

万家中证红利交易型开放式指数证券投资
基金联接基金(原万家中证红利指数证券
投资基金(LOF))
2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 24 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	万家中证红利ETF联接
基金主代码	161907
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024年7月10日
报告期末基金份额总额	2,394,244,490.29份
投资目标	本基金通过主要投资于目标ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为目标ETF的联接基金，以目标ETF作为其主要投资标的，方便投资人通过本基金投资目标ETF。本基金并不参与目标ETF的管理。具体策略包括： 1、大类资产配置策略；2、目标ETF投资策略；3、股票投资策略；4、存托凭证投资策略；5、债券投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、可转换债券与可交换债券投资策略；8、股指期货交易策略；9、国债期货交易策略；10、股票期权投资策略；11、融资及转融通证券出借业务策略。
业绩比较基准	中证红利指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为ETF联接基金，所跟踪的目标ETF为股票型基金，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。 本基金主要通过投资于万家中证红利交易型开放式指数证券投资基金实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证红利指数的表现密切相关。

基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	万家中证红利ETF联接A	万家中证红利ETF联接C
下属分级基金的交易代码	161907	015558
报告期末下属分级基金的份额总额	1,940,943,026.24份	453,301,464.05份

2.1.1 目标基金基本情况（转型后）

基金名称	万家中证红利交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159581
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024年3月6日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2024年3月15日
基金管理人名称	万家基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明（转型后）

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	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即中证红利指数收益率。
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，主要采用完全复制法跟踪中证红利指数，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。

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	万家红利
场内简称	万家中证红利LOF
基金主代码	161907
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2011年3月17日
报告期末基金份额总额	2,408,046,950.78份
投资目标	本基金采用被动式指数化投资方法，在正常市场情况下，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪偏离度不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%，实现对中证红利指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为指数型基金，原则上采用完全复制法。 本基金的投资策略包括：1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、其他金融衍生产品投资策略。
业绩比较基准	95%×中证红利指数收益率+5%×银行同业存款利率

风险收益特征	本基金为股票型指数基金，预期风险高于货币市场基金、债券型基金及混合型基金，属于较高风险，较高预期收益的证券投资基金品种。	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	万家红利 A	万家红利 C
下属分级基金的场内简称	万家中证红利 LOF	-
下属分级基金的交易代码	161907	015558
报告期末下属分级基金的份额总额	1,910,278,009.34 份	497,768,941.44 份

注：本基金 A 类基金份额于 2024 年 7 月 10 日终止上市（最后交易日：2024 年 7 月 9 日）。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 7 月 10 日-2024 年 9 月 30 日）	
	万家中证红利 ETF 联接 A	万家中证红利 ETF 联接 C
1. 本期已实现收益	-173,125,095.52	-40,509,205.10
2. 本期利润	210,964,615.83	46,433,815.29
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1085	0.1025
4. 期末基金资产净值	3,403,765,554.99	783,437,825.30
5. 期末基金份额净值	1.7537	1.7283

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人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。

2、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。

3、自 2024 年 7 月 10 日起，《万家中证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效，原《万家中证红利指数证券投资基金（LOF）基金合同》自同日起失效。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 9 日）	
	万家红利 A	万家红利 C
1. 本期已实现收益	11,282,580.21	2,781,562.27
2. 本期利润	26,054,996.95	6,616,653.77
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0137	0.0133
4. 期末基金资产净值	3,161,699,385.04	812,141,620.82
5. 期末基金份额净值	1.6551	1.6316

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人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。

2、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。

3.2 基金净值表现（转型后）

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

万家中证红利ETF联接A

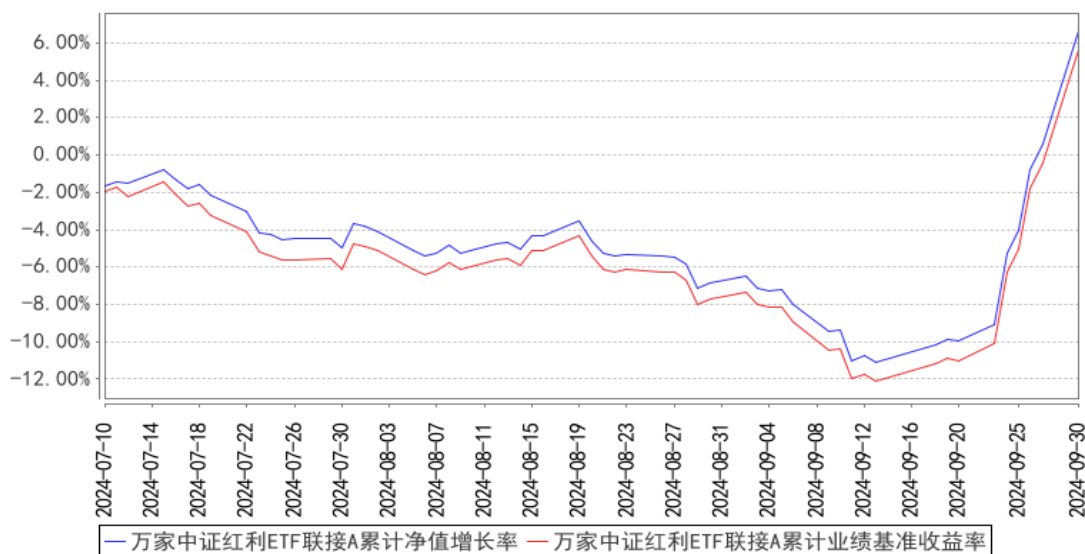
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	6.61%	1.29%	5.62%	1.33%	0.99%	-0.04%

万家中证红利ETF联接C

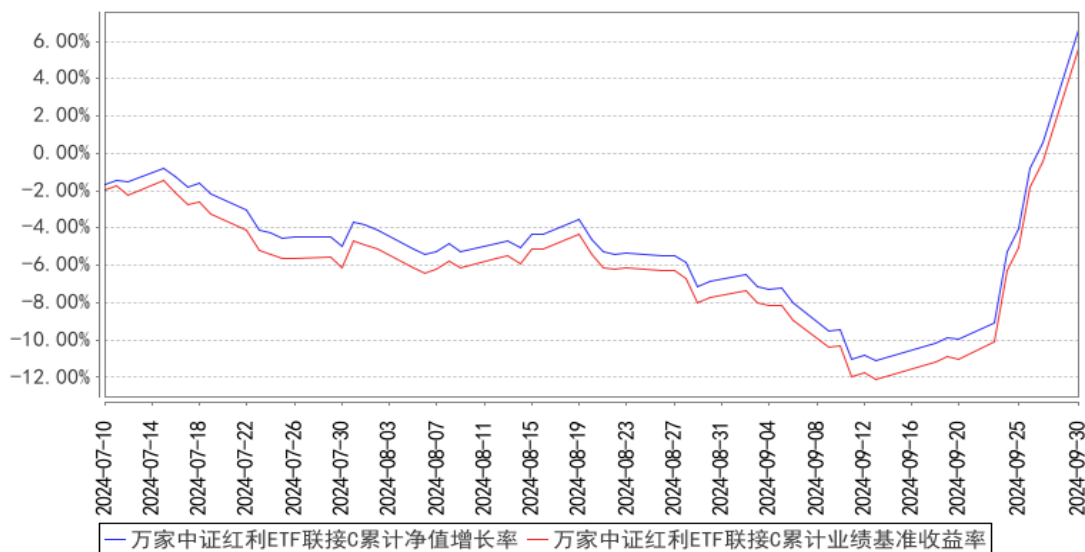
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	6.58%	1.29%	5.62%	1.33%	0.96%	-0.04%

3.2.2 自基金转型以来基金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

万家中证红利ETF联接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



万家中证红利ETF联接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 2024 年 7 月 10 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。截至报告期末本基金尚处于建仓期。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、本基金由万家中证红利指数证券投资基金（LOF）变更而来。万家中证红利指数证券投资基金（LOF）于 2024 年 5 月 22 日经中国证券监督管理委员会证监许可[2024]814 号文准予变更注册，2024 年 7 月 2 日经万家中证红利指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会审议通过，自 2024 年 7 月 10 日起，《万家中证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效，原《万家中证红利指数证券投资基金（LOF）基金合同》自同日起失效。

3.2 基金净值表现（转型前）

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

万家红利 A

阶段	净值增长率①	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	1.33%	0.80%	-1.02%	0.82%	2.35%	-0.02%
过去六个月	8.14%	0.90%	5.79%	0.91%	2.35%	-0.01%
过去一年	9.04%	0.75%	5.85%	0.77%	3.19%	-0.02%
过去三年	21.96%	0.97%	6.66%	0.99%	15.30%	-0.02%
过去五年	57.18%	1.00%	21.52%	1.01%	35.66%	-0.01%

自基金合同 生效起至 2024年7月 9日	160.52%	1.29%	64.12%	1.26%	96.40%	0.03%
--------------------------------	---------	-------	--------	-------	--------	-------

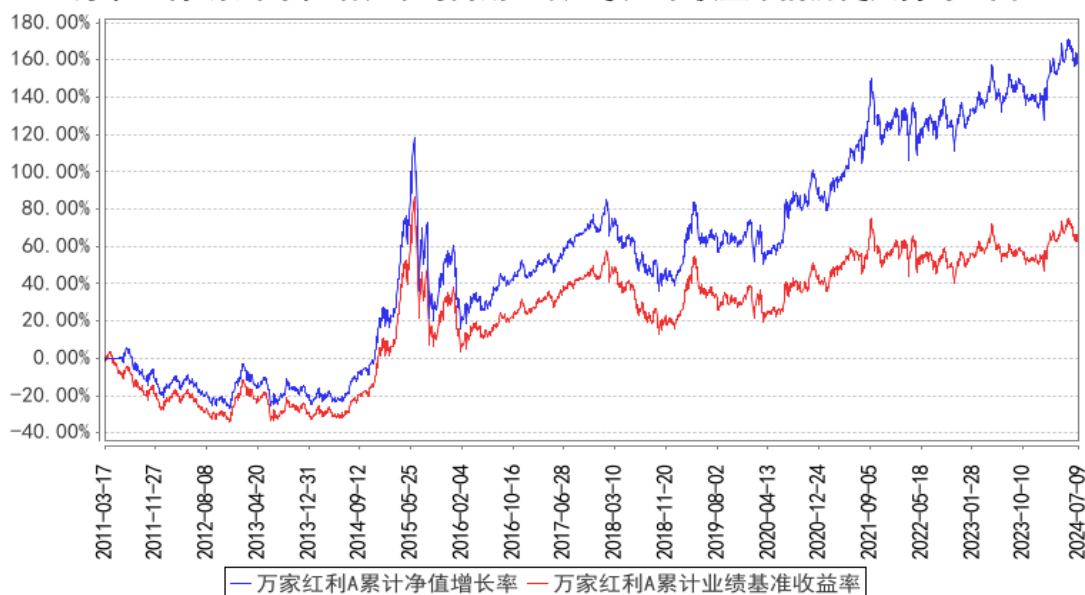
万家红利C

阶段	净值增长率①	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	1.19%	0.80%	-1.02%	0.82%	2.21%	-0.02%
过去六个月	7.82%	0.90%	5.79%	0.91%	2.03%	-0.01%
过去一年	8.40%	0.75%	5.85%	0.77%	2.55%	-0.02%
自基金合同 生效起至 2024年7月 9日	20.93%	0.83%	10.36%	0.85%	10.57%	-0.02%

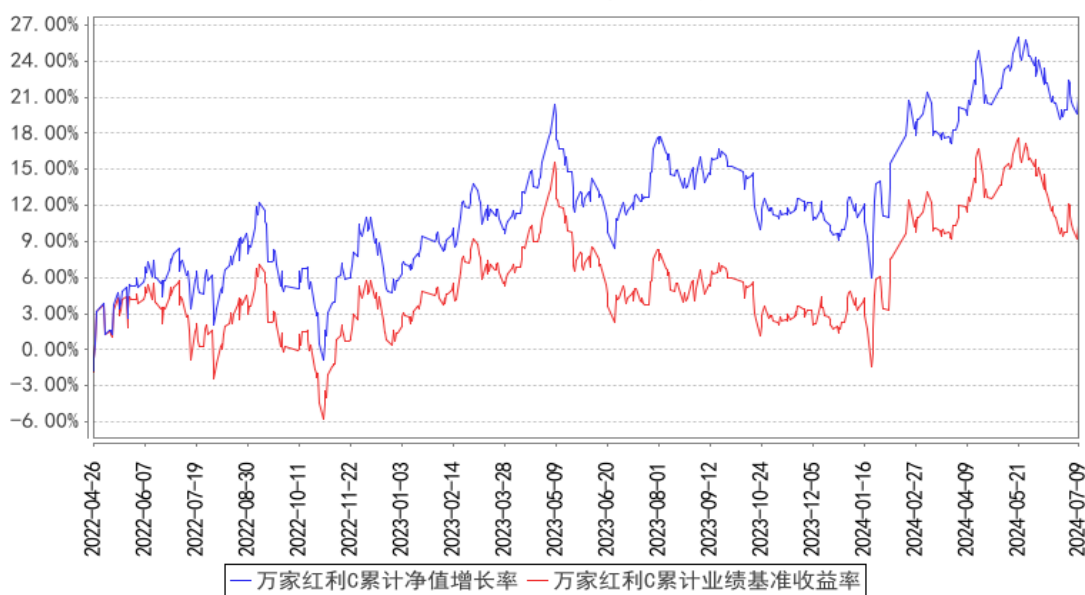
注：万家红利C上述“自基金合同生效起至2024年7月9日”实际为“自基金份额类别首次确认起至2024年7月9日”，下同。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

万家红利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



万家红利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、本基金于2011年3月17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。截至2024年7月9日各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

2、本基金自2022年4月25日起增设C类份额，2022年4月26日起确认有C类基金份额登记在册。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨坤	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、万家中证港	2024年07月10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Fractabole量化IT工程师等职。

<p>股通创新药交易型开放式指数证券投资基金、万家中证港股通央企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、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</p>				
--	--	--	--	--

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、万家恒生互联网科技业指数型发起式证券投资基金(QDII)、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。				
---	--	--	--	--

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。

4.1.1 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（转型后）

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 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨坤	万家中证工业有色	2019年10月24日	2024年07月09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，

<p>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、万家中证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金、万家中证港股通央企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、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</p>				<p>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>
--	--	--	--	---

<p>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、万家恒生互联网科技业指数型发起式证券投资基金(QDII)、万家纳斯达克100指数型发起式证券投资基金(QDII)的</p>				
---	--	--	--	--

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。

4.1.1 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（转型前）

本报告期末，本基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

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43次，均为指数和量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

7月以来A股走势延续低迷，沪指一度跌破2700整数点大关，以银行为代表的红利核心资产出现补跌。9月19日美联储降息50bp落地后，国内政策也迎来重要拐点，24日金融政策组合拳出台、5000+3000亿增量资金政策引发关注，26日政治局会议罕见讨论经济形势，并提出“要努力提振资本市场”，释放更积极信号。A股投资者情绪高涨，指数直线拉升，收复年初以来跌幅，成交量创下历史新高。

展望后续，一方面，国内政策协同加码超预期，政策密集落地将对经济和市场预期带来支撑，且增量政策尤可期待；另一方面，随着美联储开启降息周期，国内流动性也迎来拐点，9月货币端降准降息力度超1-8月以来的累计水平，预计四季度流动性整体维持宽松。在外部不发生大幅扰动的前提下市场修复趋势有望延续，A股有望震荡向上。2024年三季度本基金投资标的指数——中证红利指数收益率为6.43%。

本基金为万家中证红利ETF的联接基金，主要通过投资于万家中证红利ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。报告期内本基金在运作过程中严格遵守基金合同，对指数基金采取被动复制的方式跟踪指数，保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。本基金跟踪误差的来源主要是申购赎回、标的指数成分股调整、以及ETF对指数的跟踪误差等。

4.5 报告期内基金的业绩表现

转型后，截至2024年9月30日万家中证红利ETF联接A的基金份额净值为1.7537元，2024年7月10日至2024年9月30日基金份额净值增长率为6.61%，同期业绩比较基准收益率为5.62%；截至2024年9月30日万家中证红利ETF联接C的基金份额净值为1.7283元，2024年7月10日至2024年9月30日基金份额净值增长率为6.58%，同期业绩比较基准收益率为5.62%。基金报告期内转型后A份额、C份额日均跟踪偏离度分别为0.0489%、0.0491%，年跟踪误差分别为1.2847%、1.2839%，符合基金合同中日均跟踪偏离度低于0.35%和年跟踪误差低于4%的规定。

转型前，截至2024年7月9日万家红利A的基金份额净值为1.6551元，2024年7月1日至2024年7月9日基金份额净值增长率为0.84%，同期业绩比较基准收益率为0.49%；截至2024年7月9日万家红利C的基金份额净值为1.6316元，2024年7月1日至2024年7月9日基金份额净值增长率为0.83%，同期业绩比较基准收益率为0.49%。基金报告期内转型前A份额、C份额日均跟踪偏离度分别为0.0595%、0.0582%，年跟踪误差分别为1.0492%、1.0268%，符合基金合同中日均跟踪偏离度低于0.35%和年跟踪误差低于4%的规定。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告（转型后）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	149,694.28	0.00
	其中：股票	149,694.28	0.00
2	基金投资	3,955,248,000.00	93.67
3	固定收益投资	8,062,610.41	0.19
	其中：债券	8,062,610.41	0.19
	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	224,710,526.15	5.32
8	其他资产	34,226,809.53	0.81
9	合计	4,222,397,640.37	100.00

5.2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	万家中证红利交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式(ETF)	万家基金管理有限公司	3,955,248,000.00	94.46

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3.1 报告期末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	87,020.52	0.00
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	62,673.76	0.00

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		
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	149,694.28	0.00

5.3.2 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。

5.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.4.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	688692	达梦数据	175	51,353.75	0.00
2	301580	爱迪特	202	11,954.36	0.00
3	301606	绿联科技	396	11,448.36	0.00
4	688691	灿芯股份	247	11,320.01	0.00
5	301392	汇成真空	219	10,656.54	0.00
6	001389	广合科技	222	9,359.52	0.00
7	301603	乔锋智能	233	9,161.56	0.00
8	301587	中瑞股份	306	8,008.02	0.00
9	301539	宏鑫科技	361	7,432.99	0.00
10	301552	科力装备	143	6,352.06	0.00

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	8,062,610.41	0.19
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,062,610.41	0.19

5.6 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019740	24国债09	80,000	8,062,610.41	0.19

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 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。

5.9 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10.2 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。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 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。

5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11.3 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。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 本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。

5.12.2 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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,874,180.97
2	应收证券清算款	27,781,793.98
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,570,834.58
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	34,226,809.53

5.12.4 报告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。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688692	达梦数据	51,353.75	0.00	新股流通受限
2	301580	爱迪特	11,954.36	0.00	新股流通受限
3	301606	绿联科技	11,448.36	0.00	新股流通受限
4	688691	灿芯股份	11,320.01	0.00	新股流通受限
5	301392	汇成真空	10,656.54	0.00	新股流通受限
6	001389	广合科技	9,359.52	0.00	新股流通受限
7	301603	乔锋智能	9,161.56	0.00	新股流通受限
8	301587	中瑞股份	8,008.02	0.00	新股流通受限
9	301539	宏鑫科技	7,432.99	0.00	新股流通受限
10	301552	科力装备	6,352.06	0.00	新股流通受限

5.12.6 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。

§ 5 投资组合报告（转型前）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,728,006,341.60	93.73
	其中：股票	3,728,006,341.60	93.73
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	244,637,788.21	6.15
8	其他资产	4,644,356.06	0.12
9	合计	3,977,288,485.87	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	703,831,705.68	17.71
C	制造业	1,112,922,870.10	28.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	147,653,849.68	3.72
E	建筑业	96,426,635.06	2.43
F	批发和零售业	50,205,526.80	1.26
G	交通运输、仓储和邮政业	334,913,531.48	8.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	856,275,621.74	21.55
K	房地产业	109,944,315.10	2.77
L	租赁和商务服务业	119,606,386.13	3.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	195,583,675.00	4.92
S	综合	-	-
	合计	3,727,364,116.77	93.80

5.2.2 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	565,407.50	0.01
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	11,493.30	0.00
H	住宿和餐饮业		
I	信息传输、软件和信息技术服务业	44,793.47	0.00
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	20,530.56	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	642,224.83	0.02

5.2.3 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	601398	工商银行	16,175,347	96,081,561.18	2.42
2	601088	中国神华	1,892,433	82,131,592.20	2.07
3	601000	唐山港	15,871,039	81,894,561.24	2.06
4	601225	陕西煤业	2,909,100	77,411,151.00	1.95
5	601006	大秦铁路	9,291,456	66,712,654.08	1.68
6	600398	海澜之家	8,096,100	66,307,059.00	1.67
7	601328	交通银行	8,060,648	62,389,415.52	1.57
8	000983	山西焦煤	5,759,306	57,881,025.30	1.46
9	600350	山东高速	6,373,530	57,616,711.20	1.45
10	000830	鲁西化工	4,702,000	57,223,340.00	1.44

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

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	234,842.32	0.01
2	603341	龙旗科技	2,978	107,445.96	0.00
3	301603	乔锋智能	2,326	61,639.00	0.00
4	688692	达梦数据	175	28,766.50	0.00

5	601033	永兴股份	1,258	20,530.56	0.00
---	--------	------	-------	-----------	------

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	854,389.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,789,966.62
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	4,644,356.06

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告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。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	301589	诺瓦星云	234,842.32	0.01	新股流通受限
2	301603	乔锋智能	61,639.00	0.00	新股流通受限
3	688692	达梦数据	28,766.50	0.00	新股流通受限
4	601033	永兴股份	20,530.56	0.00	新股流通受限
5	603341	龙旗科技	10,376.36	0.00	新股流通受限

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	万家中证红利ETF联接A	万家中证红利ETF联接C
基金合同生效日(2024年7月10日)期初基金份额总额	1,910,278,009.34	497,768,941.44
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	101,283,328.37	57,972,854.34
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	70,618,311.47	102,440,331.73
基金合同生效日起至报告期期末基金拆	-	-

分变动份额（份额减少以“-”填列）		
报告期期末基金份额总额	1,940,943,026.24	453,301,464.05

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	万家红利 A	万家红利 C
报告期期初基金份额总额	1,900,799,796.55	497,045,246.74
报告期期间基金总申购份额	10,541,230.17	2,146,418.30
减：报告期期间基金总赎回份额	1,063,017.38	1,422,723.60
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	1,910,278,009.34	497,768,941.44

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申赎及买卖本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申赎及买卖本基金的情况。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申赎及买卖本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申赎及买卖本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20240701-20240930	492,428,652.78	3,027,703.93	-	495,456,356.71	20.69
	2	20240701-20240820、20240828-20240930	485,384,602.16	2,985,669.89	-	488,370,272.05	20.40

产品特有风险

报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付

赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

§ 9 备查文件目录

9.1 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、《万家中证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》。
- 3、《万家中证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》。
- 4、万家中证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金(原万家中证红利指数证券投资基金(LOF))2024年第3季度报告原文。
- 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。

9.2 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。

9.3 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10月24日