

万家中证 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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 21 日（基金合同生效日）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	6
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	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 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	17
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	46

8.1 期末基金资产组合情况	46
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
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	64
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	64
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	64
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	64
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
8.12 投资组合报告附注	65
§ 9 基金份额持有人信息	65
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
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	66
§ 10 开放式基金份额变动	66
§ 11 重大事件揭示	67
11.1 基金份额持有人大会决议	67
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	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
11.4 基金投资策略的改变	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	68
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
11.8 其他重大事件	70
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	73
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	73
§ 13 备查文件目录	73
13.1 备查文件目录	73
13.2 存放地点	73
13.3 查阅方式	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家中证 2000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	万家中证 2000 指数增强	
基金主代码	019920	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 1 月 21 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	32,988,069.91 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	万家中证 2000 指数增强 A	万家中证 2000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	019920	019921
报告期末下属分级基金的份额总额	9,571,765.13 份	23,416,304.78 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、公开发行的证券公司短期公司债券投资策略；7、金融衍生产品投资策略：（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、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	中证 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通标的股票，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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	兰剑	任航
	联系电话	021-38909626	010-66060069
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008880800	95599
传真		021-38909627	010-68121816
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）	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200122	100031
法定代表人		方一天	谷澍

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 1 月 21 日(基金合同生效日) - 2025 年 12 月 31 日	
	万家中证 2000 指数增强 A	万家中证 2000 指数增强 C
本期已实现 收益	8,521,931.72	9,874,629.12
本期利润	9,069,789.69	9,103,895.12
加权平均基 金份额本期 利润	0.2953	0.2972
本期加权平 均净值利润 率	27.64%	26.11%
本期基金份 额净值增长	40.01%	39.47%

率		
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	
期末可供分配利润	3,829,385.14	9,242,266.26
期末可供分配基金份额利润	0.4001	0.3947
期末基金资产净值	13,401,150.27	32,658,571.04
期末基金份额净值	1.4001	1.3947
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	
基金份额累计净值增长率	40.01%	39.47%

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）。

4、本基金合同生效于 2025 年 1 月 21 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家中证 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	6.18%	1.08%	3.40%	1.13%	2.78%	-0.05%
过去六个月	23.11%	1.02%	17.44%	1.09%	5.67%	-0.07%
自基金合同生效起至今	40.01%	1.32%	33.83%	1.44%	6.18%	-0.12%

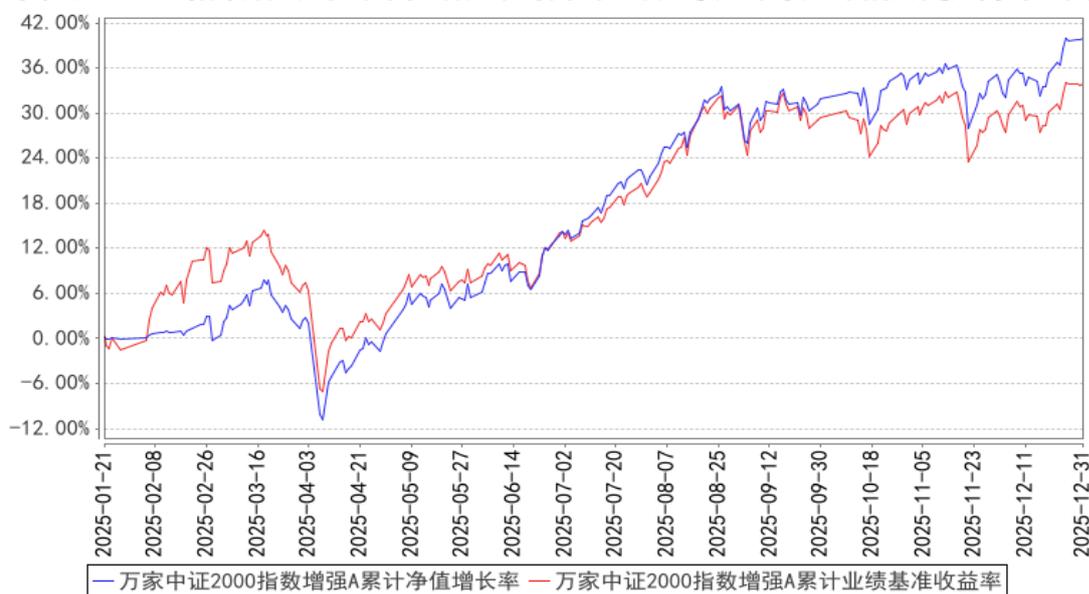
万家中证 2000 指数增强 C

阶段	份额净值	份额净值增	业绩比较	业绩比较基	①-③	②-④
----	------	-------	------	-------	-----	-----

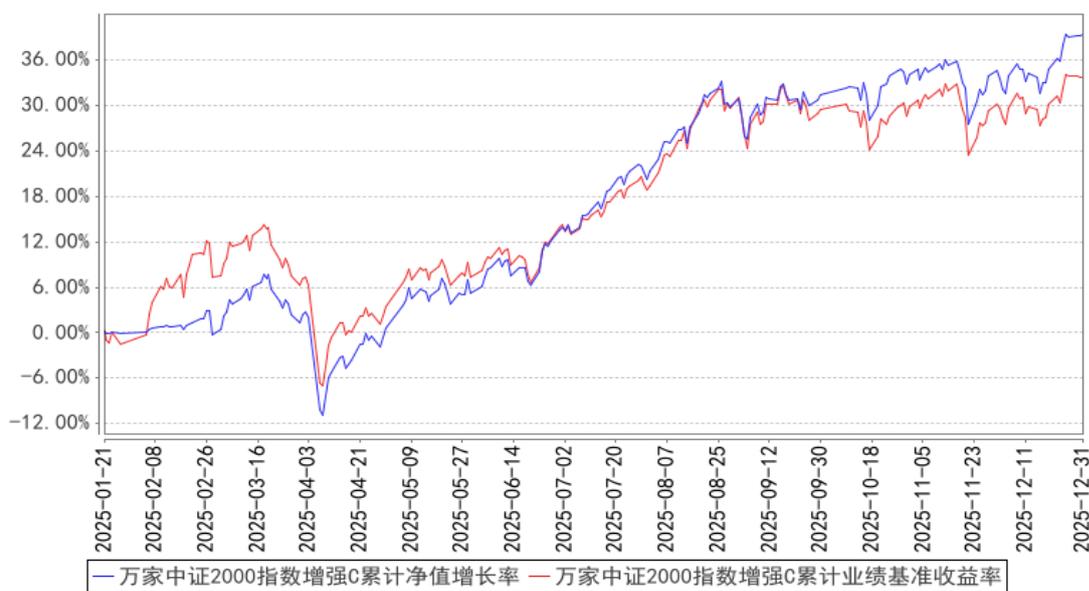
	增长率①	长率标准差 ②	基准收益 率③	准收益率标 准差④		
过去三个月	6.07%	1.08%	3.40%	1.13%	2.67%	-0.05%
过去六个月	22.86%	1.02%	17.44%	1.09%	5.42%	-0.07%
自基金合同生效 起至今	39.47%	1.32%	33.83%	1.44%	5.64%	-0.12%

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

万家中证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



万家中证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

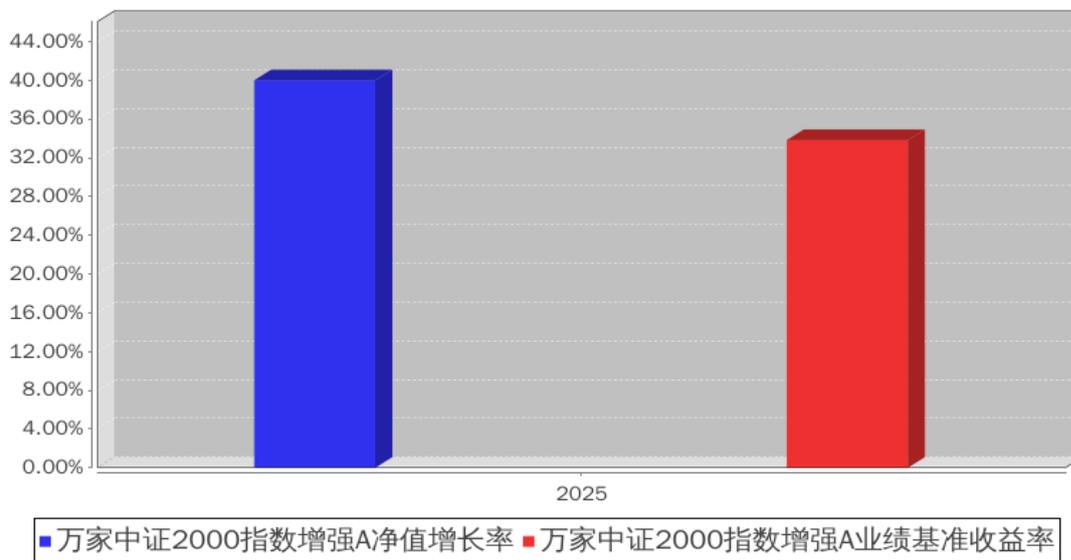


注：1、本基金合同生效日期为 2025 年 1 月 21 日，基金合同生效未满一年。

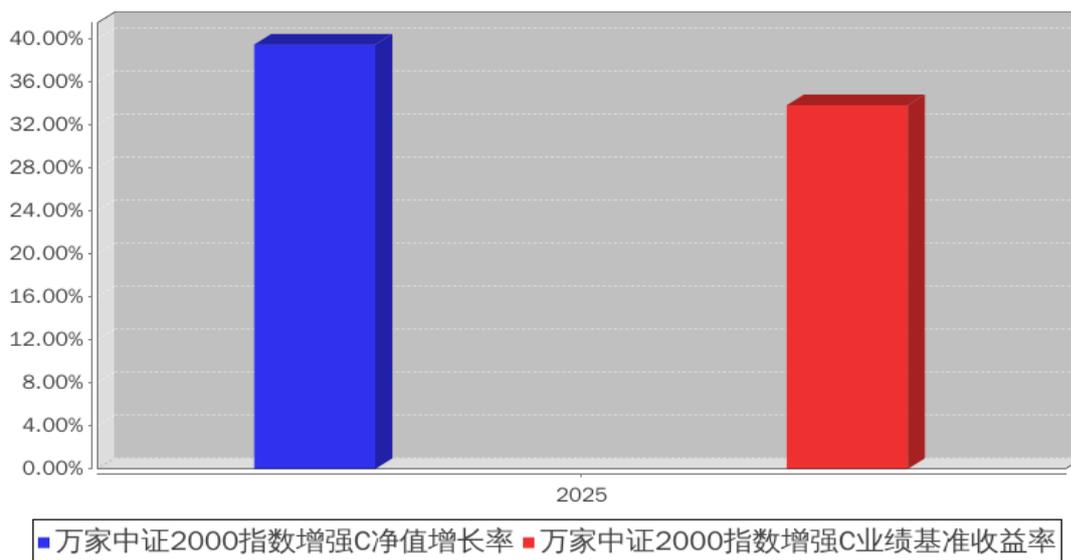
2、根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

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

万家中证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



万家中证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（2025年1月21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		
张永强	万家中证 2000 指数增强型证券投资基金、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、	2025 年 1 月 21 日	-	10.5 年	国籍：中国；学历：复旦大学基础数学专业硕士，2019 年 7 月入职万家基金管理有限公司，现任量化投资部基金经理，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。

	<p>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。</p>				
<p>乔亮</p>	<p>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</p>	<p>2025 年 1 月 21 日</p>	<p>-</p>	<p>19 年</p>	<p>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>

	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。				
--	--	--	--	--	--

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，执行交易系统内的公平交易程序；(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%以上权重为中证 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中证 2000 指数增强 A 的基金份额净值为 1.4001 元，本报告期基金份额净值增长率为 40.01%，同期业绩比较基准收益率为 33.83%；截至本报告期末万家中证 2000 指数增强 C 的基金份额净值为 1.3947 元，本报告期基金份额净值增长率为 39.47%，同期业绩比较基准收益率为 33.83%。基金报告期内 A 份额、C 份额日均跟踪偏离度分别为 0.2878%、0.2870%，年跟踪误差分别为 7.4179%、7.4122%，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，本基金自 2025 年 3 月 31 日至 2025 年 8 月 15 日连续 95 个工作日基金资产净值低于五千万元，自 2025 年 9 月 4 日至 2025 年 11 月 12 日连续 44 个工作日基金资产净值低于五千万元。在本基金连续 60 个工作日净值低于五千万元之后，且净值继续低于五千万元的期间，本基金的信息披露费、审计费、银行间账户维护费等各类固定费用，由管理人自主承担而不从本基金的资产中列支。

本报告期内，本基金的基金份额持有人数量不存在低于二百人的情况。

§ 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—万家基金管理有限公司报告期内基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，万家基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，本托管人未发现有损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，万家基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 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 ZA31422 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	万家中证 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	<p>我们审计了万家中证 2000 指数增强型证券投资基金（以下简称“万家中证 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 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>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（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，公允反映了万家中证 2000 指数增强 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<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，我们独立于万家中证 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>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>万家中证 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中证 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中证 2000 指数增强的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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</p>

	<p>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，就可能对导致对万家中证 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中证 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。</p> <p>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：万家中证 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
资产：		
货币资金	7.4.7.1	2,489,490.12

结算备付金		263,348.04
存出保证金		27,110.72
交易性金融资产	7.4.7.2	43,289,454.03
其中：股票投资		43,289,454.03
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		322,066.19
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		46,391,469.10
负债和净资产	附注号	本期末 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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		190,856.87
应付管理人报酬		33,324.42
应付托管费		6,248.33
应付销售服务费		12,103.41
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	89,214.76
负债合计		331,747.79
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	32,988,069.91
其他综合收益	7.4.7.8	-

未分配利润	7.4.7.9	13,071,651.40
净资产合计		46,059,721.31
负债和净资产总计		46,391,469.10

注：1、报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 32,988,069.91 份，其中万家中证 2000 指数增强 A 基金份额净值 1.4001 元，基金份额总额 9,571,765.13 份；万家中证 2000 指数增强 C 基金份额净值 1.3947 元，基金份额总额 23,416,304.78 份。

2、本基金基金合同生效日为 2025 年 1 月 21 日，无上年度末对比数据。

7.2 利润表

会计主体：万家中证 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 21 日（基金合同 生效日）至 2025 年 12 月 31 日
一、营业总收入		19,011,885.42
1. 利息收入		362,937.76
其中：存款利息收入	7.4.7.10	177,361.16
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		185,576.60
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		18,040,952.07
其中：股票投资收益	7.4.7.11	17,780,818.36
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.12	985.64
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-
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	259,148.07
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	-222,876.03
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	830,871.62
减：二、营业总支出		838,200.61
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	537,652.22
其中：暂估管理人报酬		-

2. 托管费	7.4.10.2.2	100,809.81
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	136,220.09
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		668.08
8. 其他费用	7.4.7.20	62,850.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		18,173,684.81
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		18,173,684.81
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		18,173,684.81

注：1、本财务报表的实际编制期间为 2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日。

2、本基金合同生效日为 2025 年 1 月 21 日，无上年度可比期间数据。

7.3 净资产变动表

会计主体：万家中证 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	291,585,062.79	-	-	291,585,062.79
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-258,596,992.88	-	13,071,651.40	-245,525,341.48
（一）、综合收益总额	-	-	18,173,684.81	18,173,684.81
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数	-258,596,992.88	-	-5,102,033.41	-263,699,026.29

(净资产减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	74,386,569.56	-	15,336,749.54	89,723,319.10
2. 基金赎回款	-332,983,562.44	-	-20,438,782.95	-353,422,345.39
(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	32,988,069.91	-	13,071,651.40	46,059,721.31

注：1、本财务报表的实际编制期间为 2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日。

2、本基金合同生效日为 2025 年 1 月 21 日，无上年度可比期间数据。

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：

方一天

陈广益

尹超

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

万家中证 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]2363 号文《关于准予万家中证 2000 指数增强型证券投资基金注册的批复》的核准，并依据中国证监会机构司函[2024]1787 号文（《关于万家中证 2000 指数增强型证券投资基金延期募集备案的回函》由万家基金管理有限公司作为基金管理人于 2025 年 1 月 6 日至 2025 年 1 月 17 日向社会公开募集，募集期结束经立信会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具信会师报字[2025]第 ZA30024 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2025 年 1 月 21 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 291,516,519.43 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 68,543.36 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 291,585,062.79 元，折合 291,585,062.79 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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、公开发行的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：中证 2000 指数收益率 \times 95%+银行活期存款利率（税后） \times 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 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间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。本期财务报表的实际编制期间系 2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日。

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业务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 类基金份额分别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
活期存款	2,489,490.12
等于：本金	2,489,106.53
加：应计利息	383.59
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	2,489,490.12

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

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	43,512,330.06	-	43,289,454.03	-222,876.03

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	43,512,330.06	-	43,289,454.03	-222,876.03

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

7.4.7.3 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。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

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

本基金本报告期末未持有各项买入返售金融资产。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

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
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	28.38
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	31,229.24
其中：交易所市场	31,229.24
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	57,957.14
合计	89,214.76

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

万家中证 2000 指数增强 A

项目	本期 2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	182,094,953.22	182,094,953.22
本期申购	16,728,582.28	16,728,582.28
本期赎回（以“-”号填列）	-189,251,770.37	-189,251,770.37
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	9,571,765.13	9,571,765.13

万家中证 2000 指数增强 C

项目	本期 2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	109,490,109.57	109,490,109.57
本期申购	57,657,987.28	57,657,987.28
本期赎回（以“-”号填列）	-143,731,792.07	-143,731,792.07
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	23,416,304.78	23,416,304.78

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

本基金本报告期无其他综合收益。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

万家中证 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
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	8,521,931.72	547,857.97	9,069,789.69
本期基金份额交易产	-4,492,241.23	-748,163.32	-5,240,404.55

生的变动数			
其中：基金申购款	3,158,799.47	-951,256.31	2,207,543.16
基金赎回款	-7,651,040.70	203,092.99	-7,447,947.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,029,690.49	-200,305.35	3,829,385.14

万家中证 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
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	9,874,629.12	-770,734.00	9,103,895.12
本期基金份额交易产生的变动数	-141,339.96	279,711.10	138,371.14
其中：基金申购款	14,209,908.96	-1,080,702.58	13,129,206.38
基金赎回款	-14,351,248.92	1,360,413.68	-12,990,835.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,733,289.16	-491,022.90	9,242,266.26

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	175,555.42
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,694.23
其他	111.51
合计	177,361.16

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

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21日（基金合同生效日）至2025年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	17,780,818.36
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	17,780,818.36
----	---------------

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

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21日（基金合同生效日）至2025年12月31日
卖出股票成交总额	542,482,010.99
减：卖出股票成本总额	524,141,274.74
减：交易费用	559,917.89
买卖股票差价收入	17,780,818.36

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月21日（基金合同生效日）至2025年12月31日
债券投资收益——利息收入	457.64
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	528.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	985.64

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月21日（基金合同生效日）至2025年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	600,331.89
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	598,164.00
减：应计利息总额	1,639.89
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	528.00

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

7.4.7.13 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。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	259,148.07
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	259,148.07

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

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 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-222,876.03
股票投资	-222,876.03
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	-222,876.03

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	827,826.33
基金转换费收入	3,045.29
合计	830,871.62

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

7.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
审计费用	3,000.00
信息披露费	54,957.14
证券出借违约金	-
银行费用	4,493.27
其他	400.00
合计	62,850.41

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

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
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

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 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	537,652.22
其中：应支付销售机构的客户维护费	260,603.73
应支付基金管理人的净管理费	277,048.49

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后，向基金托管人发送基金管理费划款指令。基金管理人可选择在次月首日起 3 个工作日内向基金托管人出具划款指令，也可授权基金托管人进行费用自动支付处理，如选择自动支付，基金管理人应确保支付当日账户余额充足，如因资金余额不足或其他原因造成自动支付无法进行，管理人应另行出具划款指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	100,809.81

注：1、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，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后，向基金托管人发送基金托管费划款指令。基金管理人可选择在次月首日起 3 个工作日内向基金托管人出具划款指令，也可授权基金托管人进行费用自动支付处理，如选择自动支付，基金管理人应确保支付当日账户余额充足，如因资金余额不足或其他原因造成自动支付无法进行，管理人应另行出具划款指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

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 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家中证 2000 指数增强 A	万家中证 2000 指数增强 C	合计
农业银行	-	100,687.01	100,687.01

万家基金	-	88.18	88.18
中泰证券	-	588.61	588.61
合计	-	101,363.80	101,363.80

注：1、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，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后，向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，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、公休日等，支付日期顺延。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

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

本基金本报告期末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。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

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

本基金本报告期末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。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

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

本基金本报告期末发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

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

本基金本报告期末无除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

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 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
农业银行	2,489,490.12	175,555.42

注：1、本基金的银行存款由基金托管人中国农业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。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方所承销的证券。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期没有需作说明的其他关联交易事项。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

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**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金的货币资金均存放于信用良好的银行，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

于 2025 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资。

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	2,489,490.12	-	-	-	-	-	2,489,490.12
结算备付金	263,348.04	-	-	-	-	-	263,348.04
存出保证金	27,110.72	-	-	-	-	-	27,110.72
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-43,289,454.03	43,289,454.03
应收申购款	5,000.03	-	-	-	-	317,066.16	322,066.19
资产总计	2,784,948.91	-	-	-	-	-43,606,520.19	46,391,469.10
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	190,856.87	190,856.87

应付管理人报酬	-	-	-	-	33,324.42	33,324.42
应付托管费	-	-	-	-	6,248.33	6,248.33
应付销售服务费	-	-	-	-	12,103.41	12,103.41
其他负债	-	-	-	-	89,214.76	89,214.76
负债总计	-	-	-	-	331,747.79	331,747.79
利率敏感度缺口	2,784,948.91	-	-	-	-43,274,772.40	46,059,721.31

注：1、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。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

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，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。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

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。

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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	43,289,454.03	93.99
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	43,289,454.03	93.99

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

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）
	股票基准指数上升100个基点	436,607.73
	股票基准指数下降100个基点	-436,607.73

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

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
第一层次	43,289,454.03
第二层次	-
第三层次	-
合计	43,289,454.03

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

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）和非公开发售等情况，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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具本期末未以第三层次公允价值计量。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本期末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

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	43,289,454.03	93.31
	其中：股票	43,289,454.03	93.31
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	2,752,838.16	5.93
8	其他各项资产	349,176.91	0.75

9	合计	46,391,469.10	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	92,156.00	0.20
B	采矿业	572,772.00	1.24
C	制造业	26,307,948.96	57.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	422,465.00	0.92
E	建筑业	108,747.00	0.24
F	批发和零售业	1,288,138.00	2.80
G	交通运输、仓储和邮政业	150,783.00	0.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,391,339.00	7.36
J	金融业	-	-
K	房地产业	166,752.00	0.36
L	租赁和商务服务业	530,977.00	1.15
M	科学研究和技术服务业	1,650,739.12	3.58
N	水利、环境和公共设施管理业	163,004.00	0.35
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	202,756.00	0.44
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	404,395.00	0.88
S	综合	-	-
	合计	35,452,972.08	76.97

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	84,064.00	0.18
B	采矿业	331,709.00	0.72
C	制造业	5,455,151.95	11.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	28,464.00	0.06
E	建筑业	286,072.00	0.62
F	批发和零售业	86,884.00	0.19

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	968,242.00	2.10
J	金融业	55,120.00	0.12
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	29,140.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	401,037.00	0.87
N	水利、环境和公共设施管理业	104,760.00	0.23
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	5,838.00	0.01
	合计	7,836,481.95	17.01

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	002527	新时达	13,300	235,942.00	0.51
2	300328	宜安科技	13,400	228,738.00	0.50
3	603936	博敏电子	17,700	224,790.00	0.49
4	600230	沧州大化	14,000	213,640.00	0.46
5	688025	杰普特	1,500	212,355.00	0.46
6	688488	艾迪药业	12,700	207,391.00	0.45
7	300139	晓程科技	6,800	206,448.00	0.45
8	002042	华孚时尚	48,400	205,700.00	0.45
9	300975	商络电子	16,200	205,578.00	0.45
10	688609	九联科技	20,100	205,221.00	0.45
11	300825	阿尔特	21,000	203,280.00	0.44
12	002659	凯文教育	34,600	202,756.00	0.44
13	688707	振华新材	14,600	202,210.00	0.44
14	002263	大东南	60,400	201,132.00	0.44
15	688299	长阳科技	11,800	199,656.00	0.43

16	002580	圣阳股份	16,000	199,040.00	0.43
17	002908	德生科技	18,900	199,017.00	0.43
18	300531	优博讯	11,000	198,440.00	0.43
19	002376	新北洋	25,400	196,088.00	0.43
20	688222	成都先导	8,300	194,635.00	0.42
21	002119	康强电子	11,800	194,346.00	0.42
22	301096	百诚医药	3,400	194,276.00	0.42
23	603787	新日股份	13,800	194,028.00	0.42
24	300572	安车检测	6,800	193,324.00	0.42
25	002886	沃特股份	8,900	193,308.00	0.42
26	301052	果麦文化	5,000	190,950.00	0.41
27	603367	辰欣药业	11,000	190,520.00	0.41
28	003015	日久光电	12,200	190,320.00	0.41
29	300541	先进数通	12,500	188,250.00	0.41
30	605196	华通线缆	5,400	187,596.00	0.41
31	605208	永茂泰	13,800	187,404.00	0.41
32	300805	电声股份	17,700	186,735.00	0.41
33	600207	安彩高科	36,100	185,915.00	0.40
34	002454	松芝股份	21,300	185,523.00	0.40
35	300340	科恒股份	15,000	184,800.00	0.40
36	603500	祥和实业	15,400	184,492.00	0.40
37	603032	德新科技	9,600	183,936.00	0.40
38	002917	金奥博	13,700	183,306.00	0.40
39	002688	金河生物	30,800	183,260.00	0.40
40	603922	金鸿顺	8,800	182,688.00	0.40
41	300510	金冠股份	44,200	182,546.00	0.40
42	301190	善水科技	8,600	182,406.00	0.40
43	300882	万胜智能	9,700	182,360.00	0.40
44	300407	凯发电气	16,000	181,120.00	0.39
45	300560	中富通	11,200	180,992.00	0.39
45	300945	曼卡龙	11,200	180,992.00	0.39
46	002997	瑞鹄模具	4,800	179,520.00	0.39
47	688238	和元生物	26,932	179,367.12	0.39
48	605228	神通科技	12,000	179,160.00	0.39
49	002250	联化科技	13,300	177,954.00	0.39
50	301161	唯万密封	4,700	177,942.00	0.39
51	301058	中粮科工	16,200	177,552.00	0.39
52	300611	美力科技	6,500	177,190.00	0.38
53	300700	岱勒新材	14,300	176,605.00	0.38
54	002722	物产金轮	11,600	174,116.00	0.38
55	300249	依米康	11,900	174,097.00	0.38
56	603126	中材节能	25,900	174,048.00	0.38
57	002731	ST 萃华	13,800	173,328.00	0.38

58	603629	利通电子	6,500	173,225.00	0.38
59	300473	德尔股份	5,800	172,724.00	0.38
60	300040	九洲集团	28,600	172,172.00	0.37
61	000822	山东海化	32,400	170,100.00	0.37
62	301132	满坤科技	5,100	169,830.00	0.37
63	605066	天正电气	23,200	169,360.00	0.37
64	000506	招金黄金	12,900	168,474.00	0.37
65	002599	盛通股份	19,700	168,238.00	0.37
66	300365	恒华科技	26,600	168,112.00	0.36
67	300016	北陆药业	21,100	167,534.00	0.36
68	300643	万通智控	8,600	167,184.00	0.36
69	002286	保龄宝	18,700	167,178.00	0.36
70	603035	常熟汽饰	10,800	167,076.00	0.36
71	688428	诺诚健华	8,100	166,212.00	0.36
72	603969	银龙股份	16,400	165,804.00	0.36
73	002609	捷顺科技	17,800	165,362.00	0.36
74	603987	康德莱	18,900	162,540.00	0.35
75	000607	华媒控股	39,100	162,265.00	0.35
76	300654	世纪天鸿	16,300	161,533.00	0.35
77	300681	英搏尔	6,400	160,384.00	0.35
78	300420	五洋自控	39,800	158,802.00	0.34
79	688550	瑞联新材	3,500	158,585.00	0.34
80	603586	金麒麟	8,300	158,364.00	0.34
81	688227	品高股份	2,400	156,024.00	0.34
82	002184	海得控制	11,900	155,771.00	0.34
83	002819	东方中科	5,700	155,667.00	0.34
84	688201	信安世纪	10,500	153,615.00	0.33
85	603949	雪龙集团	8,100	152,037.00	0.33
86	688080	映翰通	3,000	151,500.00	0.33
87	300709	精研科技	3,200	150,912.00	0.33
88	002298	中电鑫龙	14,200	148,248.00	0.32
89	300891	惠云钛业	16,800	147,840.00	0.32
90	300389	艾比森	9,100	147,693.00	0.32
91	603186	华正新材	2,900	143,840.00	0.31
92	002734	利民股份	9,000	143,460.00	0.31
93	300987	川网传媒	8,500	142,800.00	0.31
94	688678	福立旺	5,900	142,662.00	0.31
95	002552	宝鼎科技	8,600	141,986.00	0.31
96	002054	德美化工	19,100	140,958.00	0.31
97	688103	国力电子	2,300	139,357.00	0.30
98	002664	信质集团	5,800	138,968.00	0.30
99	688148	芳源股份	15,400	135,058.00	0.29
100	300219	鸿利智汇	18,700	134,827.00	0.29

101	300719	安达维尔	7,300	132,203.00	0.29
102	300956	英力股份	7,800	129,792.00	0.28
103	688365	光云科技	7,600	128,212.00	0.28
104	301082	久盛电气	7,100	127,090.00	0.28
105	002598	山东章鼓	11,800	126,142.00	0.27
106	300245	天玑科技	10,400	125,736.00	0.27
107	688595	芯海科技	3,800	124,640.00	0.27
108	002406	远东传动	15,500	123,070.00	0.27
109	600798	宁波海运	34,800	122,496.00	0.27
110	002636	金安国纪	7,300	121,983.00	0.26
111	600569	安阳钢铁	52,200	117,450.00	0.25
112	603313	梦百合	13,000	115,700.00	0.25
113	603777	来伊份	8,200	112,586.00	0.24
114	300859	西域旅游	3,000	110,910.00	0.24
115	603527	众源新材	10,000	110,900.00	0.24
116	688255	凯尔达	3,000	109,890.00	0.24
117	300278	华昌达	18,000	109,800.00	0.24
118	688593	新相微	5,400	108,972.00	0.24
119	300683	海特生物	3,900	108,147.00	0.23
120	002246	北化股份	6,000	108,120.00	0.23
121	301038	深水规院	4,600	107,870.00	0.23
122	603178	圣龙股份	5,700	107,559.00	0.23
123	688095	福昕软件	1,200	107,124.00	0.23
124	688577	浙海德曼	1,100	106,546.00	0.23
125	300382	斯莱克	6,800	105,808.00	0.23
126	301007	德迈仕	2,600	105,352.00	0.23
127	605068	明新旭腾	4,100	104,837.00	0.23
128	600397	江钨装备	13,500	102,600.00	0.22
129	002117	东港股份	7,400	102,194.00	0.22
130	002757	南兴股份	5,200	101,244.00	0.22
131	688179	阿拉丁	8,100	101,169.00	0.22
132	002283	天润工业	16,200	101,088.00	0.22
133	300619	金银河	2,300	100,970.00	0.22
134	301607	富特科技	2,500	100,275.00	0.22
135	002860	星帅尔	7,100	100,110.00	0.22
136	301110	青木科技	1,500	99,270.00	0.22
137	688280	精进电动	11,400	99,180.00	0.22
138	605277	新亚电子	4,500	99,000.00	0.21
139	300569	天能重工	17,200	98,728.00	0.21
140	002878	元隆雅图	5,400	98,388.00	0.21
141	300042	朗科科技	3,800	97,660.00	0.21
142	002165	红宝丽	12,900	97,524.00	0.21
143	002957	科瑞技术	4,500	97,425.00	0.21

144	002587	奥拓电子	14,400	97,344.00	0.21
145	688135	利扬芯片	3,500	97,160.00	0.21
146	003002	壶化股份	3,000	97,110.00	0.21
147	603336	宏辉果蔬	11,300	96,728.00	0.21
148	300830	金现代	9,500	96,710.00	0.21
149	002823	凯中精密	6,000	96,360.00	0.21
150	300430	诚益通	5,000	96,100.00	0.21
151	688512	慧智微	8,600	95,976.00	0.21
152	688202	美迪西	1,700	95,880.00	0.21
153	688207	格灵深瞳	6,300	95,760.00	0.21
154	301379	天山电子	3,700	95,645.00	0.21
155	300149	睿智医药	10,000	95,600.00	0.21
156	688799	华纳药厂	2,000	95,400.00	0.21
157	300890	翔丰华	3,200	95,360.00	0.21
158	000045	深纺织 A	7,800	95,316.00	0.21
159	603901	永创智能	6,700	95,140.00	0.21
160	300494	盛天网络	7,800	95,004.00	0.21
161	688308	欧科亿	3,000	94,920.00	0.21
162	601956	东贝集团	13,300	94,829.00	0.21
163	300092	科新机电	6,000	94,740.00	0.21
164	002334	英威腾	10,500	94,710.00	0.21
165	688059	华锐精密	1,200	94,440.00	0.21
166	603538	美诺华	4,900	94,276.00	0.20
167	605056	咸亨国际	5,700	94,050.00	0.20
168	600262	北方股份	3,600	93,708.00	0.20
169	002137	实益达	10,900	93,522.00	0.20
170	600313	农发种业	14,500	93,380.00	0.20
171	301230	泓博医药	3,100	92,597.00	0.20
172	300847	中船汉光	5,400	92,556.00	0.20
173	688531	日联科技	1,400	92,442.00	0.20
174	688373	盟科药业	15,300	92,412.00	0.20
175	603811	诚意药业	8,800	92,400.00	0.20
176	603520	司太立	9,800	92,120.00	0.20
177	002846	英联股份	5,700	91,998.00	0.20
178	000717	中南股份	35,500	91,945.00	0.20
179	603378	亚士创能	13,500	91,935.00	0.20
180	688680	海优新材	2,400	91,800.00	0.20
181	688590	新致软件	4,900	91,434.00	0.20
182	002554	惠博普	28,600	91,234.00	0.20
183	301048	金鹰重工	8,000	91,200.00	0.20
184	002660	茂硕电源	9,900	91,179.00	0.20
185	300483	首华燃气	6,400	90,752.00	0.20
186	002296	辉煌科技	8,100	90,720.00	0.20

187	600738	丽尚国潮	17,500	90,300.00	0.20
188	300745	欣锐科技	3,500	90,160.00	0.20
189	600351	亚宝药业	13,800	89,562.00	0.19
190	601086	国芳集团	8,800	89,496.00	0.19
191	002546	新联电子	12,800	89,472.00	0.19
192	603697	有友食品	7,300	89,425.00	0.19
193	002746	仙坛股份	14,700	89,229.00	0.19
194	603330	天洋新材	12,300	89,052.00	0.19
195	300858	科拓生物	5,300	88,881.00	0.19
196	688136	科兴制药	2,800	88,676.00	0.19
197	600212	绿能慧充	11,000	88,550.00	0.19
198	002952	亚世光电	4,500	88,380.00	0.19
199	002593	日上集团	14,900	88,059.00	0.19
200	002990	盛视科技	3,100	87,761.00	0.19
201	002206	海利得	15,000	87,750.00	0.19
202	603036	如通股份	4,100	87,617.00	0.19
203	000011	深物业 A	9,700	87,397.00	0.19
204	003019	宸展光电	2,600	87,048.00	0.19
205	603916	苏博特	9,200	87,032.00	0.19
206	300230	永利股份	18,200	86,996.00	0.19
207	002695	煌上煌	7,400	86,876.00	0.19
208	300120	经纬辉开	10,200	86,700.00	0.19
209	300279	和晶科技	12,000	86,640.00	0.19
210	603106	恒银科技	8,100	86,589.00	0.19
211	000601	韶能股份	18,400	86,480.00	0.19
212	688510	航亚科技	3,200	86,080.00	0.19
213	603015	弘讯科技	6,800	85,340.00	0.19
214	688508	芯朋微	1,400	85,260.00	0.19
215	600980	北矿科技	3,700	85,026.00	0.18
216	300662	科锐国际	3,300	83,589.00	0.18
217	002057	中钢天源	8,200	83,558.00	0.18
218	603138	海量数据	5,800	82,476.00	0.18
219	603115	海星股份	4,400	82,324.00	0.18
220	603912	佳力图	9,500	81,415.00	0.18
221	688636	智明达	1,900	81,396.00	0.18
222	002393	力生制药	3,700	80,327.00	0.17
223	300698	万马科技	1,900	80,047.00	0.17
224	300105	龙源技术	11,100	79,476.00	0.17
225	000014	沙河股份	5,900	79,355.00	0.17
226	688089	嘉必优	3,400	79,152.00	0.17
227	300933	中辰股份	9,500	78,755.00	0.17
228	688320	禾川科技	2,100	78,372.00	0.17
229	300872	天阳科技	3,800	78,128.00	0.17

230	300066	三川智慧	12,500	77,875.00	0.17
231	002824	和胜股份	4,000	77,600.00	0.17
232	300491	通合科技	3,000	75,390.00	0.16
233	300586	美联新材	6,800	74,052.00	0.16
234	688410	山外山	4,868	72,873.96	0.16
235	300582	英飞特	4,500	71,865.00	0.16
236	688505	复旦张江	8,600	71,380.00	0.15
237	603848	好太太	3,900	71,253.00	0.15
238	301323	新莱福	1,300	70,941.00	0.15
239	300691	联合光电	4,100	70,807.00	0.15
240	688507	索辰科技	700	70,203.00	0.15
241	300711	广哈通信	3,000	69,660.00	0.15
242	603739	蔚蓝生物	4,900	69,335.00	0.15
243	300986	志特新材	6,200	69,316.00	0.15
244	301076	新瀚新材	1,400	69,034.00	0.15
245	300515	三德科技	3,500	68,810.00	0.15
246	600731	湖南海利	10,100	68,377.00	0.15
247	301413	安培龙	500	67,400.00	0.15
248	000404	长虹华意	9,700	65,669.00	0.14
249	603002	宏昌电子	8,300	61,337.00	0.13
250	300022	吉峰科技	7,800	60,996.00	0.13
251	603058	永吉股份	6,400	59,968.00	0.13
252	002445	中南文化	22,600	58,760.00	0.13
253	300796	贝斯美	6,700	58,223.00	0.13
254	603105	芯能科技	6,300	57,897.00	0.13
255	300440	运达科技	4,700	57,857.00	0.13
256	002658	雪迪龙	6,400	57,792.00	0.13
257	001267	汇绿生态	2,600	56,940.00	0.12
258	688418	震有科技	1,300	56,524.00	0.12
259	301011	华立科技	2,100	53,949.00	0.12
260	300802	矩子科技	2,800	53,592.00	0.12
261	600825	新华传媒	8,400	51,912.00	0.11
262	601616	广电电气	13,100	50,566.00	0.11
263	688143	长盈通	1,000	50,210.00	0.11
264	300435	中泰股份	2,200	48,884.00	0.11
265	300940	南极光	1,700	48,382.00	0.11
266	688191	智洋创新	1,500	48,270.00	0.10
267	002772	众兴菌业	3,200	46,688.00	0.10
268	688579	地纬智能	4,300	46,354.00	0.10
269	301260	格力博	2,600	44,330.00	0.10
270	600626	申达股份	9,000	43,470.00	0.09
271	603067	振华股份	1,500	43,215.00	0.09
272	002989	中天精装	1,400	43,176.00	0.09

273	603061	金海通	300	42,120.00	0.09
274	603112	华翔股份	2,400	41,688.00	0.09
275	300380	安硕信息	1,000	41,370.00	0.09
276	603683	晶华新材	1,600	40,928.00	0.09
277	688039	当虹科技	900	40,275.00	0.09
278	688719	爱科赛博	900	39,735.00	0.09
279	301099	雅创电子	900	38,304.00	0.08
280	301389	隆扬电子	700	38,206.00	0.08
281	002782	可立克	2,100	38,136.00	0.08
282	000096	广聚能源	3,700	37,999.00	0.08
283	300559	佳发教育	3,000	37,830.00	0.08
284	300048	合康新能	6,300	37,485.00	0.08
285	688486	龙迅股份	500	37,155.00	0.08
286	000713	国投丰乐	5,500	36,410.00	0.08
287	001207	联科科技	1,400	35,518.00	0.08
288	002937	兴瑞科技	1,500	35,400.00	0.08
289	001896	豫能控股	6,800	35,360.00	0.08
290	002923	润都股份	2,900	35,235.00	0.08
291	002996	顺博合金	4,600	34,776.00	0.08
292	002362	汉王科技	1,600	34,624.00	0.08
293	300720	海川智能	1,000	33,890.00	0.07
294	002452	长高电新	4,100	33,743.00	0.07
295	002395	双象股份	2,000	33,460.00	0.07
296	688685	迈信林	600	33,288.00	0.07
297	300581	晨曦航空	1,900	31,331.00	0.07
298	600756	浪潮软件	1,700	31,314.00	0.07
299	301307	美利信	900	31,122.00	0.07
300	002975	博杰股份	400	30,800.00	0.07
301	688290	景业智能	500	29,720.00	0.06
302	603859	能科科技	700	29,435.00	0.06
303	300299	富春股份	4,000	28,400.00	0.06
304	605050	福然德	2,100	28,287.00	0.06
305	000153	丰原药业	4,500	28,215.00	0.06
306	603121	华培动力	1,300	27,508.00	0.06
307	600819	耀皮玻璃	3,400	27,472.00	0.06
308	000920	沃顿科技	2,200	27,390.00	0.06
309	300354	东华测试	600	27,300.00	0.06
310	002090	金智科技	2,300	27,140.00	0.06
311	603989	艾华集团	1,600	26,848.00	0.06
312	003037	三和管桩	3,300	26,730.00	0.06
313	300774	倍杰特	1,400	26,600.00	0.06
314	000025	特力A	1,500	26,190.00	0.06
315	300991	创益通	600	25,308.00	0.05

316	301150	中一科技	600	25,194.00	0.05
317	603758	秦安股份	1,400	24,346.00	0.05
318	300911	亿田智能	700	23,310.00	0.05
319	301330	熵基科技	700	23,135.00	0.05
320	300918	南山智尚	1,200	22,308.00	0.05
321	300203	聚光科技	1,400	22,204.00	0.05
322	300304	云意电气	1,900	22,116.00	0.05
323	300797	钢研纳克	1,300	22,035.00	0.05
324	300563	神宇股份	600	22,008.00	0.05
325	600722	金牛化工	3,700	21,978.00	0.05
326	300213	佳讯飞鸿	2,300	21,896.00	0.05
327	688378	奥来德	800	21,840.00	0.05
328	301266	宇邦新材	600	21,810.00	0.05
329	600769	祥龙电业	1,800	21,672.00	0.05
330	300275	梅安森	1,600	21,296.00	0.05
331	002225	濮耐股份	3,700	21,090.00	0.05
332	605305	中际联合	500	20,830.00	0.05
333	688661	和林微纳	400	20,704.00	0.04
334	300843	胜蓝股份	400	20,624.00	0.04
335	300862	蓝盾光电	900	20,592.00	0.04
336	688691	灿芯股份	200	20,396.00	0.04
337	301013	利和兴	700	19,607.00	0.04
338	688028	沃尔德	300	19,362.00	0.04
339	300927	江天化学	800	18,648.00	0.04
340	603199	九华旅游	500	18,380.00	0.04
341	603319	美湖股份	500	18,290.00	0.04
342	000957	中通客车	1,600	18,272.00	0.04
343	301391	卡莱特	200	16,970.00	0.04
344	603396	金辰股份	500	16,775.00	0.04
345	301225	恒勃股份	100	16,550.00	0.04
346	300893	松原安全	700	16,548.00	0.04
347	002919	名臣健康	700	16,093.00	0.03
348	000852	石化机械	2,200	15,994.00	0.03
349	000968	蓝焰控股	2,400	15,864.00	0.03
350	300490	华自科技	1,300	15,587.00	0.03
351	603109	神驰机电	600	15,474.00	0.03
352	603660	苏州科达	1,400	15,442.00	0.03
353	301162	国能日新	300	15,378.00	0.03
354	002955	鸿合科技	500	15,135.00	0.03
355	603286	日盈电子	200	13,832.00	0.03
356	605133	嵘泰股份	400	13,716.00	0.03
357	300835	龙磁科技	200	13,116.00	0.03
358	688621	阳光诺和	200	12,430.00	0.03

359	301209	联合化学	100	11,289.00	0.02
360	603416	信捷电气	200	11,046.00	0.02
361	300652	雷迪克	200	10,972.00	0.02
362	003041	真爱美家	200	10,866.00	0.02
363	002392	北京利尔	1,400	10,472.00	0.02
364	002662	峰璟股份	2,500	10,050.00	0.02
365	600860	京城股份	800	10,032.00	0.02
366	688401	路维光电	200	9,762.00	0.02
367	688665	四方光电	200	9,754.00	0.02
368	603855	华荣股份	500	9,675.00	0.02
369	300905	宝丽迪	300	9,669.00	0.02
370	002279	久其软件	1,200	9,588.00	0.02
371	600354	敦煌种业	1,400	9,058.00	0.02
372	002655	共达电声	700	9,044.00	0.02
373	300879	大叶股份	300	8,955.00	0.02
374	301525	儒竞科技	100	8,634.00	0.02
375	002628	成都路桥	2,100	8,631.00	0.02
376	300539	横河精密	200	8,404.00	0.02
377	300465	高伟达	400	8,052.00	0.02
378	603200	上海洗霸	100	7,114.00	0.02
379	002514	宝馨科技	1,200	7,056.00	0.02
380	300533	冰川网络	200	6,946.00	0.02
381	688312	燕麦科技	200	6,636.00	0.01
382	605319	无锡振华	300	6,312.00	0.01
383	002255	海陆重工	500	6,310.00	0.01
384	300842	帝科股份	100	5,927.00	0.01
385	300161	华中数控	200	5,808.00	0.01
386	603610	麒盛科技	300	5,715.00	0.01
387	300756	金马游乐	100	5,688.00	0.01
388	000561	烽火电子	400	4,888.00	0.01
389	300523	辰安科技	200	4,786.00	0.01
390	600571	信雅达	300	4,764.00	0.01
391	002189	中光学	200	4,618.00	0.01
392	002730	电光科技	300	4,512.00	0.01
393	300689	澄天伟业	100	4,495.00	0.01
394	300993	玉马科技	300	4,416.00	0.01
395	603626	科森科技	200	4,188.00	0.01
396	688225	亚信安全	200	3,880.00	0.01
397	688221	前沿生物	200	3,610.00	0.01
398	300916	朗特智能	100	3,278.00	0.01
399	301179	泽宇智能	100	1,581.00	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	688158	优刻得	6,700	188,203.00	0.41
2	688182	灿勤科技	6,200	183,024.00	0.40
3	603956	威派格	26,900	173,774.00	0.38
4	605118	力鼎光电	5,600	168,616.00	0.37
5	300158	振东制药	29,000	168,490.00	0.37
6	300810	中科海讯	4,400	168,432.00	0.37
7	300127	银河磁体	5,200	157,716.00	0.34
8	300732	设研院	21,000	157,500.00	0.34
9	688327	云从科技	10,500	150,885.00	0.33
10	603982	泉峰汽车	17,300	144,801.00	0.31
11	301487	盟固利	5,900	129,387.00	0.28
12	002811	郑中设计	8,300	123,172.00	0.27
13	300746	汉嘉数智	9,500	120,365.00	0.26
14	688077	大地熊	3,909	119,419.95	0.26
15	002602	世纪华通	6,400	109,184.00	0.24
16	002826	易明医药	5,800	106,604.00	0.23
17	603903	中持股份	7,200	104,760.00	0.23
18	688081	兴图新科	2,700	97,416.00	0.21
19	002812	恩捷股份	1,700	96,288.00	0.21
20	603118	共进股份	8,000	92,000.00	0.20
21	300418	昆仑万维	2,200	91,740.00	0.20
22	600810	神马股份	10,100	90,799.00	0.20
23	002487	大金重工	1,700	88,281.00	0.19
24	601515	衢州东峰	20,400	87,720.00	0.19
25	600126	杭钢股份	10,700	87,312.00	0.19
26	301158	德石股份	3,900	87,243.00	0.19
27	002326	永太科技	3,500	87,220.00	0.19
28	002836	新宏泽	5,800	86,884.00	0.19
28	600082	海泰发展	21,400	86,884.00	0.19
29	300191	潜能恒信	4,700	86,856.00	0.19
30	600478	科力远	12,600	86,814.00	0.19
31	002436	兴森科技	4,100	86,797.00	0.19
32	300073	当升科技	1,500	86,700.00	0.19
33	002402	和而泰	2,200	86,064.00	0.19
34	601020	华钰矿业	3,200	85,952.00	0.19
35	300353	东土科技	4,200	85,512.00	0.19
36	688779	五矿新能	11,400	85,386.00	0.19
37	300289	利德曼	12,200	85,034.00	0.18
38	688170	德龙激光	2,700	84,942.00	0.18
39	603218	日月股份	6,400	84,800.00	0.18
40	002017	东信和平	3,800	84,740.00	0.18
41	688128	中国电研	2,900	84,332.00	0.18

42	600097	开创国际	7,400	84,064.00	0.18
43	603089	正裕工业	6,600	83,622.00	0.18
44	000059	华锦股份	15,600	83,460.00	0.18
45	300358	楚天科技	8,500	83,215.00	0.18
46	605303	园林股份	4,800	83,040.00	0.18
47	688800	瑞可达	1,000	83,000.00	0.18
48	300925	法本信息	3,900	82,836.00	0.18
49	603059	倍加洁	2,700	81,216.00	0.18
50	688062	迈威生物	2,100	80,787.00	0.18
51	605287	德才股份	3,100	80,352.00	0.17
52	688557	兰剑智能	2,200	80,146.00	0.17
53	000988	华工科技	1,000	79,330.00	0.17
54	603185	弘元绿能	2,600	79,300.00	0.17
55	603316	诚邦股份	5,400	78,300.00	0.17
56	001337	四川黄金	2,700	75,222.00	0.16
57	603915	国茂股份	4,000	73,640.00	0.16
58	688519	南亚新材	900	72,774.00	0.16
59	688700	东威科技	2,000	70,560.00	0.15
60	688321	微芯生物	2,400	70,128.00	0.15
61	300068	南都电源	4,500	69,930.00	0.15
62	603219	富佳股份	4,100	69,044.00	0.15
63	600353	旭光电子	4,100	66,092.00	0.14
64	002965	祥鑫科技	1,600	65,088.00	0.14
65	300674	宇信科技	2,600	63,076.00	0.14
66	603100	川仪股份	2,600	59,800.00	0.13
67	001236	弘业期货	5,200	55,120.00	0.12
68	301345	涛涛车业	200	50,264.00	0.11
69	603712	七一二	2,300	47,771.00	0.10
70	002941	新疆交建	2,800	44,380.00	0.10
71	688596	正帆科技	1,400	44,282.00	0.10
72	002379	宏桥控股	1,800	43,056.00	0.09
73	000426	兴业银锡	1,200	42,720.00	0.09
74	002333	罗普斯金	7,300	41,026.00	0.09
75	300084	海默科技	4,100	40,959.00	0.09
76	300724	捷佳伟创	400	38,240.00	0.08
77	300007	汉威科技	700	37,520.00	0.08
78	603496	恒为科技	1,300	35,464.00	0.08
79	300274	阳光电源	200	34,208.00	0.07
80	001269	欧晶科技	1,400	33,712.00	0.07
81	300775	三角防务	1,100	33,440.00	0.07
82	605318	法狮龙	500	32,585.00	0.07
83	688068	热景生物	200	32,400.00	0.07
84	688543	国科军工	500	31,035.00	0.07

85	000058	深赛格	3,100	29,140.00	0.06
86	603693	江苏新能	2,400	28,464.00	0.06
87	603948	建业股份	1,000	27,300.00	0.06
88	300378	鼎捷数智	600	27,156.00	0.06
89	603151	邦基科技	1,500	27,030.00	0.06
90	601777	千里科技	2,500	26,575.00	0.06
91	688382	益方生物	900	24,516.00	0.05
92	002625	光启技术	500	24,380.00	0.05
93	603863	松炆资源	1,200	23,940.00	0.05
94	688252	天德钰	1,100	23,287.00	0.05
95	603269	海鸥股份	1,600	20,944.00	0.05
96	300861	美畅股份	1,400	20,902.00	0.05
97	002156	通富微电	500	18,850.00	0.04
98	300808	久量股份	600	18,042.00	0.04
99	300857	协创数据	100	16,868.00	0.04
100	600410	华胜天成	900	16,092.00	0.03
101	000818	航锦科技	800	15,440.00	0.03
102	605198	安德利	400	15,048.00	0.03
103	002497	雅化集团	600	14,850.00	0.03
104	600764	中国海防	500	13,670.00	0.03
105	688335	复洁科技	500	13,480.00	0.03
106	603192	汇得科技	500	13,120.00	0.03
107	688011	新光光电	200	12,768.00	0.03
108	688522	纳睿雷达	300	11,979.00	0.03
109	603119	浙江荣泰	100	11,567.00	0.03
110	300766	每日互动	300	9,831.00	0.02
111	688549	中巨芯	900	8,208.00	0.02
112	002506	协鑫集成	2,700	7,560.00	0.02
113	000833	粤桂股份	300	5,838.00	0.01
114	002276	万马股份	300	5,073.00	0.01
115	600423	柳化股份	1,200	4,464.00	0.01
116	002979	雷赛智能	100	4,207.00	0.01
117	301238	瑞泰新材	200	4,080.00	0.01
118	300600	国瑞科技	200	2,980.00	0.01
119	002265	建设工业	100	2,682.00	0.01
120	002317	众生药业	100	1,898.00	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002576	通达动力	1,613,984.00	3.50
2	600237	铜峰电子	1,463,196.00	3.18
3	603586	金麒麟	1,406,369.00	3.05

4	688418	震有科技	1,377,347.35	2.99
5	300745	欣锐科技	1,367,755.00	2.97
6	601616	广电电气	1,340,353.00	2.91
7	000823	超声电子	1,224,512.00	2.66
8	002527	新时达	1,220,556.00	2.65
9	300975	商络电子	1,193,417.00	2.59
10	002250	联化科技	1,190,728.00	2.59
11	301021	英诺激光	1,176,729.00	2.55
12	002886	沃特股份	1,156,982.00	2.51
13	002298	中电鑫龙	1,139,241.00	2.47
14	002614	奥佳华	1,134,639.00	2.46
15	002885	京泉华	1,116,677.00	2.42
16	300473	德尔股份	1,113,652.00	2.42
17	002725	跃岭股份	1,099,879.00	2.39
18	301058	中粮科工	1,097,775.00	2.38
19	002782	可立克	1,096,028.00	2.38
20	300486	东杰智能	1,091,361.00	2.37
21	002284	亚太股份	1,087,994.00	2.36
22	002483	润邦股份	1,086,724.00	2.36
23	000925	众合科技	1,084,127.00	2.35
24	688609	九联科技	1,075,615.70	2.34
25	688025	杰普特	1,074,698.89	2.33
26	002474	榕基软件	1,068,120.00	2.32
27	300245	天玑科技	1,066,778.00	2.32
28	688201	信安世纪	1,064,447.66	2.31
29	300510	金冠股份	1,059,538.00	2.30
30	300805	电声股份	1,055,941.00	2.29
31	300609	汇纳科技	1,049,224.00	2.28
32	300940	南极光	1,044,074.00	2.27
33	002579	中京电子	1,041,912.00	2.26
34	688158	优刻得	1,041,014.33	2.26
35	300824	北鼎股份	1,038,185.00	2.25
36	000850	华茂股份	1,025,933.00	2.23
37	603969	银龙股份	1,025,793.00	2.23
38	300374	中铁装配	1,023,273.00	2.22
39	600523	贵航股份	1,009,577.00	2.19
40	002659	凯文教育	1,008,345.00	2.19
41	300228	富瑞特装	1,005,940.00	2.18
42	000659	珠海中富	1,001,185.00	2.17
43	600560	金白天正	983,416.00	2.14
44	605066	天正电气	981,191.00	2.13
45	002593	日上集团	976,468.00	2.12
46	002676	顺威股份	976,442.00	2.12

47	300016	北陆药业	973,541.00	2.11
48	603527	众源新材	972,192.00	2.11
49	002362	汉王科技	970,840.00	2.11
50	603600	永艺股份	968,968.00	2.10
51	688365	光云科技	961,113.57	2.09
52	000803	山高环能	958,114.00	2.08
53	300240	飞力达	957,811.00	2.08
54	002952	亚世光电	954,479.00	2.07
55	000159	国际实业	950,670.00	2.06
56	002376	新北洋	949,296.00	2.06
57	603697	有友食品	938,825.00	2.04
58	603626	科森科技	930,316.00	2.02
59	000715	中兴商业	930,001.00	2.02
60	300546	雄帝科技	928,335.00	2.02
61	603499	翔港科技	928,081.00	2.01
62	300241	瑞丰光电	925,593.00	2.01
63	002669	康达新材	923,719.00	2.01
64	300018	中元股份	921,912.00	2.00

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002576	通达动力	1,716,460.00	3.73
2	600237	铜峰电子	1,485,732.00	3.23
3	300745	欣锐科技	1,442,947.00	3.13
4	688418	震有科技	1,405,800.02	3.05
5	601616	广电电气	1,347,183.00	2.92
6	301021	英诺激光	1,314,465.00	2.85
7	603586	金麒麟	1,303,269.00	2.83
8	000823	超声电子	1,261,726.00	2.74
9	002885	京泉华	1,239,431.00	2.69
10	300486	东杰智能	1,236,693.00	2.68
11	002614	奥佳华	1,199,378.00	2.60
12	002284	亚太股份	1,185,045.00	2.57
13	002298	中电鑫龙	1,172,133.00	2.54
14	002725	跃岭股份	1,169,077.00	2.54
15	002483	润邦股份	1,155,739.00	2.51
16	000925	众合科技	1,141,576.00	2.48
17	300940	南极光	1,098,356.00	2.38
18	002782	可立克	1,093,416.00	2.37
19	300609	汇纳科技	1,091,103.00	2.37
20	002474	榕基软件	1,088,777.00	2.36
21	603626	科森科技	1,087,281.00	2.36

22	300824	北鼎股份	1,072,148.00	2.33
23	600560	金白天正	1,070,044.00	2.32
24	002250	联化科技	1,069,729.00	2.32
25	300240	飞力达	1,068,088.00	2.32
26	002527	新时达	1,062,551.00	2.31
27	300228	富瑞特装	1,059,581.00	2.30
28	002579	中京电子	1,045,921.00	2.27
29	300374	中铁装配	1,045,559.30	2.27
30	000850	华茂股份	1,034,867.00	2.25
31	300975	商络电子	1,026,147.00	2.23
32	000659	珠海中富	1,021,546.00	2.22
33	002676	顺威股份	1,015,380.00	2.20
34	002886	沃特股份	1,011,884.00	2.20
35	301058	中粮科工	1,011,521.00	2.20
36	000803	山高环能	1,010,132.00	2.19
37	600523	贵航股份	1,008,668.00	2.19
38	002162	悦心健康	1,006,052.00	2.18
39	002379	宏桥控股	989,395.00	2.15
40	300018	中元股份	974,776.00	2.12
41	688201	信安世纪	967,876.86	2.10
42	300543	朗科智能	967,481.00	2.10
43	002593	日上集团	965,785.00	2.10
44	002769	普路通	961,411.00	2.09
45	300473	德尔股份	959,687.00	2.08
46	300510	金冠股份	957,503.00	2.08
47	300968	格林精密	956,532.00	2.08
48	000159	国际实业	953,524.98	2.07
49	002669	康达新材	949,385.00	2.06
50	002362	汉王科技	947,476.00	2.06
51	688662	富信科技	947,385.38	2.06
52	688025	杰普特	941,032.24	2.04
53	300903	科翔股份	940,825.00	2.04
54	603600	永艺股份	939,777.00	2.04
55	300637	扬帆新材	939,706.00	2.04
56	000715	中兴商业	938,278.00	2.04
57	301013	利和兴	935,805.00	2.03
58	688365	光云科技	931,588.55	2.02
59	601116	三江购物	931,152.00	2.02
60	603386	骏亚科技	928,852.00	2.02
61	002297	博云新材	928,163.00	2.02
62	003010	若羽臣	925,848.00	2.01
63	600619	海立股份	924,559.00	2.01

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	567,653,604.80
卖出股票收入（成交）总额	542,482,010.99

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	27,110.72
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	322,066.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	349,176.91

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 (%)
万家中证 2000 指数 增强 A	681	14,055.46	-	-	9,571,765.13	100.00
万家中证 2000 指数 增强 C	3,070	7,627.46	-	-	23,416,304.78	100.00
合计	3,693	8,932.59	-	-	32,988,069.91	100.00

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	万家中证 2000 指数增强 A	201,543.38	2.1056
	万家中证 2000 指数增强 C	-	-
	合计	201,543.38	0.6110

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	万家中证 2000 指数增强 A	10~50
	万家中证 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	万家中证 2000 指数增强 A	10~50
	万家中证 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	万家中证 2000 指数增强 A	万家中证 2000 指数增强 C
基金合同生效日 (2025 年 1 月 21 日) 基金份额总额	182,094,953.22	109,490,109.57

基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	16,728,582.28	57,657,987.28
减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	189,251,770.37	143,731,792.07
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	9,571,765.13	23,416,304.78

§ 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

基金管理人：

报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

基金托管人：

2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。

2025 年 3 月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。

2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

2025 年 9 月，中国农业银行总行决定蔡崎峰任托管业务部总裁。

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 3,000.00 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，本基金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，本基金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 (%)	
银河证券	2	950,727,296.62	85.64	186,257.74	85.64	-
方正证券	1	96,773,131.77	8.72	18,958.56	8.72	-
中信建投	1	62,635,187.40	5.64	12,270.68	5.64	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
金融街证券	2	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	3	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-

甬兴证券	1	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

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、基金专用交易席位的变更情况：

本基金为本报告期内成立的基金，上述席位均为新增交易单元。

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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
银河证券	1,196,856.00	100.00	332,000,000.00	100.00	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

诚通证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国泰海 通证券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
江海证 券	-	-	-	-	-	-
金融街 证券	-	-	-	-	-	-
联储证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
甬兴证 券	-	-	-	-	-	-

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	关于新增苏州银行为万家中证 2000 指数增强型证券投资基金销售机构的公告	指定媒介	2025 年 1 月 3 日
2	关于新增中信银行股份有限公司为万家中证 2000 指数增强型证券投资基金销售机构的公告	指定媒介	2025 年 1 月 3 日
3	关于新增华鑫证券等机构为万家中证 2000 指数增强型证券投资基金销售机构的公告	指定媒介	2025 年 1 月 6 日
4	关于新增方正证券为万家中证 2000 指数增强型证券投资基金销售机构的公告	指定媒介	2025 年 1 月 8 日

5	关于新增中银国际证券为万家中证 2000 指数增强型证券投资基金销售机构的公告	指定媒介	2025 年 1 月 8 日
6	关于新增上海浦东发展银行股份有限公司为万家中证 2000 指数增强基金销售机构的公告	指定媒介	2025 年 1 月 8 日
7	关于新增东方证券为万家中证 2000 指数增强型证券投资基金销售机构的公告	指定媒介	2025 年 1 月 8 日
8	关于新增东莞银行为万家中证 2000 指数增强型证券投资基金销售机构的公告	指定媒介	2025 年 1 月 9 日
9	关于新增上海证券为万家中证 2000 指数增强型证券投资基金销售机构的公告	指定媒介	2025 年 1 月 13 日
10	万家中证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	指定媒介	2025 年 1 月 22 日
11	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在开源证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2025 年 2 月 18 日
12	关于万家中证 2000 指数增强型证券投资基金开放申购、赎回、基金转换及定期定额投资业务的公告	指定媒介	2025 年 2 月 19 日
13	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
14	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
15	万家中证 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
16	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
17	万家基金管理有限公司关于增加邮储银行为旗下部分基金销售机构并开通定投业务的公告	指定媒介	2025 年 5 月 17 日
18	万家基金管理有限公司关于增加宁波银行为旗下部分基金销售机构并开通定投业务的公告	指定媒介	2025 年 6 月 18 日
19	万家中证 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
20	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

21	万家基金管理有限公司关于增加中国人寿为旗下部分基金销售机构并开通转换、定投业务的公告	指定媒介	2025 年 7 月 19 日
22	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
23	万家中证 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
24	万家基金管理有限公司关于增加招商银行为旗下部分基金销售机构并开通转换、定投业务的公告	指定媒介	2025 年 9 月 22 日
25	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
26	万家中证 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
27	万家基金管理有限公司关于旗下基金新增北京汇成基金销售有限公司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 11 月 10 日
28	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
29	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 25 日
30	万家中证 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 25 日
31	万家中证 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 25 日
32	万家基金管理有限公司关于以通讯方式召开万家中证 2000 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	指定媒介	2025 年 12 月 24 日
33	万家基金管理有限公司关于以通讯方式召开万家中证 2000 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	指定媒介	2025 年 12 月 25 日
34	万家基金管理有限公司关于以通讯方式召开万家中证 2000 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	指定媒介	2025 年 12 月 26 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

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 (%)
个人	1	20250520-20250527	8,000,333.33	-	8,000,333.33	-	-
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p>							

§ 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、《万家中证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家中证 2000 指数增强型证券投资基金托管协议》。
- 4、万家中证 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