600755	厦门国贸	2,601,476	14,099,999.92	1.01
42	600012	皖通高速	881,173	13,887,286.48	0.99
43	601916	浙商银行	5,252,500	13,814,075.00	0.99
44	601963	重庆银行	1,349,800	13,605,984.00	0.97
45	002601	龙佰集团	822,700	13,558,096.00	0.97
46	601187	厦门银行	1,979,100	13,517,253.00	0.96
47	600282	南钢股份	2,935,700	13,474,863.00	0.96
48	601328	交通银行	2,094,874	13,470,039.82	0.96
49	601166	兴业银行	811,500	13,438,440.00	0.96
50	601398	工商银行	1,896,000	13,404,720.00	0.96
51	000895	双汇发展	597,100	13,375,040.00	0.95
52	601998	中信银行	1,903,700	13,192,641.00	0.94
53	601009	南京银行	1,333,496	13,188,275.44	0.94
54	601216	君正集团	2,879,400	12,842,124.00	0.92
55	600461	洪城环境	1,395,117	12,639,760.02	0.90
56	301109	军信股份	1,013,800	12,631,948.00	0.90
57	601006	大秦铁路	2,738,100	12,622,641.00	0.90
58	601818	光大银行	4,290,400	12,399,256.00	0.88
59	601658	邮储银行	2,477,500	12,214,075.00	0.87
60	601997	贵阳银行	2,371,700	12,166,821.00	0.87
61	600737	中粮糖业	971,100	11,973,663.00	0.85
62	600036	招商银行	334,300	11,867,650.00	0.85
63	601825	沪农商行	1,582,000	11,849,180.00	0.85

64	002043	兔 宝 宝	1,066,600	11,817,928.00	0.84
65	600016	民生银行	3,638,300	11,715,326.00	0.84
66	002563	森马服饰	2,306,525	11,624,886.00	0.83
67	601288	农业银行	1,907,800	11,580,346.00	0.83
68	600028	中国石化	2,578,600	11,500,556.00	0.82
69	600064	南京高科	1,572,632	11,212,866.16	0.80
70	601098	中南传媒	1,134,300	11,161,512.00	0.80
71	601928	凤凰传媒	1,258,730	11,064,236.70	0.79
72	601598	中国外运	2,184,400	10,834,624.00	0.77
73	600273	嘉化能源	1,645,400	10,728,008.00	0.77
74	601318	中国平安	224,300	10,708,082.00	0.76
75	601668	中国建筑	2,456,300	10,660,342.00	0.76
76	000933	神火股份	497,900	10,555,480.00	0.75
77	600757	长江传媒	1,390,600	10,165,286.00	0.73
78	600741	华域汽车	640,500	9,940,560.00	0.71
79	000157	中联重科	1,407,377	9,809,417.69	0.70
80	002416	爱施德	1,053,100	9,435,776.00	0.67
81	002233	塔牌集团	1,329,900	9,269,403.00	0.66
82	601019	山东出版	1,424,533	9,117,011.20	0.65
83	601717	中创智领	652,900	9,081,839.00	0.65
84	600373	中文传媒	1,346,000	8,923,980.00	0.64
85	600585	海螺水泥	505,100	8,561,445.00	0.61
86	600057	厦门象屿	1,512,300	8,196,666.00	0.58
87	600729	重百集团	431,300	8,099,814.00	0.58
88	002572	索菲亚	1,076,700	7,859,910.00	0.56
89	600971	恒源煤电	1,137,940	7,851,786.00	0.56
90	600502	安徽建工	1,558,800	6,780,780.00	0.48
91	002154	报 喜 鸟	1,858,000	6,614,480.00	0.47
92	603706	东方环宇	378,500	6,544,265.00	0.47
93	600123	兰花科创	1,181,160	6,307,394.40	0.45
94	603967	中创物流	604,730	6,258,955.50	0.45
95	002267	陕天然气	951,700	6,224,118.00	0.44
96	920599	同力股份	373,900	6,158,133.00	0.44
97	600997	开滦股份	1,236,741	5,874,519.75	0.42
98	000090	天健集团	1,915,400	5,765,354.00	0.41
99	002737	葵花药业	512,636	5,746,649.56	0.41
100	002540	亚太科技	1,013,800	4,734,446.00	0.34

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	6,251	4,231,551.94	0.30
2	688802	沐曦股份	3,994	3,070,946.66	0.22
3	001248	华润新能源	63,190	638,850.90	0.05

4	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.04
5	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.01
6	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
7	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
8	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
9	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
10	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
11	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
12	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
13	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
14	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
15	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
16	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
17	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
18	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
19	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
20	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
21	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
22	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
23	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
24	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
25	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
26	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	601919	中远海控	23,981,405.00	2.14
2	603565	中谷物流	18,663,015.00	1.67
3	600256	广汇能源	18,194,244.00	1.62
4	600188	兖矿能源	15,766,740.05	1.41
5	601699	潞安环能	14,646,078.00	1.31
6	600546	山煤国际	13,806,070.00	1.23
7	600295	鄂尔多斯	13,530,475.40	1.21
8	601225	陕西煤业	13,320,645.00	1.19
9	601666	平煤股份	12,319,379.00	1.10
10	601088	中国神华	12,196,831.00	1.09
11	601857	中国石油	11,843,119.00	1.06
12	600985	淮北矿业	11,726,353.00	1.05
13	600938	中国海油	11,651,298.00	1.04
14	601168	西部矿业	10,935,141.84	0.98
15	600348	华阳股份	10,680,439.00	0.95
16	600177	雅戈尔	10,477,796.04	0.94

17	601101	昊华能源	9,986,746.00	0.89
18	600153	建发股份	9,983,634.00	0.89
19	601001	晋控煤业	9,868,262.00	0.88
20	600273	嘉化能源	9,488,719.00	0.85

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	601919	中远海控	11,452,711.00	1.02
2	601088	中国神华	9,344,317.00	0.83
3	600256	广汇能源	7,821,951.00	0.70
4	600273	嘉化能源	7,337,964.00	0.66
5	601699	潞安环能	6,903,136.00	0.62
6	600295	鄂尔多斯	6,585,587.00	0.59
7	601225	陕西煤业	6,541,371.00	0.58
8	600546	山煤国际	6,485,415.00	0.58
9	600188	兖矿能源	6,442,390.70	0.58
10	601318	中国平安	6,249,053.00	0.56
11	601666	平煤股份	6,063,087.00	0.54
12	603565	中谷物流	6,015,921.00	0.54
13	601168	西部矿业	5,910,804.00	0.53
14	600938	中国海油	5,833,081.00	0.52
15	600985	淮北矿业	5,415,673.66	0.48
16	600348	华阳股份	5,158,085.00	0.46
17	600177	雅戈尔	5,133,696.00	0.46
18	600153	建发股份	5,092,015.03	0.45
19	601101	昊华能源	4,760,244.00	0.43
20	601838	成都银行	4,716,817.00	0.42

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	693,696,267.02
卖出股票收入（成交）总额	351,198,739.03

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	285,250.11
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	-
8	其他	-
9	合计	285,250.11

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	4,231,551.94	0.30	新股流通受限
2	688802	沐曦股份	3,070,946.66	0.22	新股流通受限
3	001248	华润新能源	638,850.90	0.05	新股未上市
4	301666	大普微	565,262.60	0.04	新股流通受限
5	001399	惠科股份	179,912.24	0.01	新股流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		万家中证红利 ETF 联接	
		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（%）
9,727	150,120.87	594,222,592.00	40.69	363,471,116.00	24.89	502,532,000.00	34.41

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（2024 年 3 月 6 日）基金份额总额	317,225,708.00
本报告期期初基金份额总额	1,068,225,708.00
本报告期基金总申购份额	753,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	361,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,460,225,708.00

§ 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，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门调查或处罚。

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 (%)	
国投证券	1	743,053,432.71	71.24	145,599.40	71.11	-
万联证券	2	224,665,428.69	21.54	44,023.05	21.50	-
东方财富证券	2	53,363,484.57	5.12	10,455.66	5.11	-
西部证券	2	14,810,052.28	1.42	2,901.38	1.42	-
浙商证券	2	6,267,553.22	0.60	1,567.23	0.77	-
兴业证券	3	809,213.85	0.08	202.28	0.10	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高盛证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-

广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联民生 证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通 证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源 西部证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际 证券	2	-	-	-	-	-

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、基金专用交易席位的变更情况：

本报告期内，本基金新增华金证券交易单元 2 个、新增万联证券交易单元 2 个、新增国联民生证券交易单元 1 个、减少渤海证券交易单元 2 个、减少中信证券交易单元 2 个、减少方正证券交易单元 1 个。

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	万家中证红利交易型开放式指数证券投资基金分红公告	指定媒介	2026 年 1 月 15 日
2	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
3	万家中证红利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	万家中证红利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
5	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
6	万家中证红利交易型开放式指数证券投资基金分红公告	指定媒介	2026 年 2 月 5 日
7	万家中证红利交易型开放式指数证券投资基金分红公告	指定媒介	2026 年 3 月 5 日
8	万家中证红利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	万家中证红利交易型开放式指数证券投资基金分红公告	指定媒介	2026 年 4 月 9 日
10	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
11	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
12	万家中证红利交易型开放式指数证券	指定媒介	2026 年 4 月 21 日

	投资基金 2026 年第 1 季度报告		
13	万家中证红利交易型开放式指数证券投资基金分红公告	指定媒介	2026 年 5 月 14 日
14	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
15	万家中证红利交易型开放式指数证券投资基金分红公告	指定媒介	2026 年 6 月 11 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	20260101-20260630	550,020,000.00	122,399,000.00	169,887,000.00	502,532,000.00	34.41
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、《万家中证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家中证红利交易型开放式指数证券投资基金托管协议》。
- 4、万家中证红利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