# 万家中证500指数增强型发起式证券投资基金
# 2026年第3季度报告

2026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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2026年10月27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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 26 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 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

# §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 万家中证 500 指数增强发起式 |
| 基金主代码 | 006729 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 5 月 23 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,688,100,565.99 份 |
| 投资目标 | 本基金为指数增强型股票基金，采取量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，在力求有效跟踪标的指数基础上，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | 本基金为增强型指数产品，在标的指数成份股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。具体策略包括：1、股票投资策略；2、债券投资策略；3、中小企业私募债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、可转换债券投资策略；6、证券公司短期公司债券投资策略；7、衍生产品投资策略：（1）权证投资策略；（2）股指期货投资策略；（3）国债期货投资策略；（4）股票期权投资策略；（5）其他金融衍生产品；8、融资及转融通证券出借业务投资策略；9、其他。 |
| 业绩比较基准 | 中证 500 指数收益率*95%＋一年期人民币定期存款利率（税后）*5% |

| | | |
|---|---|---|
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。 | |
| 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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 万家中证 500 指数增强发起式 A | 万家中证 500 指数增强发起式 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 006729 | 006730 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 909,781,063.78 份 | 778,319,502.21 份 |

# §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日） | |
|---|---|---|
| | 万家中证 500 指数增强发起式 A | 万家中证 500 指数增强发起式 C |
| 1.本期已实现收益 | -34,426,864.39 | -32,610,212.80 |
| 2.本期利润 | -234,364,137.78 | -213,553,704.71 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.2942 | -0.2860 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,524,190,837.53 | 1,269,048,735.92 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.6753 | 1.6305 |

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

### 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 500 指数增强发起式 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 | -16.71% | 2.07% | -16.80% | 1.89% | 0.09% | 0.18% |
| 过去六个月 | 3.98% | 1.89% | -2.14% | 1.75% | 6.12% | 0.14% |
| 过去一年 | 12.77% | 1.64% | 0.53% | 1.58% | 12.24% | 0.06% |
| 过去三年 | 49.13% | 1.49% | 29.77% | 1.50% | 19.36% | -0.01% |

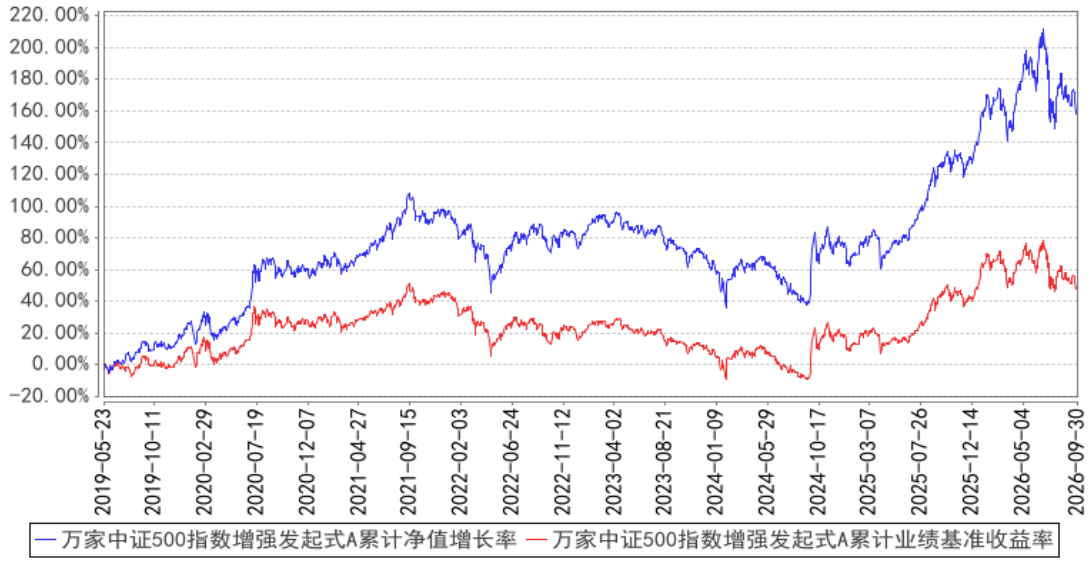
| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去五年 | 33.65% | 1.34% | 5.43% | 1.34% | 28.22% | 0.00% |
| 过去七年 | 138.30% | 1.32% | 49.39% | 1.33% | 88.91% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 159.25% | 1.31% | 48.47% | 1.32% | 110.78% | -0.01% |

万家中证 500 指数增强发起式 C

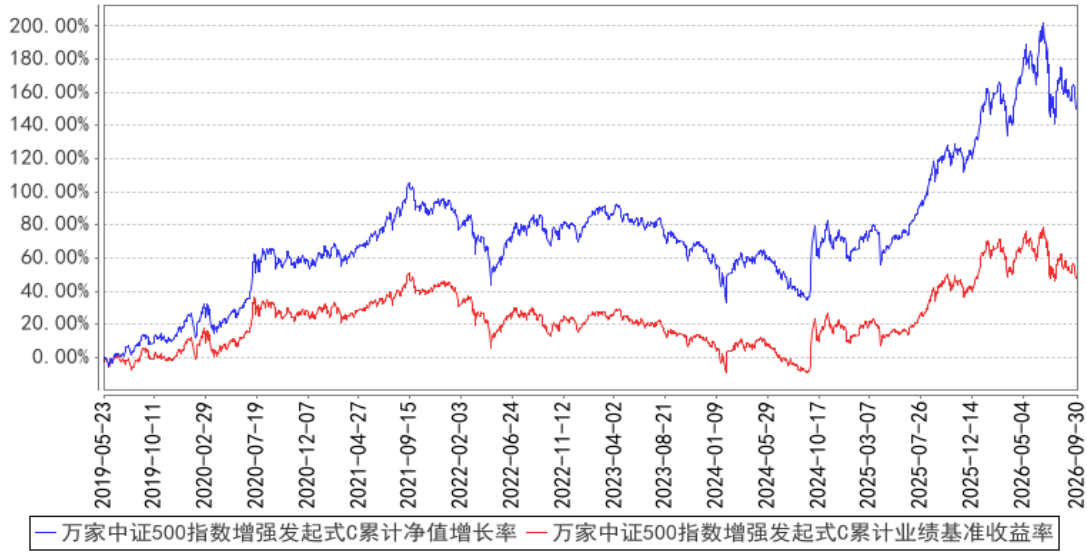
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -16.79% | 2.07% | -16.80% | 1.89% | 0.01% | 0.18% |
| 过去六个月 | 3.78% | 1.89% | -2.14% | 1.75% | 5.92% | 0.14% |
| 过去一年 | 12.32% | 1.64% | 0.53% | 1.58% | 11.79% | 0.06% |
| 过去三年 | 47.33% | 1.49% | 29.77% | 1.50% | 17.56% | -0.01% |
| 过去五年 | 30.98% | 1.34% | 5.43% | 1.34% | 25.55% | 0.00% |
| 过去七年 | 131.82% | 1.32% | 49.39% | 1.33% | 82.43% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 150.95% | 1.31% | 48.47% | 1.32% | 102.48% | -0.01% |

### 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

**万家中证500指数增强发起式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500指数增强发起式C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**




注：本基金于 2019 年 5 月 23 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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 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 | | |
| 乔亮 | 公司领导、首席量化投资官；万家上证科创板 100 指数增强型发起式证券投资基金、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家中证 2000 指数增强型证 | 2019 年 9 月 6 日 | - | 19.5 年 | 国籍：中国；学历：美国斯坦福大学工商管理博士，2019 年 7 月入职万家基金管理有限公司，现任公司首席量化投资官、基金经理，历任公司总经理助理、量化投资部总监（兼）、副总经理。曾任美国巴克莱国际投资管理公司投资部基金经理，加拿大退休基金国际投资管理公司量化投资部基金经理，南方基金管理有限公司数量化投资部投资经理，通联数据股份公司联合创始人、首席投资官，上海寻乾资产管理有限公司投资总监、总经理，巨杉（上海）资产管理有限公司量化投资部投资总监等职。 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 券投资基金、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、万家元贞量化选股股票型证券投资基金、万家创业板指数增强型证券投资基金、万家国证 2000 指数增强型证券投资基金、万家家瑞债券型证券投资基金、万家沪深 300 指数增强型证券投资基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家颐达灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 | | | | |

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

## 4.1.1 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

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》，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,执行交易系统中的公平交易程序；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2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

2026年三季度，A股市场经历了剧烈的风格再平衡与深度调整，呈现"价值防御、成长杀估值"的显著特征。行情大致分为两个阶段：7月急跌,前期极致抱团的AI、半导体等科技赛道集中回调，获利盘兑现、融资盘减仓形成负反馈，叠加海外科技股波动、韩国杠杆踩踏、Meta出售算力

等事件冲击，科技板块深度调整，通信、电子单月跌幅较大；8-9 月震荡筑底，随着拥挤交易风险出清、中报业绩验证，市场进入底部区间震荡，风格从单一科技主线转向红利、资源等防御板块，高低切换特征突出。行业层面，银行、煤炭等红利资源板块逆势走强，而电子、通信、半导体等前期热门赛道领跌。

展望后市，三季度 A 股调整后，当前市场修复动能积聚，处于底部震荡蓄势阶段。政策层面，稳预期信号密集释放，证监会于 10 月 10 日召开专家座谈会，明确将“持续加强稳市机制建设”，“研究储备更多增量政策工具”。中长期资金入市渠道有望进一步拓宽，分红回购常态化趋势确立，政策重心从短期刺激转向制度性托底。其次稳增长政策逐步出台，9 月 29 日中央财政首次推出房贷贴息，叠加央行下调 PSL 利率，稳增长提速信号明确。基本面上，9 月制造业 PMI 录得 50.1%，符合预期且高于前值，连续两月回升并重返荣枯线上方，生产与新订单指数保持扩张，中小企业景气同步改善，经济动能边际增强。外部环境方面，美国 9 月非农数据明显不及预期，加息担忧降温，全球风险偏好回暖，为 A 股修复提供了有利窗口。总体而言，政策发力、数据改善与海外压力缓解形成共振，市场有望摆脱前期弱势，转入震荡上行的修复通道。

万家中证 500 指数增强型证券投资基金采用中证 500 指数增强的投资策略，运用量化多因子选股模型，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

万家中证 500 指数增强型证券投资基金在保持相对中证 500 指数较小跟踪误差情况下，控制行业权重偏离度、个股集中度，通过量化多因子选股的方式选取一篮子股票组合。在组合的行业和风格上相对于中证 500 指数保持了均衡的配置，在量化选股方面精选行业内质优个股，持股较为分散。本基金采用量化风险模型来合理控制组合风险，保证较小的跟踪误差，投资目标是获取在既定跟踪误差下的超额收益最大化。本基金股票组合中 80%以上权重为中证 500 成分股，保持了跟标的指数的风格基本一致。

后续投资运作继续坚持以量化多因子选股为策略基础，积极参与科创、创业板打新等事件性机会，追求长期稳健的超额收益。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家中证 500 指数增强发起式 A 的基金份额净值为 1.6753 元，本报告期基金份额净值增长率为-16.71%，同期业绩比较基准收益率为-16.80%；截至本报告期末万家中证 500 指数增强发起式 C 的基金份额净值为 1.6305 元，本报告期基金份额净值增长率为-16.79%，同期业绩比较基准收益率为-16.80%。基金报告期内 A 份额、C 份额日均跟踪偏离度分别为 0.2039%、0.2032%，年跟踪误差分别为 4.2447%、4.2346%，符合基金合同中日均跟踪偏离度的绝对值不超

过0.5%、年跟踪误差不超过7.75%的规定。

### 4.6 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

### 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 | 2,620,490,052.70 | 91.12 |
| | 其中：股票 | 2,620,490,052.70 | 91.12 |
| 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 | 248,913,564.89 | 8.66 |
| 8 | 其他资产 | 6,384,414.10 | 0.22 |
| 9 | 合计 | 2,875,788,031.69 | 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 | 341,640.00 | 0.01 |
| B | 采矿业 | 104,902,867.00 | 3.76 |
| C | 制造业 | 1,691,965,474.74 | 60.57 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 19,404,711.00 | 0.69 |
| E | 建筑业 | 4,001,003.00 | 0.14 |
| F | 批发和零售业 | 22,125,201.00 | 0.79 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 27,290,220.38 | 0.98 |
| H | 住宿和餐饮业 | 3,398,815.00 | 0.12 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 121,726,450.91 | 4.36 |
| J | 金融业 | 116,209,807.04 | 4.16 |
| K | 房地产业 | 2,314,365.00 | 0.08 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| L | 租赁和商务服务业 | 11,735,060.00 | 0.42 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 14,992,239.00 | 0.54 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 7,195,020.00 | 0.26 |
| 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 | 769,971.00 | 0.03 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 2,148,372,845.07 | 76.91 |

### 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 | 17,792,687.96 | 0.64 |
| C | 制造业 | 353,825,717.12 | 12.67 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 18,092,374.88 | 0.65 |
| E | 建筑业 | 974,798.00 | 0.03 |
| F | 批发和零售业 | 7,490,662.27 | 0.27 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 14,056,630.00 | 0.50 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 21,000,140.40 | 0.75 |
| J | 金融业 | 10,972,979.00 | 0.39 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,398,500.00 | 0.12 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 12,058,012.00 | 0.43 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 11,703,926.00 | 0.42 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 750,780.00 | 0.03 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 472,117,207.63 | 16.90 |

### 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。

## 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 | 688498 | 源杰科技 | 24,500 | 39,518,500.00 | 1.41 |
| 2 | 300857 | 协创数据 | 143,320 | 35,996,251.20 | 1.29 |
| 3 | 002436 | 兴森科技 | 681,400 | 27,896,516.00 | 1.00 |
| 4 | 002008 | 大族激光 | 329,225 | 26,347,876.75 | 0.94 |
| 5 | 688313 | 仕佳光子 | 167,500 | 25,875,400.00 | 0.93 |
| 6 | 002966 | 苏州银行 | 2,764,010 | 25,705,293.00 | 0.92 |
| 7 | 002851 | 麦格米特 | 202,400 | 23,421,728.00 | 0.84 |
| 8 | 601665 | 齐鲁银行 | 3,265,400 | 23,282,302.00 | 0.83 |
| 9 | 300604 | 长川科技 | 93,400 | 22,396,386.00 | 0.80 |
| 10 | 600601 | 方正科技 | 1,641,000 | 21,661,200.00 | 0.78 |

### 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 | 002460 | 赣锋锂业 | 301,740 | 13,104,568.20 | 0.47 |
| 2 | 688825 | 长鑫科技 | 295,247 | 11,411,296.55 | 0.41 |
| 3 | 001314 | 亿道信息 | 223,200 | 10,947,960.00 | 0.39 |
| 4 | 601677 | 明泰铝业 | 675,000 | 10,914,750.00 | 0.39 |
| 5 | 605007 | 五洲特纸 | 707,600 | 10,175,288.00 | 0.36 |

## 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

本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行交易，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地实现投资目标。

## 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

本基金可基于谨慎原则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。

### 5.10.2 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，苏州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江苏省分行的处罚，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。

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 505,989.22 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 5,878,424.88 |
| 6 | 其他应收款 | - |

| | | |
|---|---|---|
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 6,384,414.10 |

### 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 | 688825 | 长鑫科技 | 11,411,296.55 | 0.41 | 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

单位：份

| 项目 | 万家中证 500 指数增强发起式 A | 万家中证 500 指数增强发起式 C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 571,800,653.90 | 504,267,353.49 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 410,448,713.18 | 572,115,745.32 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 72,468,303.30 | 298,063,596.60 |
| 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 | 909,781,063.78 | 778,319,502.21 |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

本基金成立后有 10,001,000.10 份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为 2019 年 5 月 23

日（合同生效日）起 3 年。截至本报告期期末，最低持有期限届满，发起资金持有份额为 0.00 份。

# §9 影响投资者决策的其他重要信息

## 9.1 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 | 20260701-20260702、20260706 | 221,715,160.65 | - | - | 221,715,160.65 | 13.13 |
| 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。<br>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。 | | | | | | | |

# §10 备查文件目录

## 10.1 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 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》。

3、《万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》。

4、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2026 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。

## 10.2 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。

## 10.3 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 10 月 27 日