

万家国证 2000 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 27 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。

本报告财务资料已经审计，立信会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	52

8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
8.3 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	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	69
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	70
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	70
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	70
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	70
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	70
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
8.12 投资组合报告附注	71
§ 9 基金份额持有人信息	72
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	72
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	72
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	72
§ 10 开放式基金份额变动	73
§ 11 重大事件揭示	73
11.1 基金份额持有人大会决议	73
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	73
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	73
11.4 基金投资策略的改变	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	74
11.8 其他重大事件	75
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	76
12.1 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	76
§ 13 备查文件目录	76
13.1 备查文件目录	76
13.2 存放地点	76
13.3 查阅方式	76

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家国证 2000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	万家国证 2000 指数增强	
基金主代码	018653	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 9 月 26 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	266,150,923.76 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	万家国证 2000 指数增强 A	万家国证 2000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	018653	018654
报告期末下属分级基金的份额总额	160,227,679.77 份	105,923,243.99 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	本基金采用指数增强投资策略，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，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%，年化跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。具体策略包括：1、大类资产配置策略；2、股票投资策略：（1）指数化投资策略；（2）指数增强策略；（3）港股通标的股票投资策略；（4）存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、可转换债券与可交换债券投资策略；6、证券公司短期公司债券投资策略；7、金融衍生品投资策略：（1）股指期货交易策略；（2）国债期货交易策略；（3）股票期权投资策略；8、信用衍生品投资策略；9、融资及转融通证券出借业务投资策略。
业绩比较基准	国证 2000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为指数增强型股票基金，其预期风险收益水平理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 本基金可投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	万家基金管理有限公司		中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	兰剑	郭明
	联系电话	021-38909626	010-66105799
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	4008880800		95588
传真	021-38909627		010-66105798
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区浦 电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）		北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	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 55 号
邮政编码	200122		100140
法定代表人	方一天		廖林

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网 址	http://www.wjasset.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	立信会计师事务所（特殊普通 合伙）	上海市南京东路 61 号 4 楼新黄浦金融大厦
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2025 年		2024 年		2023 年 9 月 26 日（基金合同 生效日） - 2023 年 12 月 31 日	
	万家国证 2000 指数增 强 A	万家国证 2000 指数增 强 C	万家国证 2000 指数增 强 A	万家国证 2000 指数增 强 C	万家国证 2000 指数增 强 A	万家国证 2000 指数增 强 C
本期 已实 现收 益	74,897,187. 28	42,314,869. 11	-16,078,004 .44	-14,390,905 .53	-1,826,833. 51	-1,944,986. 08
本期 利润	83,142,427. 24	47,695,038. 21	-18,595,443 .60	-16,862,444 .90	-6,021,957. 72	-5,369,434. 81
加权 平均	0.4401	0.4203	-0.0434	-0.0513	-0.0097	-0.0109

基金份额 本期 利润						
本期 加权 平均 净值 利润 率	35.92%	35.56%	-4.96%	-5.88%	-0.97%	-1.09%
本期 基金 份额 净值 增长 率	42.97%	42.41%	0.53%	0.13%	-0.82%	-0.93%
3.1. 2 期 末数 据和 指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
期末 可供 分配 利润	68,195,611. 50	43,719,572. 21	-648,913.45	-1,333,502. 50	-4,821,193. 41	-4,264,126. 60
期末 可供 分配 基金 份额 利润	0.4256	0.4127	-0.0029	-0.0080	-0.0082	-0.0093
期末 基金 资产 净值	228,423,291 .27	149,642,816 .20	220,832,455 .58	166,207,438 .26	582,586,457 .90	456,721,389 .37
期末 基金 份额 净值	1.4256	1.4127	0.9971	0.9920	0.9918	0.9907
3.1. 3 累 计期 末指 标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
基金	42.56%	41.27%	-0.29%	-0.80%	-0.82%	-0.93%

份额 累计 净值 增长 率						
---------------------------	--	--	--	--	--	--

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

万家国证 2000 指数增强 A

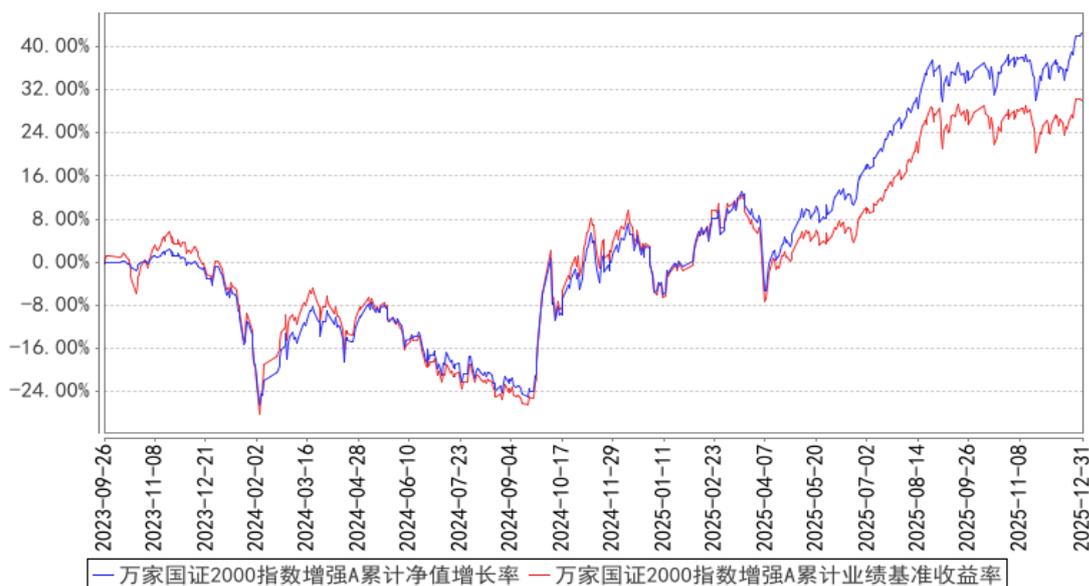
阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.15%	1.06%	1.76%	1.11%	3.39%	-0.05%
过去六个月	21.37%	1.01%	18.39%	1.09%	2.98%	-0.08%
过去一年	42.97%	1.38%	30.53%	1.42%	12.44%	-0.04%
自基金合同生效 起至今	42.56%	1.62%	30.16%	1.73%	12.40%	-0.11%

万家国证 2000 指数增强 C

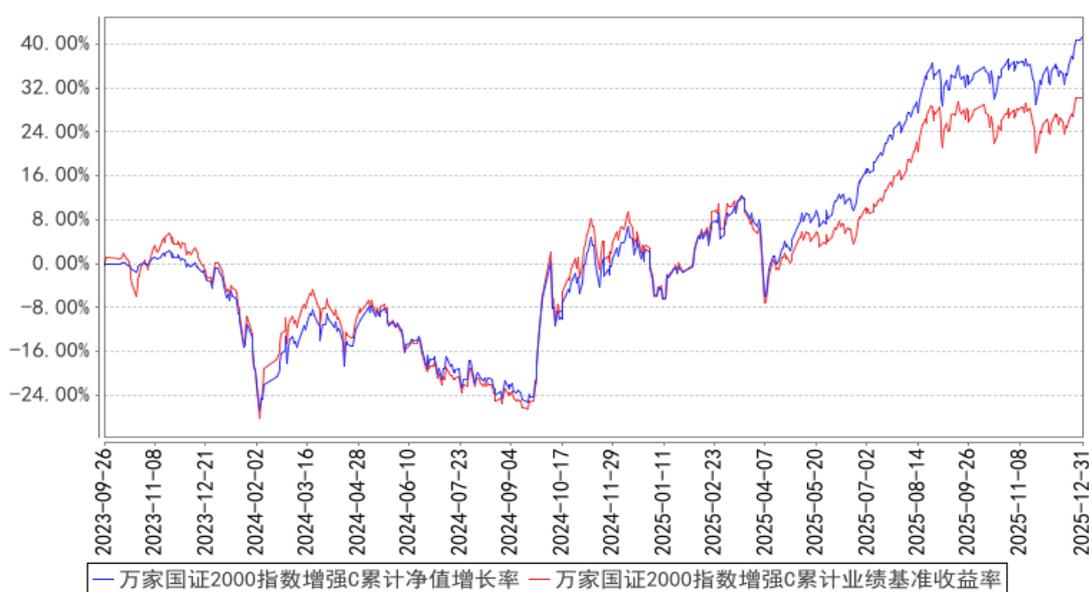
阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.04%	1.06%	1.76%	1.11%	3.28%	-0.05%
过去六个月	21.13%	1.01%	18.39%	1.09%	2.74%	-0.08%
过去一年	42.41%	1.38%	30.53%	1.42%	11.88%	-0.04%
自基金合同生效 起至今	41.27%	1.62%	30.16%	1.73%	11.11%	-0.11%

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

万家国证2000指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



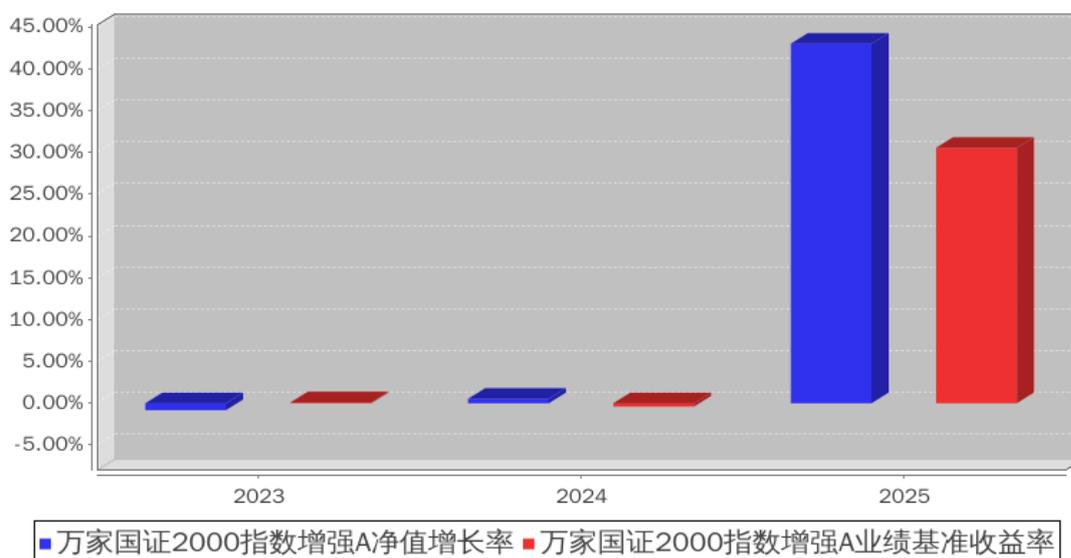
万家国证2000指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



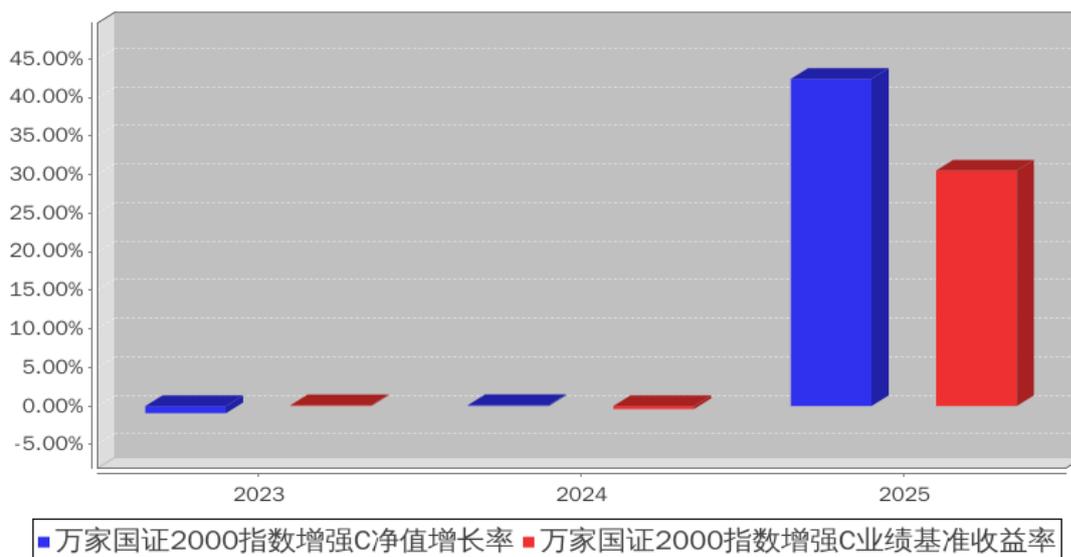
注：本基金于 2023 年 9 月 26 日成立，根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家国证2000指数增强A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



万家国证2000指数增强C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自成立（2023年9月26日）以来未分配利润。

§ 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 2025 年 12 月 31 日，公司共管理 193 只开放式基金，其中包括 55 只股票型基金、73 只混合型基金、46 只债券型基金、5 只货币市场基金、4 只 QDII 基金、10 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	2023 年 9 月 26 日	-	19 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。

<p>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。</p>				
--	--	--	--	--

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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内，本基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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》，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，严禁直

接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送，确保公平对待不同投资组合。

在投资决策上：(1)管理人投资管理实行分层次决策，投资决策委员会根据公募基金和私募投资组合的规模、风格特征等因素合理确定各投资组合经理的投资权限，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需经过严格的逐级审批程序。(2)管理人研究员撰写的研究报告等均通过统一的投研管理平台发布，确保各投资组合经理在获得投资信息、投资建议和实施决策方面享有公平的机会。

在交易执行上：(1)管理人将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度；(2)对于交易公开竞价交易，所有指令必须通过系统下达，执行交易系统中的公平交易程序；(3)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，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，原则上公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；(4)对于银行间交易，交易部按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。

在行为监控上，管理人定期对不同投资组合的同向交易价差、反向交易，场外交易对手议价的价格公允性及其他异常交易情况进行监控及分析，基金经理对异常交易情况进行合理性解释并留存记录，并定期编制公平交易分析报告，由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

管理人定期进行同向交易价差分析，即采集公司旗下管理的所有组合，连续四个季度期间内，不同时间窗下(日内、3日内、5日内)的同向交易样本，对两两组合之间的同向交易价差均值进行原假设为 0, 95%的置信水平下的 t 检验，并对结论进行跟踪分析。分析结果显示在样本数量大于 30 的前提下，组合之间在同向交易方面不存在违反公平交易的情况。

4.3.3 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 2 次，均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%以上权重为国证 2000 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国证 2000 指数增强 A 的基金份额净值为 1.4256 元，本报告期基金份额净值增长率为 42.97%，同期业绩比较基准收益率为 30.53%；截至本报告期末万家国证 2000 指数增强 C 的基金份额净值为 1.4127 元，本报告期基金份额净值增长率为 42.41%，同期业绩比较基准收益率为 30.53%。基金报告期内 A 份额、C 份额日均跟踪偏离度分别为 0.2130%、0.2128%，年跟踪误差分别为 4.1669%、4.1708%。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

2025 年 A 股市场整体呈现“震荡上行、结构分化”的走势，成交量创出新高，上证指数创十年新高；宏观层面，国际秩序重构和国内产业创新共振，成为本轮行情的核心驱动力，推动中国资产重估。资金面较为活跃，个人投资者积极入市、居民存款搬家；机构投资者受益政策鼓励引导中长期资金入市。风格层面，整体来看小盘风格跑赢大盘、成长跑赢价值，至年底阶段市场风格略趋于均衡。行业层面，有色金属、通信、电子领涨；食品饮料、煤炭相对较弱。

展望后市，2 月以来，权益市场在受贵金属大幅波动冲击下迎来修复，市场有望延续震荡向上格局。首先春节假期，特朗普关税政策受阻，调整后的关税压力均较此前版本有所缓和，关税降低提振风险偏好。其次 1 月金融数据中性略偏强，M1 在此前下行后重新回升，显示资金活性增强，M2 增速明显上升，显示流动性充裕。最后稳增长政策基调重新升温，2026 年为“十五五”规划第一年，市场对 2026 年财政安排抱有期待，中央经济工作会议也提出支持新兴产业和“投资于人的服务消费，为经济转型与内需稳定提供动能。总体来看，春节假期海外事件偏积极，国内金融数据中性略偏强，“十五五”规划下国内内需政策适度加力，市场流动性和风险偏好同步改善，A 股市场有望震荡向上。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规与监管要求，紧跟行业政策导向，通过健全制度流程、强化科技赋能、完善合规审查、强化风险管理体系与全流程风控等，有效保障旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

报告期内，基金管理人主要监察稽核工作情况如下：

（一）加强文化建设，强化合规意识

持续践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化理念，坚持投资者利益至上，通过“线上+线下”的模式开展多种形式的合规培训、合规提示、合规文化宣导，多管齐下全面提升全员合规意识，筑牢合规经营防线。

（二）筑牢制度根基，优化体系建设

持续推进内控制度建设，依据最新监管规定及业务发展需求，全面梳理并新增、修订多项内控制度和业务流程，确保制度体系的时效性、完备性与可操作性。主动响应监管新规，将外部监管要求内化为管理规范，动态优化制度执行中的薄弱环节，以高质量的制度体系支撑公司稳健合规发展。

（三）强化全面风控，落实全流程管理

秉持全面风险管理理念，持续深入开展风险管理信息化建设，加强各类风险管理工具功能和成果整合，将管控措施贯穿投资运作的事前、事中、事后全过程。针对流动性风险、市场风险、合规风险、操作风险等关键风险类型，强化监测预警机制，力求做到风险“早识别、早预警、早处置”，提升风险识别、评估与应对的精准度，确保各项风控措施执行到位。

（四）夯实稽核监督，坚持整改闭环

坚持“全面覆盖、风险导向”的工作原则，以高密度的稽核频率和细颗粒度的深度审查，全面履行监督职责。针对内控与合规管理盲点，加强整改督办机制，强化检查结果的刚性约束，协助业务部门构建风险防范的长效机制。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对万家基金管理有限公司编制和披露的本基金 2025 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	信会师报字[2026]第 ZA31472 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	万家国证 2000 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了万家国证 2000 指数增强型证券投资基金（以下简称“万家国证 2000 指数增强”）财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会

	<p>(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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编制,公允反映了万家国证 2000 指数增强 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则,我们独立于万家国证 2000 指数增强,并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>万家国证 2000 指数增强的基金管理人万家基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估万家国证 2000 指数增强的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督万家国证 2000 指数增强的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p>

	<p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时, 根据获取的审计证据, 就可能对万家国证 2000 指数增强持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性, 审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露; 如果披露不充分, 我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而, 未来的事项或情况可能导致万家国证 2000 指数增强不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报 (包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	立信会计师事务所 (特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	朱颖	杨利敏
会计师事务所的地址	中国·上海	
审计报告日期	2026 年 03 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 万家国证 2000 指数增强型证券投资基金

报告截止日: 2025 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产:			
货币资金	7.4.7.1	8,048,014.10	1,438,838.45
结算备付金		19,079,020.97	29,157,198.61
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	355,722,571.57	363,211,444.33
其中: 股票投资		355,722,571.57	363,211,444.33
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
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		425,403.89	62,271.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		383,275,010.53	393,869,752.67
负债和净资产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		4,598,842.94	6,185,135.99
应付管理人报酬		349,703.18	374,711.40
应付托管费		52,455.45	56,206.70
应付销售服务费		51,207.12	63,622.49
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	7.4.7.6	156,694.37	150,182.25
负债合计		5,208,903.06	6,829,858.83
净资产:			
实收基金	7.4.7.7	266,150,923.76	389,022,309.79
其他综合收益	7.4.7.8	-	-
未分配利润	7.4.7.9	111,915,183.71	-1,982,415.95
净资产合计		378,066,107.47	387,039,893.84
负债和净资产总计		383,275,010.53	393,869,752.67

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 266,150,923.76 份，其中万家国证 2000 指数增强 A 基金份额净值 1.4256 元，基金份额总额 160,227,679.77 份；万家国证 2000 指数增强 C 基金份额净值 1.4127 元，基金份额总额 105,923,243.99 份。

7.2 利润表

会计主体：万家国证 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
-----	-----	----	---------

		2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		135,755,210.39	-26,503,160.58
1. 利息收入		74,746.25	136,745.98
其中：存款利息收入	7.4.7.10	74,746.25	136,745.98
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）		118,581,981.98	-21,998,959.82
其中：股票投资收益	7.4.7.11	116,109,950.73	-32,315,369.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,472,031.25	10,316,409.80
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）	7.4.7.17	13,625,409.06	-4,988,978.53
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	3,473,073.10	348,031.79
减：二、营业总支出		4,917,744.94	8,954,727.92
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,661,547.38	6,644,921.72
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	549,232.19	996,738.21
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	538,275.37	1,151,814.99
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	7.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.20	168,690.00	161,253.00
三、利润总额（亏损总额		130,837,465.45	-35,457,888.50

以“-”号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		130,837,465.45	-35,457,888.50
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		130,837,465.45	-35,457,888.50

7.3 净资产变动表

会计主体：万家国证 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 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	389,022,309.79	-	-1,982,415.95	387,039,893.84
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	389,022,309.79	-	-1,982,415.95	387,039,893.84
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-122,871,386.03	-	113,897,599.66	-8,973,786.37
(一)、综合收益总额	-	-	130,837,465.45	130,837,465.45
(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)	-122,871,386.03	-	-16,939,865.79	-139,811,251.82
其中：1. 基金申购款	717,205,208.07	-	203,066,679.95	920,271,888.02
2. 基金赎回款	-840,076,594.10	-	-220,006,545.74	-1,060,083,139.84
(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	266,150,923.76	-	111,915,183.71	378,066,107.47
项目	上年度可比期间			
	2024年1月1日至2024年12月31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	1,048,393,167.28	-	-9,085,320.01	1,039,307,847.27
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,048,393,167.28	-	-9,085,320.01	1,039,307,847.27
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-659,370,857.49	-	7,102,904.06	-652,267,953.43
(一)、综合收益总额	-	-	-35,457,888.50	-35,457,888.50
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-659,370,857.49	-	42,560,792.56	-616,810,064.93
其中：1. 基金申购款	78,733,571.62	-	-8,579,083.41	70,154,488.21
2. 基金赎回款	-738,104,429.11	-	51,139,875.97	-686,964,553.14
(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	389,022,309.79	-	-1,982,415.95	387,039,893.84

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

万家国证 2000 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[2023]1138 号文《关于准予万家国证 2000 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 2023 年 9 月 1 日至 2023 年 9 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[2023]第 ZA31748 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 2023 年 9 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 1,116,462,284.91 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 320,158.23 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,116,782,443.14 元，折合 1,116,782,443.14 份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为万家基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的主要投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板以及其他中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、证券公司短期公司债、政府支持机构债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资业务和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：国证 2000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁

布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 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 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

1、金融资产分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的以摊余成本计量的金融资产，包括货币资金、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

2、金融负债分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和以摊余成本计量的金融负债。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在债券投资的账面价值中。对于其他金融资产和以摊余成本计量的金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于其他金融资产和以摊余成本计量的金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，按照未来 12 个月内（若预期存续期少于 12 个月，则为预期存续期内）的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终

止；（2）该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者（3）该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（2）不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

（3）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，

申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率或者合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

其他金融资产在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理

人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

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

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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	8,048,014.10	1,438,838.45
等于：本金	8,046,798.10	1,438,277.92
加：应计利息	1,216.00	560.53
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	8,048,014.10	1,438,838.45

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	354,705,713.98	-	355,722,571.57	1,016,857.59
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	354,705,713.98	-	355,722,571.57	1,016,857.59
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	375,819,995.80	-	363,211,444.33	-12,608,551.47
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	375,819,995.80	-	363,211,444.33	-12,608,551.47

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有各项买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	6,694.37	182.25
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	150,000.00	150,000.00
合计	156,694.37	150,182.25

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

万家国证 2000 指数增强 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	221,481,369.03	221,481,369.03
本期申购	501,633,805.43	501,633,805.43
本期赎回（以“-”号填列）	-562,887,494.69	-562,887,494.69
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	160,227,679.77	160,227,679.77

万家国证 2000 指数增强 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	167,540,940.76	167,540,940.76
本期申购	215,571,402.64	215,571,402.64

本期赎回（以“-”号填列）	-277,189,099.41	-277,189,099.41
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	105,923,243.99	105,923,243.99

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 其他综合收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他综合收益。

7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

万家国证 2000 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	17,972,510.50	-18,621,423.95	-648,913.45
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	17,972,510.50	-18,621,423.95	-648,913.45
本期利润	74,897,187.28	8,245,239.96	83,142,427.24
本期基金份额交易产生的变动数	-16,875,541.26	2,577,638.97	-14,297,902.29
其中：基金申购款	168,037,809.95	-23,223,872.63	144,813,937.32
基金赎回款	-184,913,351.21	25,801,511.60	-159,111,839.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	75,994,156.52	-7,798,545.02	68,195,611.50

万家国证 2000 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	12,678,174.32	-14,011,676.82	-1,333,502.50
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	12,678,174.32	-14,011,676.82	-1,333,502.50
本期利润	42,314,869.11	5,380,169.10	47,695,038.21
本期基金份额交易产生的变动数	-6,138,087.54	3,496,124.04	-2,641,963.50
其中：基金申购款	69,328,465.03	-11,075,722.40	58,252,742.63
基金赎回款	-75,466,552.57	14,571,846.44	-60,894,706.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	48,854,955.89	-5,135,383.68	43,719,572.21

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	34,218.39	40,569.59
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	40,526.99	96,171.18
其他	0.87	5.21
合计	74,746.25	136,745.98

7.4.7.11 股票投资收益

7.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	116,109,950.73	-32,315,369.62
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	116,109,950.73	-32,315,369.62

7.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	3,933,197,242.35	7,515,005,789.45
减：卖出股票成本总额	3,813,116,071.10	7,537,602,193.81
减：交易费用	3,971,220.52	9,718,965.26
买卖股票差价收入	116,109,950.73	-32,315,369.62

7.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月 31日
股票投资产生的股利收益	2,472,031.25	10,316,409.80
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	2,472,031.25	10,316,409.80

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
1. 交易性金融资产	13,625,409.06	-4,988,978.53
股票投资	13,625,409.06	-4,988,978.53
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	13,625,409.06	-4,988,978.53

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
基金赎回费收入	3,417,350.67	341,388.39
基金转换费收入	55,722.43	6,643.40

合计	3,473,073.10	348,031.79
----	--------------	------------

7.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	30,000.00	30,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	690.00	753.00
账户维护费	18,000.00	10,500.00
合计	168,690.00	161,253.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司（“万家基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
中泰证券股份有限公司（“中泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
山东省新动能基金管理有限公司	基金管理人的股东
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
万家共赢资产管理有限公司（“万家共赢”）	基金管理人的子公司
山东能源集团有限公司	基金管理人的实际控制人

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,661,547.38	6,644,921.72
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,661,649.17	2,843,998.91
应支付基金管理人的净管理费	1,999,898.21	3,800,922.81

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

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	549,232.19	996,738.21

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

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

7.4.10.2.3 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家国证 2000 指数增 强 A	万家国证 2000 指数增 强 C	合计
工商银行	-	88,729.68	88,729.68
万家财富	-	7.53	7.53
万家基金	-	115.89	115.89
中泰证券	-	8,538.00	8,538.00
合计	-	97,391.10	97,391.10
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家国证 2000 指数增 强 A	万家国证 2000 指数增 强 C	合计
工商银行	-	47,658.59	47,658.59
万家基金	-	6.03	6.03
中泰证券	-	25,205.34	25,205.34
合计	-	72,869.96	72,869.96

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付

指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，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、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	8,048,014.10	34,218.39	1,438,838.45	40,569.59

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

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001221	悍高集团	2025 年 7 月 23 日	6 个月	新股流通受限	15.43	56.94	155	2,391.65	8,825.70	-
001233	海安集团	2025 年 11 月 18 日	6 个月	新股流通受限	48.00	51.88	269	12,912.00	13,955.72	-
001280	中国铀业	2025 年 11 月 25 日	6 个月	新股流通受限	17.89	45.36	1,632	29,196.48	74,027.52	-
001285	瑞立科密	2025 年 9 月 23 日	6 个月	新股流通受限	42.28	56.08	137	5,792.36	7,682.96	-
001369	双欣材料	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股流通受限	6.85	12.89	689	4,719.65	8,881.21	-
001386	马可波罗	2025 年 10 月 15 日	6 个月	新股流通受限	13.75	18.53	1,341	18,438.75	24,848.73	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	16.42	42.94	94	1,543.48	4,036.36	-
001396	誉帆	2025 年 12	6 个月	新股流通	22.29	35.39	69	1,538.01	2,441.91	-

	科技	月 23 日		受限							
301449	天溯计量	2025 年 12 月 16 日	6 个月	新股流通受限	36.80	65.23	112	4,121.60	7,305.76	-	
301491	汉桑科技	2025 年 7 月 29 日	6 个月	新股流通受限	28.91	55.11	193	5,579.63	10,636.23	-	
301563	云汉芯城	2025 年 9 月 23 日	6 个月	新股流通受限	27.00	133.69	110	2,970.00	14,705.90	-	
301575	艾芬达	2025 年 9 月 3 日	6 个月	新股流通受限	27.69	49.55	126	3,488.94	6,243.30	-	
301584	建发致新	2025 年 9 月 18 日	6 个月	新股流通受限	7.05	26.82	447	3,151.35	11,988.54	-	
301609	山大电力	2025 年 7 月 16 日	6 个月	新股流通受限	14.66	40.99	277	4,060.82	11,354.23	-	
301632	广东建科	2025 年 8 月 5 日	6 个月	新股流通受限	6.56	23.68	617	4,047.52	14,610.56	-	
301638	南网数字	2025 年 11 月 11 日	6 个月	新股流通受限	5.69	14.21	1,648	9,377.12	23,418.08	-	
301656	联合动力	2025 年 9 月 17 日	6 个月	新股流通受限	12.48	25.46	3,504	43,729.92	89,211.84	-	
301667	纳百川	2025 年 12 月 10 日	6 个月	新股流通受限	22.63	57.07	151	3,417.13	8,617.57	-	
301668	昊创	2025 年 9 月	6 个月	新股流通	21.00	44.80	165	3,465.00	7,392.00	-	

	瑞通	月 15 日		受限							
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	21.93	54.39	195	4,276.35	10,606.05	-	
601026	道生天合	2025 年 10 月 9 日	6 个月	新股流通受限	5.98	14.28	451	2,696.98	6,440.28	-	
603092	德力佳	2025 年 10 月 30 日	6 个月	新股流通受限	46.68	55.66	121	5,648.28	6,734.86	-	
603175	超颖电子	2025 年 10 月 17 日	6 个月	新股流通受限	17.08	48.56	169	2,886.52	8,206.64	-	
603248	锡华科技	2025 年 12 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.10	16.30	260	2,626.00	4,238.00	-	
603262	技源集团	2025 年 7 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.88	28.10	155	1,686.40	4,355.50	-	
603334	丰倍生物	2025 年 10 月 29 日	6 个月	新股流通受限	24.49	32.82	88	2,155.12	2,888.16	-	
603370	华新精科	2025 年 8 月 27 日	6 个月	新股流通受限	18.60	46.35	82	1,525.20	3,800.70	-	
603376	大明电子	2025 年 10 月 28 日	6 个月	新股流通受限	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-	
603406	天富龙	2025 年 7 月 30 日	6 个月	新股流通受限	23.60	40.16	99	2,336.40	3,975.84	-	
603418	友升	2025 年 9 月	6 个月	新股流通	46.36	59.06	139	6,444.04	8,209.34	-	

	股份	月 16 日		受限							
688729	屹唐股份	2025 年 7 月 1 日	6 个月	新股流通受限	8.45	24.28	1,001	8,458.45	24,304.28	-	
688765	禾元生物	2025 年 10 月 16 日	6 个月	新股流通受限	29.06	52.62	1,911	55,533.66	100,556.82	-	
688783	西安奕材	2025 年 10 月 20 日	6 个月	新股流通受限	8.62	18.36	7,121	61,383.02	130,741.56	-	
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	9 个月	新股流通受限	114.28	416.02	1,575	179,991.00	655,231.50	-	
688796	百奥赛图	2025 年 12 月 2 日	6 个月	新股流通受限	26.68	42.25	420	11,205.60	17,745.00	-	
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股流通受限	104.66	399.40	1,298	135,848.68	518,421.20	-	
688805	健信超导	2025 年 12 月 17 日	6 个月	新股流通受限	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	-	
688807	优迅股份	2025 年 12 月 10 日	6 个月	新股流通受限	51.66	135.56	131	6,767.46	17,758.36	-	
688809	强一股份	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股流通受限	85.09	203.31	127	10,806.43	25,820.37	-	

7.4.12.2 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
------	------	------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

002049	紫光 国微	2025 年 12 月 30 日	重大事 项停牌	78.81	2026 年 1 月 15 日	86.69	12,700	961,331.90	1,000,887.00	-
--------	----------	---------------------------	------------	-------	--------------------------	-------	--------	------------	--------------	---

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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 2025 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资。（2024 年 12 月 31 日：同）

7.4.13.3 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 7.4.12 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。

7.4.13.3.1 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 7.4.12 “期末（2025 年 12 月 31 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	8,048,014.10	-	-	-	-	-	-8,048,014.10
结算备付金	19,079,020.97	-	-	-	-	-	19,079,020.97
交易性金融资产	-	-	-	-	-	355,722,571.57	355,722,571.57
应收申购款	-	-	-	-	-	-425,403.89	425,403.89
资产总计	27,127,035.07	-	-	-	-	356,147,975.46	383,275,010.53
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,598,842.94	4,598,842.94
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-349,703.18	349,703.18
应付托管费	-	-	-	-	-	-52,455.45	52,455.45
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-51,207.12	51,207.12
其他负债	-	-	-	-	-	-156,694.37	156,694.37
负债总计	-	-	-	-	-	5,208,903.06	5,208,903.06
利率敏感度缺口	27,127,035.07	-	-	-	-	350,939,072.40	378,066,107.47
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,438,838.45	-	-	-	-	-	-1,438,838.45
结算备付金	29,157,198.61	-	-	-	-	-	29,157,198.61
交易性金融资产	-	-	-	-	-	363,211,444.33	363,211,444.33
应收申购款	0.59	-	-	-	-	-62,270.69	62,271.28
资产总计	30,596,037.65	-	-	-	-	363,273,715.02	393,869,752.67

负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,185,135.99	6,185,135.99
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	374,711.40	374,711.40
应付托管费	-	-	-	-	-	56,206.70	56,206.70
应付销售服务费	-	-	-	-	-	63,622.49	63,622.49
其他负债	-	-	-	-	-	150,182.25	150,182.25
负债总计	-	-	-	-	-	6,829,858.83	6,829,858.83
利率敏感度缺口	30,596,037.65	-	-	-	-	356,443,856.19	387,039,893.84

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2025 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2024 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（2024 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 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	355,722,571.57	94.09	363,211,444.33	93.84

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	355,722,571.57	94.09	363,211,444.33	93.84

7.4.13.4.3.2 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（2025年12月31日）	上年度末（2024年12月31日）
	股票基准指数上升100个基点	3,225,406.99	6,009,557.30
	股票基准指数下降100个基点	-3,225,406.99	-6,009,557.30

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	352,809,978.63	362,636,400.08
第二层次	1,000,887.00	27,736.50

第三层次	1,911,705.94	547,307.75
合计	355,722,571.57	363,211,444.33

7.4.14.2.2 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）和非公开发行业务等情况，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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	547,307.75	547,307.75
当期购买	-	672,533.75	672,533.75
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	630,122.63	630,122.63
当期利得或损失总额	-	1,321,987.07	1,321,987.07
其中：计入损益的利得或损失	-	1,321,987.07	1,321,987.07
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,911,705.94	1,911,705.94
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	1,239,172.19	1,239,172.19
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	171,340.94	171,340.94

当期购买	-	219,079.33	219,079.33
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	145,683.00	145,683.00
当期利得或损失总额	-	302,570.48	302,570.48
其中：计入损益的利得或损失	-	302,570.48	302,570.48
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	547,307.75	547,307.75
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	328,228.42	328,228.42

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,911,705.94	亚式期权模型	预期波动率	0.1800-3.0791	预期波动率越大公允价值越低
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	547,307.75	亚式期权模型	预期波动率	0.2665-5.7444	预期波动率越大公允价值越低

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	355,722,571.57	92.81
	其中：股票	355,722,571.57	92.81
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	27,127,035.07	7.08
8	其他各项资产	425,403.89	0.11
9	合计	383,275,010.53	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	7,525,676.00	1.99
C	制造业	208,660,818.19	55.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,830,925.92	1.01
E	建筑业	2,119,249.20	0.56
F	批发和零售业	5,088,161.14	1.35
G	交通运输、仓储和邮政业	991,901.84	0.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	40,245,175.31	10.65
J	金融业	3,274,502.00	0.87
K	房地产业	1,570,011.00	0.42
L	租赁和商务服务业	3,531,763.00	0.93
M	科学研究和技术服务业	8,596,197.40	2.27
N	水利、环境和公共	3,443,051.00	0.91

	设施管理业		
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	629,316.80	0.17
S	综合	930,188.00	0.25
	合计	290,436,936.80	76.82

8.2.2 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	502,320.00	0.13
B	采矿业	1,229,912.52	0.33
C	制造业	48,713,385.95	12.88
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	3,920,762.96	1.04
G	交通运输、仓储和邮政业	29,920.00	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,736,299.33	0.99
J	金融业	9.28	0.00
K	房地产业	38.50	0.00
L	租赁和商务服务业	3,119,755.00	0.83
M	科学研究和技术服务业	3,723,989.23	0.99
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	278,690.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	30,552.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	65,285,634.77	17.27

8.2.3 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。

8.3 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

8.3.1 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	601020	华钰矿业	76,900	2,065,534.00	0.55
2	605196	华通线缆	58,600	2,035,764.00	0.54
3	688158	优刻得	72,300	2,030,907.00	0.54
4	002446	盛路通信	183,100	1,920,719.00	0.51
5	688025	杰普特	13,010	1,841,825.70	0.49
6	300224	正海磁材	117,200	1,811,912.00	0.48
7	600986	浙文互联	230,400	1,801,728.00	0.48
8	301316	慧博云通	40,300	1,800,604.00	0.48
9	603013	亚普股份	72,800	1,795,976.00	0.48
10	688779	五矿新能	239,500	1,793,855.00	0.47
11	300925	法本信息	83,500	1,773,540.00	0.47
12	300278	华昌达	290,300	1,770,830.00	0.47
13	300068	南都电源	113,500	1,763,790.00	0.47
14	688488	艾迪药业	106,800	1,744,044.00	0.46
15	688182	灿勤科技	58,600	1,729,872.00	0.46
16	002448	中原内配	133,600	1,727,448.00	0.46
17	300328	宜安科技	101,000	1,724,070.00	0.46
18	002406	远东传动	216,800	1,721,392.00	0.46
19	301487	盟固利	78,100	1,712,733.00	0.45
20	688609	九联科技	167,700	1,712,217.00	0.45
21	002246	北化股份	94,200	1,697,484.00	0.45
22	002560	通达股份	168,300	1,696,464.00	0.45
23	002734	利民股份	105,900	1,688,046.00	0.45
24	300975	商络电子	132,700	1,683,963.00	0.45
25	688590	新致软件	90,100	1,681,266.00	0.44
26	002376	新北洋	217,500	1,679,100.00	0.44
27	600230	沧州大化	109,900	1,677,074.00	0.44
28	603969	银龙股份	165,500	1,673,205.00	0.44
29	300323	华灿光电	208,500	1,663,830.00	0.44
30	300607	拓斯达	50,400	1,660,176.00	0.44
31	300846	首都在线	72,700	1,659,741.00	0.44
32	605305	中际联合	39,600	1,649,736.00	0.44
33	603219	富佳股份	97,700	1,645,268.00	0.44
34	002886	沃特股份	75,600	1,642,032.00	0.43
35	688299	长阳科技	95,300	1,612,476.00	0.43
36	688222	成都先导	68,400	1,603,980.00	0.42
37	300158	振东制药	275,700	1,601,817.00	0.42
38	688577	浙海德曼	16,500	1,598,190.00	0.42
39	300872	天阳科技	77,700	1,597,512.00	0.42

40	301238	瑞泰新材	78,100	1,593,240.00	0.42
41	300681	英搏尔	63,400	1,588,804.00	0.42
42	000058	深赛格	169,000	1,588,600.00	0.42
43	605228	神通科技	106,400	1,588,552.00	0.42
44	688209	英集芯	79,600	1,587,224.00	0.42
45	300127	银河磁体	52,200	1,583,226.00	0.42
46	301381	赛维时代	76,600	1,577,194.00	0.42
47	605118	力鼎光电	52,000	1,565,720.00	0.41
48	603629	利通电子	58,600	1,561,690.00	0.41
49	300040	九洲集团	259,300	1,560,986.00	0.41
50	688678	福立旺	64,500	1,559,610.00	0.41
51	002609	捷顺科技	167,100	1,552,359.00	0.41
52	300882	万胜智能	82,500	1,551,000.00	0.41
53	688185	康希诺	24,600	1,546,110.00	0.41
54	300859	西域旅游	41,800	1,545,346.00	0.41
55	300942	易瑞生物	163,800	1,541,358.00	0.41
56	301048	金鹰重工	135,037	1,539,421.80	0.41
57	688707	振华新材	109,300	1,513,805.00	0.40
58	603767	中马传动	62,700	1,507,935.00	0.40
59	603313	梦百合	169,200	1,505,880.00	0.40
60	300861	美畅股份	99,900	1,491,507.00	0.39
61	603693	江苏新能	123,700	1,467,082.00	0.39
62	605198	安德利	38,600	1,452,132.00	0.38
63	300747	锐科激光	53,500	1,446,105.00	0.38
64	002276	万马股份	85,300	1,442,423.00	0.38
65	603323	苏农银行	283,300	1,430,665.00	0.38
66	688498	源杰科技	2,200	1,412,378.00	0.37
67	002222	福晶科技	24,800	1,397,232.00	0.37
68	002950	奥美医疗	126,900	1,385,748.00	0.37
69	300249	依米康	93,500	1,367,905.00	0.36
70	300409	道氏技术	60,300	1,356,147.00	0.36
71	300790	宇瞳光学	45,300	1,354,923.00	0.36
72	603915	国茂股份	72,700	1,338,407.00	0.35
73	300035	中科电气	62,600	1,332,754.00	0.35
74	688428	诺诚健华	64,900	1,331,748.00	0.35
75	002552	宝鼎科技	79,800	1,317,498.00	0.35
76	300021	大禹节水	286,300	1,316,980.00	0.35
77	300652	雷迪克	24,000	1,316,640.00	0.35
78	300382	斯莱克	84,200	1,310,152.00	0.35
79	002119	康强电子	79,100	1,302,777.00	0.34
80	600478	科力远	188,800	1,300,832.00	0.34
81	300624	万兴科技	18,300	1,292,895.00	0.34
82	301058	中粮科工	117,511	1,287,920.56	0.34

83	300348	长亮科技	81,900	1,267,812.00	0.34
84	301382	蜂助手	35,740	1,266,625.60	0.34
85	002908	德生科技	120,200	1,265,706.00	0.33
86	300940	南极光	44,340	1,261,916.40	0.33
87	603185	弘元绿能	41,200	1,256,600.00	0.33
88	002941	新疆交建	78,100	1,237,885.00	0.33
89	688321	微芯生物	42,300	1,236,006.00	0.33
90	002846	英联股份	76,200	1,229,868.00	0.33
91	002897	意华股份	22,700	1,227,389.00	0.32
92	002206	海利得	209,500	1,225,575.00	0.32
93	603035	常熟汽饰	78,700	1,217,489.00	0.32
94	002664	信质集团	49,600	1,188,416.00	0.31
95	300569	天能重工	207,000	1,188,180.00	0.31
96	688063	派能科技	20,900	1,187,538.00	0.31
97	300047	天源迪科	94,500	1,185,975.00	0.31
98	603112	华翔股份	67,900	1,179,423.00	0.31
99	300389	艾比森	72,400	1,175,052.00	0.31
100	688059	华锐精密	14,900	1,172,630.00	0.31
101	300353	东土科技	57,200	1,164,592.00	0.31
102	688365	光云科技	68,922	1,162,714.14	0.31
103	002987	京北方	53,889	1,160,230.17	0.31
104	300072	海新能科	248,700	1,144,020.00	0.30
105	688062	迈威生物	29,100	1,119,477.00	0.30
106	603032	德新科技	58,000	1,111,280.00	0.29
107	300662	科锐国际	43,800	1,109,454.00	0.29
108	300531	优博讯	61,400	1,107,656.00	0.29
109	300719	安达维尔	61,100	1,106,521.00	0.29
110	688001	华兴源创	36,413	1,098,944.34	0.29
111	002117	东港股份	79,400	1,096,514.00	0.29
112	605020	永和股份	40,500	1,089,045.00	0.29
113	002815	崇达技术	79,700	1,088,702.00	0.29
114	688410	山外山	72,600	1,086,822.00	0.29
115	688320	禾川科技	29,000	1,082,280.00	0.29
116	300191	潜能恒信	58,500	1,081,080.00	0.29
117	300358	楚天科技	110,000	1,076,900.00	0.28
118	688595	芯海科技	32,700	1,072,560.00	0.28
119	002096	易普力	80,500	1,072,260.00	0.28
120	301215	中汽股份	156,400	1,071,340.00	0.28
121	002137	实益达	124,800	1,070,784.00	0.28
122	002454	松芝股份	122,600	1,067,846.00	0.28
123	300168	万达信息	165,000	1,065,900.00	0.28
124	600195	中牧股份	135,400	1,065,598.00	0.28
125	300858	科拓生物	63,400	1,063,218.00	0.28

126	300674	宇信科技	43,800	1,062,588.00	0.28
127	301101	明月镜片	25,200	1,044,036.00	0.28
128	688327	云从科技	71,600	1,028,892.00	0.27
129	300802	矩子科技	53,200	1,018,248.00	0.27
130	301607	富特科技	25,100	1,006,761.00	0.27
131	603328	依顿电子	91,000	997,360.00	0.26
132	603538	美诺华	51,500	990,860.00	0.26
133	000603	盛达资源	32,000	990,720.00	0.26
134	001914	招商积余	91,700	979,356.00	0.26
135	688207	格灵深瞳	64,100	974,320.00	0.26
136	000506	招金黄金	74,600	974,276.00	0.26
137	300678	中科信息	31,600	972,016.00	0.26
138	002824	和胜股份	49,800	966,120.00	0.26
139	300494	盛天网络	79,300	965,874.00	0.26
140	002782	可立克	52,500	953,400.00	0.25
141	603848	好太太	52,000	950,040.00	0.25
142	301216	万凯新材	56,288	949,015.68	0.25
143	300365	恒华科技	148,400	937,888.00	0.25
144	000833	粤桂股份	47,800	930,188.00	0.25
145	002675	东诚药业	67,300	924,702.00	0.24
146	002757	南兴股份	47,400	922,878.00	0.24
147	000837	秦川机床	70,200	904,176.00	0.24
148	300769	德方纳米	19,940	877,559.40	0.23
149	605056	咸亨国际	52,600	867,900.00	0.23
150	001267	汇绿生态	39,400	862,860.00	0.23
151	688108	赛诺医疗	44,410	854,448.40	0.23
152	002746	仙坛股份	132,700	805,489.00	0.21
153	000899	赣能股份	78,900	781,110.00	0.21
154	603083	剑桥科技	5,800	779,404.00	0.21
155	688593	新相微	38,300	772,894.00	0.20
156	300263	隆华科技	85,500	755,820.00	0.20
157	688518	联赢激光	30,600	743,274.00	0.20
158	300241	瑞丰光电	131,500	735,085.00	0.19
159	601069	西部黄金	27,400	731,032.00	0.19
160	688201	信安世纪	49,000	716,870.00	0.19
161	000422	湖北宜化	49,800	707,658.00	0.19
162	688128	中国电研	24,300	706,644.00	0.19
163	301608	博实结	7,800	706,212.00	0.19
164	300066	三川智慧	112,700	702,121.00	0.19
165	603520	司太立	74,600	701,240.00	0.19
166	603612	索通发展	29,700	697,950.00	0.18
167	688202	美迪西	12,100	682,440.00	0.18
168	002878	元隆雅图	36,800	670,496.00	0.18

169	300185	通裕重工	233,800	663,992.00	0.18
170	688766	普冉股份	5,200	661,492.00	0.17
171	301330	熵基科技	19,940	659,017.00	0.17
172	000810	创维数字	55,700	656,146.00	0.17
173	300180	华峰超纤	93,500	647,955.00	0.17
174	002250	联化科技	47,700	638,226.00	0.17
175	300691	联合光电	36,800	635,536.00	0.17
176	300693	盛弘股份	16,600	635,448.00	0.17
177	603466	风语筑	67,200	628,992.00	0.17
178	002537	海联金汇	69,200	626,952.00	0.17
179	002082	万邦德	44,800	624,064.00	0.17
180	688136	科兴制药	19,500	617,565.00	0.16
181	301031	中熔电气	5,500	617,045.00	0.16
182	600629	华建集团	28,100	609,770.00	0.16
183	688559	海目星	12,617	606,373.02	0.16
184	002948	青岛银行	135,300	606,144.00	0.16
185	603530	神马电力	14,700	603,876.00	0.16
186	603367	辰欣药业	34,800	602,736.00	0.16
187	301095	广立微	8,400	602,364.00	0.16
188	000045	深纺织 A	49,200	601,224.00	0.16
189	003040	楚天龙	29,000	599,720.00	0.16
190	600266	城建发展	116,500	590,655.00	0.16
191	002332	仙琚制药	64,900	584,749.00	0.15
192	600292	电投水电	44,500	580,725.00	0.15
193	601177	杭齿前进	33,200	576,020.00	0.15
194	688123	聚辰股份	4,580	575,156.40	0.15
195	688519	南亚新材	7,100	574,106.00	0.15
196	603100	川仪股份	24,900	572,700.00	0.15
197	300909	汇创达	11,900	572,390.00	0.15
198	300315	掌趣科技	115,100	568,594.00	0.15
199	600626	申达股份	117,500	567,525.00	0.15
200	300213	佳讯飞鸿	59,600	567,392.00	0.15
201	000612	焦作万方	51,000	562,020.00	0.15
202	300825	阿尔特	58,000	561,440.00	0.15
203	301096	百诚医药	9,800	559,972.00	0.15
204	688380	中微半导	17,300	556,195.00	0.15
205	002562	兄弟科技	85,900	554,914.00	0.15
206	300171	东富龙	35,000	549,500.00	0.15
207	002452	长高电新	66,300	545,649.00	0.14
208	301260	格力博	32,000	545,600.00	0.14
209	301297	富乐德	15,200	544,160.00	0.14
210	300768	迪普科技	29,300	542,929.00	0.14
211	300709	精研科技	11,500	542,340.00	0.14

212	002334	英威腾	60,000	541,200.00	0.14
213	003037	三和管桩	66,800	541,080.00	0.14
214	000852	石化机械	74,400	540,888.00	0.14
215	300079	数码视讯	99,900	538,461.00	0.14
216	002957	科瑞技术	24,800	536,920.00	0.14
217	603997	继峰股份	38,600	536,540.00	0.14
218	002823	凯中精密	33,400	536,404.00	0.14
219	001337	四川黄金	19,200	534,912.00	0.14
220	300933	中辰股份	64,500	534,705.00	0.14
221	600367	红星发展	30,600	534,582.00	0.14
222	001236	弘业期货	50,400	534,240.00	0.14
223	688238	和元生物	80,200	534,132.00	0.14
224	605050	福然德	39,200	528,024.00	0.14
225	603002	宏昌电子	71,400	527,646.00	0.14
226	688252	天德钰	24,900	527,133.00	0.14
227	603989	艾华集团	31,400	526,892.00	0.14
228	002649	博彦科技	39,300	518,367.00	0.14
229	300369	绿盟科技	68,900	515,372.00	0.14
230	300420	五洋自控	129,064	514,965.36	0.14
231	300183	东软载波	34,700	514,601.00	0.14
232	603496	恒为科技	18,800	512,864.00	0.14
233	301277	新天地	43,420	511,921.80	0.14
234	002993	奥海科技	11,700	511,407.00	0.14
235	002017	东信和平	22,600	503,980.00	0.13
236	300083	创世纪	54,500	501,945.00	0.13
237	002392	北京利尔	66,800	499,664.00	0.13
238	300566	激智科技	27,100	497,285.00	0.13
239	002283	天润工业	79,100	493,584.00	0.13
240	688049	炬芯科技	9,320	490,232.00	0.13
241	600908	无锡银行	82,100	486,853.00	0.13
242	002296	辉煌科技	43,200	483,840.00	0.13
243	688091	上海谊众	10,220	480,340.00	0.13
244	002449	国星光电	56,400	477,144.00	0.13
245	002258	利尔化学	36,500	476,325.00	0.13
246	002727	一心堂	37,000	475,820.00	0.13
247	601311	骆驼股份	51,500	472,255.00	0.12
248	600758	辽宁能源	129,300	470,652.00	0.12
249	300042	朗科科技	18,200	467,740.00	0.12
250	300873	海晨股份	21,100	463,567.00	0.12
251	300149	睿智医药	48,100	459,836.00	0.12
252	300292	吴通控股	101,500	457,765.00	0.12
253	300403	汉字集团	31,600	455,356.00	0.12
254	002215	诺普信	42,800	453,252.00	0.12

255	002393	力生制药	20,400	442,884.00	0.12
256	301307	美利信	12,800	442,624.00	0.12
257	300043	星辉娱乐	77,900	440,135.00	0.12
258	300587	天铁科技	71,400	437,682.00	0.12
259	603912	佳力图	50,700	434,499.00	0.11
260	300206	理邦仪器	32,900	420,791.00	0.11
261	002695	煌上煌	35,800	420,292.00	0.11
262	002965	祥鑫科技	10,300	419,004.00	0.11
263	688177	百奥泰	18,000	416,520.00	0.11
264	603859	能科科技	9,900	416,295.00	0.11
265	002919	名臣健康	17,900	411,521.00	0.11
266	603339	四方科技	32,000	410,560.00	0.11
267	688127	蓝特光学	10,600	407,994.00	0.11
268	600569	安阳钢铁	178,100	400,725.00	0.11
269	002263	大东南	119,700	398,601.00	0.11
270	603132	金徽股份	26,700	391,689.00	0.10
271	603583	捷昌驱动	10,100	384,507.00	0.10
272	300811	铂科新材	5,200	370,812.00	0.10
273	000555	神州信息	22,100	365,755.00	0.10
274	688556	高测股份	31,900	364,298.00	0.10
275	002612	朗姿股份	17,100	349,524.00	0.09
276	603067	振华股份	11,940	343,991.40	0.09
277	300725	药石科技	8,774	338,325.44	0.09
278	300698	万马科技	8,000	337,040.00	0.09
279	000404	长虹华意	49,300	333,761.00	0.09
280	002860	星帅尔	23,600	332,760.00	0.09
281	002688	金河生物	55,500	330,225.00	0.09
282	002345	潮宏基	26,000	325,000.00	0.09
283	688173	希荻微	22,100	324,870.00	0.09
284	002160	常铝股份	62,000	322,400.00	0.09
285	603878	武进不锈	34,100	315,766.00	0.08
286	002580	圣阳股份	25,300	314,732.00	0.08
287	300184	力源信息	31,500	314,685.00	0.08
288	301391	卡莱特	3,700	313,945.00	0.08
289	688432	有研硅	24,200	300,322.00	0.08
290	600212	绿能慧充	36,200	291,410.00	0.08
291	603663	三祥新材	8,100	286,335.00	0.08
292	002483	润邦股份	39,900	284,886.00	0.08
293	002990	盛视科技	9,900	280,269.00	0.07
294	300796	贝斯美	30,800	267,652.00	0.07
295	300134	大富科技	21,100	263,750.00	0.07
296	688191	智洋创新	7,900	254,222.00	0.07
297	301080	百普赛斯	4,600	248,400.00	0.07

298	301110	青木科技	3,600	238,248.00	0.06
299	600552	凯盛科技	19,200	238,080.00	0.06
300	002298	中电鑫龙	22,400	233,856.00	0.06
301	002979	雷赛智能	5,500	231,385.00	0.06
302	601003	柳钢股份	46,000	231,380.00	0.06
303	300007	汉威科技	4,300	230,480.00	0.06
304	688549	中巨芯	24,700	225,264.00	0.06
305	603009	北特科技	4,500	216,720.00	0.06
306	601963	重庆银行	20,000	216,600.00	0.06
307	603611	诺力股份	8,500	207,825.00	0.05
308	688800	瑞可达	2,500	207,500.00	0.05
309	300341	麦克奥迪	12,600	205,884.00	0.05
310	688690	纳微科技	7,914	204,260.34	0.05
311	300245	天玑科技	16,400	198,276.00	0.05
312	002254	泰和新材	19,700	197,394.00	0.05
313	688799	华纳药厂	4,046	192,994.20	0.05
314	688636	智明达	4,450	190,638.00	0.05
315	000795	英洛华	18,500	184,445.00	0.05
316	002997	瑞鹄模具	4,826	180,492.40	0.05
317	300739	明阳电路	9,700	178,286.00	0.05
318	002587	奥拓电子	26,300	177,788.00	0.05
319	688262	国芯科技	5,830	176,940.50	0.05
320	002907	华森制药	11,900	176,239.00	0.05
321	300580	贝斯特	6,700	176,143.00	0.05
322	000521	长虹美菱	26,597	174,210.35	0.05
323	600301	华锡有色	4,400	168,784.00	0.04
324	603758	秦安股份	9,600	166,944.00	0.04
325	002676	顺威股份	20,220	166,612.80	0.04
326	300590	移为通信	13,100	166,108.00	0.04
327	002707	众信旅游	22,700	163,213.00	0.04
328	301511	德福科技	4,500	161,055.00	0.04
329	600507	方大特钢	26,100	153,729.00	0.04
330	300618	寒锐钴业	3,400	153,714.00	0.04
331	300976	达瑞电子	2,500	150,175.00	0.04
332	002526	山东矿机	41,600	149,760.00	0.04
333	300480	光力科技	8,800	147,048.00	0.04
334	603308	应流股份	3,500	146,125.00	0.04
335	601968	宝钢包装	26,300	140,442.00	0.04
336	688685	迈信林	2,500	138,700.00	0.04
337	688553	汇宇制药	7,480	133,069.20	0.04
338	002174	游族网络	10,800	132,192.00	0.03
339	300847	中船汉光	7,400	126,836.00	0.03
340	300378	鼎捷数智	2,719	123,061.94	0.03

341	002658	雪迪龙	13,600	122,808.00	0.03
342	300468	四方精创	3,100	120,373.00	0.03
343	301211	亨迪药业	9,850	120,367.00	0.03
344	000968	蓝焰控股	17,700	116,997.00	0.03
345	002057	中钢天源	10,900	111,071.00	0.03
346	300036	超图软件	6,100	110,776.00	0.03
347	002110	三钢闽光	24,000	105,360.00	0.03
348	002730	电光科技	6,800	102,272.00	0.03
349	300559	佳发教育	8,100	102,141.00	0.03
350	301015	百洋医药	4,300	101,480.00	0.03
351	601609	金田股份	9,300	100,440.00	0.03
352	300711	广哈通信	4,300	99,846.00	0.03
353	002048	宁波华翔	3,000	94,380.00	0.02
354	688179	阿拉丁	7,500	93,675.00	0.02
355	600961	株冶集团	5,700	91,770.00	0.02
356	000973	佛塑科技	5,900	86,730.00	0.02
357	002996	顺博合金	11,400	86,184.00	0.02
358	688697	纽威数控	5,600	86,128.00	0.02
359	300835	龙磁科技	1,200	78,696.00	0.02
360	603683	晶华新材	2,900	74,182.00	0.02
361	688206	概伦电子	1,872	65,201.76	0.02
362	002556	辉隆股份	10,500	63,420.00	0.02
363	002923	润都股份	4,800	58,320.00	0.02
364	600267	海正药业	5,700	56,373.00	0.01
365	688631	莱斯信息	800	54,464.00	0.01
366	002170	芭田股份	4,400	53,592.00	0.01
367	300772	运达股份	2,800	53,368.00	0.01
368	603901	永创智能	3,700	52,540.00	0.01
369	002165	红宝丽	6,000	45,360.00	0.01
370	688484	南芯科技	1,100	44,726.00	0.01
371	300702	天宇股份	1,800	42,480.00	0.01
372	300809	华辰装备	1,100	41,877.00	0.01
373	603950	长源东谷	1,400	40,530.00	0.01
374	301413	安培龙	300	40,440.00	0.01
375	301606	绿联科技	600	35,244.00	0.01
376	688591	泰凌微	800	34,048.00	0.01
377	301326	捷邦科技	300	32,748.00	0.01
378	600571	信雅达	1,800	28,584.00	0.01
379	000601	韶能股份	4,600	21,620.00	0.01
380	002705	新宝股份	1,500	21,390.00	0.01
381	300049	福瑞医科	300	21,123.00	0.01
382	002349	精华制药	2,900	21,054.00	0.01
383	300541	先进数通	1,300	19,578.00	0.01

384	688505	复旦张江	2,300	19,090.00	0.01
385	600223	福瑞达	2,500	18,400.00	0.00
386	002062	宏润建设	1,700	15,725.00	0.00
387	688210	统联精密	200	11,064.00	0.00
388	600531	豫光金铅	900	10,575.00	0.00
389	300219	鸿利智汇	1,400	10,094.00	0.00
390	300440	运达科技	700	8,617.00	0.00
391	301479	弘景光电	82	7,135.64	0.00
392	603124	江南新材	88	6,940.56	0.00
393	688516	奥特维	96	4,344.96	0.00
394	300539	横河精密	100	4,202.00	0.00
395	603202	天有为	39	3,580.59	0.00
396	301501	恒鑫生活	76	3,318.16	0.00
397	605598	上海港湾	40	2,779.20	0.00
398	688661	和林微纳	50	2,588.00	0.00
399	688601	力芯微	59	2,512.81	0.00
400	300913	兆龙互连	40	2,105.20	0.00
401	301099	雅创电子	49	2,085.44	0.00
402	605016	百龙创园	80	1,728.00	0.00
403	688302	海创药业	33	1,622.61	0.00
404	600694	大商股份	90	1,613.70	0.00
405	300900	广联航空	40	1,562.80	0.00
406	603319	美湖股份	40	1,463.20	0.00
407	001382	新亚电缆	66	1,353.00	0.00
408	301339	通行宝	80	1,163.20	0.00
409	603085	天成自控	98	1,161.30	0.00
410	688035	德邦科技	24	1,158.00	0.00
411	603667	五洲新春	16	1,119.68	0.00
412	688165	埃夫特	46	1,092.96	0.00
413	300787	海能实业	80	940.00	0.00
414	000551	创元科技	60	882.00	0.00
415	300708	聚灿光电	95	843.60	0.00
416	605319	无锡振华	40	841.60	0.00
417	301348	蓝箭电子	40	807.60	0.00
418	300887	谱尼测试	84	806.40	0.00
419	688658	悦康药业	33	746.13	0.00
420	688208	道通科技	19	699.20	0.00
421	300581	晨曦航空	40	659.60	0.00
422	600345	长江通信	19	658.54	0.00
423	001288	运机集团	20	639.00	0.00
424	300981	中红医疗	47	590.32	0.00
425	301268	铭利达	28	510.44	0.00
426	300697	电工合金	30	503.40	0.00

427	301076	新瀚新材	10	493.10	0.00
428	300099	尤洛卡	50	376.50	0.00
429	600480	凌云股份	30	368.70	0.00
430	002398	垒知集团	58	325.96	0.00
431	600551	时代出版	40	324.80	0.00
432	002006	精工科技	14	324.24	0.00
433	000900	现代投资	76	310.84	0.00
434	300586	美联新材	20	217.80	0.00
435	603866	桃李面包	40	210.40	0.00
436	600226	亨通股份	24	127.92	0.00
437	688176	亚虹医药	11	126.61	0.00
438	600103	青山纸业	22	92.18	0.00
439	605099	共创草坪	1	35.69	0.00
440	000823	超声电子	2	27.12	0.00

8.3.2 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	000059	华锦股份	291,500	1,559,525.00	0.41
2	002042	华孚时尚	364,900	1,550,825.00	0.41
3	002602	世纪华通	88,800	1,514,928.00	0.40
4	002436	兴森科技	71,400	1,511,538.00	0.40
5	002156	通富微电	39,800	1,500,460.00	0.40
6	603126	中材节能	222,400	1,494,528.00	0.40
7	300073	当升科技	25,800	1,491,240.00	0.39
8	000607	华媒控股	354,800	1,472,420.00	0.39
9	300746	汉嘉数智	112,100	1,420,307.00	0.38
10	300945	曼卡龙	87,600	1,415,616.00	0.37
11	002527	新时达	78,800	1,397,912.00	0.37
12	300805	电声股份	131,200	1,384,160.00	0.37
13	002819	东方中科	50,000	1,365,500.00	0.36
14	601777	千里科技	127,200	1,352,136.00	0.36
15	605208	永茂泰	98,700	1,340,346.00	0.35
16	601515	衢州东峰	288,800	1,241,840.00	0.33
17	600126	杭钢股份	148,100	1,208,496.00	0.32
18	301190	善水科技	54,800	1,162,308.00	0.31
19	002812	恩捷股份	20,300	1,149,792.00	0.30
20	002625	光启技术	22,700	1,106,852.00	0.29
21	300473	德尔股份	36,900	1,098,882.00	0.29
22	300418	昆仑万维	25,400	1,059,180.00	0.28
23	600082	海泰发展	252,900	1,026,774.00	0.27
24	603118	共进股份	87,500	1,006,250.00	0.27
25	002049	紫光国微	12,700	1,000,887.00	0.26
26	688280	精进电动	109,300	950,910.00	0.25

27	603982	泉峰汽车	113,500	949,995.00	0.25
28	300438	鹏辉能源	17,600	936,672.00	0.25
29	002826	易明医药	49,500	909,810.00	0.24
30	300502	新易盛	2,100	904,848.00	0.24
31	300003	乐普医疗	56,600	894,846.00	0.24
32	300308	中际旭创	1,300	793,000.00	0.21
33	002917	金奥博	53,600	717,168.00	0.19
34	300735	光弘科技	27,800	691,108.00	0.18
35	003015	日久光电	43,000	670,800.00	0.18
36	688795	摩尔线程	1,575	655,231.50	0.17
37	301132	满坤科技	17,400	579,420.00	0.15
38	002497	雅化集团	23,200	574,200.00	0.15
39	603987	康德莱	64,800	557,280.00	0.15
40	603949	雪龙集团	29,500	553,715.00	0.15
41	688077	大地熊	18,100	552,955.00	0.15
42	301230	泓博医药	18,300	546,621.00	0.14
43	603059	倍加洁	18,100	544,448.00	0.14
44	688802	沐曦股份	1,298	518,421.20	0.14
45	603178	圣龙股份	27,200	513,264.00	0.14
46	300084	海默科技	51,100	510,489.00	0.14
47	603956	威派格	78,800	509,048.00	0.13
48	601956	东贝集团	70,900	505,517.00	0.13
49	688981	中芯国际	4,100	503,603.00	0.13
50	600598	北大荒	33,600	502,320.00	0.13
51	002402	和而泰	12,800	500,736.00	0.13
52	000822	山东海化	94,200	494,550.00	0.13
53	000426	兴业银锡	13,800	491,280.00	0.13
54	605318	法狮龙	7,400	482,258.00	0.13
55	601600	中国铝业	39,200	479,024.00	0.13
56	002624	完美世界	28,600	468,754.00	0.12
57	603236	移远通信	4,900	467,509.00	0.12
58	300700	岱勒新材	37,600	464,360.00	0.12
59	000887	中鼎股份	19,200	445,632.00	0.12
60	605066	天正电气	60,700	443,110.00	0.12
61	300748	金力永磁	12,800	436,608.00	0.12
62	300333	兆日科技	37,900	435,850.00	0.12
63	600989	宝丰能源	22,200	435,786.00	0.12
64	002599	盛通股份	50,800	433,832.00	0.11
65	301007	德迈仕	9,900	401,148.00	0.11
66	000778	新兴铸管	90,700	379,126.00	0.10
67	603019	中科曙光	4,400	376,816.00	0.10
68	300643	万通智控	18,700	363,528.00	0.10
69	688313	仕佳光子	4,000	355,120.00	0.09

70	600361	创新新材	73,400	311,216.00	0.08
71	300558	贝达药业	6,500	303,485.00	0.08
72	002415	海康威视	9,600	286,464.00	0.08
73	301267	华夏眼科	15,500	278,690.00	0.07
74	601608	中信重工	40,000	263,600.00	0.07
75	600415	小商品城	16,500	263,175.00	0.07
76	600207	安彩高科	50,100	258,015.00	0.07
77	688308	欧科亿	8,100	256,284.00	0.07
78	300340	科恒股份	18,300	225,456.00	0.06
79	301038	深水规院	9,400	220,430.00	0.06
80	300230	永利股份	45,200	216,056.00	0.06
81	688772	珠海冠宇	9,800	210,994.00	0.06
82	688373	盟科药业	34,200	206,568.00	0.05
83	603336	宏辉果蔬	23,100	197,736.00	0.05
84	603922	金鸿顺	9,500	197,220.00	0.05
85	000932	华菱钢铁	33,700	189,394.00	0.05
86	603916	苏博特	19,300	182,578.00	0.05
87	300496	中科创达	2,700	182,250.00	0.05
88	603115	海星股份	9,600	179,616.00	0.05
89	000408	藏格矿业	1,800	151,920.00	0.04
90	688135	利扬芯片	5,440	151,014.40	0.04
91	002333	罗普斯金	25,600	143,872.00	0.04
92	300274	阳光电源	800	136,832.00	0.04
93	688783	西安奕材	7,121	130,741.56	0.03
94	002514	宝馨科技	21,000	123,480.00	0.03
95	002460	赣锋锂业	1,900	119,491.00	0.03
96	002554	惠博普	36,400	116,116.00	0.03
97	600980	北矿科技	4,900	112,602.00	0.03
98	603712	七一二	5,000	103,850.00	0.03
99	688765	禾元生物	1,911	100,556.82	0.03
100	002603	以岭药业	5,600	95,592.00	0.03
101	688286	敏芯股份	1,200	94,740.00	0.03
102	002102	能特科技	28,400	94,572.00	0.03
103	002709	天赐材料	2,000	92,660.00	0.02
104	301656	联合动力	3,504	89,211.84	0.02
105	300279	和晶科技	12,100	87,362.00	0.02
106	600397	江钨装备	11,300	85,880.00	0.02
107	300916	朗特智能	2,500	81,950.00	0.02
108	603606	东方电缆	1,300	77,675.00	0.02
109	001280	中国铀业	1,632	74,027.52	0.02
110	605068	明新旭腾	2,000	51,140.00	0.01
111	002281	光迅科技	700	48,965.00	0.01
112	002558	巨人网络	1,100	47,619.00	0.01

113	600392	盛和资源	2,100	45,213.00	0.01
114	603993	洛阳钼业	1,900	38,000.00	0.01
115	301013	利和兴	1,100	30,811.00	0.01
116	301052	果麦文化	800	30,552.00	0.01
117	600798	宁波海运	8,500	29,920.00	0.01
118	688260	昀冢科技	1,000	28,800.00	0.01
119	300548	长芯博创	200	28,400.00	0.01
120	688809	强一股份	127	25,820.37	0.01
121	001386	马可波罗	1,341	24,848.73	0.01
122	688729	屹唐股份	1,001	24,304.28	0.01
123	301638	南网数字	1,648	23,418.08	0.01
124	002916	深南电路	100	23,229.00	0.01
125	603948	建业股份	800	21,840.00	0.01
126	688807	优迅股份	131	17,758.36	0.00
127	688796	百奥赛图	420	17,745.00	0.00
128	000100	TCL 科技	3,500	15,890.00	0.00
129	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.00
130	301632	广东建科	617	14,610.56	0.00
131	001233	海安集团	269	13,955.72	0.00
132	301358	湖南裕能	200	12,932.00	0.00
133	301584	建发致新	447	11,988.54	0.00
134	301609	山大电力	277	11,354.23	0.00
135	301491	汉桑科技	193	10,636.23	0.00
136	301687	新广益	195	10,606.05	0.00
137	001369	双欣材料	689	8,881.21	0.00
138	001221	悍高集团	155	8,825.70	0.00
139	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00
140	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
141	603418	友升股份	139	8,209.34	0.00
142	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
143	001285	瑞立科密	137	7,682.96	0.00
144	002837	英维克	70	7,482.30	0.00
145	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
146	301449	天溯计量	112	7,305.76	0.00
147	603092	德力佳	121	6,734.86	0.00
148	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
149	688028	沃尔德	97	6,260.38	0.00
150	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00
151	301595	太力科技	96	4,708.80	0.00
152	603262	技源集团	155	4,355.50	0.00
153	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
154	688213	思特威	43	4,088.87	0.00
155	688607	康众医疗	95	4,066.00	0.00

156	001388	信通电子	94	4,036.36	0.00
157	603406	天富龙	99	3,975.84	0.00
158	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
159	301560	众捷汽车	90	3,065.40	0.00
160	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
161	603334	丰倍生物	88	2,888.16	0.00
162	688312	燕麦科技	86	2,853.48	0.00
163	300573	兴齐眼药	40	2,811.60	0.00
164	688220	翱捷科技	31	2,560.91	0.00
165	001396	誉帆科技	69	2,441.91	0.00
166	301379	天山电子	80	2,068.00	0.00
167	688349	三一重能	68	1,719.04	0.00
168	688234	天岳先进	19	1,688.72	0.00
169	688393	安必平	71	1,681.99	0.00
170	688551	科威尔	44	1,620.52	0.00
171	688005	容百科技	43	1,522.20	0.00
172	603699	纽威股份	26	1,351.22	0.00
173	603014	威高血净	28	1,109.64	0.00
174	300557	理工光科	30	1,058.70	0.00
175	688288	鸿泉技术	39	1,045.59	0.00
176	300432	富临精工	60	1,002.00	0.00
177	688080	映翰通	18	909.00	0.00
178	603037	凯众股份	60	867.60	0.00
179	003025	思进智能	58	833.46	0.00
180	688580	伟思医疗	17	822.80	0.00
181	688170	德龙激光	25	786.50	0.00
182	688571	杭华股份	89	663.05	0.00
183	002863	今飞凯达	98	575.26	0.00
184	688079	美迪凯	48	543.36	0.00
185	300932	三友联众	40	479.60	0.00
186	603499	翔港科技	20	408.80	0.00
187	600386	北巴传媒	68	298.52	0.00
188	688655	迅捷兴	15	256.95	0.00
189	603500	祥和实业	20	239.60	0.00
190	002238	天威视讯	26	211.38	0.00
191	000970	中科三环	15	203.40	0.00
192	600308	华泰股份	20	78.00	0.00
193	000402	金融街	14	38.50	0.00
194	600585	海螺水泥	1	21.86	0.00
195	001227	兰州银行	4	9.28	0.00
196	000912	泸天化	1	4.15	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	300134	大富科技	9,373,165.00	2.42
2	688182	灿勤科技	8,977,621.36	2.32
3	002376	新北洋	8,822,850.00	2.28
4	300745	欣锐科技	8,458,752.00	2.19
5	002649	博彦科技	8,379,732.00	2.17
6	002246	北化股份	8,281,819.00	2.14
7	300762	上海瀚讯	8,178,757.00	2.11
8	300925	法本信息	8,069,800.00	2.09
9	002782	可立克	7,910,160.00	2.04
10	605228	神通科技	7,832,089.00	2.02
11	300942	易瑞生物	7,727,166.46	2.00
12	688313	仕佳光子	7,631,708.95	1.97
13	688779	五矿新能	7,511,930.99	1.94
14	002448	中原内配	7,430,599.00	1.92
15	300975	商络电子	7,365,680.00	1.90
16	300047	天源迪科	7,319,962.00	1.89
17	002733	雄韬股份	7,311,315.00	1.89
18	300083	创世纪	7,266,375.00	1.88
19	601616	广电电气	7,233,783.00	1.87
20	300323	华灿光电	7,218,865.00	1.87

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。

8.4.2 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	688313	仕佳光子	9,915,201.03	2.56
2	300134	大富科技	9,462,406.00	2.44
3	300745	欣锐科技	9,387,772.00	2.43
4	002284	亚太股份	9,038,405.51	2.34
5	300435	中泰股份	8,887,588.00	2.30
6	300083	创世纪	8,705,499.00	2.25
7	002733	雄韬股份	8,620,491.00	2.23
8	300762	上海瀚讯	8,617,436.71	2.23
9	002649	博彦科技	8,273,371.00	2.14
10	002212	天融信	8,008,789.00	2.07
11	002376	新北洋	8,000,976.00	2.07
12	300975	商络电子	7,982,099.00	2.06
13	300903	科翔股份	7,813,018.00	2.02
14	002483	润邦股份	7,744,700.00	2.00

15	688182	灿勤科技	7,732,140.37	2.00
16	002782	可立克	7,688,994.00	1.99
17	300184	力源信息	7,622,201.00	1.97
18	601616	广电电气	7,552,909.00	1.95
19	000560	我爱我家	7,516,492.00	1.94
20	600367	红星发展	7,513,934.00	1.94

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。

8.4.3 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	3,792,001,789.28
卖出股票收入（成交）总额	3,933,197,242.35

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

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

通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

8.12.3 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	425,403.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	425,403.89

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 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。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 (%)
万家国证 2000 指数 增强 A	2,822	56,778.06	2,993,525.39	1.87	157,234,154.38	98.13
万家国证 2000 指数 增强 C	2,927	36,188.33	24,720,120.92	23.34	81,203,123.07	76.66
合计	5,645	47,148.08	27,713,646.31	10.41	238,437,277.45	89.59

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）。

9.2 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	万家国证 2000 指数增强 A	227,814.68	0.1422
	万家国证 2000 指数增强 C	912.74	0.0009
	合计	228,727.42	0.0859

9.3 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	万家国证 2000 指数增强 A	10~50
	万家国证 2000 指数增强 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有 本开放式基金	万家国证 2000 指数增强 A	10~50
	万家国证 2000 指数增强 C	0
	合计	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家国证 2000 指数增强 A	万家国证 2000 指数增强 C
基金合同生效日 (2023 年 9 月 26 日) 基金份额总额	623,505,338.37	493,277,104.77
本报告期期初基金份额总额	221,481,369.03	167,540,940.76
本报告期基金总申购份额	501,633,805.43	215,571,402.64
减：本报告期基金总赎回份额	562,887,494.69	277,189,099.41
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	160,227,679.77	105,923,243.99

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内由立信会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，该机构自基金合同生效日起为本基金连续提供审计服务。本报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬为人民币 30,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国信证券	2	4,879,134,135.17	63.19	956,008.45	63.33	-
中国中金财富	2	2,317,954,669.13	30.02	454,187.40	30.09	-
中信证券	3	524,125,195.76	6.79	99,325.14	6.58	-

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：证券公司具备完善的内部控制制度，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国信证券、中国中金财富证券和中信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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江苏银行为销售机构并开通转换、基金定投业务的公告	指定媒介	2025 年 1 月 8 日
2	万家国证 2000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	指定媒介	2025 年 1 月 21 日
3	万家基金管理有限公司旗下基金季度报告提示性公告	指定媒介	2025 年 1 月 21 日
4	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增顺德农商银行为销售机构并开通转换、基金定投业务的公告	指定媒介	2025 年 3 月 12 日
5	万家基金管理有限公司旗下基金年度报告提示性公告	指定媒介	2025 年 3 月 29 日
6	万家国证 2000 指数增强型证券投资基金 2024 年年度报告	指定媒介	2025 年 3 月 29 日
7	万家基金管理有限公司关于增加华西证券为旗下部分基金销售机构并开通定投及参与费率优惠活动的公告	指定媒介	2025 年 4 月 7 日
8	万家国证 2000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	指定媒介	2025 年 4 月 21 日
9	万家基金管理有限公司旗下基金季度报告提示性公告	指定媒介	2025 年 4 月 21 日
10	万家基金管理有限公司关于增加广发银行为旗下部分基金销售机构并开通定投业务及参加其费率优惠活动的公告	指定媒介	2025 年 5 月 6 日
11	万家国证 2000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	指定媒介	2025 年 7 月 18 日
12	万家基金管理有限公司旗下基金季度报告提示性公告	指定媒介	2025 年 7 月 18 日
13	万家基金管理有限公司旗下基金中期报告提示性公告	指定媒介	2025 年 8 月 29 日

14	万家国证 2000 指数增强型证券投资基金 2025 年中期报告	指定媒介	2025 年 8 月 29 日
15	万家国证 2000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	指定媒介	2025 年 10 月 25 日
16	万家基金管理有限公司旗下基金季度报告提示性公告	指定媒介	2025 年 10 月 25 日
17	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海国信嘉利基金销售有限公司为销售机构、开通转换和定投业务以及参与费率优惠活动的公告	指定媒介	2025 年 11 月 12 日
18	万家国证 2000 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	指定媒介	2025 年 11 月 14 日
19	万家国证 2000 指数增强型证券投资基金更新招募说明书(2025 年第 1 号)	指定媒介	2025 年 11 月 14 日
20	万家基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金更新招募说明书和基金产品资料概要的提示性公告	指定媒介	2025 年 11 月 14 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

§ 13 备查文件目录

13.1 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、《万家国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家国证 2000 指数增强型证券投资基金托管协议》。
- 4、万家国证 2000 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告原文。
- 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。

13.2 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。

13.3 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 3 月 30 日