

万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	12
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	66

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	66
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	66
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	66
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
7.12 投资组合报告附注	67
§ 8 基金份额持有人信息	68
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	68
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	69
§ 9 开放式基金份额变动	69
§ 10 重大事件揭示	69
10.1 基金份额持有人大会决议	69
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
10.4 基金投资策略的改变	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	70
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	70
10.8 其他重大事件	71
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	72
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	72
§ 12 备查文件目录	72
12.1 备查文件目录	72
12.2 存放地点	72
12.3 查阅方式	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	万家中证 1000 指数增强	
基金主代码	005313	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 12 月 3 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,282,457,584.19 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	万家中证 1000 指数增强 A	万家中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	005313	005314
报告期末下属分级基金的份额总额	544,244,716.44 份	738,212,867.75 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金，采取量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，在力求有效跟踪标的指数基础上，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型指数产品，在标的指数成份股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整。具体策略包括：1、股票投资策略；2、债券投资策略；3、中小企业私募债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、可转换债券投资策略；6、证券公司短期公司债券投资策略；7、衍生产品投资策略：（1）权证投资策略；（2）股指期货投资策略；（3）国债期货投资策略；（4）股票期权投资策略；（5）其他金融衍生产品；8、融资及转融通证券出借业务投资策略；9、其他。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率*95%+一年期人民币定期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		万家基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	张姗
	联系电话	021-38909626	400-61-95555
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	zhangshan_1027@cmbchina.com

客户服务电话	4008880800	400-61-95555
传真	021-38909627	0755-83195201
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）	深圳市深南大道 7088 号招商银 行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银 行大厦
邮政编码	200122	518040
法定代表人	陈广益	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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)	
	万家中证 1000 指数增强 A	万家中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	136,082,128.34	178,291,483.44
本期利润	193,233,978.80	249,034,737.39
加权平均基金份 额本期利润	0.3501	0.3386
本期加权平均净 值利润率	21.16%	20.75%
本期基金份额净 值增长率	23.52%	23.27%
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	426,714,730.31	559,135,481.23
期末可供分配基 金份额利润	0.7840	0.7574

期末基金资产净值	989, 896, 155. 25	1, 321, 837, 013. 99
期末基金份额净值	1. 8188	1. 7906
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	233. 39%	224. 22%

- 注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
- 3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3. 2 基金净值表现

3. 2. 1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家中证 1000 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	18. 61%	1. 64%	14. 84%	1. 53%	3. 77%	0. 11%
过去六个月	23. 52%	1. 61%	15. 26%	1. 54%	8. 26%	0. 07%
过去一年	52. 70%	1. 34%	36. 61%	1. 31%	16. 09%	0. 03%
过去三年	49. 38%	1. 57%	32. 45%	1. 57%	16. 93%	0. 00%
过去五年	70. 22%	1. 47%	24. 34%	1. 47%	45. 88%	0. 00%
过去七年	190. 81%	1. 45%	63. 82%	1. 45%	126. 99%	0. 00%
自基金合同生效起至今	233. 39%	1. 46%	86. 58%	1. 47%	146. 81%	-0. 01%

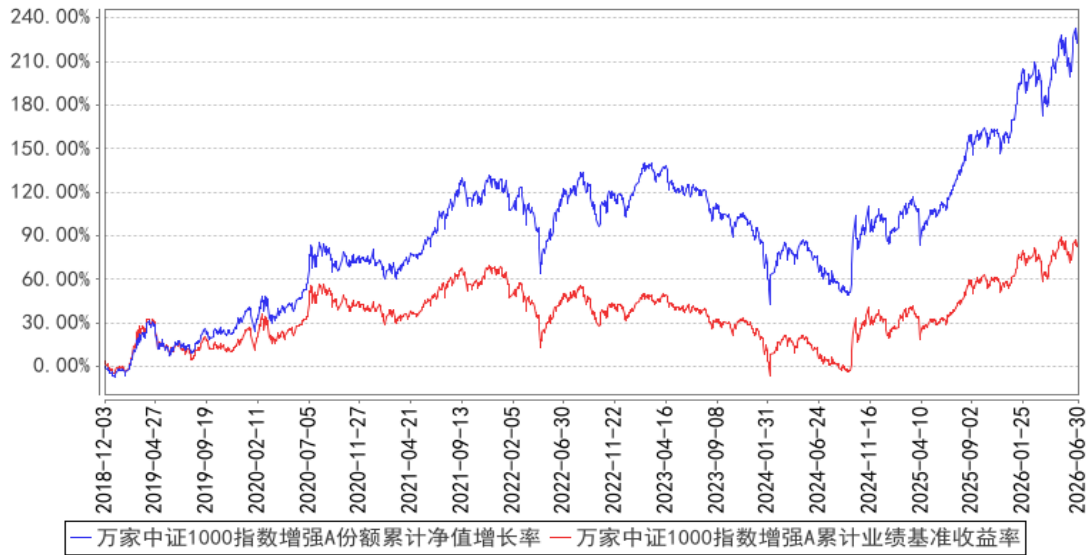
万家中证 1000 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	18. 50%	1. 64%	14. 84%	1. 53%	3. 66%	0. 11%
过去六个月	23. 27%	1. 61%	15. 26%	1. 54%	8. 01%	0. 07%

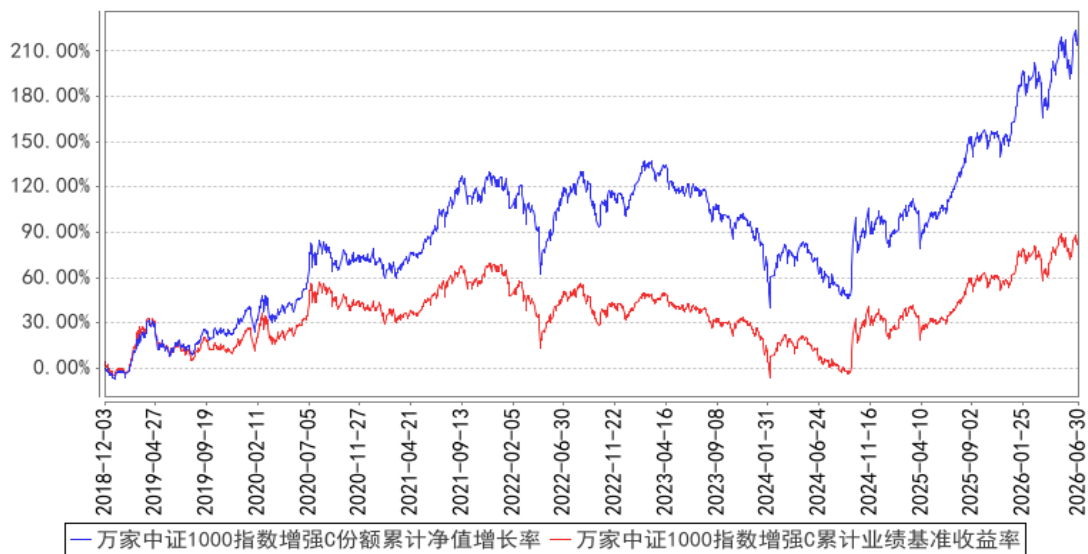
过去一年	52.09%	1.34%	36.61%	1.31%	15.48%	0.03%
过去三年	47.60%	1.57%	32.45%	1.57%	15.15%	0.00%
过去五年	66.84%	1.47%	24.34%	1.47%	42.50%	0.00%
过去七年	182.61%	1.45%	63.82%	1.45%	118.79%	0.00%
自基金合同 生效起至今	224.22%	1.46%	86.58%	1.47%	137.64%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

万家中证1000指数增强A份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



万家中证1000指数增强C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 2018 年 12 月 3 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		
乔亮	公司领导，首席量化投资官；万家上证科创板 100 指数增强型发起式证券投资基金、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家中证 2000 指数增强型证券投资基金、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资	2019 年 8 月 21 日	-	19.5 年	国籍：中国；学历：美国斯坦福大学工商管理博士，2019 年 7 月入职万家基金管理有限公司，现任公司首席量化投资官、基金经理，历任公司总经理助理、量化投资部总监（兼）、副总经理。曾任美国巴克莱国际投资管理公司投资部基金经理，加拿大退休基金国际投资管理公司量化投资部基金经理，南方基金管理有限公司数量化投资部投资经理，通联数据股份公司联合创始人、首席投资官，上海寻乾资产管理有限公司投资总监、总经理，巨杉（上海）资产管理有限公司量化投资部投资总监等职。

基金、万 家元贞量 化选股股 票型证券 投 资 基 金、万家 创业板指 数增强型 证券投资 基金、万 家 国 证 2000 指数 增强型证 券投资基 金、万家 家瑞债券 型证券投资 基金、 万家沪深 300 指数 增强型证 券投资基 金、万家 量化睿选 灵活配置 混合型证 券投资基 金、万家 颐达灵活 配置混合 型证券投资 基金的 基 金 经 理。				
--	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

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

本基金为指数增强型股票基金，采取量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，在力求有效跟踪标的指数基础上，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75% 的基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金采用量化多因子选股策略，控制行业权重偏离度、个股集中度，通过量化多因子选股的方式选取一篮子股票组合。在行业和风格配置相对于业绩基准指数相对均衡，无重仓行业或具体风格，在量化选股方面精选行业内质优个股组合，持股较为分散。采用量化风险模型合理控制组合风险，保证较小的跟踪误差，投资目标是获取在既定跟踪误差下的超额收益最大化。本基金股票组合中 80% 以上权重为中证 1000 成分股，保持了跟标的指数的风格基本一致。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家中证 1000 指数增强 A 的基金份额净值为 1.8188 元，本报告期基金份额净值增长率为 23.52%，同期业绩比较基准收益率为 15.26%；截至本报告期末万家中证 1000 指数增强 C 的基金份额净值为 1.7906 元，本报告期基金份额净值增长率为 23.27%，同期业绩比较基准收益率为 15.26%。

基金报告期内 A 份额、C 份额日均跟踪偏离度分别为 0.1989%、0.1988%，年跟踪误差分别为 3.9797%、3.9883%，符合基金合同中日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%的规定。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年上半年，A 股市场呈现“科技领涨、指数震荡抬升”的结构分化格局。人工智能产业革命、国产替代加速与全球科技周期共振向上，三重驱动之下，资金深度抱团 AI 相关板块，科技成长走出独立行情；而传统价值板块则持续承压，资金流出与价格下跌并行，市场分化显著。

展望后市，7 月以来 AI 板块杠杆资金快速出清，市场经历大幅调整后估值已回归合理区间，A 股有望逐步企稳回升。从政策层面看，近期决策层对资本市场积极表态，稳定信号明确，维稳资金正有序入场，托底力度增强；从基本面看，二季度 PPI 中枢较一季度显著抬升，价格端改善正向企业盈利传导，上市公司盈利有望进一步上行，为市场走强提供有力支撑；从政策定调看，7 月政治局会议基调积极，强调高度重视经济运行中的困难挑战，要求及时谋划增量政策，加大逆周期调节与扩内需力度，财政与货币表述均较 4 月更为积极——财政端加快支出与债券资金使用进度，推进“两重”“两新”落地，货币端要求适时调整政策工具，降准降息预期升温，且股市表述从“稳信心”升级为“提升韧性信心”，政策呵护力度进一步加码。总体而言，市场调整已较为充分，叠加政策托底与基本面改善的双重支撑，A 股有望企稳回升。

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

2026 年 1 月 12 日万家中证 1000 指数增强 A 类每 10 份基金份额分红 0.522 元，万家中证 1000 指数增强 C 类每 10 份基金份额分红 0.5 元。万家中证 1000 指数增强 A 共计分配利润 29,380,941.85 元，万家中证 1000 指数增强 C 共计分配利润 35,593,296.63 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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 1000 指数增强型发起式证券投资基金

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	45,786,538.81	20,860,404.13
结算备付金		110,748,763.62	113,330,679.08
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,178,712,698.36	1,856,650,459.59
其中：股票投资		2,178,712,698.36	1,856,650,459.59
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		5,355,845.53	5,906,196.29
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		2,340,603,846.32	1,996,747,739.09
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		-	-
应付赎回款		26,156,429.76	19,144,756.59
应付管理人报酬		1,828,661.57	1,629,781.27
应付托管费		365,732.30	325,956.26
应付销售服务费		424,491.17	271,884.36
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	95,362.28	171,325.58
负债合计		28,870,677.08	21,543,704.06
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,282,457,584.19	1,308,809,803.42
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	1,029,275,585.05	666,394,231.61
净资产合计		2,311,733,169.24	1,975,204,035.03
负债和净资产总计		2,340,603,846.32	1,996,747,739.09

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 1,282,457,584.19 份，其中万家中证 1000 指数增强 A 基金份额净值 1.8188 元，基金份额总额 544,244,716.44 份；万家中证 1000 指数增强 C 基金份额净值 1.7906 元，基金份额总额 738,212,867.75 份。

6.2 利润表

会计主体：万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

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		457,311,970.19	310,759,447.46
1. 利息收入		102,667.33	131,716.39
其中：存款利息收入	6.4.7.10	102,667.33	131,716.39
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）		327,877,921.02	179,507,055.89
其中：股票投资收益	6.4.7.11	318,458,280.44	159,574,906.20
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-273,145.89
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	9,419,640.58	20,205,295.58
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 17	127, 895, 104. 41	130, 460, 931. 09
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, 436, 277. 43	659, 744. 09
减：二、营业总支出		15, 043, 254. 00	19, 789, 760. 47
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	10, 465, 505. 87	13, 651, 940. 17
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	2, 093, 101. 13	2, 730, 388. 06
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	2, 375, 026. 84	3, 191, 895. 54
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	109, 620. 16	215, 536. 70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		442, 268, 716. 19	290, 969, 686. 99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		442, 268, 716. 19	290, 969, 686. 99
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		442, 268, 716. 19	290, 969, 686. 99

6.3 净资产变动表

会计主体：万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

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, 308, 809, 803. 42	-	666, 394, 231. 61	1, 975, 204, 035. 03
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	1, 308, 809, 803. 42	-	666, 394, 231. 61	1, 975, 204, 035. 03

资产	42			3
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-26,352,219.23	-	362,881,353.44	336,529,134.21
(一)、综合收益总额	-	-	442,268,716.19	442,268,716.19
(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)	-26,352,219.23	-	-14,413,124.27	-40,765,343.50
其中：1. 基金申购款	643,555,553.05	-	420,960,378.81	1,064,515,931.86
2. 基金赎回款	-669,907,772.28	-	-435,373,503.08	-1,105,281,275.36
(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)	-	-	-64,974,238.48	-64,974,238.48
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,282,457,584.19	-	1,029,275,585.05	2,311,733,169.24
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	2,678,009,090.78	-	296,326,505.40	2,974,335,596.18
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,678,009,090.78	-	296,326,505.40	2,974,335,596.18

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-732,682,323.03	-	136,280,550.18	-596,401,772.85
(一)、综合收益总额	-	-	290,969,686.99	290,969,686.99
(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)	-732,682,323.03	-	-125,087,950.93	-857,770,273.96
其中：1. 基金申购款	317,733,409.14	-	45,395,762.59	363,129,171.73
2. 基金赎回款	-1,050,415,732.17	-	-170,483,713.52	-1,220,899,445.69
(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)	-	-	-29,601,185.88	-29,601,185.88
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,945,326,767.75	-	432,607,055.58	2,377,933,823.33

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 1000 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）由万家裕债券型证券投资基金转型而来。根据万家裕债券型证券投资基金基金份额持有人大会审议通过的《关于修改万家裕债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》以及相关法律法规的规定，并向中国证券监督管理委员会备案，万家裕债券型证券投资基金于 2018 年 12 月 3 日转型为本基金。

本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）、其他股票（包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中小企业私募债券、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、债券回购、银行存款、同业存单、资产支持证券、金融衍生品（包括权证、股指期货、国债期货、股票期权等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可参与融资业务和转融通证券出借交易。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金在履行适当程序后可将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率*95%+一年期人民币定期存款利率（税后）*5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《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	45,786,538.81
等于：本金	45,782,866.17
加：应计利息	3,672.64
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	45,786,538.81

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		2,044,646,530.83	-	2,178,712,698.36	134,066,167.53
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		2,044,646,530.83	-	2,178,712,698.36	134,066,167.53

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

本基金本报告期末未持有各项买入返售金融资产。

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	4,696.19
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	84,302.56
其他	6,363.53
合计	95,362.28

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

万家中证 1000 指数增强 A

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	582,641,812.06	582,641,812.06
本期申购	219,324,496.88	219,324,496.88
本期赎回（以“-”号填列）	-257,721,592.50	-257,721,592.50
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	544,244,716.44	544,244,716.44

万家中证 1000 指数增强 C

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	726,167,991.36	726,167,991.36
本期申购	424,231,056.17	424,231,056.17
本期赎回（以“-”号填列）	-412,186,179.78	-412,186,179.78
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	738,212,867.75	738,212,867.75

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

万家中证 1000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	342,273,291.66	-38,495,435.11	303,777,856.55
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	342,273,291.66	-38,495,435.11	303,777,856.55
本期利润	136,082,128.34	57,151,850.46	193,233,978.80
本期基金份额交易产生的变动数	-22,259,747.84	280,293.15	-21,979,454.69
其中：基金申购款	144,964,711.27	3,588,514.32	148,553,225.59
基金赎回款	-167,224,459.11	-3,308,221.17	-170,532,680.28
本期已分配利润	-29,380,941.85	-	-29,380,941.85
本期末	426,714,730.31	18,936,708.50	445,651,438.81

万家中证 1000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	410,646,551.70	-48,030,176.64	362,616,375.06
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	410,646,551.70	-48,030,176.64	362,616,375.06
本期利润	178,291,483.44	70,743,253.95	249,034,737.39
本期基金份额交易产生的变动数	5,790,742.72	1,775,587.70	7,566,330.42
其中：基金申购款	264,791,087.28	7,616,065.94	272,407,153.22

基金赎回款	-259,000,344.56	-5,840,478.24	-264,840,822.80
本期已分配利润	-35,593,296.63	-	-35,593,296.63
本期末	559,135,481.23	24,488,665.01	583,624,146.24

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	77,993.11
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	24,646.49
其他	27.73
合计	102,667.33

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	318,458,280.44
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	318,458,280.44

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	2,680,314,016.71
减：卖出股票成本总额	2,359,155,664.30
减：交易费用	2,700,071.97
买卖股票差价收入	318,458,280.44

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	9,419,640.58
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	9,419,640.58

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	127,895,104.41
股票投资	127,895,104.41
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	127,895,104.41

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	1,420,122.57
基金转换费收入	16,154.86
合计	1,436,277.43

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	6,717.60
账户维护费	18,600.00
合计	109,620.16

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、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
中泰证券股份有限公司（“中泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
万家财富基金销售（天津）有限公司（“万家财富”）	基金管理人的子公司、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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	10,465,505.87	13,651,940.17
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,537,023.42	5,703,627.58
应支付基金管理人的净管理费	5,928,482.45	7,948,312.59

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 1.00\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，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	2,093,101.13	2,730,388.06

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

$$H=E\times 0.20\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	万家中证 1000 指数增 强 A	万家中证 1000 指数增 强 C	合计
万家财富	—	9.72	9.72
万家基金	—	66,905.47	66,905.47
招商银行	—	66,887.21	66,887.21
中泰证券	—	25,640.31	25,640.31
合计	—	159,442.71	159,442.71
获得销售服务费的各关联 方名称	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销售服务费		
	万家中证 1000 指数增 强 A	万家中证 1000 指数增 强 C	合计
万家财富	—	1.98	1.98
万家基金	—	197,701.69	197,701.69
招商银行	—	149,725.25	149,725.25
中泰证券	—	7,428.30	7,428.30
合计	—	354,857.22	354,857.22

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据相关协议支付给各销售机构。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，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

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
招商银行	45,786,538.81	77,993.11	55,840,383.70	58,862.18

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方所承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间没有需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

万家中证 1000 指数增强 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 1 月 12 日	-	2026 年 1 月 12 日	0.5220	18,980,083.79	10,400,858.06	29,380,941.85	-
合计	-	-	-	0.5220	18,980,083.79	10,400,858.06	29,380,941.85	-
万家中证 1000 指数增强 C								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分	现金形 式	再投资形 式	本期利 润分配	备注
		场内	场外					

				红数	发放总额	发放总额	合计	
1	2026 年 1 月 12 日	-	2026 年 1 月 12 日	0.5000	28,553,883.34	7,039,413.29	35,593,296.63	-
合计	-	-	-	0.5000	28,553,883.34	7,039,413.29	35,593,296.63	-

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	58,873	595,206.03	595,206.03	-
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	25,231	255,085.41	255,085.41	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-

				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	新股流通受限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-

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	-
603284	林平	2026 年 2 月	6 个月	新股	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-

	发展	月 3 日		流通受限						
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	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股流通	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-

				受限						
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	9 个月	新股流通受限	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	9 个月	新股流通受限	114.28	676.94	7,334	838,129.52	4,964,677.96	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股流通受限	104.66	768.89	3,994	418,012.04	3,070,946.66	-
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	163	13,346.44	258,245.79	-
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	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-

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	879.53	2026 年 07 月 13 日	890.99	1,900	966,145.00	1,671,107.00	-
688260	昀冢科技	2026 年 6 月 26 日	异常波动	145.02	2026 年 7 月 1 日	132.00	11,000	352,514.22	1,595,220.00	-
300332	天壕能源	2026 年 6 月 26 日	重大事项	4.30	2026 年 07 月 09 日	4.64	148,000	714,317.77	636,400.00	-

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	45,786,538.81	-	-	-	-	-	45,786,538.81
结算备付金	110,748,763.62	-	-	-	-	-	110,748,763.62
交易性金融资产	-	-	-	-	-	2,178,712,698.36	2,178,712,698.36
应收申购款	10.52	-	-	-	-	5,355,835.01	5,355,845.53
资产总计	156,535,312.95	-	-	-	-	2,184,068,533.37	2,340,603,846.32
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	26,156,429.76	26,156,429.76
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,828,661.57	1,828,661.57
应付托管费	-	-	-	-	-	365,732.30	365,732.30
应付销售服务费	-	-	-	-	-	424,491.17	424,491.17
其他负债	-	-	-	-	-	95,362.28	95,362.28
负债总计	-	-	-	-	-	28,870,677.08	28,870,677.08
利率敏感度缺口	156,535,312.95	-	-	-	-	2,155,197,856.29	2,311,733,169.24
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	20,860,404.13	-	-	-	-	-	20,860,404.13
结算备付金	113,330,679.08	-	-	-	-	-	113,330,679.08
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,856,650,459.59	1,856,650,459.59
应收申购款	435.74	-	-	-	-	5,905,760.55	5,906,196.29
资产总计	134,191,518.95	-	-	-	-	1,862,556,220.14	1,996,747,739.09
负债							

应付赎回款	-	-	-	-	-	19,144,756.59	19,144,756.59
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,629,781.27	1,629,781.27
应付托管费	-	-	-	-	-	325,956.26	325,956.26
应付销售服务费	-	-	-	-	-	271,884.36	271,884.36
其他负债	-	-	-	-	-	171,325.58	171,325.58
负债总计	-	-	-	-	-	21,543,704.06	21,543,704.06
利率敏感度缺口	134,191,518.95	-	-	-	-	1,841,012,516.08	1,975,204,035.03

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	2,178,712,698.36	94.25	1,856,650,459.59	94.00
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	2,178,712,698.36	94.25	1,856,650,459.59	94.00

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	25,741,105.91	19,798,798.22
	股票基准指数下降 100 个基点	-25,741,105.91	-19,798,798.22

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：
第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	2,163,513,167.82	1,848,413,997.95
第二层次	4,753,018.44	791,252.40
第三层次	10,446,512.10	7,445,209.24
合计	2,178,712,698.36	1,856,650,459.59

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	2,178,712,698.36	93.08
	其中：股票	2,178,712,698.36	93.08
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	156,535,302.43	6.69
8	其他各项资产	5,355,845.53	0.23
9	合计	2,340,603,846.32	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合**

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	10,764,818.70	0.47

B	采矿业	34,363,799.80	1.49
C	制造业	1,357,834,855.53	58.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,936,718.00	1.12
E	建筑业	13,077,468.00	0.57
F	批发和零售业	27,175,621.52	1.18
G	交通运输、仓储和邮政业	15,424,747.89	0.67
H	住宿和餐饮业	611,520.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	174,970,426.39	7.57
J	金融业	32,969,451.70	1.43
K	房地产业	10,953,483.24	0.47
L	租赁和商务服务业	7,800,542.00	0.34
M	科学研究和技术服务业	32,697,325.00	1.41
N	水利、环境和公共设施管理业	17,585,926.26	0.76
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	934,320.00	0.04
Q	卫生和社会工作	4,504,756.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	3,111,213.00	0.13
S	综合	86,654.00	—
	合计	1,770,803,647.03	76.60

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,164,207.00	0.05
B	采矿业	9,687,390.82	0.42
C	制造业	337,665,593.21	14.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,575,868.44	0.15
E	建筑业	2,008,647.00	0.09
F	批发和零售业	11,461,081.00	0.50
G	交通运输、仓储和邮政业	434,990.46	0.02
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,503,125.00	1.54

J	金融业	1,070,964.00	0.05
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	236,378.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	2,817,074.40	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	1,516,196.00	0.07
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	767,536.00	0.03
S	综合	—	—
	合计	407,909,051.33	17.65

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	688766	普冉股份	40,500	31,047,300.00	1.34
2	688048	长光华芯	44,300	22,238,600.00	0.96
3	688409	富创精密	67,500	20,671,875.00	0.89
4	603083	剑桥科技	77,400	19,726,938.00	0.85
5	300236	上海新阳	131,325	17,269,237.50	0.75
6	688630	芯碁微装	31,400	17,250,846.00	0.75
7	002222	福晶科技	177,700	16,398,156.00	0.71
8	688503	聚和材料	116,700	15,486,090.00	0.67
9	688167	炬光科技	43,395	15,370,942.95	0.66
10	688372	伟测科技	81,650	15,186,900.00	0.66
11	688627	精智达	20,600	14,729,000.00	0.64
12	688025	杰普特	30,600	14,382,000.00	0.62
13	000811	冰轮环境	250,200	14,066,244.00	0.61
14	688519	南亚新材	36,400	13,833,456.00	0.60
15	688559	海目星	158,600	13,309,712.00	0.58
16	301205	联特科技	39,400	13,163,540.00	0.57
17	688110	东芯股份	64,600	13,159,020.00	0.57
18	688127	蓝特光学	127,900	12,483,040.00	0.54
19	605020	永和股份	302,543	12,319,550.96	0.53

20	688536	思瑞浦	32,600	11,869,334.00	0.51
21	300870	欧陆通	32,860	11,359,373.40	0.49
22	688195	腾景科技	57,000	10,977,060.00	0.47
23	002497	雅化集团	523,300	10,659,621.00	0.46
24	688668	鼎通科技	27,900	10,415,070.00	0.45
25	688596	正帆科技	130,100	10,285,706.00	0.44
26	002518	科士达	190,300	10,198,177.00	0.44
27	300811	铂科新材	105,980	10,056,442.20	0.44
28	688262	国芯科技	229,500	9,921,285.00	0.43
29	300861	美畅股份	391,500	9,861,885.00	0.43
30	688205	德科立	46,700	9,722,473.00	0.42
31	688700	东威科技	107,000	9,565,800.00	0.41
32	601677	明泰铝业	542,620	9,007,492.00	0.39
33	300438	鹏辉能源	107,880	8,937,858.00	0.39
34	300672	国科微	30,003	8,850,885.00	0.38
35	301127	武汉天源	423,100	8,766,632.00	0.38
36	605376	博迁新材	32,100	8,708,730.00	0.38
37	688392	骄成超声	38,100	8,655,558.00	0.37
38	688182	灿勤科技	195,000	8,398,650.00	0.36
39	688123	聚辰股份	38,934	8,277,368.40	0.36
40	000837	秦川机床	735,800	8,174,738.00	0.35
41	301510	固高科技	256,000	8,174,080.00	0.35
42	688652	京仪装备	40,700	8,146,919.00	0.35
43	301511	德福科技	56,400	8,113,140.00	0.35
44	300323	华灿光电	388,901	7,933,580.40	0.34
45	601777	千里科技	971,700	7,929,072.00	0.34
46	002237	恒邦股份	536,300	7,878,247.00	0.34
47	002151	北斗星通	242,000	7,683,500.00	0.33
48	600330	天通股份	247,800	7,642,152.00	0.33
49	300456	赛微电子	179,900	7,640,353.00	0.33
50	300065	海兰信	334,200	7,456,002.00	0.32
51	688390	固德威	68,200	7,400,382.00	0.32
52	300762	上海瀚讯	161,042	7,351,567.30	0.32
53	002906	华阳集团	293,600	7,328,256.00	0.32
54	002378	章源钨业	215,200	7,204,896.00	0.31
55	300224	正海磁材	534,708	7,127,657.64	0.31
56	688779	五矿新能	875,300	7,098,683.00	0.31
57	600366	宁波韵升	482,100	7,077,228.00	0.31
58	603005	晶方科技	131,335	7,075,016.45	0.31
59	688107	安路科技	154,000	7,022,400.00	0.30
60	000970	中科三环	457,900	6,955,501.00	0.30
61	301487	盟固利	361,600	6,924,640.00	0.30
62	002004	华邦健康	1,746,291	6,862,923.63	0.30

63	600323	瀚蓝环境	244,731	6,720,313.26	0.29
64	688206	概伦电子	150,000	6,655,500.00	0.29
65	301217	铜冠铜箔	40,300	6,652,321.00	0.29
66	603929	亚翔集成	24,400	6,637,288.00	0.29
67	300455	航天智装	307,400	6,621,396.00	0.29
68	002993	奥海科技	92,000	6,588,120.00	0.28
69	688279	峰岬科技	29,200	6,553,648.00	0.28
70	301029	怡合达	240,900	6,506,709.00	0.28
71	688097	博众精工	101,900	6,424,795.00	0.28
72	002544	普天科技	350,300	6,382,466.00	0.28
73	688400	凌云光	96,000	6,355,200.00	0.27
74	000969	安泰科技	256,449	6,293,258.46	0.27
75	688153	唯捷创芯	193,400	6,212,008.00	0.27
76	300153	科泰电源	274,000	6,197,880.00	0.27
77	688158	优刻得	168,500	6,194,060.00	0.27
78	688131	皓元医药	64,700	6,120,620.00	0.26
79	301219	腾远钴业	111,045	6,085,266.00	0.26
80	601375	中原证券	1,520,300	6,065,997.00	0.26
81	603588	高能环境	314,200	6,032,640.00	0.26
82	603915	国茂股份	421,000	5,973,990.00	0.26
83	688321	微芯生物	226,700	5,969,011.00	0.26
84	300034	钢研高纳	346,600	5,940,724.00	0.26
85	002458	益生股份	764,410	5,939,465.70	0.26
86	000810	创维数字	446,700	5,918,775.00	0.26
87	300772	运达股份	480,460	5,909,658.00	0.26
88	301589	诺瓦星云	39,600	5,899,608.00	0.26
89	688403	汇成股份	147,500	5,855,750.00	0.25
90	688522	纳睿雷达	290,543	5,816,670.86	0.25
91	300573	兴齐眼药	142,500	5,808,300.00	0.25
92	000901	航天科技	323,900	5,762,181.00	0.25
93	688433	华曙高科	67,000	5,735,200.00	0.25
94	002017	东信和平	387,100	5,663,273.00	0.24
95	603306	华懋科技	54,000	5,599,260.00	0.24
96	301215	中汽股份	1,052,400	5,461,956.00	0.24
97	300593	新雷能	179,900	5,407,794.00	0.23
98	301238	瑞泰新材	220,300	5,375,320.00	0.23
99	688531	日联科技	30,200	5,370,768.00	0.23
100	301071	力量钻石	58,040	5,368,700.00	0.23
101	600572	康恩贝	1,369,400	5,368,048.00	0.23
102	002488	金固股份	601,800	5,362,038.00	0.23
103	301550	斯菱智驱	58,565	5,354,597.95	0.23
104	000829	天音控股	683,900	5,334,420.00	0.23
105	300166	东方国信	301,000	5,330,710.00	0.23

106	601963	重庆银行	526,900	5,311,152.00	0.23
107	688062	迈威生物	187,900	5,308,175.00	0.23
108	688088	虹软科技	146,800	5,218,740.00	0.23
109	300049	福瑞医科	133,900	5,206,032.00	0.23
110	600933	爱柯迪	350,700	5,183,346.00	0.22
111	603496	恒为科技	224,800	5,165,904.00	0.22
112	688141	杰华特	33,600	5,157,600.00	0.22
113	002276	万马股份	507,800	5,133,858.00	0.22
114	688063	派能科技	96,300	5,129,901.00	0.22
115	601069	西部黄金	229,700	5,053,400.00	0.22
116	301316	慧博云通	126,700	4,989,446.00	0.22
117	688549	中巨芯	134,900	4,965,669.00	0.21
118	300130	新国都	234,800	4,940,192.00	0.21
119	301345	涛涛车业	21,300	4,920,300.00	0.21
120	601126	四方股份	77,600	4,904,320.00	0.21
121	000685	中山公用	437,900	4,886,964.00	0.21
122	600345	长江通信	74,200	4,860,842.00	0.21
123	300579	数字认证	234,400	4,852,080.00	0.21
124	603516	淳中科技	35,800	4,819,038.00	0.21
125	002396	星网锐捷	245,280	4,702,017.60	0.20
126	000555	神州信息	451,000	4,645,300.00	0.20
127	002373	千方科技	646,400	4,641,152.00	0.20
128	603118	共进股份	382,200	4,628,442.00	0.20
129	605118	力鼎光电	132,600	4,626,414.00	0.20
130	600961	株冶集团	142,200	4,605,858.00	0.20
131	600641	先导基电	115,300	4,595,858.00	0.20
132	600971	恒源煤电	665,900	4,594,710.00	0.20
133	603950	长源东谷	54,400	4,592,992.00	0.20
134	000059	华锦股份	1,222,710	4,585,162.50	0.20
135	002428	云南锗业	38,000	4,566,840.00	0.20
136	300341	麦克奥迪	343,300	4,548,725.00	0.20
137	301005	超捷股份	40,400	4,507,024.00	0.19
138	300363	博腾股份	275,200	4,469,248.00	0.19
139	002516	旷达科技	791,700	4,417,686.00	0.19
140	300693	盛弘股份	89,900	4,382,625.00	0.19
141	300568	星源材质	233,800	4,376,736.00	0.19
142	300184	力源信息	249,200	4,373,460.00	0.19
143	002536	飞龙股份	92,600	4,368,868.00	0.19
144	002345	潮宏基	470,100	4,310,817.00	0.19
145	002389	航天彩虹	242,000	4,300,340.00	0.19
146	600475	华光环能	280,000	4,270,000.00	0.18
147	300726	宏达电子	50,100	4,236,957.00	0.18
148	002338	奥普光电	73,800	4,221,360.00	0.18

149	002048	宁波华翔	182,900	4,206,700.00	0.18
150	600596	新安股份	261,800	4,178,328.00	0.18
151	002706	良信股份	376,200	4,104,342.00	0.18
152	002192	融捷股份	45,102	4,032,118.80	0.17
153	688083	中望软件	62,200	4,027,450.00	0.17
154	300682	朗新科技	405,700	4,016,430.00	0.17
155	300602	飞荣达	77,900	3,988,480.00	0.17
156	300415	伊之密	198,200	3,946,162.00	0.17
157	688333	铂力特	37,800	3,870,720.00	0.17
158	002534	西子洁能	208,000	3,858,400.00	0.17
159	301087	可孚医疗	80,700	3,845,355.00	0.17
160	000603	盛达资源	166,100	3,836,910.00	0.17
161	301039	中集车辆	542,674	3,825,851.70	0.17
162	300779	惠城环保	75,868	3,808,573.60	0.16
163	600206	有研新材	57,100	3,802,860.00	0.16
164	002468	申通快递	260,100	3,787,056.00	0.16
165	300684	中石科技	61,600	3,757,600.00	0.16
166	603997	继峰股份	315,600	3,733,548.00	0.16
167	300045	华力创通	215,841	3,721,098.84	0.16
168	603124	江南新材	19,900	3,720,902.00	0.16
169	003039	顺控发展	335,000	3,688,350.00	0.16
170	601208	东材科技	52,000	3,681,080.00	0.16
171	001227	兰州银行	1,822,600	3,645,200.00	0.16
172	605123	派克新材	37,500	3,637,875.00	0.16
173	000973	佛塑科技	252,200	3,619,070.00	0.16
174	300007	汉威科技	93,608	3,575,825.60	0.15
175	600012	皖通高速	222,900	3,512,904.00	0.15
176	600577	精达股份	358,900	3,510,042.00	0.15
177	688717	艾罗能源	42,500	3,509,225.00	0.15
178	002416	爱施德	391,600	3,508,736.00	0.15
179	688548	广钢气体	67,100	3,495,910.00	0.15
180	300342	天银机电	73,700	3,463,900.00	0.15
181	300101	振芯科技	213,800	3,457,146.00	0.15
182	300855	图南股份	110,500	3,454,230.00	0.15
183	002163	海南发展	414,100	3,453,594.00	0.15
184	002611	东方精工	195,500	3,452,530.00	0.15
185	688001	华兴源创	40,200	3,445,140.00	0.15
186	603876	鼎胜新材	132,100	3,435,921.00	0.15
187	301153	中科江南	210,800	3,433,932.00	0.15
188	688327	云从科技	274,600	3,421,516.00	0.15
189	300398	飞凯材料	55,400	3,420,950.00	0.15
190	001301	尚太科技	36,400	3,403,764.00	0.15
191	688031	星环科技	29,500	3,397,810.00	0.15

192	001287	中电港	109,000	3,395,350.00	0.15
193	001236	弘业期货	487,800	3,390,210.00	0.15
194	603219	富佳股份	216,600	3,374,628.00	0.15
195	300337	银邦股份	288,900	3,368,574.00	0.15
196	300170	汉得信息	220,700	3,363,468.00	0.15
197	002747	埃斯顿	89,200	3,329,836.00	0.14
198	002405	四维图新	505,800	3,272,526.00	0.14
199	603305	旭升集团	269,300	3,263,916.00	0.14
200	688690	纳微科技	73,963	3,261,768.30	0.14
201	300814	中富电路	15,900	3,251,550.00	0.14
202	301413	安培龙	45,730	3,241,342.40	0.14
203	301600	慧翰股份	35,100	3,208,140.00	0.14
204	603100	川仪股份	177,400	3,202,070.00	0.14
205	002317	众生药业	130,300	3,201,471.00	0.14
206	600037	歌华有线	507,200	3,180,144.00	0.14
207	002041	登海种业	401,700	3,161,379.00	0.14
208	002745	木林森	249,300	3,128,715.00	0.14
209	688586	江航装备	266,300	3,113,047.00	0.13
210	603667	五洲新春	46,800	3,066,336.00	0.13
211	002290	禾盛新材	33,200	3,050,084.00	0.13
212	002557	洽洽食品	166,600	2,992,136.00	0.13
213	300244	迪安诊断	157,700	2,955,298.00	0.13
214	000923	河钢资源	237,600	2,948,616.00	0.13
215	002020	京新药业	235,900	2,946,391.00	0.13
216	688326	经纬恒润	41,400	2,934,432.00	0.13
217	002099	海翔药业	554,500	2,927,760.00	0.13
218	002701	奥瑞金	681,800	2,904,468.00	0.13
219	002948	青岛银行	570,760	2,899,460.80	0.13
220	002254	泰和新材	158,600	2,884,934.00	0.12
221	605111	新洁能	28,800	2,855,232.00	0.12
222	603638	艾迪精密	121,052	2,838,669.40	0.12
223	688300	联瑞新材	11,600	2,835,040.00	0.12
224	002636	金安国纪	23,600	2,831,292.00	0.12
225	002174	游族网络	224,400	2,829,684.00	0.12
226	000058	深赛格	453,200	2,782,648.00	0.12
227	002097	山河智能	384,600	2,780,658.00	0.12
228	000672	上峰材料	115,700	2,739,776.00	0.12
229	301268	铭利达	194,400	2,717,712.00	0.12
230	688408	中信博	83,400	2,681,310.00	0.12
231	603505	金石资源	131,300	2,645,695.00	0.11
232	002925	盈趣科技	106,410	2,624,070.60	0.11
233	688516	奥特维	45,204	2,594,257.56	0.11
234	601969	海南矿业	325,100	2,571,541.00	0.11

235	688128	中国电研	108,185	2,568,311.90	0.11
236	603456	九洲药业	186,800	2,551,688.00	0.11
237	601187	厦门银行	371,900	2,540,077.00	0.11
238	002324	普利特	210,281	2,538,091.67	0.11
239	603583	捷昌驱动	110,700	2,523,960.00	0.11
240	688439	振华风光	54,149	2,501,683.80	0.11
241	603556	海兴电力	112,900	2,483,800.00	0.11
242	002545	东方铁塔	152,200	2,468,684.00	0.11
243	601890	亚星锚链	301,600	2,464,072.00	0.11
244	688252	天德钰	101,880	2,445,120.00	0.11
245	603236	移远通信	47,700	2,440,809.00	0.11
246	688776	国光电气	39,700	2,435,198.00	0.11
247	601020	华钰矿业	100,300	2,406,197.00	0.10
248	603533	掌阅科技	117,900	2,392,191.00	0.10
249	688639	华恒生物	148,057	2,389,639.98	0.10
250	600201	生物股份	202,026	2,353,602.90	0.10
251	300127	银河磁体	84,200	2,353,390.00	0.10
252	300357	我武生物	100,900	2,352,988.00	0.10
253	688591	泰凌微	67,400	2,317,212.00	0.10
254	300776	帝尔激光	10,739	2,308,455.44	0.10
255	300416	苏试试验	112,000	2,282,560.00	0.10
256	300607	拓斯达	55,300	2,280,019.00	0.10
257	300428	立中集团	125,410	2,279,953.80	0.10
258	600740	山西焦化	714,500	2,279,255.00	0.10
259	001914	招商积余	278,600	2,273,376.00	0.10
260	002911	佛燃能源	238,900	2,267,161.00	0.10
261	300031	宝通科技	79,200	2,262,744.00	0.10
262	002320	海峡股份	360,007	2,257,243.89	0.10
263	601975	招商南油	604,000	2,252,920.00	0.10
264	600928	西安银行	687,500	2,248,125.00	0.10
265	300188	国投智能	238,079	2,226,038.65	0.10
266	600151	航天机电	192,500	2,159,850.00	0.09
267	600416	湘电股份	218,300	2,139,340.00	0.09
268	300468	四方精创	101,800	2,138,818.00	0.09
269	301095	广立微	17,800	2,101,290.00	0.09
270	603983	丸美生物	74,400	2,093,616.00	0.09
271	300747	锐科激光	39,200	2,081,128.00	0.09
272	002484	江海股份	19,600	2,058,000.00	0.09
273	002063	远光软件	399,800	2,038,980.00	0.09
274	300624	万兴科技	38,967	2,021,218.29	0.09
275	688515	裕太微	8,100	2,014,956.00	0.09
276	600776	东方通信	153,300	2,014,362.00	0.09
277	002815	崇达技术	121,056	2,008,319.04	0.09

278	301031	中熔电气	16,677	1,992,067.65	0.09
279	600929	雪天盐业	434,300	1,971,722.00	0.09
280	300768	迪普科技	142,900	1,967,733.00	0.09
281	001267	汇绿生态	36,700	1,963,450.00	0.08
282	688091	上海谊众	48,744	1,959,508.80	0.08
283	600908	无锡银行	385,000	1,955,800.00	0.08
284	688102	斯瑞新材	41,200	1,943,816.00	0.08
285	001337	四川黄金	52,500	1,924,650.00	0.08
286	002233	塔牌集团	273,800	1,908,386.00	0.08
287	600389	江山股份	97,568	1,904,527.36	0.08
288	600057	厦门象屿	346,600	1,878,572.00	0.08
289	300674	宇信科技	124,500	1,873,725.00	0.08
290	600185	珠免集团	415,500	1,869,750.00	0.08
291	301396	宏景科技	5,600	1,856,960.00	0.08
292	600882	妙可蓝多	116,100	1,856,439.00	0.08
293	301626	苏州天脉	4,800	1,843,008.00	0.08
294	002139	拓邦股份	192,947	1,836,855.44	0.08
295	688150	莱特光电	26,200	1,797,844.00	0.08
296	688106	金宏气体	43,300	1,796,084.00	0.08
297	600502	安徽建工	412,700	1,795,245.00	0.08
298	301018	申菱环境	15,500	1,791,955.00	0.08
299	300702	天宇股份	88,400	1,782,144.00	0.08
300	300738	奥飞数据	88,100	1,781,382.00	0.08
301	002727	一心堂	185,400	1,777,986.00	0.08
302	300047	天源迪科	198,300	1,760,904.00	0.08
303	603663	三祥新材	18,200	1,752,660.00	0.08
304	688698	伟创电气	33,200	1,741,340.00	0.08
305	600718	东软集团	236,900	1,715,156.00	0.07
306	688612	威迈斯	57,300	1,695,507.00	0.07
307	603013	亚普股份	107,100	1,691,109.00	0.07
308	002215	诺普信	203,500	1,674,805.00	0.07
309	002651	利君股份	229,100	1,674,721.00	0.07
310	688177	百奥泰	99,500	1,673,590.00	0.07
311	600158	中体产业	248,300	1,673,542.00	0.07
312	300809	华辰装备	61,700	1,668,985.00	0.07
313	300685	艾德生物	99,000	1,667,160.00	0.07
314	603713	密尔克卫	23,400	1,665,378.00	0.07
315	002961	瑞达期货	85,000	1,664,300.00	0.07
316	300761	立华股份	101,400	1,663,974.00	0.07
317	688484	南芯科技	29,300	1,655,157.00	0.07
318	603612	索通发展	90,400	1,638,952.00	0.07
319	002101	广东鸿图	168,800	1,610,352.00	0.07
320	002006	精工科技	108,700	1,598,977.00	0.07

321	600645	中源协和	93,200	1,594,652.00	0.07
322	600629	华建集团	131,300	1,590,043.00	0.07
323	300872	天阳科技	100,400	1,586,320.00	0.07
324	002326	永太科技	66,400	1,570,360.00	0.07
325	605599	莱百股份	113,300	1,552,210.00	0.07
326	301267	华夏眼科	106,200	1,549,458.00	0.07
327	603619	中曼石油	82,600	1,545,446.00	0.07
328	600064	南京高科	215,200	1,534,376.00	0.07
329	002690	美亚光电	106,830	1,530,873.90	0.07
330	301035	润丰股份	32,950	1,528,880.00	0.07
331	002947	恒铭达	19,900	1,513,395.00	0.07
332	600331	宏达股份	137,100	1,506,729.00	0.07
333	600266	城建发展	385,164	1,505,991.24	0.07
334	300493	润欣科技	100,300	1,495,473.00	0.06
335	002987	京北方	151,660	1,475,651.80	0.06
336	301489	思泉新材	8,920	1,468,053.60	0.06
337	600507	方大特钢	362,200	1,466,910.00	0.06
338	002946	新乳业	104,000	1,464,320.00	0.06
339	688660	电气风电	168,900	1,455,918.00	0.06
340	300075	数字政通	141,020	1,441,224.40	0.06
341	600428	中远海特	184,300	1,439,383.00	0.06
342	605198	安德利	22,700	1,438,272.00	0.06
343	688362	甬矽电子	14,900	1,436,360.00	0.06
344	002096	易普力	163,344	1,434,160.32	0.06
345	301275	汉朔科技	31,700	1,423,330.00	0.06
346	002212	天融信	237,500	1,420,250.00	0.06
347	600075	新疆天业	350,700	1,416,828.00	0.06
348	300969	恒帅股份	15,100	1,415,776.00	0.06
349	603678	火炬电子	16,400	1,361,200.00	0.06
350	002498	汉缆股份	199,500	1,360,590.00	0.06
351	600986	浙文互联	191,900	1,339,462.00	0.06
352	002149	西部材料	24,800	1,339,448.00	0.06
353	002985	北摩高科	48,084	1,331,926.80	0.06
354	300633	开立医疗	72,300	1,329,597.00	0.06
355	603220	中贝通信	61,899	1,322,781.63	0.06
356	002511	中顺洁柔	198,500	1,320,025.00	0.06
357	300725	药石科技	36,000	1,317,600.00	0.06
358	300773	拉卡拉	85,600	1,309,680.00	0.06
359	688449	联芸科技	15,100	1,303,281.00	0.06
360	688068	热景生物	15,000	1,299,000.00	0.06
361	688658	悦康药业	99,700	1,282,142.00	0.06
362	002400	省广集团	201,200	1,269,572.00	0.05
363	002019	亿帆医药	134,200	1,254,770.00	0.05

364	000902	新洋丰	107,585	1,243,682.60	0.05
365	600623	华谊集团	152,400	1,229,868.00	0.05
366	688523	航天环宇	23,300	1,220,920.00	0.05
367	000422	湖北宜化	86,100	1,209,705.00	0.05
368	688726	拉普拉斯	22,700	1,199,695.00	0.05
369	300926	博俊科技	67,000	1,189,250.00	0.05
370	301563	云汉芯城	6,800	1,185,852.00	0.05
371	002960	青鸟智控	139,577	1,182,217.19	0.05
372	000727	冠捷科技	432,000	1,179,360.00	0.05
373	000962	东方钽业	12,800	1,159,680.00	0.05
374	688208	道通科技	45,800	1,153,702.00	0.05
375	688353	华盛锂电	9,900	1,149,093.00	0.05
376	600328	中盐化工	191,495	1,148,970.00	0.05
377	600301	华锡有色	18,700	1,146,684.00	0.05
378	603319	美湖股份	34,300	1,139,103.00	0.05
379	600710	苏美达	117,000	1,118,520.00	0.05
380	603881	数据港	44,740	1,118,500.00	0.05
381	301078	孩子王	165,200	1,116,752.00	0.05
382	605090	九丰能源	29,900	1,111,383.00	0.05
383	002239	奥特佳	449,700	1,110,759.00	0.05
384	301488	豪恩汽电	8,660	1,098,261.20	0.05
385	688147	微导纳米	6,700	1,084,596.00	0.05
386	300353	东土科技	51,908	1,078,648.24	0.05
387	000917	电广传媒	160,200	1,071,738.00	0.05
388	688691	灿芯股份	9,100	1,054,963.00	0.05
389	600094	大名城	301,700	1,043,882.00	0.05
390	002897	意华股份	11,800	1,038,164.00	0.04
391	603025	大豪科技	74,800	1,020,272.00	0.04
392	600552	凯盛科技	31,300	1,019,754.00	0.04
393	603530	神马电力	20,000	1,018,000.00	0.04
394	300348	长亮科技	115,600	1,017,280.00	0.04
395	300253	卫宁健康	150,700	1,014,211.00	0.04
396	300775	三角防务	45,600	1,005,024.00	0.04
397	603323	苏农银行	258,070	998,730.90	0.04
398	603218	日月股份	96,900	990,318.00	0.04
399	000681	视觉中国	49,100	979,054.00	0.04
400	600643	爱建集团	261,100	968,681.00	0.04
401	600531	豫光金铅	64,700	954,972.00	0.04
402	002258	利尔化学	74,326	944,683.46	0.04
403	300492	华图山鼎	27,200	934,320.00	0.04
404	300077	国民技术	29,800	934,230.00	0.04
405	603328	依顿电子	74,300	930,979.00	0.04
406	600226	亨通股份	95,300	913,927.00	0.04

407	002541	鸿路钢构	52,700	912,764.00	0.04
408	002979	雷赛智能	16,200	903,636.00	0.04
409	002859	洁美科技	8,200	897,982.00	0.04
410	300133	华策影视	125,600	889,248.00	0.04
411	301225	恒勃股份	11,000	866,690.00	0.04
412	600391	航发科技	25,700	859,665.00	0.04
413	688789	宏华数科	16,100	856,037.00	0.04
414	000028	国药一致	45,150	853,786.50	0.04
415	603730	岱美股份	74,900	836,633.00	0.04
416	002182	宝武镁业	53,000	825,210.00	0.04
417	301389	隆扬电子	9,500	824,505.00	0.04
418	603297	永新光学	5,600	822,920.00	0.04
419	300678	中科信息	36,100	808,640.00	0.03
420	603826	坤彩科技	31,300	800,028.00	0.03
421	688100	威胜信息	25,800	789,222.00	0.03
422	301556	托普云农	13,400	783,364.00	0.03
423	600452	涪陵电力	82,500	769,725.00	0.03
424	688502	茂莱光学	1,100	762,960.00	0.03
425	603393	新天然气	35,300	755,773.00	0.03
426	300119	瑞普生物	52,246	753,909.78	0.03
427	600550	保变电气	64,000	750,720.00	0.03
428	002965	祥鑫科技	14,690	748,455.50	0.03
429	300360	炬华科技	63,500	746,125.00	0.03
430	603127	昭衍新药	19,300	737,646.00	0.03
431	605196	华通线缆	28,000	730,800.00	0.03
432	601918	新集能源	84,600	726,714.00	0.03
433	002011	盾安环境	68,200	723,602.00	0.03
434	300303	聚飞光电	64,900	717,794.00	0.03
435	300171	东富龙	63,800	705,628.00	0.03
436	002110	三钢闽光	242,400	698,112.00	0.03
437	002245	蔚蓝锂芯	37,200	696,012.00	0.03
438	601519	大智慧	80,000	690,400.00	0.03
439	002941	新疆交建	73,000	689,120.00	0.03
440	300131	英唐智控	35,634	678,115.02	0.03
441	002588	史丹利	85,000	671,500.00	0.03
442	301392	汇成真空	2,300	663,872.00	0.03
443	600006	东风股份	125,600	644,328.00	0.03
444	600216	浙江医药	56,000	638,400.00	0.03
445	300036	超图软件	56,400	635,628.00	0.03
446	300083	创世纪	46,609	634,814.58	0.03
447	603327	福蓉科技	74,600	632,608.00	0.03
448	300296	利亚德	111,605	624,988.00	0.03
449	601908	京运通	198,800	622,244.00	0.03

450	002537	海联金汇	117,400	621,046.00	0.03
451	600258	首旅酒店	56,000	611,520.00	0.03
452	688368	晶丰明源	2,800	606,256.00	0.03
453	688388	嘉元科技	13,775	606,100.00	0.03
454	300446	航天智造	35,900	604,197.00	0.03
455	603267	鸿远电子	7,700	596,596.00	0.03
456	601778	晶科科技	137,600	591,680.00	0.03
457	300503	昊志机电	6,200	572,260.00	0.02
458	300827	上能电气	18,100	557,299.00	0.02
459	600059	古越龙山	74,500	545,340.00	0.02
460	600167	联美控股	94,500	528,255.00	0.02
461	603337	杰克科技	14,500	525,335.00	0.02
462	600129	太极集团	38,600	523,802.00	0.02
463	300806	斯迪克	4,500	504,000.00	0.02
464	600353	旭光电子	10,600	483,360.00	0.02
465	600403	大有能源	89,900	475,571.00	0.02
466	002539	云图控股	41,200	466,384.00	0.02
467	605099	共创草坪	14,000	450,800.00	0.02
468	600619	海立股份	28,200	446,970.00	0.02
469	000930	中粮科技	104,600	444,550.00	0.02
470	002549	凯美特气	21,100	444,155.00	0.02
471	000612	焦作万方	41,800	442,662.00	0.02
472	600997	开滦股份	92,500	439,375.00	0.02
473	002456	欧菲光	46,300	437,998.00	0.02
474	300257	开山股份	14,400	412,992.00	0.02
475	000065	北方国际	41,500	407,945.00	0.02
476	300655	晶瑞电材	19,005	407,087.10	0.02
477	603093	南华期货	22,400	406,560.00	0.02
478	688382	益方生物	22,100	397,800.00	0.02
479	603063	禾望电气	7,400	391,386.00	0.02
480	600509	天富能源	45,400	383,630.00	0.02
481	601702	华峰铝业	27,100	382,110.00	0.02
482	301263	泰恩康	18,400	377,016.00	0.02
483	301327	华宝新能	7,800	374,946.00	0.02
484	688593	新相微	9,500	369,740.00	0.02
485	002081	金螳螂	83,900	363,287.00	0.02
486	002045	国光电器	45,900	360,315.00	0.02
487	605011	杭州热电	23,000	355,580.00	0.02
488	300613	富瀚微	4,300	344,344.00	0.01
489	300638	广和通	18,600	344,286.00	0.01
490	300035	中科电气	21,700	312,914.00	0.01
491	600420	国药现代	39,000	310,050.00	0.01
492	002896	中大力德	3,900	297,882.00	0.01

493	600635	大众公用	65,900	282,052.00	0.01
494	600315	上海家化	16,700	280,894.00	0.01
495	603103	横店影视	19,300	276,183.00	0.01
496	603162	海通发展	30,400	272,688.00	0.01
497	601595	上海电影	16,400	272,240.00	0.01
498	300925	法本信息	18,290	270,509.10	0.01
499	603888	新华网	15,700	267,371.00	0.01
500	688486	龙迅股份	4,200	267,036.00	0.01
501	300113	顺网科技	14,552	264,991.92	0.01
502	600259	中稀有色	2,500	254,025.00	0.01
503	002250	联化科技	17,800	243,326.00	0.01
504	600782	新钢股份	97,400	241,552.00	0.01
505	301662	宏工科技	2,305	233,542.60	0.01
506	002270	华明装备	11,700	220,545.00	0.01
507	688032	禾迈股份	2,317	195,832.84	0.01
508	002807	江阴银行	49,800	184,758.00	0.01
509	000506	招金黄金	15,600	182,832.00	0.01
510	301101	明月镜片	6,600	179,784.00	0.01
511	301658	首航新能	6,600	178,002.00	0.01
512	300409	道氏技术	8,700	173,391.00	0.01
513	300378	鼎捷数智	4,800	173,280.00	0.01
514	002267	陕天然气	25,100	164,154.00	0.01
515	600575	淮河能源	50,000	159,500.00	0.01
516	002895	川恒股份	5,300	154,760.00	0.01
517	001896	豫能控股	8,800	146,168.00	0.01
518	600163	中闽能源	28,100	144,715.00	0.01
519	301291	明阳电气	3,900	140,361.00	0.01
520	301421	波长光电	1,300	134,615.00	0.01
521	002051	中工国际	11,500	130,180.00	0.01
522	688190	云路股份	1,400	126,994.00	0.01
523	000035	中国天楹	24,600	118,818.00	0.01
524	301500	飞南资源	4,300	112,015.00	0.00
525	000600	建投能源	12,700	111,125.00	0.00
526	688552	航天南湖	3,900	109,707.00	0.00
527	000778	新兴铸管	28,300	104,993.00	0.00
528	000801	四川九洲	8,000	103,520.00	0.00
529	301061	匠心家居	2,700	94,689.00	0.00
530	603992	松霖科技	2,800	90,720.00	0.00
531	002246	北化股份	4,800	90,240.00	0.00
532	300641	正丹股份	5,700	87,666.00	0.00
533	000833	粤桂股份	3,700	86,654.00	0.00
534	603871	嘉友国际	7,500	76,575.00	0.00
535	002243	力合科创	11,200	73,584.00	0.00

536	688543	国科军工	1,800	71,010.00	0.00
537	600744	华银电力	10,800	69,444.00	0.00
538	688631	莱斯信息	1,400	65,674.00	0.00
539	002881	美格智能	1,500	54,660.00	0.00
540	601137	博威合金	2,100	46,893.00	0.00
541	603698	航天工程	1,200	46,272.00	0.00
542	688165	埃夫特	1,100	22,440.00	0.00
543	300634	彩讯股份	1,000	19,570.00	0.00
544	601003	柳钢股份	5,600	18,872.00	0.00
545	000762	西藏矿业	700	18,690.00	0.00
546	601606	长城军工	600	16,494.00	0.00
547	300319	麦捷科技	500	14,815.00	0.00
548	001369	双欣材料	897	12,127.44	0.00
549	600667	太极实业	300	8,754.00	0.00
550	301216	万凯新材	200	4,598.00	0.00
551	601333	广深铁路	400	1,100.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688498	源杰科技	4,096	7,725,056.00	0.33
2	600105	永鼎股份	111,300	7,510,524.00	0.32
3	688337	普源精电	93,400	6,998,462.00	0.30
4	300475	香农芯创	22,117	6,635,100.00	0.29
5	601869	长飞光纤	11,700	6,387,030.00	0.28
6	300882	万胜智能	349,400	5,793,052.00	0.25
7	002487	大金重工	94,004	5,449,411.88	0.24
8	002414	高德红外	406,800	5,394,168.00	0.23
9	688795	摩尔线程	7,534	5,107,975.96	0.22
10	300604	长川科技	14,700	5,018,874.00	0.22
11	300079	数码视讯	1,168,600	4,908,120.00	0.21
12	688428	诺诚健华	164,920	4,695,272.40	0.20
13	688378	奥来德	74,400	4,612,800.00	0.20
14	300953	震裕科技	34,343	4,591,659.10	0.20
15	002460	赣锋锂业	69,800	4,564,920.00	0.20
16	688320	禾川科技	106,800	4,426,860.00	0.19
17	300765	石药创新	159,000	4,329,570.00	0.19
18	300223	君正股份	16,000	3,982,400.00	0.17
19	688331	荣昌生物	29,744	3,874,453.44	0.17
20	688220	翱捷科技	31,100	3,866,352.00	0.17
21	603256	宏和科技	14,400	3,820,752.00	0.17
22	002384	东山精密	14,300	3,751,605.00	0.16
23	300620	光库科技	9,900	3,744,180.00	0.16
24	300418	昆仑万维	92,300	3,725,228.00	0.16

25	301165	锐捷网络	45,200	3,636,340.00	0.16
26	001309	德明利	3,800	3,583,020.00	0.15
27	688173	希荻微	183,300	3,508,362.00	0.15
28	300073	当升科技	72,800	3,497,312.00	0.15
29	300042	朗科科技	44,200	3,366,714.00	0.15
30	300842	帝科股份	37,600	3,352,792.00	0.15
31	688802	沐曦股份	3,994	3,070,946.66	0.13
32	300975	商络电子	57,300	2,965,275.00	0.13
33	688313	仕佳光子	16,000	2,954,400.00	0.13
34	002079	苏州固锟	188,300	2,830,149.00	0.12
35	300118	东方日升	226,800	2,823,660.00	0.12
36	002297	博云新材	97,300	2,820,727.00	0.12
37	688521	芯原股份	7,600	2,820,664.00	0.12
38	300769	德方纳米	41,800	2,779,700.00	0.12
39	688538	和辉光电	1,040,100	2,704,260.00	0.12
40	688599	天合光能	190,700	2,692,684.00	0.12
41	688200	华峰测控	5,000	2,625,500.00	0.11
42	600595	中孚实业	464,100	2,608,242.00	0.11
43	688525	佰维存储	5,200	2,572,596.00	0.11
44	688322	奥比中光	19,567	2,554,471.85	0.11
45	603119	浙江荣泰	38,440	2,550,109.60	0.11
46	605358	立昂微	32,800	2,545,280.00	0.11
47	300567	精测电子	8,000	2,540,800.00	0.11
48	300857	协创数据	7,400	2,515,260.00	0.11
49	301366	一博科技	40,900	2,501,853.00	0.11
50	688007	光峰科技	188,000	2,500,400.00	0.11
51	688343	云天励飞	29,900	2,441,634.00	0.11
52	603308	应流股份	39,500	2,385,800.00	0.10
53	002240	盛新锂能	51,800	2,322,194.00	0.10
54	600938	中国海油	84,500	2,294,175.00	0.10
55	688095	福昕软件	36,900	2,192,967.00	0.09
56	002446	盛路通信	196,300	2,108,262.00	0.09
57	002916	深南电路	4,600	2,106,340.00	0.09
58	300394	天孚通信	6,900	2,088,492.00	0.09
59	300395	菲利华	15,600	2,086,188.00	0.09
60	603126	中材节能	329,900	2,078,370.00	0.09
61	600487	亨通光电	18,800	2,055,592.00	0.09
62	688702	盛科通信	5,200	2,027,948.00	0.09
63	300802	矩子科技	87,300	2,023,614.00	0.09
64	688416	恒烁股份	14,360	2,010,400.00	0.09
65	300490	华自科技	151,500	2,004,345.00	0.09
66	688733	壹石通	47,500	1,964,125.00	0.08
67	688347	华虹宏力	5,797	1,949,531.10	0.08

68	003022	联泓新科	74,600	1,932,140.00	0.08
69	000657	中钨高新	20,000	1,914,400.00	0.08
70	000938	紫光股份	64,500	1,861,470.00	0.08
71	688059	华锐精密	9,300	1,857,303.00	0.08
72	601225	陕西煤业	91,000	1,851,850.00	0.08
73	605117	德业股份	17,380	1,845,408.40	0.08
74	688170	德龙激光	19,100	1,833,791.00	0.08
75	002362	汉王科技	115,900	1,802,245.00	0.08
76	603986	兆易创新	2,200	1,793,000.00	0.08
77	300745	欣锐科技	42,300	1,785,906.00	0.08
78	603045	福达合金	25,000	1,784,750.00	0.08
79	688311	盟升电子	68,100	1,783,539.00	0.08
80	600217	中再资环	622,300	1,754,886.00	0.08
81	603799	华友钴业	36,200	1,747,012.00	0.08
82	688072	拓荆科技	1,900	1,671,107.00	0.07
83	002602	世纪华通	118,300	1,668,030.00	0.07
84	002284	亚太股份	175,700	1,667,393.00	0.07
85	300308	中际旭创	1,300	1,651,000.00	0.07
86	301606	绿联科技	27,000	1,647,540.00	0.07
87	300502	新易盛	2,660	1,614,620.00	0.07
88	688260	昀冢科技	11,000	1,595,220.00	0.07
89	688301	奕瑞科技	12,780	1,584,720.00	0.07
90	300751	迈为股份	5,600	1,581,776.00	0.07
91	600469	风神股份	289,500	1,574,880.00	0.07
92	601360	三六零	179,800	1,562,462.00	0.07
93	301308	江波龙	2,200	1,548,360.00	0.07
94	688556	高测股份	116,200	1,543,136.00	0.07
95	688160	步科股份	14,100	1,533,657.00	0.07
96	300014	亿纬锂能	23,400	1,521,702.00	0.07
97	300666	江丰电子	4,100	1,511,260.00	0.07
98	688257	新锐股份	14,640	1,491,816.00	0.06
99	301391	卡莱特	25,600	1,461,760.00	0.06
100	688256	寒武纪	900	1,435,995.00	0.06
101	002975	博杰股份	10,100	1,434,200.00	0.06
102	688019	安集科技	4,160	1,412,153.60	0.06
103	300440	运达科技	65,800	1,403,514.00	0.06
104	601138	工业富联	19,400	1,399,710.00	0.06
105	688002	睿创微纳	9,000	1,392,210.00	0.06
106	688308	欧科亿	7,600	1,381,756.00	0.06
107	605208	永茂泰	85,400	1,362,130.00	0.06
108	002819	东方中科	60,600	1,354,410.00	0.06
109	601117	中国化学	180,000	1,323,000.00	0.06
110	301377	鼎泰高科	2,300	1,267,070.00	0.05

111	001313	粤海饲料	178,400	1,264,856.00	0.05
112	600256	广汇能源	253,900	1,254,266.00	0.05
113	300369	绿盟科技	230,400	1,253,376.00	0.05
114	600549	厦门钨业	14,700	1,252,440.00	0.05
115	688231	隆达股份	33,760	1,240,004.80	0.05
116	002465	海格通信	95,500	1,219,535.00	0.05
117	603626	科森科技	65,900	1,219,150.00	0.05
118	688361	中科飞测	2,800	1,204,000.00	0.05
119	301358	湖南裕能	15,800	1,198,746.00	0.05
120	000593	德龙汇能	55,800	1,193,004.00	0.05
121	688239	航宇科技	19,800	1,184,634.00	0.05
122	300619	金银河	37,570	1,168,802.70	0.05
123	300408	三环集团	6,900	1,151,610.00	0.05
124	603444	吉比特	3,200	1,146,944.00	0.05
125	688037	芯源微	2,600	1,141,530.00	0.05
126	301330	熵基科技	45,500	1,140,230.00	0.05
127	688411	海博思创	3,900	1,135,680.00	0.05
128	688307	中润光学	14,100	1,127,295.00	0.05
129	300720	海川智能	11,700	1,125,540.00	0.05
130	603185	弘元绿能	67,200	1,121,568.00	0.05
131	300955	嘉亨家化	30,700	1,107,963.00	0.05
132	688777	中控技术	9,400	1,104,500.00	0.05
133	002466	天齐锂业	18,000	1,103,760.00	0.05
134	002169	智光电气	75,100	1,099,464.00	0.05
135	688171	纬德信息	24,600	1,081,416.00	0.05
136	600015	华夏银行	167,600	1,070,964.00	0.05
137	002658	雪迪龙	126,400	1,068,080.00	0.05
138	002709	天赐材料	20,500	1,054,315.00	0.05
139	000933	神火股份	49,500	1,049,400.00	0.05
140	600732	爱旭股份	74,900	1,037,365.00	0.04
141	002558	巨人网络	37,600	1,036,256.00	0.04
142	001203	大中矿业	34,400	1,030,280.00	0.04
143	688225	亚信安全	82,800	1,028,376.00	0.04
144	002463	沪电股份	6,600	1,008,480.00	0.04
145	002714	牧原股份	28,500	997,215.00	0.04
146	002812	恩捷股份	14,900	996,959.00	0.04
147	301266	宇邦新材	43,510	993,768.40	0.04
148	002912	中新赛克	53,800	992,072.00	0.04
149	300697	电工合金	64,600	978,690.00	0.04
150	002238	天威视讯	177,700	959,580.00	0.04
151	603956	威派格	152,200	958,860.00	0.04
152	000975	山金国际	56,300	957,100.00	0.04
153	688981	中芯国际	6,000	952,920.00	0.04

154	002837	英维克	11,700	930,852.00	0.04
155	002917	金奥博	88,300	930,682.00	0.04
156	300757	罗博特科	1,500	928,500.00	0.04
157	002080	中材科技	10,300	927,000.00	0.04
158	300274	阳光电源	5,800	922,316.00	0.04
159	300782	卓胜微	8,400	920,472.00	0.04
160	301349	信德新材	12,300	905,280.00	0.04
161	603061	金海通	1,800	903,996.00	0.04
162	605055	迎丰股份	87,900	896,580.00	0.04
163	600795	国电电力	191,900	896,173.00	0.04
164	300483	首华燃气	49,900	877,242.00	0.04
165	002865	钧达股份	14,500	865,360.00	0.04
166	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.04
167	600292	电投水电	69,700	839,188.00	0.04
168	002379	宏桥控股	55,500	819,735.00	0.04
169	688011	新光光电	11,600	810,492.00	0.04
170	300055	万邦达	121,100	778,673.00	0.03
171	000977	浪潮信息	11,100	777,000.00	0.03
172	600800	渤海化学	236,000	762,280.00	0.03
173	688719	爱科赛博	9,600	739,200.00	0.03
174	002092	中泰化学	191,100	731,913.00	0.03
175	601956	东贝集团	155,500	718,410.00	0.03
176	300731	科创新源	12,200	711,992.00	0.03
177	603316	诚邦股份	33,300	685,647.00	0.03
178	000066	中国长城	35,700	680,085.00	0.03
179	603686	福龙马	52,400	677,008.00	0.03
180	601515	衢州东峰	209,500	670,400.00	0.03
181	603848	好太太	48,400	661,144.00	0.03
182	002885	京泉华	16,100	657,846.00	0.03
183	300496	中科创达	10,600	654,974.00	0.03
184	300206	理邦仪器	52,700	644,521.00	0.03
185	600183	生益科技	3,700	641,580.00	0.03
186	300332	天壕能源	148,000	636,400.00	0.03
187	688148	芳源股份	73,100	627,198.00	0.03
188	300548	长芯博创	2,200	611,600.00	0.03
189	002273	水晶光电	17,100	606,708.00	0.03
190	688456	有研粉材	4,200	586,320.00	0.03
191	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.02
192	300390	天华新能	6,000	561,060.00	0.02
193	300661	圣邦股份	3,900	559,572.00	0.02
194	300480	光力科技	13,000	554,840.00	0.02
195	300476	胜宏科技	1,600	554,288.00	0.02
196	601898	中煤能源	44,400	540,792.00	0.02

197	688275	万润新能	4,200	535,710.00	0.02
198	002491	通鼎互联	16,400	531,360.00	0.02
199	688787	海天瑞声	3,900	524,355.00	0.02
200	300756	金马游乐	15,620	516,241.00	0.02
201	301191	菲菱科思	4,440	504,162.00	0.02
202	000589	贵州轮胎	124,100	503,846.00	0.02
203	688601	力芯微	8,100	490,455.00	0.02
204	688052	纳芯微	1,700	490,127.00	0.02
205	001389	广合科技	2,000	474,500.00	0.02
206	688166	博瑞医药	13,409	469,449.09	0.02
207	300570	太辰光	1,900	468,749.00	0.02
208	688185	康希诺	8,987	458,247.13	0.02
209	002475	立讯精密	6,500	457,600.00	0.02
210	600489	中金黄金	24,700	445,835.00	0.02
211	002439	启明星辰	35,000	442,750.00	0.02
212	300691	联合光电	27,300	431,613.00	0.02
213	600989	宝丰能源	21,100	428,963.00	0.02
214	300938	信测标准	8,580	427,970.40	0.02
215	300981	中红医疗	43,400	415,338.00	0.02
216	603659	璞泰来	14,300	413,699.00	0.02
217	002343	慈文传媒	93,800	408,968.00	0.02
218	688472	阿特斯	37,500	405,750.00	0.02
219	002798	帝欧水华	80,500	401,695.00	0.02
220	688081	兴图新科	9,800	400,624.00	0.02
221	601163	三角轮胎	31,400	398,466.00	0.02
222	603703	盛洋科技	35,800	397,380.00	0.02
223	000572	海马汽车	104,000	384,800.00	0.02
224	688628	优利德	3,800	375,972.00	0.02
225	688387	信科移动	18,800	372,992.00	0.02
226	002990	盛视科技	4,600	363,400.00	0.02
227	300364	中文在线	15,200	358,568.00	0.02
228	688255	凯尔达	12,500	347,500.00	0.02
229	002759	ST 天际	14,000	341,460.00	0.01
230	300434	金石亚药	30,300	340,269.00	0.01
231	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.01
232	002281	光迅科技	1,300	334,022.00	0.01
233	603528	多伦科技	56,700	332,262.00	0.01
234	300810	中科海讯	13,000	329,940.00	0.01
235	301136	招标股份	28,300	310,734.00	0.01
236	300397	天和防务	19,000	287,660.00	0.01
237	003015	日久光电	21,900	285,357.00	0.01
238	688291	金橙子	4,800	280,704.00	0.01
239	300151	昌红科技	11,100	276,945.00	0.01

240	688020	方邦股份	1,100	274,560.00	0.01
241	603212	赛伍技术	22,200	271,728.00	0.01
242	000062	深圳华强	8,400	267,288.00	0.01
243	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.01
244	002850	科达利	1,400	265,020.00	0.01
245	603396	金辰股份	10,000	265,000.00	0.01
246	600230	沧州大化	20,100	261,702.00	0.01
247	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.01
248	000510	新金路	10,000	248,400.00	0.01
249	688303	大全能源	13,700	238,791.00	0.01
250	000408	藏格矿业	3,400	235,688.00	0.01
251	003016	欣贺股份	38,400	235,392.00	0.01
252	600026	中远海能	12,700	227,838.00	0.01
253	601699	潞安环能	15,700	224,196.00	0.01
254	002294	信立泰	6,700	213,663.00	0.01
255	605168	三人行	4,200	212,688.00	0.01
256	000905	厦门港务	26,500	205,640.00	0.01
257	601872	招商轮船	11,700	205,569.00	0.01
258	300724	捷佳伟创	2,900	204,740.00	0.01
259	002738	中矿资源	3,300	194,667.00	0.01
260	300365	恒华科技	41,700	190,986.00	0.01
261	002028	思源电气	1,100	190,300.00	0.01
262	300733	西菱动力	15,900	190,005.00	0.01
263	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.01
264	002772	众兴菌业	14,700	166,992.00	0.01
265	002029	七匹狼	21,800	166,552.00	0.01
266	301150	中一科技	2,520	159,037.20	0.01
267	301307	美利信	2,100	158,109.00	0.01
268	300547	川环科技	4,700	156,933.00	0.01
269	300843	胜蓝股份	1,000	156,250.00	0.01
270	300139	晓程科技	3,900	142,545.00	0.01
271	300683	海特生物	5,600	140,056.00	0.01
272	002950	奥美医疗	14,700	130,683.00	0.01
273	600410	华胜天成	8,000	126,640.00	0.01
274	600601	方正科技	8,900	123,176.00	0.01
275	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
276	002382	蓝帆医疗	23,700	120,396.00	0.01
277	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
278	300766	每日互动	5,200	111,280.00	0.00
279	603806	福斯特	6,600	110,814.00	0.00
280	688636	智明达	3,000	108,690.00	0.00
281	300846	首都在线	4,900	103,929.00	0.00
282	002624	完美世界	8,200	101,844.00	0.00

283	002623	亚玛顿	6,300	98,406.00	0.00
284	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
285	603179	新泉股份	1,820	90,363.00	0.00
286	003031	中瓷电子	500	90,150.00	0.00
287	300952	恒辉安防	5,100	88,740.00	0.00
288	301246	宏源药业	3,200	86,080.00	0.00
289	688286	敏芯股份	700	80,549.00	0.00
290	002943	宇晶股份	1,690	74,748.70	0.00
291	300905	宝丽迪	1,400	70,840.00	0.00
292	002546	新联电子	9,000	65,520.00	0.00
293	301256	华融化学	4,800	62,208.00	0.00
294	301085	亚康股份	1,000	60,610.00	0.00
295	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
296	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
297	000967	盈峰环境	5,100	53,703.00	0.00
298	603630	拉芳家化	4,200	53,676.00	0.00
299	603019	中科曙光	500	53,615.00	0.00
300	300316	晶盛机电	800	48,320.00	0.00
301	002353	杰瑞股份	300	45,750.00	0.00
302	001217	华尔泰	5,400	45,522.00	0.00
303	688233	神工股份	200	42,884.00	0.00
304	300531	优博讯	2,800	42,420.00	0.00
305	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
306	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
307	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
308	600829	人民同泰	4,300	33,368.00	0.00
309	000426	兴业银锡	1,000	32,960.00	0.00
310	688375	国博电子	300	31,290.00	0.00
311	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
312	002115	三维通信	2,300	23,690.00	0.00
313	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
314	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
315	002376	新北洋	3,300	18,975.00	0.00
316	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
317	688312	燕麦科技	200	16,798.00	0.00
318	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
319	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
320	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
321	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
322	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
323	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
324	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
325	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00

326	301182	凯旺科技	100	10,327.00	0.00
327	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
328	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
329	002218	拓日新能	2,300	8,832.00	0.00
330	603863	松炆资源	600	7,380.00	0.00
331	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
332	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
333	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
334	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
335	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
336	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
337	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	688313	仕佳光子	24,526,202.43	1.24
2	300475	香农芯创	24,219,053.18	1.23
3	300953	震裕科技	21,043,388.00	1.07
4	688167	炬光科技	20,490,990.59	1.04
5	688048	长光华芯	18,625,170.60	0.94
6	600105	永鼎股份	18,202,238.00	0.92
7	688766	普冉股份	16,474,532.55	0.83
8	688025	杰普特	13,474,509.84	0.68
9	601869	长飞光纤	13,109,389.00	0.66
10	300870	欧陆通	12,553,764.60	0.64
11	688195	腾景科技	12,295,409.59	0.62
12	002222	福晶科技	12,036,989.00	0.61
13	300236	上海新阳	11,688,079.00	0.59
14	688409	富创精密	11,631,291.49	0.59
15	300170	汉得信息	11,482,059.00	0.58
16	002544	普天科技	11,424,503.00	0.58
17	001309	德明利	11,170,623.00	0.57
18	001203	大中矿业	11,022,205.00	0.56
19	688668	鼎通科技	10,989,579.69	0.56
20	301205	联特科技	10,836,815.00	0.55

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	688498	源杰科技	42,574,489.31	2.16
2	300475	香农芯创	27,642,401.00	1.40

3	688313	仕佳光子	27,127,562.63	1.37
4	300548	长芯博创	24,669,879.50	1.25
5	300666	江丰电子	24,098,013.00	1.22
6	300620	光库科技	19,479,409.76	0.99
7	001309	德明利	19,172,553.00	0.97
8	300953	震裕科技	18,562,579.00	0.94
9	300409	道氏技术	17,208,280.07	0.87
10	688260	昀冢科技	17,089,393.65	0.87
11	002487	大金重工	16,374,466.00	0.83
12	600105	永鼎股份	14,668,586.00	0.74
13	300602	飞荣达	14,196,782.90	0.72
14	601869	长飞光纤	14,180,586.28	0.72
15	300323	华灿光电	13,904,549.00	0.70
16	300975	商络电子	13,329,256.00	0.67
17	300775	三角防务	13,211,351.44	0.67
18	300185	通裕重工	12,553,188.15	0.64
19	300296	利亚德	12,393,932.00	0.63
20	300747	锐科激光	12,327,952.00	0.62

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	2,553,322,798.66
卖出股票收入（成交）总额	2,680,314,016.71

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行交易，以

降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地实现投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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	5,355,845.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,355,845.53

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
万家中证 1000 指数 增强 A	85,268	6,382.75	45,103,713.96	8.29	499,141,002.48	91.71
万家中证 1000 指数 增强 C	66,088	11,170.15	258,364,718.50	35.00	479,848,149.25	65.00
合计	150,039	8,547.49	303,468,432.46	23.66	978,989,151.73	76.34

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管 理人所有从业 人员持有本基 金	万家中证 1000 指数增强 A	495,226.26	0.0910
	万家中证 1000 指数增强 C	3,265.68	0.0004
	合计	498,491.94	0.0389

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、 基金投资和研 究部门负责 人持有本开 放式基金	万家中证 1000 指数增强 A	10~50
	万家中证 1000 指数增强 C	0~10
	合计	10~50

本基金基金经理持有 本开放式基金	万家中证 1000 指数增强 A	10~50
	万家中证 1000 指数增强 C	0
	合计	10~50

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金成立后有 9,887,305.69 份为发起式份额，发起份额承诺的有效期限为 2018 年 12 月 3 日（合同生效日）起 3 年。截至本报告期末，最低持有期限届满，发起资金持有份额为 0.00 份。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家中证 1000 指数增强 A	万家中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日 （2018 年 12 月 3 日） 基金份额总额	25,339.33	595,564.60
本报告期期初基金份 额总额	582,641,812.06	726,167,991.36
本报告期基金总申购 份额	219,324,496.88	424,231,056.17
减：本报告期基金总 赎回份额	257,721,592.50	412,186,179.78
本报告期基金拆分变 动份额	—	—
本报告期期末基金份 额总额	544,244,716.44	738,212,867.75

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

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。

基金托管人：

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，基金托管人及其高级管理人员没有受到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 (%)	
浙商证券	3	5,229,857,946.19	100.00	1,024,518.12	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浙商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	关于万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	指定媒介	2026 年 1 月 5 日
2	万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金分红公告	指定媒介	2026 年 1 月 8 日
3	关于万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金恢复大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	指定媒介	2026 年 1 月 13 日
4	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
5	万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	指定媒介	2026 年 1 月 21 日
6	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
7	万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年年度报告	指定媒介	2026 年 3 月 30 日
8	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
9	万家基金管理有限公司关于旗下基金	指定媒介	2026 年 4 月 21 日

	2026 年第 1 季度报告提示性公告		
10	万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	指定媒介	2026 年 4 月 21 日
11	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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 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 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》。
- 4、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 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