

万家创业板指数增强型证券投资基金 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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	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	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	53

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	53
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	53
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	54
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	56
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	57
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	58
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家创业板指数增强型证券投资基金	
基金简称	万家创业板指数增强	
基金主代码	009981	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 1 月 26 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	363,358,425.91 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	万家创业板指数增强 A	万家创业板指数增强 C
下属分级基金的交易代码	009981	009982
报告期末下属分级基金的份额总额	141,208,164.41 份	222,150,261.50 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，力争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，实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	1、大类资产配置策略；2、股票投资策略；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）股指期货投资策略；（2）国债期货投资策略；（3）股票期权投资策略；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	创业板指数收益率*95%+一年期人民币定期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		万家基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	林盛
	联系电话	021-38909626	010-58560666
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		4008880800	95568
传真		021-38909627	010-57093382
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦	北京市西城区复兴门内大街 2 号

	电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	
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	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码	200122	100031
法定代表人	陈广益	高迎欣

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	万家基金管理有限公司	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

§ 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)	
	万家创业板指数增强 A	万家创业板指数增强 C
本期已实现收益	36,911,314.60	57,373,449.63
本期利润	72,321,987.88	105,035,848.26
加权平均基金份额本期利润	0.4293	0.3995
本期加权平均净值利润率	31.39%	29.94%
本期基金份额净值增长率	37.29%	37.02%
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	54,171,562.48	78,867,174.87
期末可供分配基金份额利润	0.3836	0.3550
期末基金资产净值	240,929,146.91	370,910,128.74

期末基金份额净值	1.7062	1.6696
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	70.62%	66.96%

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

万家创业板指数增强 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	38.94%	2.17%	34.38%	2.13%	4.56%	0.04%
过去六个月	37.29%	1.87%	33.71%	1.83%	3.58%	0.04%
过去一年	101.39%	1.82%	95.30%	1.81%	6.09%	0.01%
过去三年	112.13%	1.83%	91.29%	1.91%	20.84%	-0.08%
过去五年	48.51%	1.70%	25.17%	1.75%	23.34%	-0.05%
自基金合同生效起至今	70.62%	1.66%	29.65%	1.76%	40.97%	-0.10%

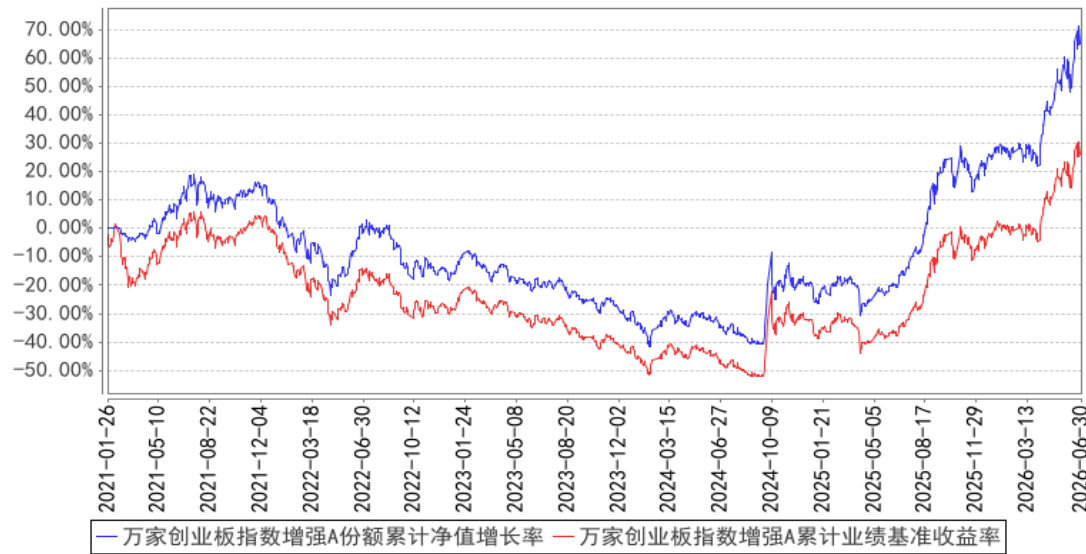
万家创业板指数增强 C

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	38.81%	2.17%	34.38%	2.13%	4.43%	0.04%
过去六个月	37.02%	1.87%	33.71%	1.83%	3.31%	0.04%
过去一年	100.60%	1.82%	95.30%	1.81%	5.30%	0.01%
过去三年	109.59%	1.83%	91.29%	1.91%	18.30%	-0.08%

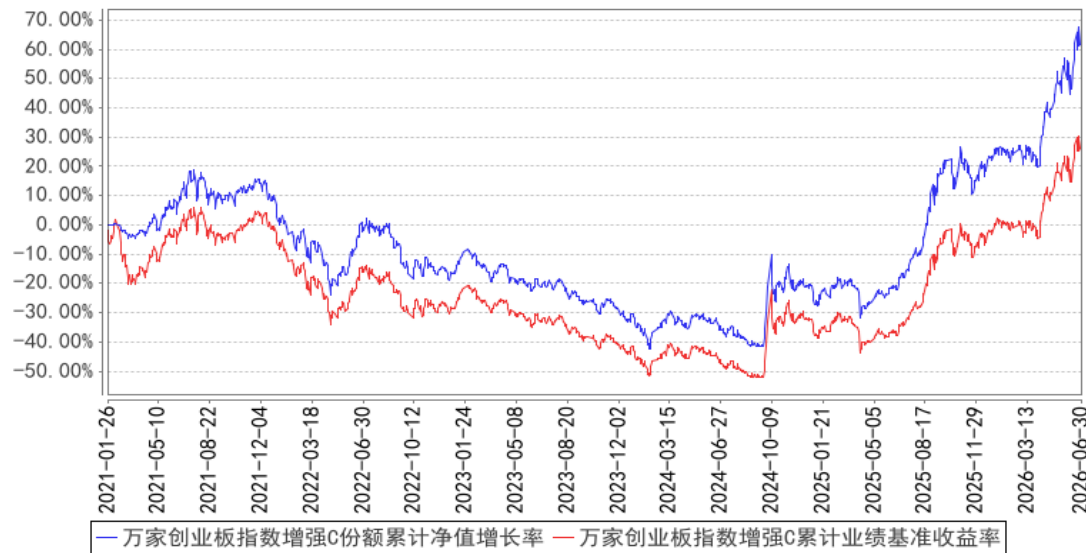
过去五年	45.58%	1.70%	25.17%	1.75%	20.41%	-0.05%
自基金合同 生效起至今	66.96%	1.66%	29.65%	1.76%	37.31%	-0.10%

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

万家创业板指数增强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



万家创业板指数增强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 2021 年 1 月 26 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基金、万家元贞量化选股股票型证券	2021 年 1 月 26 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。

	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。				
张永强	万家中证2000指数增强型证券投资基金、万家元和债券型证券投资基金、万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金、万家创业板指	2023 年 4 月 11 日	-	11 年	国籍：中国；学历：复旦大学基础数学专业硕士，2019 月 7 月入职万家基金管理有限公司，现任量化投资部基金经理，历任量化投资部研究员、投资经理。曾任上海恒生聚源数据服务有限公司研发中心指标算法研究员，上海元普投资管理有限公司量化投资部量化策略研究员，上海寻乾资产管理有限公司量化投资部量化策略研究员，巨杉(上海)资产管理有限公司量化投资部量化策略研究员等职。

	数增强型 证券投资 基金、万 家惠利债 券型证券 投 资 基 金、万家 招瑞回报 一年持有 期混合型 证券投资 基金、万 家民丰回 报一年持 有期混合 型证券投资 基金、 万家瑞丰 灵活配置 混合型证 券投资基 金、万家 瑞盈灵活 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% 以上权重为创业板指数成分股，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创业板指数增强 A 的基金份额净值为 1.7062 元，本报告期基金份额净值增长率为 37.29%，同期业绩比较基准收益率为 33.71%；截至本报告期末万家创业板指数增强 C 的基金份额净值为 1.6696 元，本报告期基金份额净值增长率为 37.02%，同期业绩比较基准收益率为 33.71%。基金报告期内 A 份额、C 份额日均跟踪偏离度分别为 0.2224%、0.2213%，年跟踪误差分别为 4.4629%、4.4640%，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

本基金本报告期内未实施利润分配，符合基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“关联方证券出借”、“各关联方投资本基金的情况”、“关联方承销证券”和“金融工具风险及管理”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：万家创业板指数增强型证券投资基金

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	19,791,612.38	7,790,581.68

结算备付金		24,094,237.43	34,398,240.48
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	574,304,863.89	556,903,428.56
其中：股票投资		574,304,863.89	556,903,428.56
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		4,569,314.10	7,079,774.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		622,760,027.80	606,172,025.27
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		9,979,098.16	12,041,389.44
应付管理人报酬		564,486.88	613,763.23
应付托管费		47,040.60	51,146.93
应付销售服务费		111,994.85	126,863.08
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	218,131.66	182,298.75
负债合计		10,920,752.15	13,015,461.43
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	363,358,425.91	483,038,293.55
其他综合收益	6.4.7.8	-	-

未分配利润	6.4.7.9	248,480,849.74	110,118,270.29
净资产合计		611,839,275.65	593,156,563.84
负债和净资产总计		622,760,027.80	606,172,025.27

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 363,358,425.91 份，其中万家创业板指数增强 A 基金份额净值 1.7062 元，基金份额总额 141,208,164.41 份；万家创业板指数增强 C 基金份额净值 1.6696 元，基金份额总额 222,150,261.50 份。

6.2 利润表

会计主体：万家创业板指数增强型证券投资基金

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		181,869,955.00	23,711,312.83
1. 利息收入		31,193.07	14,758.31
其中：存款利息收入	6.4.7.10	31,193.07	14,758.31
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）		98,126,885.72	14,265,174.77
其中：股票投资收益	6.4.7.11	95,403,906.81	12,067,977.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	2,722,978.91	2,197,197.71
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	83,073,071.91	9,364,651.86
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”	6.4.7.18	638,804.30	66,727.89

号填列)			
减：二、营业总支出		4,512,118.86	2,245,378.34
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,442,173.37	1,689,199.65
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	286,847.78	140,766.62
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	688,112.12	285,829.48
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	94,985.59	129,582.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		177,357,836.14	21,465,934.49
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		177,357,836.14	21,465,934.49
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		177,357,836.14	21,465,934.49

6.3 净资产变动表

会计主体：万家创业板指数增强型证券投资基金

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	483,038,293.55	-	110,118,270.29	593,156,563.84
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	483,038,293.55	-	110,118,270.29	593,156,563.84
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-119,679,867.64	-	138,362,579.45	18,682,711.81
（一）、综合收益总额	-	-	177,357,836.14	177,357,836.14

(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)	-119,679,867.64	-	-38,995,256.69	-158,675,124.33
其中：1. 基金申购款	543,466,345.99	-	183,446,981.23	726,913,327.22
2. 基金赎回款	-663,146,213.63	-	-222,442,237.92	-885,588,451.55
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	363,358,425.91	-	248,480,849.74	611,839,275.65
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	415,640,051.88	-	-93,064,985.11	322,575,066.77
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	415,640,051.88	-	-93,064,985.11	322,575,066.77
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-106,097,227.59	-	43,575,643.42	-62,521,584.17
(一)、综合收益总额	-	-	21,465,934.49	21,465,934.49
(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)	-106,097,227.59	-	22,109,708.93	-83,987,518.66

其中：1. 基金申购款	96,530,880.01	-	-22,554,454.36	73,976,425.65
2. 基金赎回款	-202,628,107.60	-	44,664,163.29	-157,963,944.31
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	309,542,824.29	-	-49,489,341.69	260,053,482.60

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

万家创业板指数增强型证券投资基金（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[2020]1553 号文《关于准予万家创业板指数增强型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 2021 年 1 月 11 日至 2021 年 1 月 22 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[2021]第 ZA30028 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 2021 年 1 月 26 日生效，本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 370,161,982.54 元，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 38,816.95 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 370,200,799.49 元，折合 370,200,799.49 份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为万家基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金的主要投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股、备选成份股、其他股票（包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、

债券（包括国债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、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、货币市场工具、金融衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可参与融资业务和转融通证券出借交易。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：创业板指数收益率*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	19,791,612.38
等于：本金	19,789,547.13
加：应计利息	2,065.25
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	19,791,612.38

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		423,195,292.37	-	574,304,863.89	151,109,571.52
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		423,195,292.37	-	574,304,863.89	151,109,571.52

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	18,527.05
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	199,343.16
其他	261.45
合计	218,131.66

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

万家创业板指数增强 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	187,627,849.26	187,627,849.26
本期申购	151,804,527.68	151,804,527.68
本期赎回（以“-”号填列）	-198,224,212.53	-198,224,212.53
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	141,208,164.41	141,208,164.41

万家创业板指数增强 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	295,410,444.29	295,410,444.29

本期申购	391,661,818.31	391,661,818.31
本期赎回（以“-”号填列）	-464,922,001.10	-464,922,001.10
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	222,150,261.50	222,150,261.50

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

万家创业板指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	30,357,323.42	15,200,505.43	45,557,828.85
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	30,357,323.42	15,200,505.43	45,557,828.85
本期利润	36,911,314.60	35,410,673.28	72,321,987.88
本期基金份额交易产生的变动数	-13,097,075.54	-5,061,758.69	-18,158,834.23
其中：基金申购款	39,608,221.51	15,742,597.49	55,350,819.00
基金赎回款	-52,705,297.05	-20,804,356.18	-73,509,653.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	54,171,562.48	45,549,420.02	99,720,982.50

万家创业板指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	41,462,670.16	23,097,771.28	64,560,441.44
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	41,462,670.16	23,097,771.28	64,560,441.44
本期利润	57,373,449.63	47,662,398.63	105,035,848.26
本期基金份额交易产生的变动数	-19,968,944.92	-867,477.54	-20,836,422.46
其中：基金申购款	84,819,177.21	43,276,985.02	128,096,162.23
基金赎回款	-104,788,122.13	-44,144,462.56	-148,932,584.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	78,867,174.87	69,892,692.37	148,759,867.24

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	23,331.30
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	7,860.36
其他	1.41
合计	31,193.07

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	95,403,906.81
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	95,403,906.81

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	1,450,146,572.16
减：卖出股票成本总额	1,353,396,701.26
减：交易费用	1,345,964.09
买卖股票差价收入	95,403,906.81

6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,722,978.91
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,722,978.91

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	83,073,071.91
股票投资	83,073,071.91
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	83,073,071.91

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	633,994.07
基金转换费收入	4,810.23
合计	638,804.30

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	19,835.79
信息披露费	59,507.37

证券出借违约金	-
银行费用	6,642.43
账户维护费	9,000.00
合计	94,985.59

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
中国民生银行股份有限公司（“民生银行”）	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、基金证券经纪商
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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
中泰证券	445,405,673.39	16.28	288,258,557.90	11.96

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
中泰证券	83,870.46	18.83	-	-
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 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
中泰证券	54,345.92	12.03	-	-

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	3,442,173.37	1,689,199.65
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,564,020.18	678,278.65
应支付基金管理人的净管理费	1,878,153.19	1,010,921.00

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 1.20\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人于次月首日起 3 个工作日内向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于 3 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
----	----------------------------	---------------------------------

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	286,847.78	140,766.62

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。托管费的计算方法如下：

$H=E\times 0.10\%\div \text{当年天数}$

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。由基金管理人于次月首日起 3 个工作日内向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于 3 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	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		
	万家创业板指数增强 A	万家创业板指数增强 C	合计
民生银行	-	19,585.02	19,585.02
万家基金	-	6,670.36	6,670.36
中泰证券	-	9,946.34	9,946.34
合计	-	36,201.72	36,201.72
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		
	万家创业板指数增强 A	万家创业板指数增强 C	合计
民生银行	-	3,488.63	3,488.63
万家财富	-	11.67	11.67
万家基金	-	7,589.99	7,589.99
中泰证券	-	7,998.90	7,998.90
合计	-	19,089.19	19,089.19

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按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40%年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times 0.40\%\div \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人于次月首日起 3 个工作日内向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于 3 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

万家创业板指数增强 A

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（%）
万家财富	590,353.62	0.4181	-	-

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
民生银行	19,791,612.38	23,331.30	2,984,499.46	8,733.52

注：本基金的银行存款由基金托管人中国民生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

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	233	12,409.58	13,686.42	-
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	17,819	180,150.09	180,150.09	-
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	7,636	77,199.96	77,199.96	-

001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
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	562	15,280.78	17,596.22	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	2,972	30,076.64	82,413.56	-
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	2026 年 4 月	6 个月	新股	46.08	463.33	802	36,956.16	371,590.66	-

	微	月 8 日		流通受限						
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	537	37,407.42	85,952.22	-
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	11.18	17.59	615	6,875.70	10,817.85	-

				受限						
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	-
688712	北芯生命	2026年1月28日	6个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688781	视涯科技	2026年3月18日	9个月	新股流通受限	22.68	42.16	5,431	123,175.08	228,970.96	-
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	2,264	258,729.92	1,532,592.16	-
688802	沐曦股份	2025年12月9日	9个月	新股流通受限	104.66	768.89	1,698	177,712.68	1,305,575.22	-
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	-

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	重大事项停牌	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	300	110,912.17	263,859.00	-

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	19,791,612.38	-	-	-	-	-	19,791,612.38
结算备付金	24,094,237.43	-	-	-	-	-	24,094,237.43
交易性金融资产	-	-	-	-	-	574,304,863.89	574,304,863.89
应收申购款	0.53	-	-	-	-	4,569,313.57	4,569,314.10
资产总计	43,885,850.34	-	-	-	-	578,874,177.46	622,760,027.80
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	9,979,098.16	9,979,098.16
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	564,486.88	564,486.88
应付托管费	-	-	-	-	-	47,040.60	47,040.60

应付销售服务费	-	-	-	-	-	-111,994.85	111,994.85
其他负债	-	-	-	-	-	-218,131.66	218,131.66
负债总计	-	-	-	-	-	10,920,752.15	10,920,752.15
利率敏感度缺口	43,885,850.34	-	-	-	-	567,953,425.31	611,839,275.65
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	7,790,581.68	-	-	-	-	-	7,790,581.68
结算备付金	34,398,240.48	-	-	-	-	-	34,398,240.48
交易性金融资产	-	-	-	-	-	556,903,428.56	556,903,428.56
应收申购款	620.01	-	-	-	-	7,079,154.54	7,079,774.55
资产总计	42,189,442.17	-	-	-	-	563,982,583.10	606,172,025.27
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	12,041,389.44	12,041,389.44
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	613,763.23	613,763.23
应付托管费	-	-	-	-	-	51,146.93	51,146.93
应付销售服务费	-	-	-	-	-	126,863.08	126,863.08
其他负债	-	-	-	-	-	182,298.75	182,298.75
负债总计	-	-	-	-	-	13,015,461.43	13,015,461.43
利率敏感度缺口	42,189,442.17	-	-	-	-	550,967,121.67	593,156,563.84

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	574,304,863.89	93.87	556,903,428.56	93.89
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	574,304,863.89	93.87	556,903,428.56	93.89

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	6,632,827.26	6,080,261.81
	股票基准指数下降 100 个基点	-6,632,827.26	-6,080,261.81

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	569,704,182.88	552,925,843.39
第二层次	521,209.05	1,725,939.00
第三层次	4,079,471.96	2,251,646.17
合计	574,304,863.89	556,903,428.56

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	574,304,863.89	92.22
	其中：股票	574,304,863.89	92.22
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	43,885,849.81	7.05
8	其他各项资产	4,569,314.10	0.73
9	合计	622,760,027.80	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	441,796,001.63	72.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	10,649,303.00	1.74
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,828,854.16	2.75
J	金融业	17,133,173.52	2.80
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,868,960.00	0.47
M	科学研究和技术服务业	1,022,241.00	0.17
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	150,332.00	0.02

R	文化、体育和娱乐业	1,535,396.00	0.25
S	综合	-	-
	合计	491,984,261.31	80.41

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	498,512.82	0.08
C	制造业	70,344,188.17	11.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	323,525.05	0.05
E	建筑业	54,404.00	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	184,142.46	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,696,629.88	1.42
J	金融业	456,510.00	0.07
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	1,569,904.20	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	192,786.00	0.03
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	82,320,602.58	13.45

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	300502	新易盛	95,022	57,678,354.00	9.43
2	300308	中际旭创	43,762	55,577,740.00	9.08
3	300750	宁德时代	111,478	43,811,968.78	7.16
4	300476	胜宏科技	59,451	20,595,609.93	3.37
5	300394	天孚通信	62,712	18,981,668.16	3.10
6	300408	三环集团	100,600	16,790,140.00	2.74
7	300059	东方财富	714,504	14,561,591.52	2.38
8	300274	阳光电源	83,840	13,332,236.80	2.18
9	300548	长芯博创	39,900	11,092,200.00	1.81
10	300223	君正股份	43,200	10,752,480.00	1.76
11	300857	协创数据	31,387	10,668,441.30	1.74
12	300604	长川科技	31,200	10,652,304.00	1.74
13	300567	精测电子	31,800	10,099,680.00	1.65
14	300475	香农芯创	30,700	9,210,000.00	1.51
15	300620	光库科技	24,100	9,114,620.00	1.49
16	300666	江丰电子	23,400	8,625,240.00	1.41
17	300124	汇川技术	125,027	8,293,040.91	1.36
18	300395	菲利华	46,620	6,234,492.60	1.02
19	301377	鼎泰高科	11,000	6,059,900.00	0.99
20	300136	信维通信	50,600	6,034,050.00	0.99
21	301308	江波龙	8,200	5,771,160.00	0.94
22	301165	锐捷网络	71,200	5,728,040.00	0.94
23	300757	罗博特科	8,600	5,323,400.00	0.87
24	300628	亿联网络	155,800	5,269,156.00	0.86
25	301200	大族数控	14,500	5,229,425.00	0.85
26	300285	国瓷材料	48,600	5,014,548.00	0.82
27	300442	润泽科技	58,200	4,834,674.00	0.79
28	301217	铜冠铜箔	28,600	4,721,002.00	0.77
29	300627	华测导航	165,580	4,702,472.00	0.77
30	300373	扬杰科技	28,900	4,543,947.00	0.74
31	302132	中航成飞	66,500	3,878,280.00	0.63
32	300661	圣邦股份	26,500	3,802,220.00	0.62
33	300014	亿纬锂能	57,811	3,759,449.33	0.61
34	300390	天华新能	38,700	3,618,837.00	0.59
35	301526	国际复材	73,500	3,430,245.00	0.56
36	300017	网宿科技	262,700	3,417,727.00	0.56
37	300054	鼎龙股份	31,300	3,316,861.00	0.54
38	300346	南大光电	35,600	3,298,340.00	0.54
39	300433	蓝思科技	59,000	3,165,940.00	0.52
40	300751	迈为股份	10,800	3,050,568.00	0.50
41	300760	迈瑞医疗	22,341	3,034,578.03	0.50
42	300953	震裕科技	22,500	3,008,250.00	0.49
43	300058	蓝色光标	208,500	2,868,960.00	0.47

44	301269	华大九天	23,148	2,764,334.16	0.45
45	300672	国科微	9,100	2,684,500.00	0.44
46	300474	景嘉微	42,400	2,564,352.00	0.42
47	300748	金力永磁	73,400	2,264,390.00	0.37
48	300724	捷佳伟创	29,200	2,061,520.00	0.34
49	300033	同花顺	8,160	1,966,560.00	0.32
50	300383	光环新网	155,100	1,929,444.00	0.32
51	300450	先导智能	45,800	1,864,976.00	0.30
52	301358	湖南裕能	24,100	1,828,467.00	0.30
53	300418	昆仑万维	41,000	1,654,760.00	0.27
54	300001	特锐德	43,153	1,632,477.99	0.27
55	300316	晶盛机电	27,000	1,630,800.00	0.27
56	300432	富临精工	75,000	1,506,750.00	0.25
57	300866	安克创新	14,300	1,494,350.00	0.24
58	300763	锦浪科技	16,300	1,472,705.00	0.24
59	300251	光线传媒	131,900	1,462,771.00	0.24
60	301611	珂玛科技	8,000	1,440,560.00	0.24
61	300972	万辰集团	8,300	1,439,303.00	0.24
62	300782	卓胜微	13,000	1,424,540.00	0.23
63	300037	新宙邦	15,000	1,392,750.00	0.23
64	300458	全志科技	31,700	1,250,882.00	0.20
65	301550	斯菱智驱	13,200	1,206,876.00	0.20
66	300919	中伟新材	23,800	1,041,250.00	0.17
67	300699	光威复材	34,580	990,717.00	0.16
68	300115	长盈精密	34,600	966,724.00	0.16
69	300454	深信服	10,000	962,000.00	0.16
70	300253	卫宁健康	133,900	901,147.00	0.15
71	300012	华测检测	58,100	805,266.00	0.13
72	300487	蓝晓科技	12,300	723,855.00	0.12
73	300803	指南针	6,600	605,022.00	0.10
74	300765	石药创新	21,700	590,891.00	0.10
75	301536	星辰科技	4,500	579,195.00	0.09
76	300073	当升科技	11,470	551,018.80	0.09
77	300496	中科创达	5,600	346,024.00	0.06
78	300832	新产业	5,600	235,200.00	0.04
79	300759	康龙化成	7,500	216,975.00	0.04
80	300718	长盛轴承	3,500	213,395.00	0.03
81	300015	爱尔眼科	18,200	150,332.00	0.02
82	300979	华利集团	4,100	121,975.00	0.02
83	300144	宋城演艺	12,500	72,625.00	0.01
84	300002	神州泰岳	2,400	18,744.00	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	600406	国电南瑞	158,800	3,628,580.00	0.59
2	605117	德业股份	20,860	2,214,914.80	0.36
3	002028	思源电气	12,500	2,162,500.00	0.35
4	600885	宏发股份	57,900	1,996,971.00	0.33
5	002414	高德红外	121,302	1,608,464.52	0.26
6	688795	摩尔线程	2,264	1,532,592.16	0.25
7	688019	安集科技	4,450	1,510,597.00	0.25
8	300236	上海新阳	11,200	1,472,800.00	0.24
9	002179	中航光电	31,500	1,455,300.00	0.24
10	601138	工业富联	20,000	1,443,000.00	0.24
11	688188	柏楚电子	13,220	1,410,574.00	0.23
12	000977	浪潮信息	19,700	1,379,000.00	0.23
13	603025	大豪科技	96,100	1,310,804.00	0.21
14	688802	沐曦股份	1,698	1,305,575.22	0.21
15	603019	中科曙光	12,100	1,297,483.00	0.21
16	603268	松发股份	7,800	1,086,384.00	0.18
17	000988	华工科技	5,700	1,052,277.00	0.17
18	603195	公牛集团	26,400	1,033,560.00	0.17
19	000938	紫光股份	31,900	920,634.00	0.15
20	688349	三一重能	60,590	919,756.20	0.15
21	688235	百济神州	3,609	918,887.49	0.15
22	002281	光迅科技	3,502	899,803.88	0.15
23	002518	科士达	16,523	885,467.57	0.14
24	688411	海博思创	3,000	873,600.00	0.14
25	603259	药明康德	7,000	871,570.00	0.14
26	688578	艾力斯	7,900	862,680.00	0.14
27	600875	东方电气	29,600	851,592.00	0.14
28	601100	恒立液压	7,600	817,456.00	0.13
29	603806	福斯特	48,300	810,957.00	0.13
30	688627	精智达	1,100	786,500.00	0.13
31	300811	铂科新材	8,080	766,711.20	0.13
32	601012	隆基绿能	58,200	763,584.00	0.12
33	301589	诺瓦星云	5,100	759,798.00	0.12
34	002487	大金重工	13,000	753,610.00	0.12
35	688025	杰普特	1,600	752,000.00	0.12
36	600487	亨通光电	6,800	743,512.00	0.12
37	603606	东方电缆	17,820	739,708.20	0.12
38	601869	长飞光纤	1,300	709,670.00	0.12
39	002851	麦格米特	4,200	702,156.00	0.11
40	600150	中国船舶	20,600	696,074.00	0.11
41	688503	聚和材料	5,100	676,770.00	0.11
42	600522	中天科技	10,900	661,412.00	0.11

43	601126	四方股份	10,400	657,280.00	0.11
44	601728	中国电信	123,000	638,370.00	0.10
45	688676	金盘科技	7,500	634,800.00	0.10
46	600482	中国动力	19,300	633,040.00	0.10
47	600312	平高电气	35,200	621,632.00	0.10
48	688506	百利天恒	2,100	617,463.00	0.10
49	603530	神马电力	11,800	600,620.00	0.10
50	688390	固德威	5,500	596,805.00	0.10
51	600941	中国移动	6,700	577,071.00	0.09
52	688531	日联科技	3,200	569,088.00	0.09
53	688313	仕佳光子	3,000	553,950.00	0.09
54	688777	中控技术	4,700	552,250.00	0.09
55	000333	美的集团	7,100	536,263.00	0.09
56	002371	北方华创	600	530,736.00	0.09
57	601179	中国西电	33,300	496,836.00	0.08
58	600276	恒瑞医药	9,300	483,972.00	0.08
59	688796	百奥赛图	4,423	483,876.20	0.08
60	603256	宏和科技	1,800	477,594.00	0.08
61	002001	新 和 成	16,700	474,614.00	0.08
62	603659	璞泰来	16,100	465,773.00	0.08
63	603288	海天味业	13,900	460,924.00	0.08
64	002653	海思科	6,600	437,844.00	0.07
65	000338	潍柴动力	15,800	430,550.00	0.07
66	688018	乐鑫科技	3,300	422,136.00	0.07
67	600577	精达股份	42,900	419,562.00	0.07
68	001270	铖昌科技	2,600	405,574.00	0.07
69	688027	国盾量子	800	403,208.00	0.07
70	688599	天合光能	28,400	401,008.00	0.07
71	002056	横店东磁	13,100	399,288.00	0.07
72	300438	鹏辉能源	4,800	397,680.00	0.06
73	600601	方正科技	27,800	384,752.00	0.06
74	600105	永鼎股份	5,600	377,888.00	0.06
75	301666	大普微	802	371,590.66	0.06
76	688719	爱科赛博	4,700	361,900.00	0.06
77	600519	贵州茅台	300	355,647.00	0.06
78	600089	特变电工	15,700	353,250.00	0.06
79	600989	宝丰能源	17,000	345,610.00	0.06
80	688266	泽璟制药	2,900	338,314.00	0.06
81	688472	阿特斯	30,700	332,174.00	0.05
82	600517	国网英大	70,900	331,812.00	0.05
83	688375	国博电子	3,174	331,048.20	0.05
84	002230	科大讯飞	7,800	318,552.00	0.05
85	688223	晶科能源	66,700	316,825.00	0.05

86	601877	正泰电器	11,200	280,784.00	0.05
87	002074	国轩高科	10,100	277,851.00	0.05
88	688072	拓荆科技	300	263,859.00	0.04
89	001248	华润新能源	25,455	257,350.05	0.04
90	688498	源杰科技	133	250,838.00	0.04
91	000682	东方电子	19,600	247,548.00	0.04
92	002602	世纪华通	17,100	241,110.00	0.04
93	002008	大族激光	1,600	240,176.00	0.04
94	688387	信科移动	11,700	232,128.00	0.04
95	688781	视涯科技	5,431	228,970.96	0.04
96	002916	深南电路	500	228,950.00	0.04
97	002460	赣锋锂业	3,400	222,360.00	0.04
98	000811	冰轮环境	3,900	219,258.00	0.04
99	688008	澜起科技	700	216,930.00	0.04
100	688248	南网科技	3,100	214,458.00	0.04
101	688111	金山办公	1,000	213,050.00	0.03
102	688012	中微公司	447	209,419.50	0.03
103	688120	华海清科	640	206,195.20	0.03
104	002415	海康威视	5,900	201,780.00	0.03
105	002266	浙富控股	38,100	192,786.00	0.03
106	001389	广合科技	800	189,800.00	0.03
107	001309	德明利	200	188,580.00	0.03
108	600580	卧龙电驱	5,600	185,360.00	0.03
109	688041	海光信息	500	185,150.00	0.03
110	601816	京沪高铁	40,300	182,559.00	0.03
111	603083	剑桥科技	700	178,409.00	0.03
112	002379	宏桥控股	11,900	175,763.00	0.03
113	603618	杭电股份	3,500	174,580.00	0.03
114	000657	中钨高新	1,700	162,724.00	0.03
115	601225	陕西煤业	7,900	160,765.00	0.03
116	001280	中国铀业	2,400	160,080.00	0.03
117	600183	生益科技	900	156,060.00	0.03
118	300693	盛弘股份	3,200	156,000.00	0.03
119	688191	智洋创新	4,280	152,796.00	0.02
120	002850	科达利	800	151,440.00	0.02
121	002202	金风科技	6,300	150,570.00	0.02
122	300776	帝尔激光	700	150,472.00	0.02
123	688300	联瑞新材	600	146,640.00	0.02
124	002491	通鼎互联	4,400	142,560.00	0.02
125	000408	藏格矿业	2,000	138,640.00	0.02
126	600176	中国巨石	1,900	138,472.00	0.02
127	688611	杭州柯林	1,800	128,610.00	0.02
128	002837	英维克	1,600	127,296.00	0.02

129	002142	宁波银行	4,200	124,698.00	0.02
130	688002	睿创微纳	800	123,752.00	0.02
131	002463	沪电股份	800	122,240.00	0.02
132	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.02
133	002594	比亚迪	1,500	119,550.00	0.02
134	688127	蓝特光学	1,200	117,120.00	0.02
135	002335	科华数据	2,700	114,615.00	0.02
136	000922	佳电股份	8,100	113,076.00	0.02
137	002475	立讯精密	1,600	112,640.00	0.02
138	002938	鹏鼎控股	1,000	105,380.00	0.02
139	002384	东山精密	400	104,940.00	0.02
140	603728	鸣志电器	1,700	103,564.00	0.02
141	002885	京泉华	2,500	102,150.00	0.02
142	603799	华友钴业	2,100	101,346.00	0.02
143	688783	西安奕材	1,600	99,072.00	0.02
144	688525	佰维存储	200	98,946.00	0.02
145	300570	太辰光	400	98,684.00	0.02
146	603119	浙江荣泰	1,470	97,519.80	0.02
147	603063	禾望电气	1,800	95,202.00	0.02
148	301128	强瑞技术	600	93,540.00	0.02
149	600268	国电南自	7,900	91,798.00	0.02
150	002249	大洋电机	12,200	91,500.00	0.01
151	002080	中材科技	1,000	90,000.00	0.01
152	000400	许继电气	4,100	88,970.00	0.01
153	002340	格林美	13,300	87,913.00	0.01
154	688082	盛美上海	200	86,400.00	0.01
155	688361	中科飞测	200	86,000.00	0.01
156	301682	宏明电子	537	85,952.22	0.01
157	601096	宏盛华源	19,700	85,498.00	0.01
158	002975	博杰股份	600	85,200.00	0.01
159	002595	豪迈科技	1,825	85,045.00	0.01
160	601689	拓普集团	1,500	84,630.00	0.01
161	001399	惠科股份	2,972	82,413.56	0.01
162	688103	国力电子	1,100	81,851.00	0.01
163	301638	南网数字	3,400	81,770.00	0.01
164	603986	兆易创新	100	81,500.00	0.01
165	300820	英杰电气	900	81,207.00	0.01
166	688702	盛科通信	200	77,998.00	0.01
167	002353	杰瑞股份	500	76,250.00	0.01
168	603699	纽威股份	1,500	75,450.00	0.01
169	002270	华明装备	3,800	71,630.00	0.01
170	002865	钧达股份	1,200	71,616.00	0.01
171	002346	柘中股份	3,300	70,587.00	0.01

172	603556	海兴电力	3,200	70,400.00	0.01
173	600900	长江电力	2,500	66,175.00	0.01
174	600660	福耀玻璃	1,300	65,572.00	0.01
175	002245	蔚蓝锂芯	3,500	65,485.00	0.01
176	605196	华通线缆	2,500	65,250.00	0.01
177	688257	新锐股份	620	63,178.00	0.01
178	300660	江苏雷利	2,000	55,720.00	0.01
179	002169	智光电气	3,800	55,632.00	0.01
180	603993	洛阳钼业	3,100	54,405.00	0.01
181	603929	亚翔集成	200	54,404.00	0.01
182	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01
183	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
184	688612	威迈斯	1,800	53,262.00	0.01
185	688102	斯瑞新材	1,100	51,898.00	0.01
186	002498	汉缆股份	7,200	49,104.00	0.01
187	688692	达梦数据	200	48,858.00	0.01
188	601899	紫金矿业	1,800	45,252.00	0.01
189	688337	普源精电	600	44,958.00	0.01
190	603045	福达合金	600	42,834.00	0.01
191	688261	东微半导	400	41,972.00	0.01
192	688271	联影医疗	400	40,492.00	0.01
193	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
194	001267	汇绿生态	700	37,450.00	0.01
195	301179	泽宇智能	1,800	36,828.00	0.01
196	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.01
197	003031	中瓷电子	200	36,060.00	0.01
198	002050	三花智控	800	35,064.00	0.01
199	301291	明阳电气	800	28,792.00	0.00
200	300283	温州宏丰	1,400	28,770.00	0.00
201	600732	爱旭股份	2,000	27,700.00	0.00
202	300018	中元股份	2,200	27,170.00	0.00
203	300827	上能电气	800	24,632.00	0.00
204	600489	中金黄金	1,300	23,465.00	0.00
205	600550	保变电气	1,900	22,287.00	0.00
206	600498	烽火通信	300	22,080.00	0.00
207	601208	东材科技	300	21,237.00	0.00
208	688698	伟创电气	400	20,980.00	0.00
209	688469	芯联集成	1,800	19,098.00	0.00
210	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
211	600301	华锡有色	300	18,396.00	0.00
212	601698	中国卫通	600	18,150.00	0.00
213	001365	天海电子	562	17,596.22	0.00
214	688226	威腾电气	400	17,132.00	0.00

215	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
216	002465	海格通信	1,200	15,324.00	0.00
217	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
218	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
219	688112	鼎阳科技	200	14,692.00	0.00
220	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
221	688551	科威尔	200	14,054.00	0.00
222	001237	惠康科技	233	13,686.42	0.00
223	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
224	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
225	688279	峰昭科技	52	11,670.88	0.00
226	301018	申菱环境	100	11,561.00	0.00
227	002558	巨人网络	400	11,024.00	0.00
228	603100	川仪股份	600	10,830.00	0.00
229	601112	振石股份	615	10,817.85	0.00
230	002484	江海股份	100	10,500.00	0.00
231	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
232	002730	电光科技	300	8,973.00	0.00
233	688568	中科星图	200	8,294.00	0.00
234	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
235	002534	西子洁能	300	5,565.00	0.00
236	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
237	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
238	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
239	688123	聚辰股份	7	1,488.20	0.00
240	688049	炬芯科技	14	656.74	0.00
241	688281	华秦科技	13	652.99	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	300308	中际旭创	23,020,031.00	3.88
2	300124	汇川技术	22,777,708.00	3.84
3	300502	新易盛	21,844,177.00	3.68
4	300408	三环集团	21,299,318.04	3.59
5	300223	君正股份	20,799,110.00	3.51
6	300059	东方财富	18,629,764.00	3.14
7	300857	协创数据	18,103,559.80	3.05
8	300476	胜宏科技	18,064,881.76	3.05
9	300373	扬杰科技	17,308,113.00	2.92
10	300274	阳光电源	16,408,677.60	2.77
11	300394	天孚通信	16,021,190.80	2.70
12	300628	亿联网络	15,020,893.80	2.53

13	300033	同花顺	14,993,068.00	2.53
14	300548	长芯博创	14,848,645.00	2.50
15	300395	菲利华	14,341,326.00	2.42
16	300487	蓝晓科技	14,263,457.00	2.40
17	300347	泰格医药	14,022,072.00	2.36
18	300661	圣邦股份	13,109,808.00	2.21
19	301308	江波龙	13,100,581.00	2.21
20	300750	宁德时代	12,460,765.00	2.10
21	300474	景嘉微	12,301,967.00	2.07
22	300450	先导智能	12,113,255.63	2.04

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	300308	中际旭创	53,403,718.38	9.00
2	300502	新易盛	42,851,184.00	7.22
3	300059	东方财富	34,633,877.18	5.84
4	300274	阳光电源	32,295,571.00	5.44
5	300750	宁德时代	30,941,272.22	5.22
6	300124	汇川技术	27,809,241.00	4.69
7	300408	三环集团	26,978,137.00	4.55
8	300033	同花顺	23,871,167.35	4.02
9	300857	协创数据	22,430,496.80	3.78
10	300014	亿纬锂能	19,792,291.85	3.34
11	300373	扬杰科技	19,733,727.00	3.33
12	300476	胜宏科技	18,211,153.00	3.07
13	300394	天孚通信	17,910,791.20	3.02
14	300450	先导智能	16,427,182.82	2.77
15	300223	君正股份	16,363,385.00	2.76
16	300628	亿联网络	15,198,063.40	2.56
17	300548	长芯博创	14,595,603.00	2.46
18	300207	欣旺达	14,514,902.00	2.45
19	300487	蓝晓科技	14,303,496.00	2.41
20	301308	江波龙	14,048,982.63	2.37
21	300058	蓝色光标	13,992,268.70	2.36
22	300418	昆仑万维	13,853,067.00	2.34
23	300347	泰格医药	13,629,244.00	2.30
24	300395	菲利华	13,014,872.00	2.19
25	300498	温氏股份	12,816,025.00	2.16
26	300433	蓝思科技	12,717,300.00	2.14
27	300003	乐普医疗	12,623,109.00	2.13
28	300604	长川科技	12,513,376.00	2.11
29	300763	锦浪科技	12,332,227.00	2.08

30	301358	湖南裕能	12,179,803.00	2.05
31	301236	软通动力	12,072,819.00	2.04
32	300661	圣邦股份	11,863,873.10	2.00

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,287,725,064.68
卖出股票收入（成交）总额	1,450,146,572.16

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	4,569,314.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,569,314.10

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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
万家创业 板指数增 强 A	14,771	9,559.82	923,741.99	0.65	140,284,422.42	99.35
万家创业 板指数增 强 C	15,843	14,021.98	11,871,573.90	5.34	210,278,687.60	94.66
合计	30,102	12,070.91	12,795,315.89	3.52	350,563,110.02	96.48

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	万家创业板指数增强 A	181,855.46	0.1288
	万家创业板指数增强 C	33.24	0.0000
	合计	181,888.70	0.0501

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	万家创业板指数增强 A	0
	万家创业板指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	万家创业板指数增强 A	0~10
	万家创业板指数增强 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家创业板指数增强 A	万家创业板指数增强 C
基金合同生效日 (2021 年 1 月 26 日)	276,712,763.29	93,488,036.20

基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	187,627,849.26	295,410,444.29
本报告期基金总申购份额	151,804,527.68	391,661,818.31
减：本报告期基金总赎回份额	198,224,212.53	464,922,001.10
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	141,208,164.41	222,150,261.50

§ 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：
报告期内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

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产的诉讼，未发生涉及公募基金托管业务的诉讼事项。

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，未收到关于证券投资基金托管业务受调查或处罚的情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未收到证券投资基金托管业务相关从业人员受调查或处罚的情况。

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 (%)	
招商证券	3	1,389,392,370.28	50.78	191,978.84	43.10	-
申万宏源证券	3	901,184,240.33	32.94	169,614.45	38.08	-
中泰证券	3	445,405,673.39	16.28	83,870.46	18.83	-

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准

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

选择证券公司参与证券交易的标准如下：

- (1) 财务状况稳健：证券公司应具备良好的财务状况，经营行为符合相关法律法规及行业规范；
- (2) 内控与风控能力强：证券公司合规管理和风险控制能力较强；
- (3) 技术支持完善：具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需求；
- (4) 专业能力与服务水平：具有较强的研究能力及金融服务水平，或在交易服务、券商结算等业务方面具备较强能力。

2、选择证券公司参与证券交易的程序

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

的备选库。

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

3、本基金使用券商结算模式，本报告期内管理人选择中泰证券、申万宏源证券和招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	关于万家创业板指数增强型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 7 日
2	万家基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	指定媒介	2026 年 1 月 21 日
3	万家创业板指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	指定媒介	2026 年 1 月 21 日
4	万家基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	指定媒介	2026 年 3 月 30 日
5	万家创业板指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	指定媒介	2026 年 3 月 30 日
6	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
7	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
8	万家创业板指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	指定媒介	2026 年 4 月 21 日
9	万家基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	指定媒介	2026 年 5 月 27 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20260105-20260122	-	123, 102, 174. 81	123, 102, 174. 81	-	-
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。

§ 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、《万家创业板指数增强型证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家创业板指数增强型证券投资基金托管协议》。
- 4、万家创业板指数增强型证券投资基金 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