

万家中证 A500 交易型开放式指数证券投资 基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	57

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	57
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	57
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	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	58
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	59
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	60
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	60
10.8 其他重大事件	61
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	万家中证 A500ETF
场内简称	A500ETF 万家
基金主代码	159356
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 11 月 22 日
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	668,120,647.00 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	2024 年 12 月 6 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、股指期货交易策略；7、国债期货交易策略；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 A500 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 A500 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	兰剑	任航
	联系电话	021-38909626	010-66060069
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008880800	95599
传真		021-38909627	010-68121816
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦 电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海市浦东新区浦电路 360 号陆 家嘴投资大厦 9 楼、15 楼、16 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200122	100031
法定代表人		陈广益	谷澍

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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.wjasset.com
基金中期报告置备地点	基金管理人办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	278,996,695.85
本期利润	162,725,537.46
加权平均基金份额本期利润	0.1751
本期加权平均净值利润率	13.37%
本期基金份额净值增长率	13.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	278,616,345.51
期末可供分配基金份额利润	0.4170
期末基金资产净值	946,736,992.51
期末基金份额净值	1.4170
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	41.70%

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

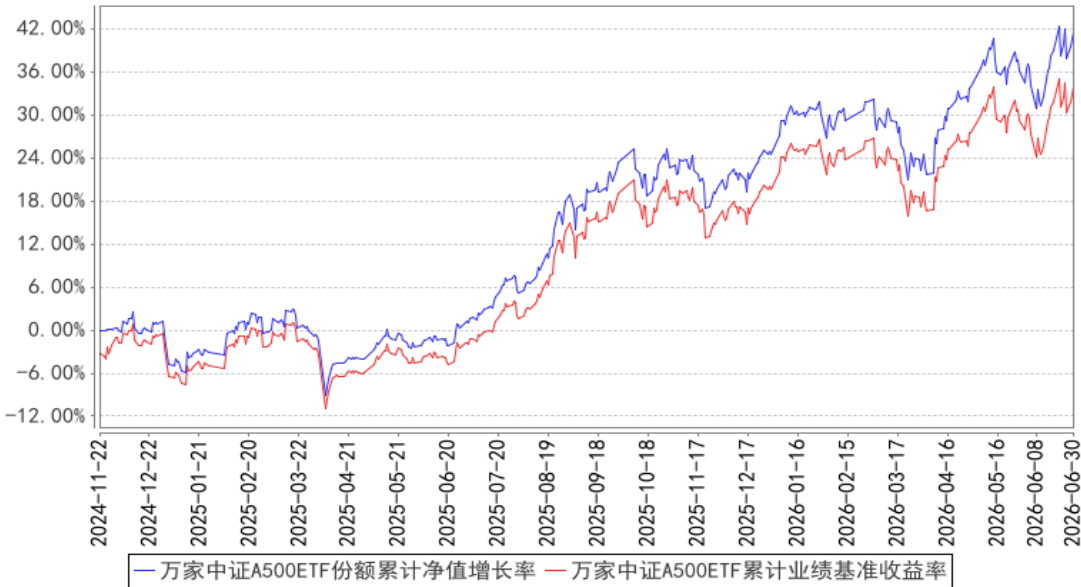
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	15.83%	1.39%	14.26%	1.41%	1.57%	-0.02%
过去六个月	13.73%	1.27%	11.91%	1.29%	1.82%	-0.02%

过去一年	40.17%	1.13%	36.38%	1.14%	3.79%	-0.01%
自基金合同生效起至今	41.70%	1.10%	33.88%	1.13%	7.82%	-0.03%

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

万家中证A500ETF份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2024 年 11 月 22 日成立，根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44 号文批准设立。公司的股东为中泰证券股份有限公司、山东省新动能基金管理有限公司，住所：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 楼（名义楼层 9 层）。截至 2026 年 6 月 30 日，公司共管理 208 只开放式基金，其中包括 59 只股票型基金、80 只混合型基金、48 只债券型基金、5 只货币市场基金、4 只 QDII 基金、12 只基金中基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨坤	万家中证	2024 年	-	11 年	国籍：中国；学历：法国南特国立高等矿

	A500 交易型开放式指数证券投资基金、万家中证 A500 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发起式联接基金、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、万家中证港股通央企红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、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、	11 月 22 日			业学校自动化与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。
--	--	-----------	--	--	--

万家创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金、万家创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、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、万家国证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、万家恒生互联网科技业					
---	--	--	--	--	--

	交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、万家恒生互联网科技业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII)、万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、万家沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、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。				
--	--	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律、法规和监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原

则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋取最大利益，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 4 次，为量化投资组合或不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，A 股市场整体波动较大，行情主线清晰但结构分化显著。指数层面，科创 50 指数以 64.25% 的涨幅领涨，创业板 50 上涨 37.01%，国证 2000 和沪深 300 分别上涨 13.86% 和 7.55%，上证综指则收涨 3.16%。行业层面上，以电子、通信为代表的 AI 硬件及基建方向凭借高景气度吸引了市场较多资金，而传统周期行业则表现相对疲弱。

分季度来看，一季度市场经历了从“开门红”到震荡筑底的过程。年初市场延续了前期的上涨势头，但随后美联储主席提名人选凯文·沃什的鹰派立场引发流动性担忧，股市出现回调。此后虽然情绪一度企稳，上证指数触及 4197.23 点，但 3 月美伊冲突超预期爆发，伊朗封锁霍尔木兹海峡导致能源价格大幅攀升，通胀与衰退预期交织，美债收益率上行压制估值，上证指数一度

下探至 3794.68 点。一季度主要指数整体收跌，仅煤炭、石油石化等避险板块表现较好。

进入二季度，市场在震荡中展现出明显的结构性分化行情。全球 AI 算力需求的爆发驱动 AI 硬件产业链成为清晰的主线，半导体设备、通信设备等板块持续获得资金青睐，带动科创 50 在二季度单季实现显著上涨，沪深 300 和国证 2000 也震荡收涨。然而，资金的高度集中导致非主线资产出现一定程度的失血，中证红利等传统方向出现明显调整。外部环境方面，尽管地缘局势有所缓和，但美国超预期的就业数据推升了美联储偏鹰派的政策预期，10 年期美债收益率震荡上行，对全球风险资产估值形成持续压制。

7 月初以来，A 股指数出现明显回调，这主要是多重内外扰动共振的结果。前期强势的科技板块估值处于历史高位，交易拥挤度较高。Meta 出租算力引发市场对算力过剩的担忧，全球半导体产业链出现明显调整。其次，在增量资金不足的存量博弈环境下，巨型 IPO 上市对二级市场产生了一定的流动性虹吸效应。最后，美伊冲突再度反复，叠加美联储鹰派立场，推动 10 年期美债利率升至 4.69% 的年内新高，全球流动性收紧进一步压制了市场估值。

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，原则上采取完全复制的方法进行投资管理，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申购现金替代、禁止投资成分股替代、标的指数成分股调整、成分股分红和基金费用等因素。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家中证 A500ETF 的基金份额净值为 1.4170 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.73%，同期业绩比较基准收益率为 11.91%。基金报告期内日跟踪偏离度为 0.0267%，年化跟踪误差为 0.6268%，符合基金合同中日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2% 的规定。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，经过 7 月以来的快速调整，市场前期的估值压力和拥挤度已经得到一定程度的释放，大盘下行空间整体有限，对后市的态度可以适当转向积极。虽然短期内海外宏观环境和地缘政治仍有扰动，但科技创新的产业趋势依然明确，国内基本面也受益于科技相关的出口与投资改善而有所回升。随着经济预期改善和企业盈利预期逐步修复，前期调整较多、估值具备性价比且基本面边际改善的板块，也有望获得资金重新关注。整体来看，后续 A 股或仍以结构性机会为主，板块轮动和阶段性反弹机会值得关注。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和

基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、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：万家中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,558,461.54	2,361,145.84
结算备付金		16,518,483.66	24,731,211.75
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	936,817,989.80	1,741,859,503.39
其中：股票投资		936,817,989.80	1,741,859,503.39
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	60,492.63	-
资产总计		954,955,427.63	1,768,951,860.98
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		7,942,285.66	9,137,707.40
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		114,948.71	251,973.23
应付托管费		38,316.25	83,991.08
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	122,884.50	178,076.00
负债合计		8,218,435.12	9,651,747.71
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	668,120,647.00	1,412,120,647.00
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	278,616,345.51	347,179,466.27
净资产合计		946,736,992.51	1,759,300,113.27
负债和净资产总计		954,955,427.63	1,768,951,860.98

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4170 元，基金份额总额 668,120,647.00 份。

6.2 利润表

会计主体：万家中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		164,098,981.41	144,602,141.28
1. 利息收入		6,515.57	42,784.55
其中：存款利息收入	6.4.7.10	6,515.57	42,784.55
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		280,058,243.49	50,523,950.35
其中：股票投资收益	6.4.7.11	271,446,097.65	-13,776,601.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-

资产支持证券投资 收益	6.4.7.13	-	-
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	8,612,145.84	64,300,552.02
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	-116,271,158.39	92,912,313.24
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	305,380.74	1,123,093.14
减：二、营业总支出		1,373,443.95	5,830,367.10
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	911,067.74	4,244,474.99
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	303,689.29	1,414,825.04
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. 其他费用	6.4.7.20	158,686.92	171,067.07
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		162,725,537.46	138,771,774.18
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		162,725,537.46	138,771,774.18
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		162,725,537.46	138,771,774.18

6.3 净资产变动表

会计主体：万家中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	1,412,120,647.00	-	347,179,466.27	1,759,300,113.27
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,412,120,647.00	-	347,179,466.27	1,759,300,113.27
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-744,000,000.00	-	-68,563,120.76	-812,563,120.76
(一)、综合收益总额	-	-	162,725,537.46	162,725,537.46
(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)	-744,000,000.00	-	-231,288,658.22	-975,288,658.22
其中：1. 基金申购款	390,000,000.00	-	123,719,907.89	513,719,907.89
2. 基金赎回款	-1,134,000,000.00	-	-355,008,566.11	-1,489,008,566.11
(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	668,120,647.00	-	278,616,345.51	946,736,992.51
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	6,107,120,647.00	-	-34,349,315.16	6,072,771,331.84

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	6,107,120,647.00	-	-34,349,315.16	6,072,771,331.84
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,623,000,000.00	-	83,071,154.85	-1,539,928,845.15
（一）、综合收益总额	-	-	138,771,774.18	138,771,774.18
（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）	-1,623,000,000.00	-	-55,700,619.33	-1,678,700,619.33
其中：1. 基金申购款	2,262,000,000.00	-	-54,218,794.03	2,207,781,205.97
2. 基金赎回款	-3,885,000,000.00	-	-1,481,825.30	-3,886,481,825.30
（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	4,484,120,647.00	-	48,721,839.69	4,532,842,486.69

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：

陈广益

莫海波

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

万家中证 A500 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[2024]1530 号文《关于准予万家中证 A500 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 2024 年 11 月 5 日至 2024 年 11 月 19 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[2024]第 ZA31844 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 2024 年 11 月 22 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 2,000,000,027.00 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 120,620.00 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 2,000,120,647.00 元，折合 2,000,120,647.00 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）。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、次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券等）、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股指期货或其他品种，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，即中证 A500 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》、《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》及其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本中期报告所采用的会计政策、会计估计与上年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

(一) 印花税

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

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

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

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

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

(二) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

根据 2026 年 1 月 1 日起施行的《中华人民共和国增值税法》的规定，取得存款利息收入不征收增值税；

根据 2026 年 1 月 1 日起施行的《中华人民共和国增值税法实施条例》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；

根据财政部、国家税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；金融同业往来利息收入免征增值税；资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税；

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（三）企业所得税

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

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

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

（四）个人所得税

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	1,558,461.54
等于：本金	1,558,297.84
加：应计利息	163.70
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	1,558,461.54

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		778,384,987.88	-	936,817,989.80	158,433,001.92
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		778,384,987.88	-	936,817,989.80	158,433,001.92

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 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	60,492.63
合计	60,492.63

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-

银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	94,219.55
其他	28,664.95
合计	122,884.50

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,412,120,647.00	1,412,120,647.00
本期申购	390,000,000.00	390,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,134,000,000.00	-1,134,000,000.00
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	668,120,647.00	668,120,647.00

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	270,362,397.21	76,817,069.06	347,179,466.27
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	270,362,397.21	76,817,069.06	347,179,466.27
本期利润	278,996,695.85	-116,271,158.39	162,725,537.46
本期基金份额交易产生的变动数	-216,634,821.25	-14,653,836.97	-231,288,658.22
其中：基金申购款	148,961,620.92	-25,241,713.03	123,719,907.89
基金赎回款	-365,596,442.17	10,587,876.06	-355,008,566.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	332,724,271.81	-54,107,926.30	278,616,345.51

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,052.87

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	3,462.70
其他	-
合计	6,515.57

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	127,999,180.20
股票投资收益——赎回差价收入	143,446,917.45
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	271,446,097.65

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	948,457,071.68
减：卖出股票成本总额	819,626,023.37
减：交易费用	831,868.11
买卖股票差价收入	127,999,180.20

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 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	1,489,008,566.11
减：现金支付赎回款总额	826,287,161.11
减：赎回股票成本总额	519,274,487.55
减：交易费用	-
赎回差价收入	143,446,917.45

6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	8,612,145.84
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,612,145.84

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-116,271,158.39
股票投资	-116,271,158.39
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	-116,271,158.39

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	305,380.74
合计	305,380.74

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	460.00
账户维护费	4,500.00
中登登记结算服务费	59,507.37
IOPV 计算服务费	9,916.99
合计	158,686.92

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司（“万家基金”）	基金管理人
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人
中泰证券股份有限公司（“中泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
万家中证 A500 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 A500ETF 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	911,067.74	4,244,474.99
其中：应支付销售机构的客户维护费	91,058.01	486,314.03
应支付基金管理人的净管理费	820,009.73	3,758,160.96

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

$$H=E\times 0.15\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

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。经基金管理人和基金托管人核对一致后由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资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，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	303,689.29	1,414,825.04

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.05\%\div \text{当年天数}$$

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。经基金管理人和基金托管人核对一致后由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资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，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
万 家 中 证 A500ETF 发 起 式 联 接	346,728,303.00	51.8961	486,229,203.00	34.4326
中泰证券	566,110.00	0.0847	491,810.00	0.0348

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
农业银行	1,558,461.54	3,052.87	2,214,013.00	14,998.04

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

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

为最大限度地降低本基金投资的跟踪误差，保护基金份额持有人的合法权益，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，经本基金基金托管人同意，且履行了基金合同规定的相关程序，在报告期内投资于基金托管人农业银行股份有限公司发行的 A 股农业银行。于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有农业银行 802,400 股（2025 年 12 月 31 日：1,736,800 股），占本基金资产净值比例为 0.51%（2025 年 12 月 31 日：0.76%）。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	29,005	293,240.55	293,240.55	-
001248	华润新能	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股未上	10.11	10.11	12,430	125,667.30	125,667.30	-

	源			市						
001257	盛龙股份	2026年3月24日	6个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026年4月14日	6个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026年5月11日	6个月	新股流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001399	惠科股份	2026年6月16日	6个月	新股流通受限	10.12	27.73	5,002	50,620.24	138,705.46	-
301513	尚水智能	2026年4月10日	6个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026年4月28日	6个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026年4月22日	6个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大	2026	6个月	新	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-

	普微	年 4 月 8 日		股流通受限						
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股流	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-

	份	日		通 受 限						
603284	林平发展	2026年2月3日	6个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026年4月9日	6个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026年1月8日	6个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603407	长裕集团	2026年4月29日	6个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026年5月15日	6个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026年3月31日	6个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026年5月20日	6个月	新股流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-

				限						
688712	北 芯 生 命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688781	视 涯 科 技	2026 年 3 月 18 日	9 个月	新 股 流 通 受 限	22.68	42.16	7,012	159,032.16	295,625.92	-
688785	恒 运 昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688795	摩 尔 线 程	2025 年 11 月 26 日	9 个月	新 股 流 通 受 限	114.28	676.94	8,170	933,667.60	5,530,599.80	-
688797	臻 宝 科 技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688802	沐 曦 股 份	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新 股 流 通 受 限	104.66	768.89	3,994	418,012.04	3,070,946.66	-
688808	联 讯 仪 器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有	2026	6 个月	新	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-

	研复材	年 4 月 1 日		股流通受限						
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	1,793	35,286.24	253,691.57	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	5,400	1,275,903.40	4,492,800.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖

出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人将风险管理融入各业务层面，建立了四道防线：以各岗位目标责任制为基础，形成第一道防线；合规风控部门通过完善的风险控制制度和手段对各一线部门的风险管理工作进行指导、管理和监督，形成第二道防线；独立的监察稽核部门对公司内部控制制度的总体执行情况和有效性进行监督、检查、评估和反馈，形成第三道防线；董事会及其风险管理委员会听取公司管理层对公司整体运营情况的报告，并提出指导性意见，形成第四道防线。

6.4.13.2 信用风险

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

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

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。（2025 年 12 月 31 日：同）

6.4.13.3 流动性风险

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

而带来的变现困难。

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持有的证券大部分具有良好的流动性，部分证券流通暂时受限的情况参见附注 6.4.12 “期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券”，本报告期内本基金未出现因投资品种变现困难或投资集中而无法以合理价格及时变现基金资产以支付赎回款的情况。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30	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
----------------------	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

日							
资产							
货币资金	1, 558, 461. 54	-	-	-	-	-	1, 558, 461. 54
结算备付金	16, 518, 483. 66	-	-	-	-	-	16, 518, 483. 66
交易性金融资产	-	-	-	-	-	936, 817, 989. 80	936, 817, 989. 80
其他资产	-	-	-	-	-	60, 492. 63	60, 492. 63
资产总计	18, 076, 945. 20	-	-	-	-	936, 878, 482. 43	954, 955, 427. 63
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	114, 948. 71	114, 948. 71
应付托管费	-	-	-	-	-	38, 316. 25	38, 316. 25
应付清算款	-	-	-	-	-	7, 942, 285. 66	7, 942, 285. 66
其他负债	-	-	-	-	-	122, 884. 50	122, 884. 50
负债总计	-	-	-	-	-	8, 218, 435. 12	8, 218, 435. 12
利率敏感度缺口	18, 076, 945. 20	-	-	-	-	928, 660, 047. 31	946, 736, 992. 51
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	2, 361, 145. 84	-	-	-	-	-	2, 361, 145. 84
结算备付金	24, 731, 211. 75	-	-	-	-	-	24, 731, 211. 75
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1, 741, 859, 503. 39	1, 741, 859, 503. 39
资产总计	27, 092, 357. 59	-	-	-	-	1, 741, 859, 503. 39	1, 768, 951, 860. 98
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	251, 973. 23	251, 973. 23
应付托管费	-	-	-	-	-	83, 991. 08	83, 991. 08
应付清算款	-	-	-	-	-	9, 137, 707. 40	9, 137, 707. 40
其他负债	-	-	-	-	-	178, 076. 00	178, 076. 00
负债总计	-	-	-	-	-	9, 651, 747. 71	9, 651, 747. 71
利率敏感度缺口	27, 092, 357. 59	-	-	-	-	1, 732, 207, 755. 68	1, 759, 300, 113. 27

注：该表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并

按照合约规定的重新定价日或到期日孰早进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2025 年 12 月 31 日：同），货币资金、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2025 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	936,817,989.80	98.95	1,741,859,503.39	99.01
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	936,817,989.80	98.95	1,741,859,503.39	99.01

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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	股票基准指数上升 100 个基点	9,280,428.51	17,320,794.26
	股票基准指数下降 100 个基点	-9,280,428.51	-17,320,794.26

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	920,991,123.49	1,722,443,964.80
第二层次	4,911,707.85	11,610,860.48
第三层次	10,915,158.46	7,804,678.11
合计	936,817,989.80	1,741,859,503.39

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	936,817,989.80	98.10
	其中：股票	936,817,989.80	98.10
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	18,076,945.20	1.89
8	其他各项资产	60,492.63	0.01
9	合计	954,955,427.63	100.00

注：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。

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	2,902,782.00	0.31
B	采矿业	38,070,489.98	4.02
C	制造业	653,931,820.22	69.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,168,825.00	2.13
E	建筑业	11,272,652.40	1.19
F	批发和零售业	7,187,009.00	0.76
G	交通运输、仓储和邮政业	20,598,218.56	2.18
H	住宿和餐饮业	433,769.00	0.05
I	信息传输、软件和	52,170,431.61	5.51

	信息技术服务业		
J	金融业	89,723,526.08	9.48
K	房地产业	5,176,215.80	0.55
L	租赁和商务服 务业	6,682,812.24	0.71
M	科学研究和技术 服务业	11,064,909.00	1.17
N	水利、环境和公共 设施管理业	1,597,154.20	0.17
O	居民服务、修理和 其他服务业	-	-
P	教育	305,820.00	0.03
Q	卫生和社会工作	1,818,883.40	0.19
R	文化、体育和娱乐 业	704,732.00	0.07
S	综合	1,670,322.00	0.18
	合计	925,480,372.49	97.75

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	36,149.82	0.00
C	制造业	10,877,425.18	1.15
D	电力、热力、燃气 及水生产和供应业	418,907.85	0.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和 邮政业	1,583.46	0.00
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	-	-
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	11,334,066.31	1.20

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	31,260	39,700,200.00	4.19
2	300750	宁德时代	73,940	29,059,159.40	3.07
3	300502	新易盛	38,860	23,588,020.00	2.49
4	600519	贵州茅台	17,375	20,597,888.75	2.18
5	603986	兆易创新	18,600	15,159,000.00	1.60
6	688256	寒武纪	8,932	14,251,452.60	1.51
7	601318	中国平安	297,502	14,202,745.48	1.50
8	600036	招商银行	345,376	12,260,848.00	1.30
9	601899	紫金矿业	460,002	11,564,450.28	1.22
10	002371	北方华创	11,967	10,585,529.52	1.12
11	000333	美的集团	135,700	10,249,421.00	1.08
12	002475	立讯精密	142,300	10,017,920.00	1.06
13	688012	中微公司	21,195	9,929,857.50	1.05
14	688008	澜起科技	31,860	9,873,414.00	1.04
15	688041	海光信息	25,737	9,530,411.10	1.01
16	002384	东山精密	35,700	9,365,895.00	0.99
17	600900	长江电力	341,300	9,034,211.00	0.95
18	688981	中芯国际	55,719	8,849,291.58	0.93
19	000725	京东方 A	1,014,200	8,803,256.00	0.93
20	603259	药明康德	69,100	8,603,641.00	0.91
21	601166	兴业银行	472,700	7,827,912.00	0.83
22	600030	中信证券	272,335	7,824,184.55	0.83
23	300059	东方财富	353,412	7,202,536.56	0.76
24	600183	生益科技	40,684	7,054,605.60	0.75
25	600276	恒瑞医药	124,584	6,483,351.36	0.68
26	300274	阳光电源	40,480	6,437,129.60	0.68
27	601398	工商银行	902,600	6,381,382.00	0.67
28	300408	三环集团	37,400	6,242,060.00	0.66
29	002594	比亚迪	76,000	6,057,200.00	0.64
30	600487	亨通光电	54,900	6,002,766.00	0.63
31	300476	胜宏科技	17,000	5,889,310.00	0.62
32	601211	国泰海通	315,300	5,738,460.00	0.61

33	002463	沪电股份	37,500	5,730,000.00	0.61
34	300394	天孚通信	18,264	5,528,147.52	0.58
35	688525	佰维存储	10,700	5,293,611.00	0.56
36	000988	华工科技	28,200	5,206,002.00	0.55
37	688498	源杰科技	2,700	5,092,200.00	0.54
38	301308	江波龙	7,200	5,067,360.00	0.54
39	600176	中国巨石	67,000	4,882,960.00	0.52
40	601288	农业银行	802,400	4,870,568.00	0.51
41	601328	交通银行	745,201	4,791,642.43	0.51
42	000651	格力电器	125,100	4,691,250.00	0.50
43	600522	中天科技	76,100	4,617,748.00	0.49
44	688072	拓荆科技	5,400	4,492,800.00	0.47
45	688521	芯原股份	11,900	4,416,566.00	0.47
46	603019	中科曙光	40,800	4,374,984.00	0.46
47	603993	洛阳钼业	243,800	4,278,690.00	0.45
48	600150	中国船舶	125,998	4,257,472.42	0.45
49	600887	伊利股份	176,500	4,228,940.00	0.45
50	300604	长川科技	12,300	4,199,466.00	0.44
51	600584	长电科技	39,900	4,131,645.00	0.44
52	000338	潍柴动力	150,000	4,087,500.00	0.43
53	000858	五 粮 液	54,300	4,018,200.00	0.42
54	688347	华虹宏力	11,514	3,872,158.20	0.41
55	601816	京沪高铁	818,300	3,706,899.00	0.39
56	688120	华海清科	11,215	3,613,248.70	0.38
57	600309	万华化学	52,500	3,591,525.00	0.38
58	002916	深南电路	7,704	3,527,661.60	0.37
59	300124	汇川技术	53,000	3,515,490.00	0.37
60	002415	海康威视	102,300	3,498,660.00	0.37
61	002008	大族激光	23,000	3,452,530.00	0.36
62	002281	光迅科技	13,400	3,442,996.00	0.36
63	600111	北方稀土	70,700	3,397,135.00	0.36
64	000100	TCL 科技	577,100	3,358,722.00	0.35
65	300857	协创数据	9,700	3,297,030.00	0.35
66	000063	中兴通讯	89,900	3,253,481.00	0.34
67	300136	信维通信	27,100	3,231,675.00	0.34
68	600000	浦发银行	371,908	3,202,127.88	0.34
69	600089	特变电工	141,196	3,176,910.00	0.34
70	601857	中国石油	361,700	3,139,556.00	0.33
71	002028	思源电气	17,320	2,996,360.00	0.32
72	601088	中国神华	76,500	2,986,560.00	0.32
73	300433	蓝思科技	55,400	2,972,764.00	0.31
74	600031	三一重工	165,300	2,856,384.00	0.30
75	300475	香农芯创	9,300	2,790,000.00	0.29

76	300014	亿纬锂能	42,500	2,763,775.00	0.29
77	002050	三花智控	62,400	2,734,992.00	0.29
78	601601	中国太保	95,755	2,730,932.60	0.29
79	000001	平安银行	271,080	2,724,354.00	0.29
80	000792	盐湖股份	88,700	2,677,853.00	0.28
81	002714	牧原股份	76,000	2,659,240.00	0.28
82	600549	厦门钨业	31,100	2,649,720.00	0.28
83	300223	君正股份	10,613	2,641,575.70	0.28
84	002353	杰瑞股份	17,100	2,607,750.00	0.28
85	002156	通富微电	33,800	2,564,406.00	0.27
86	600406	国电南瑞	112,001	2,559,222.85	0.27
87	601668	中国建筑	576,600	2,502,444.00	0.26
88	000657	中钨高新	25,500	2,440,860.00	0.26
89	002436	兴森科技	47,500	2,420,125.00	0.26
90	601919	中远海控	175,400	2,325,804.00	0.25
91	002602	世纪华通	164,400	2,318,040.00	0.24
92	300760	迈瑞医疗	16,900	2,295,527.00	0.24
93	601988	中国银行	400,100	2,288,572.00	0.24
94	600660	福耀玻璃	44,800	2,259,712.00	0.24
95	300054	鼎龙股份	21,300	2,257,161.00	0.24
96	603501	豪威集团	23,730	2,250,790.50	0.24
97	601728	中国电信	433,000	2,247,270.00	0.24
98	601012	隆基绿能	169,000	2,217,280.00	0.23
99	601225	陕西煤业	108,244	2,202,765.40	0.23
100	002230	科大讯飞	53,700	2,193,108.00	0.23
101	600941	中国移动	25,200	2,170,476.00	0.23
102	600690	海尔智家	104,400	2,130,804.00	0.23
103	688777	中控技术	17,958	2,110,065.00	0.22
104	002352	顺丰控股	66,850	2,089,731.00	0.22
105	601985	中国核电	229,600	2,073,288.00	0.22
106	002460	赣锋锂业	31,625	2,068,275.00	0.22
107	300033	同花顺	8,540	2,058,140.00	0.22
108	300757	罗博特科	3,300	2,042,700.00	0.22
109	603799	华友钴业	42,315	2,042,121.90	0.22
110	002709	天赐材料	39,700	2,041,771.00	0.22
111	002938	鹏鼎控股	19,260	2,029,618.80	0.21
112	000977	浪潮信息	28,800	2,016,000.00	0.21
113	600160	巨化股份	37,500	1,987,875.00	0.21
114	300442	润泽科技	22,900	1,902,303.00	0.20
115	002851	麦格米特	11,200	1,872,416.00	0.20
116	000425	徐工机械	228,700	1,850,183.00	0.20
117	688126	沪硅产业	46,248	1,844,832.72	0.19
118	000938	紫光股份	63,600	1,835,496.00	0.19

119	002202	金风科技	76,600	1,830,740.00	0.19
120	601600	中国铝业	221,800	1,823,196.00	0.19
121	600938	中国海油	66,800	1,813,620.00	0.19
122	600028	中国石化	406,000	1,810,760.00	0.19
123	600460	士兰微	32,700	1,787,382.00	0.19
124	002466	天齐锂业	29,000	1,778,280.00	0.19
125	300346	南大光电	19,180	1,777,027.00	0.19
126	601766	中国中车	339,500	1,765,400.00	0.19
127	002600	领益智造	101,400	1,758,276.00	0.19
128	300567	精测电子	5,500	1,746,800.00	0.18
129	600050	中国联通	435,500	1,742,000.00	0.18
130	300661	圣邦股份	11,950	1,714,586.00	0.18
131	002837	英维克	21,320	1,696,219.20	0.18
132	002080	中材科技	18,700	1,683,000.00	0.18
133	002049	紫光国微	18,900	1,677,375.00	0.18
134	002185	华天科技	74,300	1,657,633.00	0.18
135	601628	中国人寿	46,500	1,643,775.00	0.17
136	688002	睿创微纳	10,611	1,641,415.59	0.17
137	002138	顺络电子	22,400	1,637,440.00	0.17
138	002179	中航光电	35,306	1,631,137.20	0.17
139	002407	多氟多	32,400	1,627,452.00	0.17
140	601100	恒立液压	14,860	1,598,341.60	0.17
141	000568	泸州老窖	20,520	1,590,710.40	0.17
142	601872	招商轮船	90,200	1,584,814.00	0.17
143	600879	航天电子	73,800	1,571,202.00	0.17
144	002241	歌尔股份	69,400	1,563,582.00	0.17
145	300395	菲利华	11,600	1,551,268.00	0.16
146	603288	海天味业	46,679	1,547,875.64	0.16
147	601006	大秦铁路	332,394	1,532,336.34	0.16
148	000408	藏格矿业	22,000	1,525,040.00	0.16
149	601658	邮储银行	307,300	1,514,989.00	0.16
150	300390	天华新能	16,080	1,503,640.80	0.16
151	605117	德业股份	14,083	1,495,332.94	0.16
152	688469	芯联集成	140,800	1,493,888.00	0.16
153	600905	三峡能源	400,100	1,484,371.00	0.16
154	688396	华润微	15,120	1,474,956.00	0.16
155	600489	中金黄金	81,100	1,463,855.00	0.15
156	688017	绿的谐波	3,500	1,462,510.00	0.15
157	601888	中国中免	27,200	1,460,912.00	0.15
158	002625	光启技术	48,100	1,458,392.00	0.15
159	000630	铜陵有色	224,300	1,426,548.00	0.15
160	600893	航发动力	37,100	1,422,414.00	0.15
161	688271	联影医疗	14,000	1,417,220.00	0.15

162	600673	东阳光	42,000	1,410,360.00	0.15
163	600010	包钢股份	632,400	1,410,252.00	0.15
164	688111	金山办公	6,592	1,404,425.60	0.15
165	601127	赛力斯	22,700	1,390,375.00	0.15
166	300058	蓝色光标	99,820	1,373,523.20	0.15
167	601689	拓普集团	24,245	1,367,902.90	0.14
168	002273	水晶光电	38,500	1,365,980.00	0.14
169	300037	新宙邦	14,700	1,364,895.00	0.14
170	002027	分众传媒	281,700	1,363,428.00	0.14
171	600118	中国卫星	16,500	1,353,825.00	0.14
172	300751	迈为股份	4,700	1,327,562.00	0.14
173	600019	宝钢股份	243,778	1,323,714.54	0.14
174	600760	中航沈飞	31,880	1,310,268.00	0.14
175	000426	兴业银锡	39,500	1,301,920.00	0.14
176	000807	云铝股份	57,900	1,281,906.00	0.14
177	601168	西部矿业	46,500	1,262,010.00	0.13
178	600362	江西铜业	29,000	1,255,700.00	0.13
179	300450	先导智能	30,800	1,254,176.00	0.13
180	600104	上汽集团	128,500	1,254,160.00	0.13
181	600989	宝丰能源	61,520	1,250,701.60	0.13
182	601727	上海电气	176,300	1,234,100.00	0.13
183	688099	晶晨股份	11,952	1,229,860.80	0.13
184	600875	东方电气	42,700	1,228,479.00	0.13
185	600988	赤峰黄金	46,500	1,223,880.00	0.13
186	002001	新 和 成	42,900	1,219,218.00	0.13
187	605589	圣泉集团	18,800	1,195,116.00	0.13
188	002422	科伦药业	31,000	1,194,120.00	0.13
189	601390	中国中铁	285,820	1,191,869.40	0.13
190	600667	太极实业	40,800	1,190,544.00	0.13
191	600885	宏发股份	34,380	1,185,766.20	0.13
192	000538	云南白药	24,964	1,182,544.68	0.12
193	002126	银轮股份	23,700	1,180,260.00	0.12
194	002738	中矿资源	20,000	1,179,800.00	0.12
195	000960	锡业股份	27,600	1,178,244.00	0.12
196	600547	山东黄金	50,600	1,168,354.00	0.12
197	600795	国电电力	249,600	1,165,632.00	0.12
198	600392	盛和资源	39,100	1,164,007.00	0.12
199	000831	中国稀土	20,600	1,143,094.00	0.12
200	600585	海螺水泥	67,100	1,137,345.00	0.12
201	600418	江淮汽车	43,900	1,133,937.00	0.12
202	601669	中国电建	241,000	1,132,700.00	0.12
203	002648	卫星化学	47,100	1,106,379.00	0.12
204	300316	晶盛机电	18,300	1,105,320.00	0.12

205	600141	兴发集团	23,400	1,099,098.00	0.12
206	002812	恩捷股份	16,400	1,097,324.00	0.12
207	002129	TCL 中环	90,075	1,082,701.50	0.11
208	600096	云天化	35,500	1,079,200.00	0.11
209	300015	爱尔眼科	130,500	1,077,930.00	0.11
210	300782	卓胜微	9,800	1,073,884.00	0.11
211	601179	中国西电	71,400	1,065,288.00	0.11
212	301358	湖南裕能	14,000	1,062,180.00	0.11
213	600346	恒力石化	59,000	1,044,890.00	0.11
214	601868	中国能建	390,500	1,042,635.00	0.11
215	600482	中国动力	31,777	1,042,285.60	0.11
216	002195	岩山科技	158,100	1,033,974.00	0.11
217	000066	中国长城	53,920	1,027,176.00	0.11
218	600497	驰宏锌锗	84,700	1,025,717.00	0.11
219	002558	巨人网络	37,000	1,019,720.00	0.11
220	300418	昆仑万维	25,100	1,013,036.00	0.11
221	600580	卧龙电驱	30,600	1,012,860.00	0.11
222	000625	长安汽车	139,164	997,805.88	0.11
223	600066	宇通客车	36,800	986,608.00	0.10
224	600426	华鲁恒升	41,200	985,504.00	0.10
225	600157	永泰能源	611,700	984,837.00	0.10
226	000157	中联重科	139,185	970,119.45	0.10
227	600221	海航控股	718,600	970,110.00	0.10
228	600895	张江高科	26,000	968,500.00	0.10
229	002532	天山铝业	90,200	967,846.00	0.10
230	688036	传音控股	16,222	956,286.90	0.10
231	300803	指南针	10,400	953,368.00	0.10
232	600711	盛屯矿业	86,100	944,517.00	0.10
233	002340	格林美	142,500	941,925.00	0.10
234	605499	东鹏饮料	7,610	939,302.30	0.10
235	000933	神火股份	44,100	934,920.00	0.10
236	600436	片仔癀	8,550	934,344.00	0.10
237	600011	华能国际	123,000	933,570.00	0.10
238	600048	保利发展	200,900	930,167.00	0.10
239	002821	凯莱英	5,700	923,400.00	0.10
240	600143	金发科技	59,700	922,365.00	0.10
241	600438	通威股份	75,400	913,094.00	0.10
242	300017	网宿科技	69,800	908,098.00	0.10
243	600115	中国东航	237,700	905,637.00	0.10
244	002493	荣盛石化	83,800	900,850.00	0.10
245	002236	大华股份	54,500	898,705.00	0.09
246	002131	利欧股份	188,940	897,465.00	0.09
247	600886	国投电力	66,900	890,439.00	0.09

248	600570	恒生电子	42,014	890,276.66	0.09
249	002456	欧菲光	93,700	886,402.00	0.09
250	600352	浙江龙盛	72,502	877,999.22	0.09
251	688047	龙芯中科	5,642	872,648.14	0.09
252	601233	桐昆股份	40,000	866,000.00	0.09
253	603659	璞泰来	29,800	862,114.00	0.09
254	300339	润和软件	22,300	858,773.00	0.09
255	003816	中国广核	219,300	857,463.00	0.09
256	688213	思特威	8,000	856,560.00	0.09
257	601058	赛轮轮胎	73,800	850,914.00	0.09
258	601360	三六零	97,800	849,882.00	0.09
259	000301	东方盛虹	73,600	842,720.00	0.09
260	600026	中远海能	46,500	834,210.00	0.09
261	300759	康龙化成	28,800	833,184.00	0.09
262	002074	国轩高科	30,200	830,802.00	0.09
263	688578	艾力斯	7,600	829,920.00	0.09
264	300438	鹏辉能源	9,900	820,215.00	0.09
265	002555	三七互娱	43,000	811,410.00	0.09
266	688122	西部超导	12,914	811,128.34	0.09
267	688235	百济神州	3,166	806,095.26	0.09
268	600009	上海机场	34,800	803,880.00	0.08
269	600196	复星医药	35,500	797,685.00	0.08
270	000768	中航西飞	38,800	794,624.00	0.08
271	000975	山金国际	46,300	787,100.00	0.08
272	601111	中国国航	130,000	786,500.00	0.08
273	300001	特锐德	20,700	783,081.00	0.08
274	002472	双环传动	18,800	780,388.00	0.08
275	300207	欣旺达	41,000	778,590.00	0.08
276	002517	恺英网络	47,900	778,375.00	0.08
277	600415	小商品城	76,344	775,655.04	0.08
278	600029	南方航空	149,700	775,446.00	0.08
279	600674	川投能源	54,500	772,265.00	0.08
280	002601	龙佰集团	46,700	769,616.00	0.08
281	603129	春风动力	3,000	767,400.00	0.08
282	300458	全志科技	19,400	765,524.00	0.08
283	601186	中国铁建	128,500	764,575.00	0.08
284	600219	南山铝业	191,400	763,686.00	0.08
285	002128	电投能源	32,900	760,648.00	0.08
286	601877	正泰电器	30,200	757,114.00	0.08
287	600233	圆通速递	47,700	751,275.00	0.08
288	002595	豪迈科技	16,090	749,794.00	0.08
289	601117	中国化学	101,600	746,760.00	0.08
290	300115	长盈精密	26,700	745,998.00	0.08

291	002155	湖南黄金	30,590	730,183.30	0.08
292	600372	中航机载	67,200	729,120.00	0.08
293	301236	软通动力	17,158	728,357.10	0.08
294	600839	四川长虹	103,200	720,336.00	0.08
295	300454	深信服	7,400	711,880.00	0.08
296	002465	海格通信	55,500	708,735.00	0.07
297	300568	星源材质	37,300	698,256.00	0.07
298	000963	华东医药	24,600	691,752.00	0.07
299	300347	泰格医药	14,300	686,400.00	0.07
300	600741	华域汽车	44,200	685,984.00	0.07
301	603650	彤程新材	7,000	685,860.00	0.07
302	002920	德赛西威	8,400	684,600.00	0.07
303	000547	航天发展	35,700	683,655.00	0.07
304	300024	机器人	34,800	672,684.00	0.07
305	688676	金盘科技	7,800	660,192.00	0.07
306	002130	沃尔核材	34,800	659,808.00	0.07
307	300012	华测检测	47,200	654,192.00	0.07
308	002497	雅化集团	32,100	653,877.00	0.07
309	688331	荣昌生物	5,000	651,300.00	0.07
310	002432	九安医疗	9,200	650,256.00	0.07
311	300496	中科创达	10,500	648,795.00	0.07
312	688506	百利天恒	2,200	646,866.00	0.07
313	000878	云南铜业	40,700	646,316.00	0.07
314	001979	招商蛇口	100,300	644,929.00	0.07
315	002271	东方雨虹	53,800	638,606.00	0.07
316	300866	安克创新	6,100	637,450.00	0.07
317	300083	创世纪	46,700	636,054.00	0.07
318	002414	高德红外	47,900	635,154.00	0.07
319	603979	金诚信	10,700	631,621.00	0.07
320	000034	神州数码	22,620	627,705.00	0.07
321	300474	景嘉微	10,300	622,944.00	0.07
322	002444	巨星科技	20,000	622,000.00	0.07
323	601021	春秋航空	13,633	621,392.14	0.07
324	000661	长春高新	9,300	619,380.00	0.07
325	300763	锦浪科技	6,800	614,380.00	0.06
326	688266	泽璟制药	5,213	608,148.58	0.06
327	002756	永兴材料	10,700	606,048.00	0.06
328	000733	振华科技	10,600	600,384.00	0.06
329	601319	中国人保	88,600	598,936.00	0.06
330	600699	均胜电子	27,400	592,114.00	0.06
331	300748	金力永磁	19,100	589,235.00	0.06
332	002025	航天电器	7,700	586,894.00	0.06
333	601615	明阳智能	50,700	586,599.00	0.06

334	002078	太阳纸业	46,700	583,283.00	0.06
335	300073	当升科技	12,100	581,284.00	0.06
336	300142	沃森生物	44,700	580,653.00	0.06
337	603087	甘李药业	10,200	578,952.00	0.06
338	300432	富临精工	28,800	578,592.00	0.06
339	601677	明泰铝业	34,400	571,040.00	0.06
340	600039	四川路桥	72,700	568,514.00	0.06
341	601800	中国交建	99,500	568,145.00	0.06
342	000423	东阿阿胶	12,500	567,000.00	0.06
343	000002	万科 A	191,300	566,248.00	0.06
344	603606	东方电缆	13,600	564,536.00	0.06
345	300919	中伟新材	12,900	564,375.00	0.06
346	002252	上海莱士	129,400	561,596.00	0.06
347	688169	石头科技	5,880	558,423.60	0.06
348	300724	捷佳伟创	7,900	557,740.00	0.06
349	688599	天合光能	39,402	556,356.24	0.06
350	600226	亨通股份	58,000	556,220.00	0.06
351	688223	晶科能源	115,001	546,254.75	0.06
352	688608	恒玄科技	3,200	535,008.00	0.06
353	600588	用友网络	57,500	527,850.00	0.06
354	002064	华峰化学	55,100	522,899.00	0.06
355	688390	固德威	4,809	521,824.59	0.06
356	001965	招商公路	56,738	519,720.08	0.05
357	601633	长城汽车	34,423	519,443.07	0.05
358	000786	北新建材	28,500	515,565.00	0.05
359	688180	君实生物	15,100	510,682.00	0.05
360	002831	裕同科技	14,200	504,952.00	0.05
361	300677	英科医疗	12,600	493,542.00	0.05
362	000519	中兵红箭	23,400	493,038.00	0.05
363	688188	柏楚电子	4,620	492,954.00	0.05
364	601618	中国中冶	200,400	488,976.00	0.05
365	600516	方大炭素	79,200	488,664.00	0.05
366	603806	福斯特	29,100	488,589.00	0.05
367	688065	凯赛生物	10,200	488,070.00	0.05
368	600177	雅戈尔	64,700	487,191.00	0.05
369	002294	信立泰	15,248	486,258.72	0.05
370	300972	万辰集团	2,800	485,548.00	0.05
371	302132	中航成飞	8,300	484,056.00	0.05
372	603260	合盛硅业	10,000	482,600.00	0.05
373	601607	上海医药	31,300	482,020.00	0.05
374	002176	江特电机	48,063	481,110.63	0.05
375	000623	吉林敖东	26,700	473,391.00	0.05
376	300699	光威复材	16,300	466,995.00	0.05

377	000617	中油资本	70,500	464,595.00	0.05
378	002085	万丰奥威	41,800	463,562.00	0.05
379	300558	贝达药业	7,100	461,997.00	0.05
380	300832	新产业	10,940	459,480.00	0.05
381	002318	久立特材	19,200	458,880.00	0.05
382	300342	天银机电	9,700	455,900.00	0.05
383	002459	晶澳科技	55,680	451,008.00	0.05
384	300251	光线传媒	40,600	450,254.00	0.05
385	002065	东华软件	63,000	449,820.00	0.05
386	600499	科达制造	32,400	447,120.00	0.05
387	600085	同仁堂	19,300	446,023.00	0.05
388	002266	浙富控股	88,000	445,280.00	0.05
389	002044	美年健康	88,000	442,640.00	0.05
390	301550	斯菱智驱	4,800	438,864.00	0.05
391	688472	阿特斯	40,400	437,128.00	0.05
392	600515	海南机场	158,900	435,386.00	0.05
393	605090	九丰能源	11,700	434,889.00	0.05
394	300409	道氏技术	21,800	434,474.00	0.05
395	603596	伯特利	17,392	432,017.28	0.05
396	002223	鱼跃医疗	16,800	431,088.00	0.05
397	688005	容百科技	14,086	431,031.60	0.05
398	000400	许继电气	19,836	430,441.20	0.05
399	300003	乐普医疗	36,300	430,155.00	0.05
400	600521	华海药业	29,700	427,680.00	0.05
401	002405	四维图新	65,900	426,373.00	0.05
402	000032	深桑达 A	17,000	424,150.00	0.04
403	000415	渤海租赁	103,800	422,466.00	0.04
404	000683	博源化工	73,200	421,632.00	0.04
405	601216	君正集团	94,400	421,024.00	0.04
406	000999	华润三九	18,680	420,113.20	0.04
407	600862	中航高科	23,300	420,099.00	0.04
408	000039	中集集团	51,350	416,448.50	0.04
409	688617	惠泰医疗	2,273	412,685.88	0.04
410	600803	新奥股份	26,100	412,380.00	0.04
411	600704	物产中大	87,200	411,584.00	0.04
412	603605	珀莱雅	6,800	407,456.00	0.04
413	603766	隆鑫通用	34,000	405,620.00	0.04
414	600312	平高电气	22,800	402,648.00	0.04
415	600018	上港集团	85,000	401,200.00	0.04
416	000887	中鼎股份	22,300	398,947.00	0.04
417	688116	天奈科技	10,300	393,460.00	0.04
418	600332	白云山	19,500	390,780.00	0.04
419	000967	盈峰环境	37,000	389,610.00	0.04

420	600153	建发股份	49,100	389,363.00	0.04
421	600765	中航重机	30,100	388,892.00	0.04
422	000830	鲁西化工	32,400	388,800.00	0.04
423	300122	智飞生物	33,100	386,939.00	0.04
424	600166	福田汽车	132,000	384,120.00	0.04
425	002410	广联达	46,000	375,360.00	0.04
426	600323	瀚蓝环境	13,600	373,456.00	0.04
427	300896	爱美客	4,280	373,216.00	0.04
428	002007	华兰生物	30,600	373,014.00	0.04
429	601799	星宇股份	4,000	362,480.00	0.04
430	688114	华大智造	7,000	357,560.00	0.04
431	603568	伟明环保	22,940	352,817.20	0.04
432	600398	海澜之家	67,100	350,933.00	0.04
433	002603	以岭药业	23,300	349,500.00	0.04
434	601000	唐山港	83,600	346,940.00	0.04
435	600486	扬农化工	6,800	344,760.00	0.04
436	688009	中国通号	72,185	343,600.60	0.04
437	002389	航天彩虹	19,300	342,961.00	0.04
438	600529	山东药玻	18,500	341,325.00	0.04
439	601018	宁波港	107,900	339,885.00	0.04
440	600208	衢州发展	119,800	339,034.00	0.04
441	603486	科沃斯	6,600	334,950.00	0.04
442	000738	航发控制	18,300	334,707.00	0.04
443	600008	首创环保	122,900	334,288.00	0.04
444	600170	上海建工	149,300	331,446.00	0.04
445	000932	华菱钢铁	95,100	329,997.00	0.03
446	600316	洪都航空	11,800	329,692.00	0.03
447	600998	九州通	70,200	329,238.00	0.03
448	600161	天坛生物	27,700	320,766.00	0.03
449	600820	隧道股份	61,400	319,894.00	0.03
450	688303	大全能源	18,291	318,812.13	0.03
451	300118	东方日升	25,600	318,720.00	0.03
452	601238	广汽集团	62,200	315,976.00	0.03
453	603885	吉祥航空	30,500	313,845.00	0.03
454	688166	博瑞医药	8,800	308,088.00	0.03
455	002607	中公教育	169,900	305,820.00	0.03
456	603816	顾家家居	13,530	302,530.80	0.03
457	603939	益丰药房	16,800	302,064.00	0.03
458	600763	通策医疗	8,805	298,313.40	0.03
459	603392	万泰生物	10,717	289,037.49	0.03
460	601567	三星电气	19,300	288,342.00	0.03
461	600038	中直股份	11,400	288,306.00	0.03
462	300049	福瑞医科	7,400	287,712.00	0.03

463	300676	华大基因	8,200	287,492.00	0.03
464	300573	兴齐眼药	7,040	286,950.40	0.03
465	601880	辽港股份	205,800	284,004.00	0.03
466	600535	天士力	21,100	279,153.00	0.03
467	600511	国药股份	10,600	276,024.00	0.03
468	300100	双林股份	9,700	269,466.00	0.03
469	600816	建元信托	108,400	264,496.00	0.03
470	002244	滨江集团	34,800	264,480.00	0.03
471	000833	粤桂股份	11,100	259,962.00	0.03
472	688063	派能科技	4,843	257,986.61	0.03
473	601155	新城控股	25,130	257,833.80	0.03
474	002120	韵达股份	40,500	257,580.00	0.03
475	300144	宋城演艺	43,800	254,478.00	0.03
476	002544	普天科技	13,400	244,148.00	0.03
477	000998	隆平高科	32,300	243,542.00	0.03
478	600064	南京高科	33,300	237,429.00	0.03
479	601866	中远海发	107,000	236,470.00	0.02
480	600635	大众公用	54,900	234,972.00	0.02
481	600754	锦江酒店	12,700	228,473.00	0.02
482	000035	中国天楹	47,300	228,459.00	0.02
483	300457	赢合科技	10,800	227,664.00	0.02
484	600655	豫园股份	54,300	223,173.00	0.02
485	300601	康泰生物	18,800	213,192.00	0.02
486	600004	白云机场	29,000	210,540.00	0.02
487	603899	晨光股份	10,100	208,363.00	0.02
488	600663	陆家嘴	33,000	207,240.00	0.02
489	600258	首旅酒店	18,800	205,296.00	0.02
490	600859	王府井	22,300	204,714.00	0.02
491	002091	江苏国泰	27,700	200,271.00	0.02
492	300070	碧水源	61,800	197,142.00	0.02
493	000069	华侨城 A	110,400	181,056.00	0.02
494	600864	哈投股份	34,482	178,961.58	0.02
495	301078	孩子王	24,100	162,916.00	0.02
496	002292	奥飞娱乐	24,700	162,032.00	0.02
497	603833	欧派家居	5,200	156,572.00	0.02
498	002891	中宠股份	5,600	149,632.00	0.02
499	600325	华发股份	62,300	143,913.00	0.02
500	002572	索菲亚	15,700	114,610.00	0.01

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	688795	摩尔线程	8,170	5,530,599.80	0.58
2	688802	沐曦股份	3,994	3,070,946.66	0.32

3	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.06
4	001248	华润新能源	41,435	418,907.85	0.04
5	688781	视涯科技	7,012	295,625.92	0.03
6	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.03
7	688820	盛合晶微	1,793	253,691.57	0.03
8	001399	惠科股份	5,002	138,705.46	0.01
9	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
10	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
11	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
12	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01
13	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
14	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
15	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
16	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
17	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
18	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
19	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
20	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
21	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
22	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
23	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
24	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
25	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
26	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
27	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
28	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
29	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
30	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
31	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
32	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
33	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
34	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
35	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
36	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
37	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	600519	贵州茅台	25,156,954.60	1.43
2	688041	海光信息	13,141,849.89	0.75
3	601318	中国平安	10,887,997.00	0.62
4	601899	紫金矿业	9,482,690.00	0.54

5	600036	招商银行	8,297,630.00	0.47
6	688008	澜起科技	7,727,452.52	0.44
7	002371	北方华创	6,708,841.00	0.38
8	603986	兆易创新	6,673,160.00	0.38
9	688981	中芯国际	6,021,181.89	0.34
10	600900	长江电力	5,926,184.00	0.34
11	601166	兴业银行	5,494,158.00	0.31
12	600030	中信证券	4,775,511.00	0.27
13	600276	恒瑞医药	4,587,150.00	0.26
14	600183	生益科技	4,492,543.96	0.26
15	601398	工商银行	4,207,615.00	0.24
16	688498	源杰科技	4,146,247.36	0.24
17	301308	江波龙	4,141,243.00	0.24
18	603259	药明康德	4,077,367.00	0.23
19	688525	佰维存储	3,983,317.70	0.23
20	601211	国泰海通	3,568,667.00	0.20

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	600519	贵州茅台	54,138,258.35	3.08
2	601318	中国平安	32,804,166.00	1.86
3	601899	紫金矿业	29,178,925.66	1.66
4	600036	招商银行	24,107,294.80	1.37
5	688041	海光信息	21,241,902.46	1.21
6	600900	长江电力	16,527,640.00	0.94
7	601166	兴业银行	15,838,203.00	0.90
8	688008	澜起科技	14,040,801.15	0.80
9	688981	中芯国际	13,725,664.22	0.78
10	603986	兆易创新	13,543,190.00	0.77
11	600030	中信证券	13,471,351.00	0.77
12	600276	恒瑞医药	12,876,496.00	0.73
13	603259	药明康德	12,047,604.40	0.68
14	601398	工商银行	11,897,643.00	0.68
15	688256	寒武纪	10,878,458.87	0.62
16	601211	国泰海通	10,493,702.00	0.60
17	601288	农业银行	9,757,295.00	0.55
18	300308	中际旭创	9,676,407.00	0.55
19	601328	交通银行	9,140,535.00	0.52
20	603993	洛阳钼业	8,957,185.00	0.51

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	429,874,155.09
卖出股票收入（成交）总额	948,457,071.68

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将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。

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。

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，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，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约定的备选股票库

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	60,492.63
8	其他	-
9	合计	60,492.63

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	688795	摩尔线程	5,530,599.80	0.58	新股流通受限
2	688802	沐曦股份	3,070,946.66	0.32	新股流通受限
3	301666	大普微	565,262.60	0.06	新股流通受限
4	001248	华润新能源	418,907.85	0.04	新股未上市

5	688781	视涯科技	295,625.92	0.03	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		万家中证 A500ETF 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 (%)
2,096	318,759.85	270,221,983.00	40.45	51,170,361.00	7.66	346,728,303.00	51.9

8.2 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。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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（2024 年 11 月 22 日）基金份额总额	2,000,120,647.00
本报告期期初基金份额总额	1,412,120,647.00
本报告期基金总申购份额	390,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,134,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	668,120,647.00

§ 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

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：
自 2026 年 4 月 16 日起，陈广益先生担任公司董事长，方一天先生不再担任公司董事长；莫海波先生担任公司总经理，陈广益先生不再担任公司总经理；
自 2026 年 5 月 25 日起，王焱女士担任公司首席信息官，陈广益先生不再担任公司首席信息官。
2、报告期内本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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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 (%)	
中国中金财富	6	1,375,217,905.98	100.00	269,426.49	100.00	—

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准

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

选择证券公司参与证券交易的标准如下：

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

2、选择证券公司参与证券交易的程序

- (1) 管理人从财务状况、研究服务能力、风险管理能力、合规管理能力、交易服务水平、交易信息技术能力等方面对证券公司进行评估考察，经内部审批完成后，最终确定入选合作证券公司的备选库。
- (2) 与入选备选库证券公司达成合作意向后，双方签订协议，明确双方的权利义务，包括服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式等。

3、本基金使用券商结算模式，本报告期内管理人选择中国中金财富证券作为证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	万家基金管理有限公司关于旗下部分深交所 ETF 变更场内简称的公告	指定媒介	2026 年 1 月 20 日
2	万家中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	指定媒介	2026 年 1 月 21 日

3	万家中证 A500 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	2026 年 1 月 22 日
4	万家中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2026 年第 1 号）	指定媒介	2026 年 1 月 22 日
5	万家基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金更新招募说明书和基金产品资料概要的提示性公告	指定媒介	2026 年 1 月 22 日
6	万家基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金主流动性服务商的公告	指定媒介	2026 年 1 月 23 日
7	万家基金管理有限公司关于指定证券投资基金主流动性服务商的公告	指定媒介	2026 年 2 月 6 日
8	万家中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告	指定媒介	2026 年 3 月 30 日
9	万家基金管理有限公司关于董事长、高级管理人员变更的公告	指定媒介	2026 年 4 月 17 日
10	万家基金管理有限公司关于旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	指定媒介	2026 年 4 月 21 日
11	万家中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	指定媒介	2026 年 4 月 21 日
12	万家基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	指定媒介	2026 年 5 月 27 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
联接基金	1	20260101-20260630	486,229,203.00	50,334,000.00	189,834,900.00	346,728,303.00	51.90
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。							

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、《万家中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》。
- 4、万家中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2026 年中期报告原文。
- 5、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。
- 7、本报告期内在中国证监会指定媒介公开披露的基金净值、更新招募说明书及其他临时公告。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司

2026 年 8 月 29 日