

万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资
基金
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 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。本中期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 2024 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	57
7.1 期末基金资产组合情况	57
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	59
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	70
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	70

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	70
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	70
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	70
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	70
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
7.12 投资组合报告附注	70
§ 8 基金份额持有人信息	72
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	72
8.2 期末上市基金前十名持有人	72
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73
8.4 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	73
§ 9 开放式基金份额变动	73
§ 10 重大事件揭示	74
10.1 基金份额持有人大会决议	74
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	74
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	74
10.4 基金投资策略的改变	74
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	74
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	74
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	74
10.8 其他重大事件	76
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	77
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	77
§ 12 备查文件目录	77
12.1 备查文件目录	77
12.2 存放地点	77
12.3 查阅方式	78

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	万家国证 2000ETF
场内简称	国证 2000ETF
基金主代码	159628
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 6 月 29 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	941,283,250.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2022 年 7 月 18 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	1、股票投资策略；2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、可转换债券与可交换债券投资策略；6、股指期货投资策略；7、国债期货投资策略；8、股票期权投资策略；9、参与融资与转融通证券出借业务策略；10、其他。
业绩比较基准	国证 2000 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用最优化抽样复制策略，跟踪国证 2000 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	万家基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	兰剑
	联系电话	021-38909626
	电子邮箱	lanj@wjasset.com
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	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
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	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.wjasset.com
基金中期报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）基金管理人办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	-245,837,961.07
本期利润	-272,832,612.03
加权平均基金份额本期利润	-0.1767
本期加权平均净值利润率	-20.67%
本期基金份额净值增长率	-18.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	-196,719,355.35
期末可供分配基金份额利润	-0.2090
期末基金资产净值	744,563,894.65
期末基金份额净值	0.7910
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-20.90%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

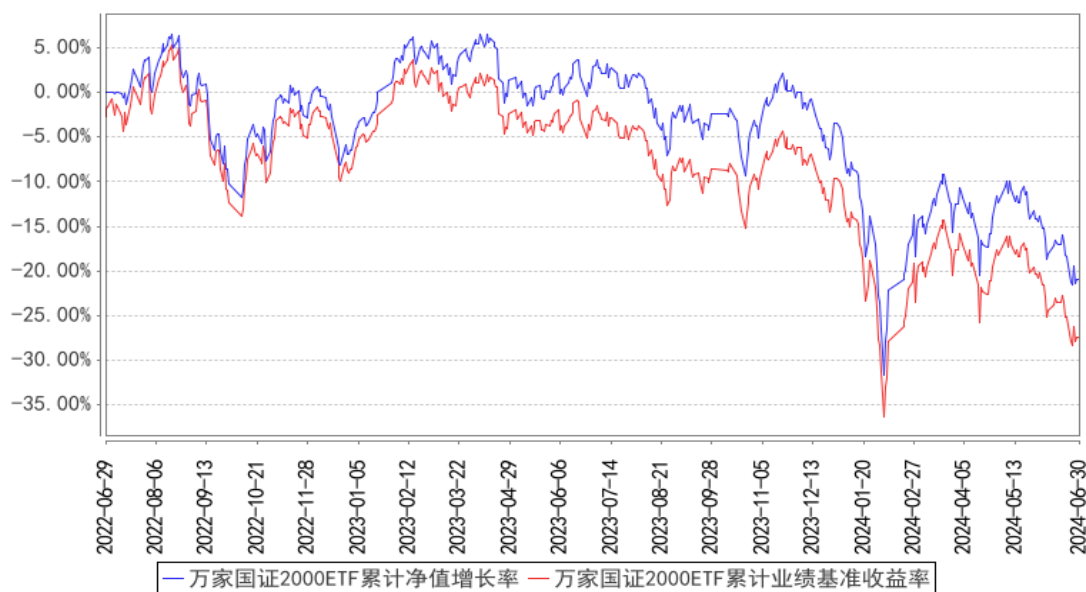
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④

过去一个月	-8.11%	1.51%	-8.98%	1.58%	0.87%	-0.07%
过去三个月	-9.63%	1.64%	-11.89%	1.68%	2.26%	-0.04%
过去六个月	-18.06%	2.08%	-19.67%	2.12%	1.61%	-0.04%
过去一年	-23.12%	1.62%	-25.85%	1.65%	2.73%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-20.90%	1.38%	-27.38%	1.43%	6.48%	-0.05%

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2000ETF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 2022 年 6 月 29 日成立，根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44 号文批准设立。截至报告期末，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），办公地点：上海市浦东新区浦电路 360 号 9 楼,注册资本 3 亿元人民币。截至报告期末，公司共管理一百五十二只开放式基金，分别为万家 180 指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证

券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金（LOF）、万家添利债券型证券投资基金（LOF）、万家新机遇价值驱动灵活配置混合型证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家上证 50 交易型开放式指数证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞和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、万家颐和灵活配置混合型证券投资基金、万家恒瑞 18 个月定期开放债券型证券投资基金、万家鑫安纯债债券型证券投资基金、万家鑫璟纯债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、万家家享中短债债券型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家 1-3 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家瑞隆混合型证券投资基金、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家现金增利货币市场基金、万家消费成长股票型证券投资基金、万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家玖盛纯债 9 个月定期开放债券型证券投资基金、万家天添宝货币市场基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、万家家瑞债券型证券投资基金、万家臻选混合型证券投资基金、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金、万家成长优选灵活配置混合型证券投资基金、万家经济新动能混合型证券投资基金、万家潜力价值灵活配置混合型证券投资基金、万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家新机遇龙头企业灵活配置混合型证券投资基金、万家智造优势混合型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型证券投资基金、万家人工智能混合型证券投资基金、万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金（LOF）、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、万家平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、万家科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、万家鑫盛纯债债券型证券投资基金、万家民安增利 12 个月定期开放债券型证券投资基金、万家汽车新趋势混合型证券投资基金、万家惠享 39 个月定期开放债券型证券投资基金、万家科技创新混合型证券投资基金、万家自主创新混合型证券投资基金、万家民丰回报一年持有期混合型证券投资基金、万家可转债债券型证券投资基金、万家民瑞祥和 6 个月持有期债券型证券投资基金、万家价值优势一年持有期混合型证

券投资基金、万家养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、万家鑫动力月月购一年滚动持有混合型证券投资基金、万家科创板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家创业板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家周期优势企业混合型证券投资基金、万家健康产业混合型证券投资基金、万家互联互通中国优势量化策略混合型证券投资基金、万家战略发展产业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、万家陆家嘴金融城金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家内需增长一年持有期混合型证券投资基金、万家互联互通核心资产量化策略混合型证券投资基金、万家民瑞祥明 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家瑞泽回报一年持有期混合型证券投资基金、万家惠裕回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家悦兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金、万家稳鑫 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、万家全球成长一年持有期混合型证券投资基金 (QDII)、万家沪港深蓝筹混合型证券投资基金、万家北交所慧选两年定期开放混合型证券投资基金、万家鼎鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家新机遇成长一年持有期混合型发起式证券投资基金、万家港股通精选混合型证券投资基金、万家景气驱动混合型证券投资基金、万家安恒纯债 3 个月持有期债券型发起式证券投资基金、万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫橙纯债债券型证券投资基金、万家聚优稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF) 、万家新能源主题混合型发起式证券投资基金、万家中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、万家匠心致远一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫融纯债债券型证券投资基金、万家颐远均衡一年持有期混合型发起式证券投资基金、万家鑫耀纯债债券型证券投资基金、万家欣远混合型证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家惠利债券型证券投资基金、万家鑫怡债券型证券投资基金、万家优享平衡混合型发起式证券投资基金、万家洞见进取混合型发起式证券投资基金、万家沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、万家中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金、万家沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家元贞量化选股股票型证券投资基金、万家 CFETS0-3 年期政策性金融债指数证券投资基金、万家中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家先进制造混合型发起式证券投资基金、万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金、万家颐德一年持有期混合型证券投资基金、万家北证 50 成份指数型发起式证券投资基金、万家恒生互联网科技业指数型发起式证券投资基金 (QDII)、万家中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家欣优混合型证券投资基金、万家集利债券型发起式证券投资基金、万家远见先锋一年持有期混合型证券投资基金、万家国证 2000 指数增强型证券投资基金、万家纳斯达克 100 指数型

发起式证券投资基金（QDII）、万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金、万家稳安 60 天持有期债券型证券投资基金、万家周期驱动股票型发起式证券投资基金、万家优选积极三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、万家养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、万家红利量化选股混合型发起式证券投资基金、万家医药量化选股混合型发起式证券投资基金、万家锦利债券型发起式证券投资基金、万家高端装备量化选股混合型发起式证券投资基金、万家趋势领先混合型证券投资基金、万家稳航 90 天持有期债券型证券投资基金、万家中证红利交易型开放式指数证券投资基金、万家惠诚回报平衡一年持有期混合型证券投资基金、万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家国企动力混合型证券投资基金、万家 CFETS 0-3 年期山东省国有企业信用债精选指数发起式证券投资基金、万家稳丰 6 个月持有期债券型证券投资基金、万家研究领航混合型证券投资基金、万家中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨坤	万家 180 指数证券投资基金、万家上证 50 交易型开放式指数证券投资基金、万家中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金、万家中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、	2022 年 6 月 29 日	-	9.5 年	国籍：中国；学历：法国南特国立高等矿业学校自动化及工业信息技术专业硕士，2015 年 6 月入职万家基金管理有限公司，现任量化投资部基金经理，历任量化投资部研究员。曾任 Fractable 量化 IT 工程师等职。

	<p>万家中证红利交易型开放式指数证券投资基金、万家中证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、万家中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金、万家中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金、万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家北证 50 成份指数型发起式证券投资基金、万家国证 2000 交易</p>				
--	--	--	--	--	--

<p>型开放式指数证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金、万家恒生互联网科技业指数型发起式证券投资基金 (QDII)、万家沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、万家沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) 的基金经理。</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。

4.2 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 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《公平交易管理办法》和《异常交易监控及报告管理办法》等规章制度，涵盖了研究、授权、投资决策和交易执行等投资管理活动的各个环节，确保公平对待不同投资组合，防范导致不公平交易以及利益输送的异常交易发生。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司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 9 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

2024 年上半年，A 股呈现震荡行情，基本面疲弱是制约市场上行的主因。1 月份，随着指数

下挫，雪球、杠杆资金等资管产品平仓压力加剧，流动性负反馈愈演愈烈，沪指大幅下探、最低触及 2635 点，微盘领跌。2 月 6 日，类平准基金发力托底、宏观基本面“开门红”等一系列催化共同助力，指数开始迎来反弹，沪指于 2 月下旬收复年初以来跌幅并向上突破。行至二季度，宏观基本面的亮眼表现未能延续，指数表现受基本面影响。到了 4 月下旬，以房地产宽松为代表的稳增长政策预期驱动指数冲高，但具体政策落地后快速迎来兑现，反映市场对经济预期仍然保持谨慎，市场延续震荡。2024H1 本基金投资标的指数——国证 2000 指数收益率为-19.67 %。

本基金作为被动投资的指数基金，其投资目标是通过跟踪、复制国证 2000 指数，为投资者获取市场长期的平均收益。报告期内我们严格按照基金合同规定，努力拟合标的指数，减小跟踪误差，将基金跟踪误差控制在较低范围之内。同时，本基金采用有效的量化跟踪技术，降低管理成本。导致跟踪误差的主要原因是基金参与新股申购、申购现金替代、标的指数成分股调整、参与转融通证券出借、成分股分红、停牌等因素。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家国证 2000ETF 的基金份额净值为 0.7910 元，本报告期基金份额净值增长率为-18.06%，同期业绩比较基准收益率为-19.67%。基金报告期内日跟踪偏离度为 0.1153%，年化跟踪误差为 2.4506%。跟踪误差较大的原因主要为产品申购赎回比例较大，造成仓位被动变化以及加减仓、调仓交易较多，且指数本身在此区间波动加大，使得跟踪误差产生放大。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，对于拐点的讨论可能迈入新的阶段、指数震荡筑底后有望上行。当前基本面信心的扰动因素主要包括两方面，一是国内财政发力的政策力度，二是海外宽货币进程与国内跟进力度。上述因素后续均有望边际缓解，带动市场信心回暖。首先，近期 3000 亿大规模设备更新和消费品以旧换新政策落地，超长期特别国债的安排反映中央财政承担权重提升。其次，美联储 9 月降息仍是大概率，而近期央行宽货币频率和力度增加，跟进海外宽松态度相对确定。

本基金将继续贯彻被动投资理念，恪守基金合同规定的投资目标和投资策略，一如既往地规范、勤勉运作，将本基金打造为稳定有效的指数投资工具，为基金份额持有人谋求长期、稳定回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了估值委员会，定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。估值委员会由负责估值业务的分管领导、合规稽核部负责人、基金运营部负责人、相关估值业务岗位人员、相关风控人员等组成。估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉政策法规，并具有丰富的实

践经验。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不介入基金日常估值业务。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中债金融估值中心有限公司签署了《中债信息产品服务协议》，本基金管理人与中证指数有限公司签署了《中证债券估值数据服务协议》、《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对万家基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	15,736,020.51	52,520,430.59
结算备付金		1,273,235.63	2,251,570.11
存出保证金		875,330.91	369,949.77
交易性金融资产	6.4.7.2	734,320,663.65	2,169,748,022.58
其中：股票投资		734,320,663.65	2,169,748,022.58
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		17,572.15	2,924,160.08
应收股利		134,021.37	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	134,728.89	120,947.09
资产总计		752,491,573.11	2,227,935,080.22
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		6,304,334.64	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		318,235.00	827,278.48
应付托管费		63,647.01	165,455.69
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5,262.79	11,794.92
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,236,199.02	12,195,149.02
负债合计		7,927,678.46	13,199,678.11
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	941,283,250.00	2,294,283,250.00
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	-196,719,355.35	-79,547,847.89
净资产合计		744,563,894.65	2,214,735,402.11
负债和净资产总计		752,491,573.11	2,227,935,080.22

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7910 元，基金份额总额 941,283,250.00 份。

6.2 利润表

会计主体：万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-268,623,140.69	25,806,227.54
1. 利息收入		2,345,392.09	233,253.17
其中：存款利息收入	6.4.7.10	89,319.21	20,675.79
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		2,256,072.88	212,577.38
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-251,968,866.89	12,130,936.24
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-260,531,227.41	8,211,940.72
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-

衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	8,562,360.52	3,918,995.52
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-26,994,650.96	12,817,155.03
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	7,994,985.07	624,883.10
减：二、营业总支出		4,209,471.34	1,464,029.67
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,360,608.22	1,086,839.59
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	672,121.66	217,367.96
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		8,126.81	765.61
8. 其他费用	6.4.7.20	168,614.65	159,056.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-272,832,612.03	24,342,197.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-272,832,612.03	24,342,197.87
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-272,832,612.03	24,342,197.87

注：上年度可比期间利润表中“证券出借利息收入”项目与“其他利息收入”项目合并列示在“其他利息收入”项目中。

6.3 净资产变动表

会计主体：万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	2,294,283,250.00	-	-79,547,847.89	2,214,735,402.11
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,294,283,250.00	-	-79,547,847.89	2,214,735,402.11
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,353,000,000.00	-	-117,171,507.46	-1,470,171,507.46
(一)、综合收益总额	-	-	-272,832,612.03	-272,832,612.03
(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)	-1,353,000,000.00	-	155,661,104.57	-1,197,338,895.43
其中：1. 基金申购款	2,226,000,000.00	-	-403,377,640.60	1,822,622,359.40
2. 基金赎回款	-3,579,000,000.00	-	559,038,745.17	-3,019,961,254.83
(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	941,283,250.00	-	-196,719,355.35	744,563,894.65
项目	上年度可比期间			
	2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	272,283,250.00	-	-17,576,469.45	254,706,780.55
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	272,283,250.00	-	-17,576,469.45	254,706,780.55
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	486,000,000.00	-	39,498,687.94	525,498,687.94
(一)、综合收益总额	-	-	24,342,197.87	24,342,197.87
(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)	486,000,000.00	-	15,156,490.07	501,156,490.07
其中：1. 基金申购款	867,000,000.00	-	24,484,910.72	891,484,910.72
2. 基金赎回款	-381,000,000.00	-	-9,328,420.65	-390,328,420.65
(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	758,283,250.00	-	21,922,218.49	780,205,468.49

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2022]473 号文《关于准予万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的核准，由万家基金管理有限公司作为基金管理人于 2022 年 6 月 14 日至 2022 年 6 月 24 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[2022]第 ZA31047 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 2022 年 6 月 29 日生效，本基金为交易型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 845,244,000.00 元（现金部分），有效认购资金在基金验资确认日之前产生的利息为人民币 39,250.00 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 845,283,250.00 元，折合 845,283,250.00 份基金份额。本基金目前暂不开通网下股票认购业务。本基金的基金管理人为万家基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货、股票期权、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即国证 2000 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本中期报告所采用的会计政策、会计估计与上年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

(一) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》的规定，基金通过深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税；

根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(二) 增值税

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、地方政府债券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。

(三) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定, 自 2004 年 1 月 1 日起, 对证券投资基金 (封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金) 管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入, 继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定, 股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等

收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(四) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》的规定，对基金通过深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	15,736,020.51
等于：本金	15,734,629.94
加：应计利息	1,390.57
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	15,736,020.51

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	821,922,416.01	-	734,320,663.65	-87,601,752.36
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	821,922,416.01	-	734,320,663.65	-87,601,752.36

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应收利息	-
其他应收款	59,319.77
待摊费用	75,409.12
合计	134,728.89

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,022,712.90
其中：交易所市场	1,022,712.90
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	213,486.12
合计	1,236,199.02

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,294,283,250.00	2,294,283,250.00
本期申购	2,226,000,000.00	2,226,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-3,579,000,000.00	-3,579,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	941,283,250.00	941,283,250.00

6.4.7.8 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	107,356,301.80	-186,904,149.69	-79,547,847.89

加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	107,356,301.80	-186,904,149.69	-79,547,847.89
本期利润	-245,837,961.07	-26,994,650.96	-272,832,612.03
本期基金份额交易产生的变动数	46,779,702.26	108,881,402.31	155,661,104.57
其中：基金申购款	-37,870,759.57	-365,506,881.03	-403,377,640.60
基金赎回款	84,650,461.83	474,388,283.34	559,038,745.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-91,701,957.01	-105,017,398.34	-196,719,355.35

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入	50,302.79	
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	33,209.00	
其他	5,807.42	
合计	89,319.21	

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	-128,525,040.21	
股票投资收益——赎回差价收入	-132,006,187.20	
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	-260,531,227.41	

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额	1,564,402,013.93	
减：卖出股票成本总额	1,689,474,488.58	
减：交易费用	3,452,565.56	
买卖股票差价收入	-128,525,040.21	

6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	3,019,961,254.83
减：现金支付赎回款总额	1,361,979,139.83
减：赎回股票成本总额	1,789,988,302.20
减：交易费用	-
赎回差价收入	-132,006,187.20

6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	8,562,360.52
其中：证券出借权益补偿收入	1,401,634.53
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,562,360.52

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-26,994,650.96
股票投资	-26,994,650.96
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	-26,994,650.96

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	7,994,985.07
合计	7,994,985.07

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	23,869.30
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	537.65
中登登记结算服务费	74,590.88
IOPV 计算服务费	9,944.48
合计	168,614.65

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

2024年2月20日，基金管理人万家基金管理有限公司控制的上海万家朴智投资管理有限公司已办理完成工商注销手续。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司（“万家基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银	基金托管人

行”)	
中泰证券股份有限公司(“中泰证券”)	基金管理人的股东
万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(“万家国证 2000ETF 发起式联接”)	本基金的联接基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
中泰证券	-	-	223,430,887.22	24.79

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
中泰证券	200,264.45	27.34	178,595.44	37.03

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,360,608.22	1,086,839.59
其中：应支付销售机构的客户维护费	392,119.78	49,841.53
应支付基金管理人的净管理费	2,968,488.44	1,036,998.06

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	672,121.66	217,367.96

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人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付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
万家国证 2000ETF 发起 式联接	39,203,106.00	4.1649	134,243,106.00	5.8512

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	15,736,020.51	50,302.79	22,438,213.33	13,315.74

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方所承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间没有需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001359	平安电工	2024年3月19日	6个月	新股流通受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001387	雪祺电气	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	11.82	15.25	173	2,045.54	2,638.25	含转增股
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	新股流通受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇成真空	2024年5月28日	6个月	新股流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024年1月26日	6个月	新股流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024年3月20日	6个月	新股流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301539	宏鑫科技	2024年4月3日	6个月	新股流通受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱	2024	6个月	新股	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-

	迪特	年6月19日		流通受限						
301587	中瑞股份	2024年3月27日	6个月	新股流通受限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
301588	美新科技	2024年3月6日	6个月	新股流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	6个月	新股流通受限	70.48	188.01	1,244	87,680.99	233,884.44	含转增股
301591	肯特股份	2024年2月20日	6个月	新股流通受限	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
601033	永兴股份	2024年1月11日	6个月	新股流通受限	16.20	15.96	1,258	20,379.60	20,077.68	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股流通受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股流通受限	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新股流通受限	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙	2024	6个月	新股	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-

	旗科技	2024年2月23日		流通受限						
603344	星德胜	2024年3月13日	6个月	新股流通受限	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603375	盛景微	2024年1月17日	6个月	新股流通受限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
688530	欧莱新材	2024年4月29日	6个月	新股流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024年2月1日	6个月	新股流通受限	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月	新股流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股流通受限	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新股流通受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024年1月31日	6个月	新股流通受限	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	-----	------	------	--------	-----	-------	-------	--------	--------	----

	称				期					
002288	*ST 超华	2024年6月27日	重大事项	0.00	-	-	962,700	3,301,886.91	0.00	-

注：截止 2024 年 6 月 30 日，本基金合计持有*ST 超华（股票代码：002288）962,700 股。于 2024 年 6 月 27 日，*ST 超华（股票代码：002288）发布关于公司股票将被终止上市暨停牌的风险提示公告。依据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》的规定，经与相关基金托管行协商一致，万家基金管理有限公司决定于 2024 年 6 月 27 日起对旗下指数基金所持有的“*ST 超华”（股票代码：002288）按照人民币 0.00 元进行估值。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	000036	华联控股	2024年7月2日-2024年7月9日	3.24	135,000	437,400.00
2	000099	中信海直	2024年7月2日-2024年7月9日	16.24	16,300	264,712.00
3	000422	湖北宜化	2024年7月2日-2024年7月9日	11.92	31,600	376,672.00
4	000521	长虹美菱	2024年7月2日-2024年7月9日	7.58	29,700	225,126.00
5	000531	穗恒运A	2024年7月2日-2024年7月9日	5.35	71,700	383,595.00
6	000543	皖能电力	2024年7月2日-2024年7月9日	8.85	44,100	390,285.00
7	000551	创元科技	2024年7月2日-2024年7月9日	8.73	46,200	403,326.00
8	000603	盛达资源	2024年7月2日-2024年7月9日	11.83	19,200	227,136.00

9	000607	华媒控股	2024年7月2日-2024年7月9日	3.09	135,100	417,459.00
10	000612	焦作万方	2024年7月2日-2024年7月9日	6.50	48,800	317,200.00
11	000657	中钨高新	2024年7月2日-2024年7月9日	9.14	27,400	250,436.00
12	000672	上峰水泥	2024年7月2日-2024年7月9日	6.12	67,700	414,324.00
13	000676	智度股份	2024年7月2日-2024年7月9日	6.07	41,100	249,477.00
14	000680	山推股份	2024年7月2日-2024年7月9日	9.27	33,700	312,399.00
15	000682	东方电子	2024年7月2日-2024年7月9日	11.04	33,800	373,152.00
16	000690	宝新能源	2024年7月2日-2024年7月9日	5.10	61,700	314,670.00
17	000735	罗牛山	2024年7月2日-2024年7月9日	4.33	69,000	298,770.00
18	000758	中色股份	2024年7月2日-2024年7月9日	5.08	59,000	299,720.00
19	000766	通化金马	2024年7月2日-2024年7月9日	16.19	22,500	364,275.00
20	000801	四川九洲	2024年7月2日-2024年7月9日	10.00	21,800	218,000.00
21	000859	国风新材	2024年7月2日-2024年7月9日	3.42	101,200	346,104.00
22	000915	华特达因	2024年7月2日-2024年7月9日	30.16	11,000	331,760.00
23	000917	电广传媒	2024年7月2日-2024年7月9日	5.05	49,600	250,480.00
24	000926	福星股份	2024年7月2日-2024年7月9日	3.17	115,600	366,452.00
25	000931	中关村	2024年7月2日-2024年7月9日	3.53	106,100	374,533.00
26	000973	佛塑科技	2024年7月2日-2024年7月9日	3.69	126,500	466,785.00
27	001696	宗申动力	2024年7月2日-2024年7月9日	10.64	23,300	247,912.00
28	002003	伟星股份	2024年7月2日-2024年7月9日	12.55	43,100	540,905.00
29	002006	精工科技	2024年7月2日-2024年7月9日	13.42	30,000	402,600.00
30	002011	盾安环境	2024年7月2日-2024年7月9日	9.83	19,600	192,668.00

31	002015	协鑫能科	2024年7月2日-2024年7月9日	7.96	30,800	245,168.00
32	002020	京新药业	2024年7月2日-2024年7月9日	10.47	19,000	198,930.00
33	002035	华帝股份	2024年7月2日-2024年7月9日	6.23	32,100	199,983.00
34	002036	联创电子	2024年7月2日-2024年7月9日	6.75	42,300	285,525.00
35	002039	黔源电力	2024年7月2日-2024年7月9日	17.60	20,700	364,320.00
36	002067	景兴纸业	2024年7月2日-2024年7月9日	2.72	172,300	468,656.00
37	002073	软控股份	2024年7月2日-2024年7月9日	7.39	34,500	254,955.00
38	002079	苏州固锝	2024年7月2日-2024年7月9日	8.52	41,600	354,432.00
39	002100	天康生物	2024年7月2日-2024年7月9日	6.93	35,700	247,401.00
40	002126	银轮股份	2024年7月2日-2024年7月9日	17.41	30,200	525,782.00
41	002130	沃尔核材	2024年7月2日-2024年7月9日	14.12	28,800	406,656.00
42	002139	拓邦股份	2024年7月2日-2024年7月9日	10.62	30,000	318,600.00
43	002154	报喜鸟	2024年7月2日-2024年7月9日	5.44	44,000	239,360.00
44	002182	宝武镁业	2024年7月2日-2024年7月9日	11.28	19,700	222,216.00
45	002206	海利得	2024年7月2日-2024年7月9日	3.82	96,300	367,866.00
46	002222	福晶科技	2024年7月2日-2024年7月9日	22.53	13,860	312,265.80
47	002258	利尔化学	2024年7月2日-2024年7月9日	8.02	54,700	438,694.00
48	002261	拓维信息	2024年7月2日-2024年7月9日	11.07	31,200	345,384.00
49	002263	大东南	2024年7月2日-2024年7月9日	2.07	223,200	462,024.00
50	002270	华明装备	2024年7月2日-2024年7月9日	22.24	18,100	402,544.00
51	002284	亚太股份	2024年7月2日-2024年7月9日	6.76	57,500	388,700.00
52	002293	罗莱生活	2024年7月2日-2024年7月9日	8.08	57,800	467,024.00

53	002303	美盈森	2024年7月2日-2024年7月9日	2.41	170,000	409,700.00
54	002317	众生药业	2024年7月2日-2024年7月9日	11.43	17,800	203,454.00
55	002324	普利特	2024年7月2日-2024年7月9日	8.55	28,600	244,530.00
56	002326	永太科技	2024年7月2日-2024年7月9日	7.82	44,200	345,644.00
57	002332	仙琚制药	2024年7月2日-2024年7月9日	11.41	35,500	405,055.00
58	002334	英威腾	2024年7月2日-2024年7月9日	5.98	35,700	213,486.00
59	002335	科华数据	2024年7月2日-2024年7月9日	21.13	15,500	327,515.00
60	002361	神剑股份	2024年7月2日-2024年7月9日	3.24	124,000	401,760.00
61	002367	康力电梯	2024年7月2日-2024年7月9日	5.77	51,300	296,001.00
62	002379	宏创控股	2024年7月2日-2024年7月9日	5.86	52,000	304,720.00
63	002400	省广集团	2024年7月2日-2024年7月9日	4.85	63,800	309,430.00
64	002412	汉森制药	2024年7月2日-2024年7月9日	5.17	75,000	387,750.00
65	002432	九安医疗	2024年7月2日-2024年7月9日	40.54	7,800	316,212.00
66	002446	盛路通信	2024年7月2日-2024年7月9日	5.65	47,000	265,550.00
67	002449	国星光电	2024年7月2日-2024年7月9日	7.12	53,300	379,496.00
68	002452	长高电新	2024年7月2日-2024年7月9日	8.28	68,900	570,492.00
69	002458	益生股份	2024年7月2日-2024年7月9日	8.66	23,700	205,242.00
70	002488	金固股份	2024年7月2日-2024年7月9日	4.39	76,300	334,957.00
71	002521	齐峰新材	2024年7月2日-2024年7月9日	11.75	23,900	280,825.00
72	002522	浙江众成	2024年7月2日-2024年7月9日	3.16	120,800	381,728.00
73	002526	山东矿机	2024年7月2日-2024年7月9日	2.36	125,200	295,472.00
74	002538	司尔特	2024年7月2日-2024年7月9日	4.48	84,900	380,352.00

75	002544	普天科技	2024年7月2日-2024年7月9日	18.69	13,600	254,184.00
76	002556	辉隆股份	2024年7月2日-2024年7月9日	4.17	100,500	419,085.00
77	002567	唐人神	2024年7月2日-2024年7月9日	5.36	39,800	213,328.00
78	002570	贝因美	2024年7月2日-2024年7月9日	2.34	175,200	409,968.00
79	002649	博彦科技	2024年7月2日-2024年7月9日	7.96	38,700	308,052.00
80	002662	京威股份	2024年7月2日-2024年7月9日	3.04	143,500	436,240.00
81	002675	东诚药业	2024年7月2日-2024年7月9日	12.26	29,100	356,766.00
82	002695	煌上煌	2024年7月2日-2024年7月9日	6.49	64,700	419,903.00
83	002697	红旗连锁	2024年7月2日-2024年7月9日	4.63	74,700	345,861.00
84	002698	博实股份	2024年7月2日-2024年7月9日	12.27	16,600	203,682.00
85	002707	众信旅游	2024年7月2日-2024年7月9日	5.74	67,200	385,728.00
86	002741	光华科技	2024年7月2日-2024年7月9日	8.98	33,400	299,932.00
87	002761	浙江建投	2024年7月2日-2024年7月9日	7.81	32,000	249,920.00
88	002783	凯龙股份	2024年7月2日-2024年7月9日	7.32	36,000	263,520.00
89	002807	江阴银行	2024年7月2日-2024年7月9日	3.77	93,600	352,872.00
90	002832	比音勒芬	2024年7月2日-2024年7月9日	24.17	15,500	374,635.00
91	002837	英维克	2024年7月2日-2024年7月9日	21.39	12,200	260,958.00
92	002851	麦格米特	2024年7月2日-2024年7月9日	25.84	12,900	333,336.00
93	002922	伊戈尔	2024年7月2日-2024年7月9日	21.86	12,500	273,250.00
94	300006	莱美药业	2024年7月2日-2024年7月9日	2.34	180,200	421,668.00
95	300008	天海防务	2024年7月2日-2024年7月9日	3.94	99,000	390,060.00
96	300035	中科电气	2024年7月2日-2024年7月9日	8.51	33,300	283,383.00

97	300036	超图软件	2024年7月2日-2024年7月9日	13.96	19,500	272,220.00
98	300045	华力创通	2024年7月2日-2024年7月9日	17.65	11,000	194,150.00
99	300048	合康新能	2024年7月2日-2024年7月9日	4.63	82,000	379,660.00
100	300049	福瑞股份	2024年7月2日-2024年7月9日	50.34	7,100	357,414.00
101	300053	航宇微	2024年7月2日-2024年7月9日	9.11	28,700	261,457.00
102	300065	海兰信	2024年7月2日-2024年7月9日	6.61	63,400	419,074.00
103	300066	三川智慧	2024年7月2日-2024年7月9日	2.86	136,100	389,246.00
104	300075	数字政通	2024年7月2日-2024年7月9日	14.75	15,000	221,250.00
105	300077	国民技术	2024年7月2日-2024年7月9日	8.73	31,900	278,487.00
106	300079	数码视讯	2024年7月2日-2024年7月9日	4.06	50,400	204,624.00
107	300083	创世纪	2024年7月2日-2024年7月9日	6.13	40,100	245,813.00
108	300087	荃银高科	2024年7月2日-2024年7月9日	6.18	58,500	361,530.00
109	300098	高新兴	2024年7月2日-2024年7月9日	4.43	90,100	399,143.00
110	300099	尤洛卡	2024年7月2日-2024年7月9日	4.54	103,100	468,074.00
111	300101	振芯科技	2024年7月2日-2024年7月9日	14.77	18,800	277,676.00
112	300109	新开源	2024年7月2日-2024年7月9日	11.58	25,200	291,816.00
113	300113	顺网科技	2024年7月2日-2024年7月9日	10.24	22,500	230,400.00
114	300129	泰胜风能	2024年7月2日-2024年7月9日	6.82	36,000	245,520.00
115	300130	新国都	2024年7月2日-2024年7月9日	16.64	8,100	134,784.00
116	300131	英唐智控	2024年7月2日-2024年7月9日	4.45	68,400	304,380.00
117	300133	华策影视	2024年7月2日-2024年7月9日	6.14	43,700	268,318.00
118	300149	睿智医药	2024年7月2日-2024年7月9日	3.96	89,700	355,212.00

119	300170	汉得信息	2024年7月2日-2024年7月9日	6.14	64,500	396,030.00
120	300179	四方达	2024年7月2日-2024年7月9日	6.61	32,500	214,825.00
121	300183	东软载波	2024年7月2日-2024年7月9日	11.58	33,700	390,246.00
122	300191	潜能恒信	2024年7月2日-2024年7月9日	13.92	29,900	416,208.00
123	300194	福安药业	2024年7月2日-2024年7月9日	3.74	111,300	416,262.00
124	300199	翰宇药业	2024年7月2日-2024年7月9日	10.85	21,900	237,615.00
125	300203	聚光科技	2024年7月2日-2024年7月9日	10.09	19,100	192,719.00
126	300219	鸿利智汇	2024年7月2日-2024年7月9日	5.59	59,400	332,046.00
127	300222	科大智能	2024年7月2日-2024年7月9日	5.36	70,900	380,024.00
128	300229	拓尔思	2024年7月2日-2024年7月9日	13.43	14,900	200,107.00
129	300233	金城医药	2024年7月2日-2024年7月9日	14.92	24,100	359,572.00
130	300260	新莱应材	2024年7月2日-2024年7月9日	20.94	9,200	192,648.00
131	300278	华昌达	2024年7月2日-2024年7月9日	2.87	139,600	400,652.00
132	300284	苏交科	2024年7月2日-2024年7月9日	8.08	39,400	318,352.00
133	300303	聚飞光电	2024年7月2日-2024年7月9日	4.86	76,400	371,304.00
134	300315	掌趣科技	2024年7月2日-2024年7月9日	4.17	68,900	287,313.00
135	300319	麦捷科技	2024年7月2日-2024年7月9日	9.33	60,900	568,197.00
136	300326	凯利泰	2024年7月2日-2024年7月9日	3.80	116,800	443,840.00
137	300327	中颖电子	2024年7月2日-2024年7月9日	19.68	13,700	269,616.00
138	300328	宜安科技	2024年7月2日-2024年7月9日	4.28	86,100	368,508.00
139	300332	天壕能源	2024年7月2日-2024年7月9日	5.31	67,900	360,549.00
140	300348	长亮科技	2024年7月2日-2024年7月9日	6.82	64,500	439,890.00

141	300352	北信源	2024年7月2日-2024年7月9日	3.84	111,900	429,696.00
142	300353	东土科技	2024年7月2日-2024年7月9日	7.31	33,800	247,078.00
143	300355	蒙草生态	2024年7月2日-2024年7月9日	2.20	158,100	347,820.00
144	300369	绿盟科技	2024年7月2日-2024年7月9日	5.11	80,200	409,822.00
145	300379	东方通	2024年7月2日-2024年7月9日	8.08	27,400	221,392.00
146	300382	斯莱克	2024年7月2日-2024年7月9日	5.91	55,900	330,369.00
147	300393	中来股份	2024年7月2日-2024年7月9日	5.77	45,000	259,650.00
148	300409	道氏技术	2024年7月2日-2024年7月9日	8.56	43,400	371,504.00
149	300415	伊之密	2024年7月2日-2024年7月9日	20.78	8,500	176,630.00
150	300416	苏试试验	2024年7月2日-2024年7月9日	12.86	22,700	291,922.00
151	300437	清水源	2024年7月2日-2024年7月9日	8.06	32,700	263,562.00
152	300443	金雷股份	2024年7月2日-2024年7月9日	15.33	15,700	240,681.00
153	300456	赛微电子	2024年7月2日-2024年7月9日	15.87	18,200	288,834.00
154	300463	迈克生物	2024年7月2日-2024年7月9日	11.38	28,800	327,744.00
155	300475	香农芯创	2024年7月2日-2024年7月9日	29.57	8,400	248,388.00
156	300493	润欣科技	2024年7月2日-2024年7月9日	8.09	54,700	442,523.00
157	300507	苏奥传感	2024年7月2日-2024年7月9日	5.75	86,100	495,075.00
158	300525	博思软件	2024年7月2日-2024年7月9日	12.70	26,200	332,740.00
159	300576	容大感光	2024年7月2日-2024年7月9日	36.53	5,100	186,303.00
160	300579	数字认证	2024年7月2日-2024年7月9日	19.50	22,900	446,550.00
161	300593	新雷能	2024年7月2日-2024年7月9日	9.94	17,600	174,944.00
162	300596	利安隆	2024年7月2日-2024年7月9日	27.13	9,100	246,883.00

163	300618	寒锐钴业	2024年7月2日-2024年7月9日	26.45	13,600	359,720.00
164	300624	万兴科技	2024年7月2日-2024年7月9日	53.07	4,700	249,429.00
165	300638	广和通	2024年7月2日-2024年7月9日	17.10	18,300	312,930.00
166	300655	晶瑞电材	2024年7月2日-2024年7月9日	7.20	27,900	200,880.00
167	300657	弘信电子	2024年7月2日-2024年7月9日	15.02	16,600	249,332.00
168	300671	富满微	2024年7月2日-2024年7月9日	25.42	12,700	322,834.00
169	300674	宇信科技	2024年7月2日-2024年7月9日	11.08	29,600	327,968.00
170	300679	电连技术	2024年7月2日-2024年7月9日	40.23	6,800	273,564.00
171	300685	艾德生物	2024年7月2日-2024年7月9日	17.64	19,000	335,160.00
172	300693	盛弘股份	2024年7月2日-2024年7月9日	20.94	9,500	198,930.00
173	300696	爱乐达	2024年7月2日-2024年7月9日	17.75	26,000	461,500.00
174	300725	药石科技	2024年7月2日-2024年7月9日	26.77	11,400	305,178.00
175	300738	奥飞数据	2024年7月2日-2024年7月9日	10.12	20,000	202,400.00
176	300739	明阳电路	2024年7月2日-2024年7月9日	14.15	25,700	363,655.00
177	300762	上海瀚讯	2024年7月2日-2024年7月9日	17.91	18,700	334,917.00
178	300767	震安科技	2024年7月2日-2024年7月9日	8.48	43,700	370,576.00
179	300770	新媒股份	2024年7月2日-2024年7月9日	33.38	11,500	383,870.00
180	300772	运达股份	2024年7月2日-2024年7月9日	9.60	25,200	241,920.00
181	300825	阿尔特	2024年7月2日-2024年7月9日	9.69	22,800	220,932.00
182	300855	图南股份	2024年7月2日-2024年7月9日	26.44	13,000	343,720.00
183	300908	仲景食品	2024年7月2日-2024年7月9日	27.78	13,200	366,696.00
184	300910	瑞丰新材	2024年7月2日-2024年7月9日	43.72	5,000	218,600.00

185	300946	恒而达	2024年7月2日-2024年7月9日	26.64	16,900	450,216.00
186	300978	东箭科技	2024年7月2日-2024年7月9日	9.23	41,800	385,814.00
187	300986	志特新材	2024年7月2日-2024年7月9日	6.77	46,400	314,128.00
188	301030	仕净科技	2024年7月2日-2024年7月9日	24.62	7,500	184,650.00
189	301031	中熔电气	2024年7月2日	82.20	2,900	238,380.00
190	301050	雷电微力	2024年7月2日-2024年7月9日	48.16	10,100	486,416.00
191	301061	匠心家居	2024年7月2日-2024年7月9日	46.96	5,200	244,192.00
192	301078	孩子王	2024年7月2日-2024年7月9日	5.06	67,400	341,044.00
193	301080	百普赛斯	2024年7月2日-2024年7月9日	35.00	9,200	322,000.00
194	600094	大名城	2024年7月2日-2024年7月9日	3.87	68,700	265,869.00
195	600114	东睦股份	2024年7月2日-2024年7月9日	14.39	17,600	253,264.00
196	600123	兰花科创	2024年7月2日-2024年7月9日	8.95	30,200	270,290.00
197	600125	铁龙物流	2024年7月2日-2024年7月9日	5.97	79,600	475,212.00
198	600133	东湖高新	2024年7月2日-2024年7月9日	10.44	27,800	290,232.00
199	600138	中青旅	2024年7月2日-2024年7月9日	9.66	42,200	407,652.00
200	600171	上海贝岭	2024年7月2日-2024年7月9日	16.68	16,700	278,556.00
201	600199	金种子酒	2024年7月2日-2024年7月9日	11.91	34,300	408,513.00
202	600201	生物股份	2024年7月2日-2024年7月9日	7.21	43,500	313,635.00
203	600217	中再资环	2024年7月2日-2024年7月9日	3.76	100,200	376,752.00
204	600218	全柴动力	2024年7月2日-2024年7月9日	6.71	50,900	341,539.00
205	600229	城市传媒	2024年7月2日-2024年7月9日	6.89	44,700	307,983.00
206	600237	铜峰电子	2024年7月2日-2024年7月9日	5.22	76,200	397,764.00

207	600266	城建发展	2024年7月2日-2024年7月9日	3.74	61,400	229,636.00
208	600269	赣粤高速	2024年7月2日-2024年7月9日	5.17	101,000	522,170.00
209	600284	浦东建设	2024年7月2日-2024年7月9日	5.34	59,000	315,060.00
210	600285	羚锐制药	2024年7月2日-2024年7月9日	24.21	19,100	462,411.00
211	600292	远达环保	2024年7月2日-2024年7月9日	4.69	78,100	366,289.00
212	600293	三峡新材	2024年7月2日-2024年7月9日	2.49	119,200	296,808.00
213	600312	平高电气	2024年7月2日-2024年7月9日	19.45	26,700	519,315.00
214	600331	宏达股份	2024年7月2日-2024年7月9日	5.79	48,000	277,920.00
215	600336	澳柯玛	2024年7月2日-2024年7月9日	4.28	69,700	298,316.00
216	600351	亚宝药业	2024年7月2日-2024年7月9日	5.61	57,900	324,819.00
217	600363	联创光电	2024年7月2日-2024年7月9日	27.52	14,200	390,784.00
218	600368	五洲交通	2024年7月2日-2024年7月9日	3.57	139,790	499,050.30
219	600389	江山股份	2024年7月2日-2024年7月9日	14.11	27,300	385,203.00
220	600422	昆药集团	2024年7月2日-2024年7月9日	17.83	17,700	315,591.00
221	600446	金证股份	2024年7月2日-2024年7月9日	9.93	23,200	230,376.00
222	600452	涪陵电力	2024年7月2日-2024年7月9日	12.67	26,300	333,221.00
223	600478	科力远	2024年7月2日-2024年7月9日	3.77	103,000	388,310.00
224	600502	安徽建工	2024年7月2日-2024年7月9日	4.30	55,200	237,360.00
225	600531	豫光金铅	2024年7月2日-2024年7月9日	6.44	66,900	430,836.00
226	600533	栖霞建设	2024年7月2日-2024年7月9日	1.96	204,200	400,232.00
227	600552	凯盛科技	2024年7月2日-2024年7月9日	9.43	26,500	249,895.00
228	600557	康缘药业	2024年7月2日-2024年7月9日	15.70	13,700	215,090.00

229	600572	康恩贝	2024年7月2日-2024年7月9日	4.47	79,000	353,130.00
230	600587	新华医疗	2024年7月2日-2024年7月9日	15.74	20,300	319,522.00
231	600594	益佰制药	2024年7月2日-2024年7月9日	3.00	123,100	369,300.00
232	600595	中孚实业	2024年7月2日-2024年7月9日	2.49	64,100	159,609.00
233	600602	云赛智联	2024年7月2日-2024年7月9日	11.04	22,300	246,192.00
234	600622	光大嘉宝	2024年7月2日-2024年7月9日	1.85	132,200	244,570.00
235	600645	中源协和	2024年7月2日-2024年7月9日	16.10	13,900	223,790.00
236	600694	大商股份	2024年7月2日-2024年7月9日	16.81	26,100	438,741.00
237	600710	苏美达	2024年7月2日-2024年7月9日	8.15	43,100	351,265.00
238	600728	佳都科技	2024年7月2日-2024年7月9日	3.71	94,400	350,224.00
239	600729	重庆百货	2024年7月2日-2024年7月9日	22.36	8,500	190,060.00
240	600750	江中药业	2024年7月2日-2024年7月9日	23.11	11,000	254,210.00
241	600756	浪潮软件	2024年7月2日-2024年7月9日	10.10	38,200	385,820.00
242	600758	辽宁能源	2024年7月2日-2024年7月9日	2.86	145,800	416,988.00
243	600761	安徽合力	2024年7月2日-2024年7月9日	21.64	18,400	398,176.00
244	600797	浙大网新	2024年7月2日-2024年7月9日	4.63	100,800	466,704.00
245	600798	宁波海运	2024年7月2日-2024年7月9日	2.71	157,600	427,096.00
246	600850	电科数字	2024年7月2日-2024年7月9日	18.10	20,100	363,810.00
247	600877	电科芯片	2024年7月2日-2024年7月9日	10.72	28,200	302,304.00
248	600965	福成股份	2024年7月2日-2024年7月9日	3.64	107,200	390,208.00
249	600971	恒源煤电	2024年7月2日-2024年7月9日	11.94	32,700	390,438.00
250	600976	健民集团	2024年7月2日-2024年7月9日	50.50	5,700	287,850.00

251	600986	浙文互 联	2024 年 7 月 2 日-2024 年 7 月 9 日	4.20	86,900	364,980.0 0
252	600993	马应龙	2024 年 7 月 2 日-2024 年 7 月 9 日	26.67	13,100	349,377.0 0
253	601020	华钰矿 业	2024 年 7 月 2 日-2024 年 7 月 9 日	12.80	18,800	240,640.0 0
254	601028	玉龙股 份	2024 年 7 月 2 日-2024 年 7 月 9 日	12.50	16,700	208,750.0 0
255	601126	四方股 份	2024 年 7 月 2 日-2024 年 7 月 9 日	19.22	20,900	401,698.0 0
256	601208	东材科 技	2024 年 7 月 2 日-2024 年 7 月 9 日	7.26	39,900	289,674.0 0
257	601918	新集能 源	2024 年 7 月 2 日-2024 年 7 月 9 日	9.75	47,300	461,175.0 0
258	601975	招商南 油	2024 年 7 月 2 日-2024 年 7 月 9 日	3.59	101,000	362,590.0 0
259	603008	喜临门	2024 年 7 月 2 日-2024 年 7 月 9 日	17.33	20,000	346,600.0 0
260	603012	创力集 团	2024 年 7 月 2 日-2024 年 7 月 9 日	4.46	100,200	446,892.0 0
261	603018	华设集 团	2024 年 7 月 2 日-2024 年 7 月 9 日	9.09	35,100	319,059.0 0
262	603035	常熟汽 饰	2024 年 7 月 2 日-2024 年 7 月 9 日	12.68	25,900	328,412.0 0
263	603063	禾望电 气	2024 年 7 月 2 日-2024 年 7 月 9 日	15.33	19,500	298,935.0 0
264	603083	剑桥科 技	2024 年 7 月 2 日-2024 年 7 月 9 日	32.28	8,400	271,152.0 0
265	603098	森特股 份	2024 年 7 月 2 日-2024 年 7 月 9 日	7.86	34,300	269,598.0 0
266	603108	润达医 疗	2024 年 7 月 2 日-2024 年 7 月 9 日	15.14	12,800	193,792.0 0
267	603197	保隆科 技	2024 年 7 月 2 日-2024 年 7 月 9 日	31.50	8,900	280,350.0 0
268	603220	中贝通 信	2024 年 7 月 2 日-2024 年 7 月 9 日	27.16	9,200	249,872.0 0
269	603267	鸿远电 子	2024 年 7 月 2 日-2024 年 7 月 9 日	34.10	8,200	279,620.0 0
270	603275	众辰科 技	2024 年 7 月 2 日-2024 年 7 月 9 日	30.00	12,500	375,000.0 0
271	603279	景津装 备	2024 年 7 月 2 日-2024 年 7 月 9 日	21.69	21,100	457,659.0 0
272	603283	赛腾股 份	2024 年 7 月 2 日-2024 年 7 月 9 日	76.40	3,800	290,320.0 0

273	603300	华铁应急	2024年7月2日-2024年7月9日	5.46	70,100	382,746.00
274	603306	华懋科技	2024年7月2日-2024年7月9日	18.07	12,600	227,682.00
275	603308	应流股份	2024年7月2日-2024年7月9日	12.42	14,600	181,332.00
276	603323	苏农银行	2024年7月2日-2024年7月9日	4.81	73,100	351,611.00
277	603387	基蛋生物	2024年7月2日-2024年7月9日	7.76	50,600	392,656.00
278	603393	新天然气	2024年7月2日-2024年7月9日	34.74	12,500	434,250.00
279	603477	巨星农牧	2024年7月2日-2024年7月9日	28.70	9,900	284,130.00
280	603496	恒为科技	2024年7月2日-2024年7月9日	24.45	8,800	215,160.00
281	603556	海兴电力	2024年7月2日-2024年7月9日	46.83	3,600	168,588.00
282	603588	高能环境	2024年7月2日-2024年7月9日	6.28	64,900	407,572.00
283	603599	广信股份	2024年7月2日-2024年7月9日	12.13	21,300	258,369.00
284	603601	再升科技	2024年7月2日-2024年7月9日	2.76	124,700	344,172.00
285	603619	中曼石油	2024年7月2日-2024年7月9日	23.42	12,500	292,750.00
286	603713	密尔克卫	2024年7月2日-2024年7月9日	53.52	3,100	165,912.00
287	603871	嘉友国际	2024年7月2日-2024年7月9日	17.69	10,000	176,900.00
288	603906	龙蟠科技	2024年7月2日-2024年7月9日	7.79	43,400	338,086.00
289	603997	继峰股份	2024年7月2日-2024年7月9日	10.23	18,900	193,347.00
290	605208	永茂泰	2024年7月2日-2024年7月9日	6.23	56,400	351,372.00
291	605305	中际联合	2024年7月2日-2024年7月9日	25.79	11,500	296,585.00
292	688007	光峰科技	2024年7月2日-2024年7月9日	16.10	12,000	193,200.00
293	688019	安集科技	2024年7月2日-2024年7月9日	125.80	2,000	251,600.00
294	688027	国盾量子	2024年7月2日-2024年7月9日	151.00	2,100	317,100.00

295	688062	迈威生物	2024年7月2日-2024年7月9日	28.94	9,200	266,248.00
296	688076	诺泰生物	2024年7月2日-2024年7月9日	78.28	5,000	391,400.00
297	688088	虹软科技	2024年7月2日-2024年7月9日	28.86	5,800	167,388.00
298	688110	东芯股份	2024年7月2日-2024年7月9日	19.07	11,000	209,770.00
299	688116	天奈科技	2024年7月2日-2024年7月9日	23.08	12,300	283,884.00
300	688123	聚辰股份	2024年7月2日-2024年7月9日	60.83	3,400	206,822.00
301	688131	皓元医药	2024年7月2日-2024年7月9日	19.13	15,680	299,958.40
302	688148	芳源股份	2024年7月2日-2024年7月9日	4.21	76,000	319,960.00
303	688166	博瑞医药	2024年7月2日-2024年7月9日	35.00	6,900	241,500.00
304	688206	概伦电子	2024年7月2日-2024年7月9日	14.85	32,500	482,625.00
305	688208	道通科技	2024年7月2日-2024年7月9日	24.14	12,200	294,508.00
306	688212	澳华内镜	2024年7月2日-2024年7月9日	40.01	4,800	192,048.00
307	688219	会通股份	2024年7月2日-2024年7月9日	7.77	49,600	385,392.00
308	688239	航宇科技	2024年7月2日-2024年7月9日	34.80	7,600	264,480.00
309	688262	国芯科技	2024年7月2日-2024年7月9日	18.21	12,000	218,520.00
310	688266	泽璟制药	2024年7月2日-2024年7月9日	54.22	7,200	390,384.00
311	688269	凯立新材	2024年7月2日-2024年7月9日	25.55	13,200	337,260.00
312	688270	臻镭科技	2024年7月2日-2024年7月9日	26.10	7,500	195,750.00
313	688277	天智航	2024年7月2日-2024年7月9日	7.74	60,100	465,174.00
314	688299	长阳科技	2024年7月2日-2024年7月9日	12.79	30,700	392,653.00
315	688306	均普智能	2024年7月2日-2024年7月9日	4.06	100,600	408,436.00
316	688326	经纬恒润	2024年7月2日-2024年7月9日	57.33	3,700	212,121.00

317	688327	云从科技	2024年7月2日-2024年7月9日	11.31	15,600	176,436.00
318	688333	铂力特	2024年7月2日-2024年7月9日	48.45	5,000	242,250.00
319	688339	亿华通	2024年7月2日-2024年7月9日	29.98	10,400	311,792.00
320	688343	云天励飞	2024年7月2日-2024年7月9日	28.55	8,600	245,530.00
321	688380	中微半导	2024年7月2日-2024年7月9日	16.72	26,700	446,424.00
322	688381	帝奥微	2024年7月2日-2024年7月9日	19.48	21,800	424,664.00
323	688388	嘉元科技	2024年7月2日-2024年7月9日	9.75	27,600	269,100.00
324	688389	普门科技	2024年7月2日-2024年7月9日	16.26	16,300	265,038.00
325	688408	中信博	2024年7月2日	92.08	1,000	92,080.00
326	688409	富创精密	2024年7月2日-2024年7月9日	36.94	3,932	145,248.08
327	688484	南芯科技	2024年7月2日-2024年7月9日	37.10	6,900	255,990.00
328	688498	源杰科技	2024年7月2日	130.99	2,000	261,980.00
329	688503	聚和材料	2024年7月2日-2024年7月9日	28.10	6,400	179,840.00
330	688508	芯朋微	2024年7月2日-2024年7月9日	36.37	11,000	400,070.00
331	688518	联赢激光	2024年7月2日-2024年7月9日	16.70	23,300	389,110.00
332	688531	日联科技	2024年7月2日-2024年7月9日	46.16	8,200	378,512.00
333	688556	高测股份	2024年7月2日-2024年7月9日	11.89	14,900	177,161.00
334	688575	亚辉龙	2024年7月2日-2024年7月9日	23.32	9,300	216,876.00
335	688596	正帆科技	2024年7月2日-2024年7月9日	33.00	8,500	280,500.00
336	688608	恒玄科技	2024年7月2日	146.38	1,600	234,208.00
337	688621	阳光诺和	2024年7月2日-2024年7月9日	42.70	5,100	217,770.00
338	688630	芯碁微装	2024年7月2日-2024年7月9日	62.57	3,100	193,967.00
339	688639	华恒生	2024年7月2日-2024年	76.39	3,200	244,448.00

		物	7月9日			0
340	688676	金盘科技	2024年7月2日-2024年7月9日	52.15	7,900	411,985.00
341	688690	纳微科技	2024年7月2日-2024年7月9日	17.37	17,100	297,027.00
342	688696	极米科技	2024年7月2日	77.24	1,100	84,964.00
343	688700	东威科技	2024年7月2日-2024年7月9日	26.21	6,900	180,849.00
344	688707	振华新材	2024年7月2日-2024年7月9日	9.74	23,600	229,864.00
345	688711	宏微科技	2024年7月2日-2024年7月9日	16.06	17,260	277,195.60
346	688766	普冉股份	2024年7月2日-2024年7月9日	97.17	3,200	310,944.00
347	688789	宏华数科	2024年7月2日-2024年7月9日	107.80	3,100	334,180.00
348	688798	艾为电子	2024年7月2日-2024年7月9日	56.62	5,500	311,410.00
349	688800	瑞可达	2024年7月2日-2024年7月9日	28.08	11,500	322,920.00
合计	-	-	-	-	14,645,822	110,752,792.18

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理融入各业务层面，建立了三道防线：以各岗位目标责任制为基础，形成第一道防线；通过相关部门、相关岗位之间相互监督制衡，形成第二道防线；由监察稽核部门、督察长对各岗位、各部门、各机构、各项业务实施监督反馈，形成第三道防线。

6.4.13.2 信用风险

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

一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款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，通过约定申报方式参与转融通证券出借业务的，基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，借券证券公司最近 1 年的分类结果应为 A 类，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 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。（2023 年 12 月 31 日：同）

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金期末持有的流通受限证券外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金资产的流动性风险进行管理，基金管理人建立了健全的流动性风险管理的内部控制体系，在申购赎回确认、投资交易、估值和信息披露等运作过程中专业审慎、勤勉尽责地管控基金的流动性风险，维护投资者的合法权益，公平对待投资者。本基金开放期间管理人对组合持仓集中度、短期变现能力、流动性受限资产比例、现金类资产比例等流动性指标进行持续的监测和分析，通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，对交易对手进行必要的尽职调查和准入，加强逆回购的流动性风险和交易对手风险的管理，并健全了逆回购交易质押品管理制度。

本基金所持有的证券大部分具有良好的流动性，部分证券流通暂时受限的情况参见附注 6.4.12 “期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券”，本报告期内本基金未出现因投资品种变现困难或投资集中而无法以合理价格及时变现基金资产以支付赎回款的情况。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2024年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	15,736,020.51	-	-	-	-	-	15,736,020.51
结算备付金	1,273,235.63	-	-	-	-	-	1,273,235.63
存出保证金	875,330.91	-	-	-	-	-	875,330.91
交易性金融资产	-	-	-	-	-	734,320,663.65	734,320,663.65
应收股利	-	-	-	-	-	134,021.37	134,021.37
应收清算款	-	-	-	-	-	17,572.15	17,572.15
其他资产	-	-	-	-	-	134,728.89	134,728.89
资产总计	17,884,587.05	-	-	-	-	734,606,986.06	752,491,573.11
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	318,235.00	318,235.00
应付托管费	-	-	-	-	-	63,647.01	63,647.01
应付清算款	-	-	-	-	-	6,304,334.64	6,304,334.64
应交税费	-	-	-	-	-	5,262.79	5,262.79
其他负债	-	-	-	-	-	1,236,199.02	1,236,199.02
负债总计	-	-	-	-	-	7,927,678.46	7,927,678.46
利率敏感度缺口	17,884,587.05	-	-	-	-	726,679,307.60	744,563,894.65
上年度末 2023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	52,520,430.59	-	-	-	-	-	52,520,430.59
结算备付金	2,251,570.11	-	-	-	-	-	2,251,570.11
存出保证金	369,949.77	-	-	-	-	-	369,949.77

交易性金融资产						-2,169,748,022.58	2,169,748,022.58
应收清算款						2,924,160.08	2,924,160.08
其他资产						120,947.09	120,947.09
资产总计	55,141,950.47					-2,172,793,129.75	2,227,935,080.22
负债							
应付管理人报酬						827,278.48	827,278.48
应付托管费						165,455.69	165,455.69
应交税费						11,794.92	11,794.92
其他负债						12,195,149.02	12,195,149.02
负债总计						13,199,678.11	13,199,678.11
利率敏感度缺口	55,141,950.47					-2,159,593,451.64	2,214,735,402.11

注：该表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2023 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（2023 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	734,320,663.65	98.62	2,169,748,022.58	97.97
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	734,320,663.65	98.62	2,169,748,022.58	97.97

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除股票基准指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 股票基准指数下降100个基点	-7,198,646.07	-17,925,473.19
2. 股票基准指数上升100个基点	7,198,646.07	17,925,473.19	

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	733,827,765.05	2,168,760,255.65

第二层次	24,002.55	-
第三层次	468,896.05	987,766.93
合计	734,320,663.65	2,169,748,022.58

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、新发未上市、涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产以及其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	734,320,663.65	97.59
	其中：股票	734,320,663.65	97.59
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	17,009,256.14	2.26
8	其他各项资产	1,161,653.32	0.15

9	合计	752,491,573.11	100.00
---	----	----------------	--------

注：1、上述股票投资包括可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项中不含可退替代款估值增值。

2、本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 110,752,792.18 元，占净值比例 14.87%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	8,013,125.60	1.08
B	采矿业	21,064,901.54	2.83
C	制造业	488,516,790.41	65.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,371,570.24	2.60
E	建筑业	9,875,144.60	1.33
F	批发和零售业	24,456,042.67	3.28
G	交通运输、仓储和邮政业	20,009,428.30	2.69
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	82,828,995.48	11.12
J	金融业	6,814,657.20	0.92
K	房地产业	12,593,019.00	1.69
L	租赁和商务服务业	13,202,303.78	1.77
M	科学研究和技术服务业	15,884,879.33	2.13
N	水利、环境和公共设施管理业	7,489,640.00	1.01
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	3,677,251.00	0.49
S	综合	-	-
	合计	733,797,749.15	98.55

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	443,781.52	0.06

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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	12,074.28	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,981.02	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	20,077.68	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	522,914.50	0.07

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600269	赣粤高速	695,200	3,594,184.00	0.48
2	002807	江阴银行	906,460	3,417,354.20	0.46
3	600368	五洲交通	953,390	3,403,602.30	0.46
4	603323	苏农银行	706,300	3,397,303.00	0.46
5	600285	羚锐制药	138,400	3,350,664.00	0.45
6	002003	伟星股份	265,293	3,329,427.15	0.45
7	600125	铁龙物流	553,100	3,302,007.00	0.44
8	000973	佛塑科技	888,400	3,278,196.00	0.44
9	300319	麦捷科技	349,609	3,261,851.97	0.44
10	002452	长高电新	391,300	3,239,964.00	0.44
11	600971	恒源煤电	270,000	3,223,800.00	0.43

12	600312	平高电气	164,100	3,191,745.00	0.43
13	002139	拓邦股份	294,100	3,123,342.00	0.42
14	603012	创力集团	696,170	3,104,918.20	0.42
15	600694	大商股份	182,432	3,066,681.92	0.41
16	300326	凯利泰	805,300	3,060,140.00	0.41
17	000690	宝新能源	595,004	3,034,520.40	0.41
18	002270	华明装备	136,200	3,029,088.00	0.41
19	002662	京威股份	989,857	3,009,165.28	0.40
20	002126	银轮股份	172,600	3,004,966.00	0.40
21	000926	福星股份	941,400	2,984,238.00	0.40
22	000758	中色股份	578,400	2,938,272.00	0.39
23	002695	煌上煌	449,800	2,919,202.00	0.39
24	601918	新集能源	294,800	2,874,300.00	0.39
25	300194	福安药业	766,345	2,866,130.30	0.38
26	002293	罗莱生活	354,529	2,864,594.32	0.38
27	600797	浙大网新	617,000	2,856,710.00	0.38
28	000531	穗恒运 A	532,400	2,848,340.00	0.38
29	002067	景兴纸业	1,045,200	2,842,944.00	0.38
30	603279	景津装备	130,875	2,838,678.75	0.38
31	002332	仙琚制药	247,500	2,823,975.00	0.38
32	000551	创元科技	322,378	2,814,359.94	0.38
33	300507	苏奥传感	489,120	2,812,440.00	0.38
34	688380	中微半导	166,500	2,783,880.00	0.37
35	300579	数字认证	141,700	2,763,150.00	0.37
36	688206	概伦电子	185,800	2,759,130.00	0.37
37	301050	雷电微力	57,200	2,754,752.00	0.37
38	300679	电连技术	67,900	2,731,617.00	0.37
39	603393	新天然气	78,600	2,730,564.00	0.37
40	603387	基蛋生物	351,832	2,730,216.32	0.37
41	000543	皖能电力	307,900	2,724,915.00	0.37
42	300493	润欣科技	336,600	2,723,094.00	0.37
43	300463	迈克生物	238,400	2,712,992.00	0.36
44	300674	宇信科技	244,200	2,705,736.00	0.36
45	300348	长亮科技	396,100	2,701,402.00	0.36
46	002258	利尔化学	336,200	2,696,324.00	0.36
47	002412	汉森制药	521,400	2,695,638.00	0.36
48	300468	四方精创	308,500	2,671,610.00	0.36
49	600123	兰花科创	297,830	2,665,578.50	0.36
50	000036	华联控股	819,700	2,655,828.00	0.36
51	300099	尤洛卡	584,600	2,654,084.00	0.36
52	002449	国星光电	372,000	2,648,640.00	0.36
53	002538	司尔特	590,600	2,645,888.00	0.36
54	688277	天智航	341,597	2,643,960.78	0.36

55	688381	帝奥微	135,700	2,643,436.00	0.36
56	300048	合康新能	570,200	2,640,026.00	0.35
57	300696	爱乐达	148,700	2,639,425.00	0.35
58	600531	豫光金铅	409,800	2,639,112.00	0.35
59	002522	浙江众成	832,600	2,631,016.00	0.35
60	300352	北信源	684,500	2,628,480.00	0.35
61	600798	宁波海运	968,100	2,623,551.00	0.35
62	600850	电科数字	144,300	2,611,830.00	0.35
63	000682	东方电子	235,900	2,604,336.00	0.35
64	002263	大东南	1,256,100	2,600,127.00	0.35
65	300946	恒而达	97,340	2,593,137.60	0.35
66	300303	聚飞光电	531,700	2,584,062.00	0.35
67	300328	宜安科技	598,700	2,562,436.00	0.34
68	600292	远达环保	546,000	2,560,740.00	0.34
69	000607	华媒控股	828,200	2,559,138.00	0.34
70	300006	莱美药业	1,093,388	2,558,527.92	0.34
71	002649	博彦科技	318,400	2,534,464.00	0.34
72	000672	上峰水泥	414,100	2,534,292.00	0.34
73	603588	高能环境	403,500	2,533,980.00	0.34
74	600750	江中药业	108,900	2,516,679.00	0.34
75	300369	绿盟科技	491,892	2,513,568.12	0.34
76	600138	中青旅	258,800	2,500,008.00	0.34
77	688306	均普智能	615,288	2,498,069.28	0.34
78	601975	招商南油	695,000	2,495,050.00	0.34
79	002570	贝因美	1,064,500	2,490,930.00	0.33
80	002303	美盈森	1,032,100	2,487,361.00	0.33
81	600993	马应龙	93,100	2,482,977.00	0.33
82	601126	四方股份	128,800	2,475,536.00	0.33
83	000735	罗牛山	569,700	2,466,801.00	0.33
84	600502	安徽建工	572,780	2,462,954.00	0.33
85	002361	神剑股份	757,700	2,454,948.00	0.33
86	600710	苏美达	300,500	2,449,075.00	0.33
87	600237	铜峰电子	466,900	2,437,218.00	0.33
88	002367	康力电梯	422,000	2,434,940.00	0.33
89	600728	佳都科技	656,000	2,433,760.00	0.33
90	300278	华昌达	847,700	2,432,899.00	0.33
91	300170	汉得信息	396,200	2,432,668.00	0.33
92	600363	联创光电	88,309	2,430,263.68	0.33
93	600533	栖霞建设	1,239,600	2,429,616.00	0.33
94	002697	红旗连锁	519,700	2,406,211.00	0.32
95	300183	东软载波	207,358	2,401,205.64	0.32
96	688219	会通股份	308,600	2,397,822.00	0.32
97	603601	再升科技	867,900	2,395,404.00	0.32

98	300355	蒙草生态	1,088,600	2,394,920.00	0.32
99	600965	福成股份	655,600	2,386,384.00	0.32
100	300065	海兰信	360,900	2,385,549.00	0.32
101	002284	亚太股份	352,000	2,379,520.00	0.32
102	300772	运达股份	247,850	2,379,360.00	0.32
103	300191	潜能恒信	170,862	2,378,399.04	0.32
104	002556	辉隆股份	570,100	2,377,317.00	0.32
105	600478	科力远	630,102	2,375,484.54	0.32
106	600756	浪潮软件	235,000	2,373,500.00	0.32
107	300978	东箭科技	256,270	2,365,372.10	0.32
108	300066	三川智慧	826,900	2,364,934.00	0.32
109	002707	众信旅游	411,900	2,364,306.00	0.32
110	000915	华特达因	78,000	2,352,480.00	0.32
111	002154	报喜鸟	431,700	2,348,448.00	0.32
112	600758	辽宁能源	820,600	2,346,916.00	0.32
113	603300	华铁应急	429,193	2,343,393.78	0.31
114	600199	金种子酒	196,100	2,335,551.00	0.31
115	688676	金盘科技	44,700	2,331,105.00	0.31
116	002488	金固股份	531,000	2,331,090.00	0.31
117	300222	科大智能	434,500	2,328,920.00	0.31
118	002432	九安医疗	57,400	2,326,996.00	0.31
119	002006	精工科技	173,000	2,321,660.00	0.31
120	002832	比音勒芬	95,752	2,314,325.84	0.31
121	600217	中再资环	613,000	2,304,880.00	0.31
122	300077	国民技术	263,800	2,302,974.00	0.31
123	300382	斯莱克	389,500	2,301,945.00	0.31
124	600761	安徽合力	106,242	2,299,076.88	0.31
125	300908	仲景食品	82,675	2,296,711.50	0.31
126	002130	沃尔核材	162,300	2,291,676.00	0.31
127	000931	中关村	648,900	2,290,617.00	0.31
128	300409	道氏技术	266,600	2,282,096.00	0.31
129	300770	新媒股份	68,022	2,270,574.36	0.30
130	300767	震安科技	267,677	2,269,900.96	0.30
131	300098	高新兴	511,500	2,265,945.00	0.30
132	300036	超图软件	162,000	2,261,520.00	0.30
133	002206	海利得	589,900	2,253,418.00	0.30
134	688508	芯朋微	61,888	2,250,866.56	0.30
135	300087	荃银高科	363,770	2,248,098.60	0.30
136	002039	黔源电力	127,600	2,245,760.00	0.30
137	688299	长阳科技	175,519	2,244,888.01	0.30
138	600594	益佰制药	746,600	2,239,800.00	0.30
139	688518	联赢激光	133,412	2,227,980.40	0.30
140	600645	中源协和	138,300	2,226,630.00	0.30

141	300233	金城医药	149,000	2,223,080.00	0.30
142	002675	东诚药业	180,700	2,215,382.00	0.30
143	688076	诺泰生物	28,300	2,215,324.00	0.30
144	300332	天壕能源	417,000	2,214,270.00	0.30
145	688266	泽璟制药	40,836	2,214,127.92	0.30
146	600389	江山股份	156,713	2,211,220.43	0.30
147	300008	天海防务	561,200	2,211,128.00	0.30
148	002783	凯龙股份	301,300	2,205,516.00	0.30
149	600284	浦东建设	410,900	2,194,206.00	0.29
150	300638	广和通	128,160	2,191,536.00	0.29
151	603275	众辰科技	72,608	2,178,240.00	0.29
152	300149	睿智医药	549,300	2,175,228.00	0.29
153	688484	南芯科技	58,600	2,174,060.00	0.29
154	002079	苏州固锴	255,154	2,173,912.08	0.29
155	600572	康恩贝	483,900	2,163,033.00	0.29
156	603599	广信股份	177,500	2,153,075.00	0.29
157	605208	永茂泰	345,300	2,151,219.00	0.29
158	688531	日联科技	46,600	2,151,056.00	0.29
159	000422	湖北宜化	180,200	2,147,984.00	0.29
160	603008	喜临门	123,900	2,147,187.00	0.29
161	600229	城市传媒	311,100	2,143,479.00	0.29
162	688608	恒玄科技	14,550	2,129,829.00	0.29
163	002326	永太科技	271,100	2,120,002.00	0.28
164	600218	全柴动力	315,700	2,118,347.00	0.28
165	688269	凯立新材	82,800	2,115,540.00	0.28
166	301078	孩子王	417,600	2,113,056.00	0.28
167	300179	四方达	319,200	2,109,912.00	0.28
168	688019	安集科技	16,724	2,103,879.20	0.28
169	002741	光华科技	233,600	2,097,728.00	0.28
170	300618	寒锐钴业	79,200	2,094,840.00	0.28
171	000766	通化金马	129,151	2,090,954.69	0.28
172	688690	纳微科技	120,100	2,086,137.00	0.28
173	603906	龙蟠科技	267,100	2,080,709.00	0.28
174	300739	明阳电路	146,900	2,078,635.00	0.28
175	300685	艾德生物	117,600	2,074,464.00	0.28
176	600336	澳柯玛	484,500	2,073,660.00	0.28
177	600986	浙文互联	493,200	2,071,440.00	0.28
178	600452	涪陵电力	162,652	2,060,800.84	0.28
179	300525	博思软件	162,100	2,058,670.00	0.28
180	002100	天康生物	295,508	2,047,870.44	0.28
181	002035	华帝股份	328,200	2,044,686.00	0.27
182	600293	三峡新材	821,100	2,044,539.00	0.27
183	002335	科华数据	96,700	2,043,271.00	0.27

184	300219	鸿利智汇	364,000	2,034,760.00	0.27
185	300049	福瑞股份	40,100	2,018,634.00	0.27
186	603035	常熟汽饰	159,100	2,017,388.00	0.27
187	300855	图南股份	75,770	2,003,358.80	0.27
188	600729	重庆百货	89,200	1,994,512.00	0.27
189	600351	亚宝药业	355,100	1,992,111.00	0.27
190	002036	联创电子	294,600	1,988,550.00	0.27
191	000612	焦作万方	305,600	1,986,400.00	0.27
192	002261	拓维信息	178,800	1,979,316.00	0.27
193	002222	福晶科技	87,240	1,965,517.20	0.26
194	000859	国风新材	573,800	1,962,396.00	0.26
195	688148	芳源股份	465,900	1,961,439.00	0.26
196	600422	昆药集团	110,000	1,961,300.00	0.26
197	603018	华设集团	215,737	1,961,049.33	0.26
198	002020	京新药业	187,300	1,961,031.00	0.26
199	002182	宝武镁业	173,720	1,959,561.60	0.26
200	000680	山推股份	210,800	1,954,116.00	0.26
201	002851	麦格米特	75,500	1,950,920.00	0.26
202	300986	志特新材	285,000	1,929,450.00	0.26
203	600201	生物股份	267,518	1,928,804.78	0.26
204	300762	上海瀚讯	107,532	1,925,898.12	0.26
205	300113	顺网科技	187,900	1,924,096.00	0.26
206	688711	宏微科技	119,125	1,913,147.50	0.26
207	688789	宏华数科	17,700	1,908,060.00	0.26
208	002400	省广集团	391,200	1,897,320.00	0.25
209	688707	振华新材	194,600	1,895,404.00	0.25
210	603098	森特股份	239,760	1,884,513.60	0.25
211	688062	迈威生物	64,900	1,878,206.00	0.25
212	300671	富满微	73,800	1,875,996.00	0.25
213	688388	嘉元科技	192,158	1,873,540.50	0.25
214	002379	宏创控股	319,500	1,872,270.00	0.25
215	300131	英唐智控	419,995	1,868,977.75	0.25
216	600877	电科芯片	174,291	1,868,399.52	0.25
217	002446	盛路通信	327,200	1,848,680.00	0.25
218	603063	禾望电气	120,400	1,845,732.00	0.25
219	688800	瑞可达	65,683	1,844,378.64	0.25
220	002837	英维克	86,181	1,843,411.59	0.25
221	600587	新华医疗	117,080	1,842,839.20	0.25
222	603619	中曼石油	78,200	1,831,444.00	0.25
223	300083	创世纪	298,700	1,831,031.00	0.25
224	300379	东方通	226,074	1,826,677.92	0.25
225	688027	国盾量子	12,056	1,820,456.00	0.24
226	688639	华恒生物	23,789	1,817,241.71	0.24

227	301080	百普赛斯	51,850	1,814,750.00	0.24
228	300284	苏交科	224,400	1,813,152.00	0.24
229	688575	亚辉龙	77,600	1,809,632.00	0.24
230	300416	苏试试验	139,920	1,799,371.20	0.24
231	300109	新开源	155,200	1,797,216.00	0.24
232	600133	东湖高新	172,075	1,796,463.00	0.24
233	688333	铂力特	37,012	1,793,231.40	0.24
234	002526	山东矿机	759,700	1,792,892.00	0.24
235	603197	保隆科技	56,900	1,792,350.00	0.24
236	688798	艾为电子	31,510	1,784,096.20	0.24
237	603308	应流股份	143,500	1,782,270.00	0.24
238	688596	正帆科技	53,955	1,780,515.00	0.24
239	600114	东睦股份	123,610	1,778,747.90	0.24
240	002073	软控股份	240,200	1,775,078.00	0.24
241	603871	嘉友国际	100,200	1,772,538.00	0.24
242	002334	英威腾	294,900	1,763,502.00	0.24
243	688166	博瑞医药	50,346	1,762,110.00	0.24
244	300315	掌趣科技	422,177	1,760,478.09	0.24
245	002567	唐人神	328,400	1,760,224.00	0.24
246	688339	亿华通	58,620	1,757,427.60	0.24
247	600552	凯盛科技	185,800	1,752,094.00	0.24
248	300415	伊之密	84,200	1,749,676.00	0.23
249	300035	中科电气	205,263	1,746,788.13	0.23
250	688766	普冉股份	17,900	1,739,343.00	0.23
251	300596	利安隆	64,100	1,739,033.00	0.23
252	301061	匠心家居	36,891	1,732,401.36	0.23
253	002698	博实股份	140,500	1,723,935.00	0.23
254	300101	振芯科技	116,629	1,722,610.33	0.23
255	300725	药石科技	64,060	1,714,886.20	0.23
256	300327	中颖电子	86,764	1,707,515.52	0.23
257	300443	金雷股份	111,300	1,706,229.00	0.23
258	600331	宏达股份	294,600	1,705,734.00	0.23
259	688131	皓元医药	89,020	1,702,952.60	0.23
260	688239	航宇科技	48,867	1,700,571.60	0.23
261	002458	益生股份	195,600	1,693,896.00	0.23
262	300079	数码视讯	415,326	1,686,223.56	0.23
263	002922	伊戈尔	77,100	1,685,406.00	0.23
264	688123	聚辰股份	27,687	1,684,200.21	0.23
265	688208	道通科技	69,652	1,681,399.28	0.23
266	605305	中际联合	64,948	1,675,008.92	0.22
267	300075	数字政通	113,544	1,674,774.00	0.22
268	688088	虹软科技	57,959	1,672,696.74	0.22
269	300229	拓尔思	124,100	1,666,663.00	0.22

270	688116	天奈科技	71,950	1,660,606.00	0.22
271	300456	赛微电子	104,500	1,658,415.00	0.22
272	688389	普门科技	101,536	1,650,975.36	0.22
273	601208	东材科技	227,160	1,649,181.60	0.22
274	603283	赛腾股份	21,500	1,642,600.00	0.22
275	600976	健民集团	32,300	1,631,150.00	0.22
276	600094	大名城	421,100	1,629,657.00	0.22
277	300437	清水源	201,900	1,627,314.00	0.22
278	688408	中信博	17,590	1,619,687.20	0.22
279	688007	光峰科技	100,539	1,618,677.90	0.22
280	300053	航宇微	177,600	1,617,936.00	0.22
281	603556	海兴电力	34,500	1,615,635.00	0.22
282	600171	上海贝岭	96,600	1,611,288.00	0.22
283	002521	齐峰新材	136,900	1,608,575.00	0.22
284	002011	盾安环境	163,300	1,605,239.00	0.22
285	603997	继峰股份	156,900	1,605,087.00	0.22
286	603477	巨星农牧	55,900	1,604,330.00	0.22
287	300393	中来股份	275,900	1,591,943.00	0.21
288	603267	鸿远电子	46,200	1,575,420.00	0.21
289	002544	普天科技	84,117	1,572,146.73	0.21
290	600595	中孚实业	627,900	1,563,471.00	0.21
291	688327	云从科技	137,000	1,549,470.00	0.21
292	300657	弘信电子	102,800	1,544,056.00	0.21
293	000657	中钨高新	168,500	1,540,090.00	0.21
294	000676	智度股份	253,400	1,538,138.00	0.21
295	000917	电广传媒	304,500	1,537,725.00	0.21
296	688621	阳光诺和	36,000	1,537,200.00	0.21
297	002761	浙江建投	196,800	1,537,008.00	0.21
298	600602	云赛智联	139,200	1,536,768.00	0.21
299	603083	剑桥科技	47,546	1,534,784.88	0.21
300	300133	华策影视	249,800	1,533,772.00	0.21
301	688262	国芯科技	83,892	1,527,673.32	0.21
302	688409	富创精密	41,283	1,524,994.02	0.20
303	300353	东土科技	208,500	1,524,135.00	0.20
304	000099	中信海直	93,800	1,523,312.00	0.20
305	300910	瑞丰新材	34,780	1,520,581.60	0.20
306	688498	源杰科技	11,600	1,519,484.00	0.20
307	002324	普利特	177,500	1,517,625.00	0.20
308	002015	协鑫能科	190,000	1,512,400.00	0.20
309	300693	盛弘股份	72,198	1,511,826.12	0.20
310	300655	晶瑞电材	209,549	1,508,752.80	0.20
311	688630	芯碁微装	24,100	1,507,937.00	0.20
312	600557	康缘药业	96,000	1,507,200.00	0.20

313	688110	东芯股份	78,800	1,502,716.00	0.20
314	601020	华钰矿业	117,200	1,500,160.00	0.20
315	600622	光大嘉宝	802,000	1,483,700.00	0.20
316	300199	翰宇药业	135,700	1,472,345.00	0.20
317	688556	高测股份	123,277	1,465,763.53	0.20
318	300593	新雷能	146,500	1,456,210.00	0.20
319	603306	华懋科技	79,300	1,432,951.00	0.19
320	002317	众生药业	124,914	1,427,767.02	0.19
321	300624	万兴科技	26,813	1,422,965.91	0.19
322	600446	金证股份	143,100	1,420,983.00	0.19
323	001696	宗申动力	133,500	1,420,440.00	0.19
324	300738	奥飞数据	140,100	1,417,812.00	0.19
325	603220	中贝通信	51,990	1,412,048.40	0.19
326	600266	城建发展	377,000	1,409,980.00	0.19
327	300475	香农芯创	47,600	1,407,532.00	0.19
328	300129	泰胜风能	205,500	1,401,510.00	0.19
329	300045	华力创通	78,800	1,390,820.00	0.19
330	000521	长虹美菱	183,300	1,389,414.00	0.19
331	688343	云天励飞	48,500	1,384,675.00	0.19
332	301031	中熔电气	16,800	1,380,960.00	0.19
333	300825	阿尔特	141,000	1,366,290.00	0.18
334	300203	聚光科技	134,100	1,353,069.00	0.18
335	300130	新国都	80,700	1,342,848.00	0.18
336	688700	东威科技	50,831	1,332,280.51	0.18
337	688212	澳华内镜	33,267	1,331,012.67	0.18
338	000603	盛达资源	110,400	1,306,032.00	0.18
339	603713	密尔克卫	24,200	1,295,184.00	0.17
340	000801	四川九洲	126,500	1,265,000.00	0.17
341	688503	聚和材料	44,700	1,256,070.00	0.17
342	688270	臻镭科技	47,929	1,250,946.90	0.17
343	603496	恒为科技	50,000	1,222,500.00	0.16
344	603108	润达医疗	79,900	1,209,686.00	0.16
345	601028	玉龙股份	96,700	1,208,750.00	0.16
346	688326	经纬恒润	20,698	1,186,616.34	0.16
347	688696	极米科技	14,400	1,112,256.00	0.15
348	300260	新莱应材	52,000	1,088,880.00	0.15
349	300576	容大感光	29,000	1,059,370.00	0.14
350	301030	仕净科技	42,600	1,048,812.00	0.14

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.03
2	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00

3	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
4	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00
5	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
6	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
7	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
8	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
9	601083	锦江航运	1,263	12,074.28	0.00
10	301516	中远通	604	11,252.52	0.00
11	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
12	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
13	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
14	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
15	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
16	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
17	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
18	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
19	688720	艾森股份	165	6,689.10	0.00
20	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
21	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
22	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
23	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
24	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
25	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
26	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
27	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
28	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
29	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
30	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
31	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
32	002288	*ST 超华	962,700	0.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603960	克来机电	11,952,588.94	0.54
2	600368	五洲交通	11,559,172.30	0.52
3	600285	羚锐制药	10,590,382.03	0.48
4	688333	铂力特	10,331,212.34	0.47
5	688621	阳光诺和	10,159,672.72	0.46
6	603979	金诚信	9,835,220.00	0.44
7	688278	特宝生物	9,737,706.65	0.44
8	600123	兰花科创	8,903,848.70	0.40

9	600125	铁龙物流	8,576,441.00	0.39
10	603012	创力集团	8,404,044.40	0.38
11	688270	臻镭科技	8,247,687.72	0.37
12	600971	恒源煤电	8,113,525.00	0.37
13	603279	景津装备	7,988,784.19	0.36
14	603323	苏农银行	7,771,989.00	0.35
15	600694	大商股份	7,539,911.67	0.34
16	688266	泽璟制药	7,525,187.38	0.34
17	603197	保隆科技	7,460,077.00	0.34
18	600979	广安爱众	7,400,148.00	0.33
19	688213	思特威	7,388,360.29	0.33
20	688578	艾力斯	7,340,940.70	0.33

注：“买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603960	克来机电	22,421,566.23	1.01
2	603979	金诚信	21,189,698.60	0.96
3	600368	五洲交通	21,189,289.40	0.96
4	600285	羚锐制药	18,966,015.00	0.86
5	688278	特宝生物	16,243,388.99	0.73
6	600979	广安爱众	16,071,099.00	0.73
7	688333	铂力特	15,392,376.68	0.69
8	600125	铁龙物流	14,207,782.00	0.64
9	688621	阳光诺和	14,120,788.65	0.64
10	600123	兰花科创	14,113,670.20	0.64
11	600708	光明地产	13,920,674.55	0.63
12	603012	创力集团	13,861,183.96	0.63
13	600971	恒源煤电	13,204,827.41	0.60
14	688213	思特威	13,114,094.58	0.59
15	603881	数据港	13,053,123.70	0.59
16	688391	钜泉科技	12,984,705.64	0.59
17	600789	鲁抗医药	12,906,917.00	0.58
18	600694	大商股份	12,887,869.59	0.58
19	688578	艾力斯	12,845,509.48	0.58
20	600094	大名城	12,721,398.00	0.57

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,096,475,275.54
卖出股票收入（成交）总额	1,564,402,013.93

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，江苏江阴农村商业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行无锡市中心支行的处罚，本基金对上述主体所发行证券的投资决策

程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	875,330.91
2	应收清算款	17,572.15
3	应收股利	134,021.37
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	59,319.77
7	待摊费用	75,409.12
8	其他	-
9	合计	1,161,653.32

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002452	长高电新	570,492.00	0.08	转融通流通受限
2	300319	麦捷科技	568,197.00	0.08	转融通流通受限
3	002003	伟星股份	540,905.00	0.07	转融通流通受限
4	600269	赣粤高速	522,170.00	0.07	转融通流通受限
5	600368	五洲交通	499,050.30	0.07	转融通流通受限
6	600125	铁龙物流	475,212.00	0.06	转融通流通受限
7	000973	佛塑科技	466,785.00	0.06	转融通流通受限

8	600285	羚锐制药	462,411.00	0.06	转融通流通受限
9	002807	江阴银行	352,872.00	0.05	转融通流通受限
10	603323	苏农银行	351,611.00	0.05	转融通流通受限

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	301589	诺瓦星云	233,884.44	0.03	新股流通受限
2	688692	达梦数据	30,612.75	0.00	新股流通受限
3	603285	键邦股份	24,002.55	0.00	新股未上市
4	601033	永兴股份	20,077.68	0.00	新股流通受限
5	688709	成都华微	19,635.55	0.00	新股流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		万家国证 2000ETF 发起式联接	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
7,218	130,407.77	654,538,493.00	69.54	247,541,651.00	26.30	39,203,106.00	4.16

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	中国平安人寿保险股份有限公司一分红一个险分红	268,612,800.00	28.54
2	中国人寿保险股份有限公司	117,000,000.00	12.43
3	招商证券股份有限公司	29,159,528.00	3.10

	司		
4	中信证券—中信银行—中信证券鸿鑫 2 号集合资产管理计划	28,040,600.00	2.98
5	渤海人寿保险股份有限公司—分红保险八	19,571,600.00	2.08
6	海通证券股份有限公司	16,265,404.00	1.73
7	国联证券股份有限公司融券专用证券账户	14,000,000.00	1.49
8	中信建投证券—中国华融资产管理股份有限公司—中信建投—先锋单一资产管理计划	12,109,000.00	1.29
9	东北证券股份有限公司	12,077,500.00	1.28
10	国泰君安证券股份有限公司融券专用证券账户	10,016,500.00	1.06
11	中国工商银行股份有限公司—万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	39,203,106.00	4.16

注：上述持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022 年 6 月 29 日）基金份额总额	845,283,250.00
本报告期期初基金份额总额	2,294,283,250.00
本报告期基金总申购份额	2,226,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	3,579,000,000.00

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	941,283,250.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 (%)	
中信建投	1	2,082,900,102.82	78.33	1,970,340.68	78.82	-
平安证券	2	251,630,070.04	9.46	235,498.34	9.42	-
招商证券	1	241,398,034.04	9.08	228,342.13	9.13	-
山西证券	2	52,377,909.7	1.97	39,068.81	1.56	-

		9				
德邦证券	2	18,317,597.88	0.69	17,327.80	0.69	-
财通证券	3	12,416,913.57	0.47	9,261.74	0.37	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	3	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 财务状况良好，经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 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要；
- (3) 具有较强的金融服务能力和水平。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

3、基金专用交易席位的变更情况：

本报告期内，本基金新增广发证券交易单元 1 个。

10.7.2 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。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于万家基金管理有限公司指定证券投资基金主流流动性服务商的公告	指定媒介	2024年1月3日
2	关于旗下万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	指定媒介	2024年1月12日
3	关于万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	指定媒介	2024年1月12日
4	万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	指定媒介	2024年1月19日
5	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	2024年1月19日
6	关于万家基金管理有限公司指定证券投资基金主流流动性服务商的公告	指定媒介	2024年1月29日
7	万家基金管理有限公司关于万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金增加西南证券为申购赎回代办券商的公告	指定媒介	2024年3月14日
8	万家基金管理有限公司关于万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金增加渤海证券为申购赎回代办券商的公告	指定媒介	2024年3月18日
9	万家基金管理有限公司关于万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金增加浙商证券为申购赎回代办券商的公告	指定媒介	2024年3月18日
10	万家基金管理有限公司关于万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金增加长江证券为申购赎回代办券商的公告	指定媒介	2024年3月21日
11	关于万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	指定媒介	2024年3月26日
12	万家基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	指定媒介	2024年3月29日
13	万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年年度报告	指定媒介	2024年3月29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	2024年4月19日
15	万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	指定媒介	2024年4月19日
16	万家基金管理有限公司关于旗下公开	指定媒介	2024年6月26日

	募集证券投资基金更新基金产品资料概要的提示性公告		
17	万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要(更新)	指定媒介	2024 年 6 月 26 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240119-20240204、 20240301-20240326、 20240410、 20240416-20240630	405,533,100.00	42,004,800.00	178,925,100.00	268,612,800.00	28.54
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。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>							

注：上述申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》。
- 4、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年中期报告原文。
- 5、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。
- 7、本报告期内在中国证监会指定媒介公开披露的基金净值、更新招募说明书及其他临时公告。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人网站：www.wjasset.com。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日