

# 万家战略发展产业混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	18
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	18
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>18</b>
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	19
6.3 净资产变动表	21
6.4 报表附注	23
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46

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 .....	46
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 .....	46
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 .....	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	47
7.12 投资组合报告附注 .....	47
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	48
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 .....	48
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>49</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
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 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4 基金投资策略的改变 .....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
10.8 其他重大事件 .....	51
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>52</b>
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 .....	52
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>52</b>
12.1 备查文件目录 .....	52
12.2 存放地点 .....	53
12.3 查阅方式 .....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	万家战略发展产业混合型证券投资基金	
基金简称	万家战略发展产业混合	
基金主代码	010611	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 1 月 13 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	2,128,023,836.59 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	万家战略发展产业混合 A	万家战略发展产业混合 C
下属分级基金的交 易代码	010611	010612
报告期末下属分级 基金的份额总额	1,373,081,652.83 份	754,942,183.76 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于符合国家战略规划发展的行业和领域的优质上市公司，在有效控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1、大类资产配置策略；2、股票投资策略：（1）主题界定；（2）个股投资策略；（3）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、金融衍生产品投资策略：（1）股指期货投资策略；（2）国债期货投资策略；（3）股票期权投资策略；7、信用衍生品投资策略；8、融资交易策略；9、其他。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*70%+上证国债指数收益率*30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	兰剑
	联系电话	021-38909626
	电子邮箱	lanj@wjasset.com
客户服务电话	4008880800	400-61-95555
传真	021-38909627	0755-83195201
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）	深圳市深南大道 7088 号招商银 行大厦

办公地址	中国（上海）自由贸易试验区浦 电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	深圳市深南大道 7088 号招商银 行大厦
邮政编码	200122	518040
法定代表人	方一天	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网 址	<a href="http://www.wjasset.com">http://www.wjasset.com</a>
基金中期报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名 义楼层 9 层）基金管理人办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	万家基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区 浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	万家战略发展产业混合 A	万家战略发展产业混合 C
本期已实现收益	-3,195,184.57	-2,786,147.77
本期利润	34,291,367.28	2,687,484.78
加权平均基金份 额本期利润	0.0407	0.0056
本期加权平均净 值利润率	4.65%	0.66%
本期基金份额净 值增长率	7.81%	7.55%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	-151,679,235.37	-94,917,006.54
期末可供分配基 金份额利润	-0.1105	-0.1257
期末基金资产净	1,221,402,417.46	660,025,177.22

值		
期末基金份额净值	0.8895	0.8743
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-11.05%	-12.57%

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

万家战略发展产业混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-4.81%	1.63%	-2.12%	0.34%	-2.69%	1.29%
过去三个月	-0.25%	1.80%	-0.90%	0.53%	0.65%	1.27%
过去六个月	7.81%	1.99%	1.90%	0.63%	5.91%	1.36%
过去一年	-15.45%	1.67%	-5.32%	0.61%	-10.13%	1.06%
过去三年	-20.51%	1.73%	-21.23%	0.73%	0.72%	1.00%
自基金合同生效起至今	-11.05%	1.65%	-24.47%	0.76%	13.42%	0.89%

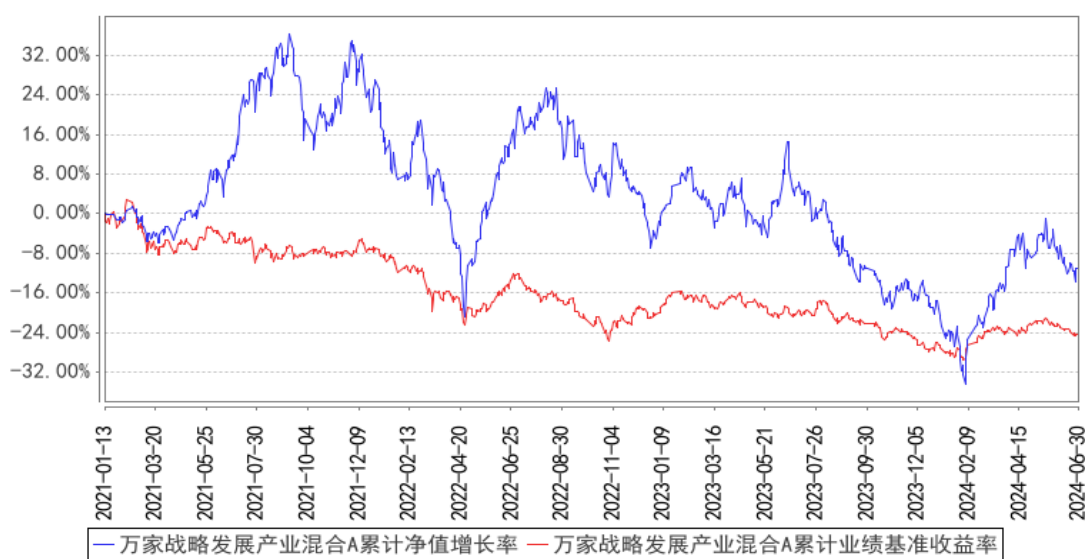
万家战略发展产业混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-4.83%	1.63%	-2.12%	0.34%	-2.71%	1.29%
过去三个月	-0.35%	1.80%	-0.90%	0.53%	0.55%	1.27%
过去六个月	7.55%	1.99%	1.90%	0.63%	5.65%	1.36%

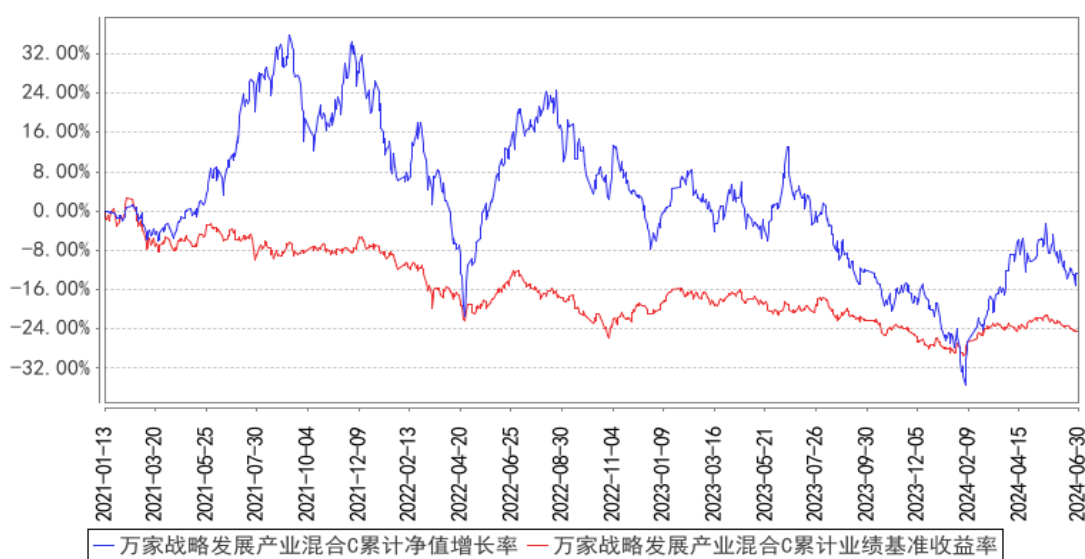
过去一年	-15.87%	1.67%	-5.32%	0.61%	-10.55%	1.06%
过去三年	-21.69%	1.73%	-21.23%	0.73%	-0.46%	1.00%
自基金合同生效起至今	-12.57%	1.65%	-24.47%	0.76%	11.90%	0.89%

### 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

万家战略发展产业混合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



万家战略发展产业混合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 2021 年 1 月 13 日成立，根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合



法律法规和基金合同要求。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44号文批准设立。截至报告期末，公司的股东为中泰证券股份有限公司、山东省新动能基金管理有限公司，住所：中国（上海）自由贸易试验区浦电路360号8楼（名义楼层9层），办公地点：上海市浦东新区浦电路360号9楼，注册资本3亿元人民币。截至报告期末，公司共管理一百五十二只开放式基金，分别为万家180指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金（LOF）、万家添利债券型证券投资基金（LOF）、万家新机遇价值驱动灵活配置混合型证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家上证50交易型开放式指数证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞和灵活配置混合型证券投资基金、万家颐达灵活配置混合型证券投资基金、万家颐和灵活配置混合型证券投资基金、万家恒瑞18个月定期开放债券型证券投资基金、万家鑫安纯债债券型证券投资基金、万家鑫璟纯债债券型证券投资基金、万家沪深300指数增强型证券投资基金、万家家享中短债债券型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家1-3年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家瑞隆混合型证券投资基金、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家现金增利货币市场基金、万家消费成长股票型证券投资基金、万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家玖盛纯债9个月定期开放债券型证券投资基金、万家天添宝货币市场基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、万家家瑞债券型证券投资基金、万家臻选混合型证券投资基金、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金、万家成长优选灵活配置混合型证券投资

资基金、万家经济新动能混合型证券投资基金、万家潜力价值灵活配置混合型证券投资基金、万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家新机遇龙头企业灵活配置混合型证券投资基金、万家智造优势混合型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型证券投资基金、万家人工智能混合型证券投资基金、万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金 (LOF)、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、万家平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、万家科创主题灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、万家鑫盛纯债债券型证券投资基金、万家民安增利 12 个月定期开放债券型证券投资基金、万家汽车新趋势混合型证券投资基金、万家惠享 39 个月定期开放债券型证券投资基金、万家科技创新混合型证券投资基金、万家自主创新混合型证券投资基金、万家民丰回报一年持有期混合型证券投资基金、万家可转债债券型证券投资基金、万家民瑞祥和 6 个月持有期债券型证券投资基金、万家价值优势一年持有期混合型证券投资基金、万家养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、万家鑫动力月月购一年滚动持有混合型证券投资基金、万家科创板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家创业板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家周期优势企业混合型证券投资基金、万家健康产业混合型证券投资基金、万家互联互通中国优势量化策略混合型证券投资基金、万家战略发展产业混合型证券投资基金、万家创业板指数增强型证券投资基金、万家陆家嘴金融城金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家内需增长一年持有期混合型证券投资基金、万家互联互通核心资产量化策略混合型证券投资基金、万家民瑞祥明 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家瑞泽回报一年持有期混合型证券投资基金、万家惠裕回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家悦兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金、万家稳鑫 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、万家全球成长一年持有期混合型基金 (QDII)、万家沪港深蓝筹混合型证券投资基金、万家北交所慧选两年定期开放混合型证券投资基金、万家鼎鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家新机遇成长一年持有期混合型发起式证券投资基金、万家港股通精选混合型证券投资基金、万家景气驱动混合型证券投资基金、万家安恒纯债 3 个月持有期债券型发起式证券投资基金、万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫橙纯债债券型证券投资基金、万家聚优稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、万家新能源主题混合型发起式证券投资基金、万家中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、万家匠心致远一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫融纯债债券型证券投资基金、万家颐远均衡一年持有期混合型发起式证券投资基金、万家鑫耀纯债债券型证券投资基金、万家欣远混合型证券投资基金、万家国证 2000

交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家惠利债券型证券投资基金、万家鑫怡债券型证券投资基金、万家优享平衡混合型发起式证券投资基金、万家洞见进取混合型发起式证券投资基金、万家沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、万家中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金、万家沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家元贞量化选股股票型证券投资基金、万家 CFETS0-3 年期政策性金融债指数证券投资基金、万家中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家先进制造混合型发起式证券投资基金、万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金、万家颐德一年持有期混合型证券投资基金、万家北证 50 成份指数型发起式证券投资基金、万家恒生互联网科技业指数型发起式证券投资基金 (QDII)、万家中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家欣优混合型证券投资基金、万家集利债券型发起式证券投资基金、万家远见先锋一年持有期混合型证券投资基金、万家国证 2000 指数增强型证券投资基金、万家纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII)、万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金、万家稳安 60 天持有期债券型证券投资基金、万家周期驱动股票型发起式证券投资基金、万家优选积极三个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、万家养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、万家红利量化选股混合型发起式证券投资基金、万家医药量化选股混合型发起式证券投资基金、万家锦利债券型发起式证券投资基金、万家高端装备量化选股混合型发起式证券投资基金、万家趋势领先混合型证券投资基金、万家稳航 90 天持有期债券型证券投资基金、万家中证红利交易型开放式指数证券投资基金、万家惠诚回报平衡一年持有期混合型证券投资基金、万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家国企动力混合型证券投资基金、万家 CFETS 0-3 年期山东省国有企业信用债精选指数发起式证券投资基金、万家稳丰 6 个月持有期债券型证券投资基金、万家研究领航混合型证券投资基金、万家中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
叶勇	万家北交所慧选两年定期开放混合型证券投资基金、万家双引擎	2024 年 2 月 8 日	-	11.5 年	国籍：中国；学历：中国政法大学法学专业学士，2015 年 3 月入职万家基金管理有限公司，现任权益投资部基金经理，同时兼任投资经理，历任股权投资部副总监、投资经理，权益投资二部总监、投资经理。曾任上海证券报社记者，华泰证券股份有限公司研究所研究员，上海市北高新股份

	灵活配置混合型证券投资基金、万家周期驱动股票型发起式证券投资基金、万家国企动力混合型证券投资基金、万家战略发展产业混合型证券投资基金、万家趋势领先混合型证券投资基金的基金经理。				有限公司投资管理部经理助理，上海三熙投资管理咨询有限公司副总经理等职。
李文宾	报告期内已离职。	2021年1月13日	2024年2月8日	14年	国籍：中国；学历：复旦大学工商管理硕士，2015年11月入职万家基金管理有限公司，任权益投资部基金经理，历任投资研究部研究总监助理。曾任中银国际证券有限责任公司研究所研究员，华泰资产管理有限公司研究部研究员等职。报告期内已离职。

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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
叶勇	公募基金	6	5,289,244,313.77	2018年8月24日
	私募资产管理计划	1	500,063,838.06	2016年10月13日
	其他组合	-	-	-
	合计	7	5,789,308,151.83	-

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 9 次，均为量化投资组合或不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年一季度，A 股市场 V 型震荡，2 月 5 日上证指数探底 2635 点，中小盘股经历了一个快速下跌和快速反弹的过程。而与经济基本面相关的大盘蓝筹价值股波动幅度相对较小，呈现出夯实底部的状态，尤其是高股息个股和大宗商品类资源股表现相对强势。究其原因，市场对经济走势的预期不断降低。外部环境恶化、库存周期探底、M1 不断创新低严重压制了市场。

2024 年二季度，A 股市场继续震荡调整，二次寻底。从结构上看，中小微盘反弹之后如期大

幅回调；消费、制造持续杀估值之路；科技板块除 AI 硬件领域细分领域有亮点，整体表现萎靡；红利策略在市场长期预期过度悲观之下，继续成为机构资金首选方向；资源股进入震荡调整阶段。

与市场较为悲观的预期不同，基金经理认为，上半年的宏观情况证实，当前全球经济的确正处在库存周期触底上行阶段，未来几个季度也将继续处于这一阶段，这一点是符合预期的；而中国经济在制造业出口的拉动下，已经并将继续运行在弱复苏区间；即便全球金融市场出现重大事件扰动和巨幅震荡，短期出现大萧条的概率较低。

经济在复苏，但却不是以市场普遍习惯的面貌来复苏，这是本轮库存周期上行与历史的显著区别。这也决定了本轮库存周期上行对股票市场的影响也有显著区别。不同于历史上地产、基建、出口、消费共同拉动的库存周期繁荣阶段，本轮弱复苏下的核心亮点只有制造业。基于弱复苏的现状，股市可能很难再现历史同期大部分板块轮动上涨的股票市场强势格局。而复苏主力的制造业，在内部产能过剩，外部逆全球化抑制下，生产不断繁荣之下，未必能兼得利润快速增长和利润率快速修复，以量补价可能成为常态。这也是当前经济结构面临的显著问题。当然，从积极的方向来看，这也是中国经济艰难转型的必然过程。道路是曲折的，前途是光明的。从历史的角度来看，我们将见证这个过程中一批企业在“内卷”和“外卷”中最终成为全球性卓越公司。

回到股票市场，面对当前的宏观格局，生产繁荣之下行业比较中，全球定价的上游资源行业依然是相对较为牢靠的选择。核心逻辑在于上游和中下游的在产业链中的利润分配格局：上游行业受益于全球大宗商品周期的上行，在利润分配中占比不断提升，这一上游占优的利润分配格局将持续较长时间，而中下游占据主导的制造业产业链将继续受到大宗商品价格强势、逆全球化摩擦成本的影响，利润率持续受到压制，在股票业绩和估值端持续遭受不利影响。但是，上游产业股票的市值依然远未与其在产业链中的利润占比匹配，依然有较大的修复空间。

从上半年股票市场表现来看，红利策略可以说是一枝独秀，尤其是大量险资机构的投资策略集体转向为红利策略提供了持续不断的边际增量资金。尽管资源股跟红利股之间存在一些交叉地带，但是，资源股策略的逻辑内核和红利策略的逻辑内核却存在显著差异：前者对全球库存周期上行带来的经济走势是乐观的，同时在积极寻找产业链条中最有利的行业去展开进攻；后者则体现的是在全球中长期增速下行下对不确定的忧虑，以及对当前中国经济环境下长端利率不断走低的预期，从而以防御为主的姿态买入有稳定现金流和股息率的公用事业股票、龙头能源股等。尽管对红利策略一贯较为欣赏，但是基金经理从进攻角度更愿意偏向资源股。

本基金自 2024 年 2 月份变更基金经理以来，投资组合结构转变为以工业金属、贵金属、原油、油运行业为主，尤其是工业金属和贵金属占比很高。

总体而言，上半年本基金绝对收益和相对收益表现尚可，但是，受到市场整体压力和大宗商

品阶段性回撤过大影响下，净值回撤幅度较大。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家战略发展产业混合 A 的基金份额净值为 0.8895 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.81%，同期业绩比较基准收益率为 1.90%；截至本报告期末万家战略发展产业混合 C 的基金份额净值为 0.8743 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.55%，同期业绩比较基准收益率为 1.90%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

库存周期的上行和本轮大宗商品牛市的第二个主升浪叠加，构成了本基金配置策略的核心逻辑：从宏观择时角度看，全球库存周期已触底回升。在此宏观背景下，本基金的整体策略以进攻性为主导，强化全球定价的有色金属作为第一大仓位，有利于组合在后续运行中展现较好的向上弹性；从大风格周期来看，大宗商品牛市格局已然确立，大宗商品周期依然处于上行趋势通道中，不同类型的大宗商品价格或先后走出第二大浪趋势性上行行情。因此，现阶段布局首先依然是以资源股为主。

需要特别指出的是：全球经济的繁荣从来都不是大宗商品牛市的必要条件。回顾过去一百多年的大宗商品产能周期的历史，我们会发现，商品产能周期一般为 25-30 年，上行周期一般延续 8-10 年，下行周期一般延续 15-20 年。历史上看，大宗商品牛市反而多数出现在全球经济衰退或者萧条阶段，而科技革命和全球经济繁荣期，大宗商品反而是熊市或者弱市。这一反常识现象的根本原因在于：大宗商品周期有其自身的规律，长期供给端的周期性特征是造成大宗商品牛熊波段的核心原因。也就是说，长期供给决定大宗商品的趋势，短期需求决定大宗商品的波动。而科技革命在推升需求繁荣的同时，往往会更大的推动供给端产能的爆发，从而使得大宗商品进入平衡期。而科技革命红利的尾声，往往意味着技术对于大宗商品供给能力的提升趋于见顶。

自 2020 年下半年开始，新一轮大宗商品牛市已经启动。由于本轮大宗商品产能周期出现了史上未有之新变量：全球环保化、清洁能源化和 ESG 的进程使得化石能源新一轮资本开支困难重重。而对于金属类大宗商品，虽然不存在环保约束问题，但是，同样面临中长期产能不足的问题，此外，开采品位的不断下滑，使得新增资本开支对于产量增长的贡献效率在下滑，边际供给成本不断抬升。而且，从需求端看，金属资源没有化石能源资源在双碳上的制约，且由于需求端结构性变化，新兴产业需求逐步填补传统产业需求下滑的缺口，使金属资源品的需求端持续保持韧性。在供给持续紧平衡的环境下，需求略有抬升就可能使金属资源品价格展现出较大的向上价格弹性。以上因素，让本轮大宗商品牛市更早到来，且可能更晚结束。

回到当下，本轮大宗商品牛市的第一波上涨行情在 2022 年一季度见顶，经历接近两年的调整，

于 2023 年见底。在全球库存周期和制造业 PMI 触底回升、中国库存周期见底上行的需求助推下，2024-2025 年大宗商品有望展开新一轮新的主升浪行情。

而从二季度大宗商品的表现来看，全球定价的贵金属、工业金属、原油等大宗商品价格新一轮上行行情已经启动，充分验证了基金经理的预判。不过，5 月中下旬以来，大宗商品尤其是工业金属价格在上涨之后出现较大幅度的回撤，造成了资源股的大幅度震荡和回调。基金经理认为，这一轮回撤是在阶段性涨幅过大、短期库存较高、全球金融市场巨幅震荡等背景下形成的，尽管短期回调幅度较大，但并没有逆转我们配置资源股的根本逻辑。

对投资资源股而言，我们不是在交易商品期货，我们判断资源股价值的核心在于企业内在价值的持续提升。虽然商品价格很重要，但重要的不是短时间的高价，而是价格中枢的稳定抬升——这才是决定资源股内在价值的关键因素。因为，只有中长期价格中枢稳定上了一个新台阶，才能带来资源股边际盈利的较快增长，并带来中长期盈利的和股息的稳定抬升。这是从风格上战略配置资源股的逻辑基础。此次回调让前期有色金属股票过高的上行斜率得到显著修复，随着获利盘回吐结束和情绪性资金卖出接近尾声，资源股的回撤可能接近尾声，部分核心股票已经经过两个月的回撤和盘整，下行空间有限，买入价值凸显。

此外，航运板块受到巴以冲突的影响，叠加市场整体下调影响，也出现回调。油运板块实质上受到红海事件影响并不明显，此次回调有错杀成分，叠加油运淡季影响。但是，油运中长期逻辑依然是整个航运大行业中最好的，当前的回调后，按照最新的二手船舶价格，板块龙头股票市值已经基本与公司资产重置价值接近，安全边际较高，投资价值凸显。

展望后市，随着全球库存周期的持续上行，大宗商品价格有望继续稳健上行。库存周期的上行和本轮大宗商品牛市的第二个主升浪叠加，将继续成为支撑本基金配置策略的核心逻辑。基金经理将继续以工业金属、贵金属、原油、油运、煤炭等板块为主，努力获取进攻性收益。

从政策层面，资源品储备的重要性更加凸显，已经上升为国家重大战略。从 2023 年开始，自然资源部已经全面启动新一轮战略性矿产国内找矿行动，已经开始突出紧缺和大宗战略性矿产，全面启动新一轮战略性矿产国内找矿行动，并组织实施矿产地战略储备工程，增强战略性矿产资源长远保障能力。对生态保护红线内的矿产资源潜力区，国家投资进行重点勘探，用于战略储备。完善社会资本投入勘查找矿的激励政策，并会同有关部门研究完善支持政策，充分调动市场主体积极性，优先保障战略性矿产探矿权转采矿权用地需求。2023 年末的中央经济工作会议指出，加强重要能源、矿产资源国内勘探开发和增储上产，加快规划建设新型能源体系，提升国家战略物资储备保障能力。我国一些重要矿产资源对外依存度高，国际形势一旦出现变化，必然影响经济安全甚至是国家安全。对此，一方面要推进高水平对外开放，用好“两种资源、两个市场”；另一



方面要未雨绸缪，做好特殊情况下的国内资源安全保障。

二十届三中全会通过了《中共中央关于进一步全面深化改革 推进中国式现代化的决定》。决定特别指出：建设国家战略腹地和关键产业备份，加快完善国家储备体系，完善战略性矿产资源探产供储销统筹和衔接体系。决定进一步提升了资源安全战略的重要地位。

从风格选股角度看，在大宗商品上行周期中，观察当下资源股的位置，它们依然是行业比较之后具有性价比的战略选择。重点配置资源品股票符合本基金的战略发展产业主题。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

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

##### 2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不介入基金日常估值业务。

##### 3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

##### 4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：万家战略发展产业混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	105,848,201.15	47,295,753.13
结算备付金		4,092,777.36	788,571.74
存出保证金		384,684.05	267,879.63
交易性金融资产	6.4.7.2	1,777,582,800.24	725,271,776.59
其中：股票投资		1,777,582,800.24	725,271,776.59
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		260,843.75	645,282.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,888,169,306.55	774,269,263.31
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付赎回款		2,399,306.02	1,586,017.86
应付管理人报酬		1,851,511.25	806,595.62
应付托管费		308,585.21	134,432.61
应付销售服务费		263,571.22	139,588.70
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	1,918,738.17	837,506.85
负债合计		6,741,711.87	3,504,141.64
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	2,128,023,836.59	939,842,067.48
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	-246,596,241.91	-169,076,945.81
净资产合计		1,881,427,594.68	770,765,121.67
负债和净资产总计		1,888,169,306.55	774,269,263.31

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 2,128,023,836.59 份，其中万家战略发展产业混合 A 基金份额净值 0.8895 元，基金份额总额 1,373,081,652.83 份；万家战略发展产业混合 C 基金份额净值 0.8743 元，基金份额总额 754,942,183.76 份。

## 6.2 利润表

会计主体：万家战略发展产业混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日

<b>一、营业总收入</b>		45,978,048.83	117,130,663.28
1. 利息收入		167,795.69	149,436.77
其中：存款利息收入	6.4.7.10	167,795.69	149,436.77
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）		1,346,705.85	-15,800,428.54
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-14,199,082.38	-20,768,706.15
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	4,993.29
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	15,545,788.23	4,963,284.32
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	42,960,184.40	132,437,617.82
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	1,503,362.89	344,037.23
<b>减：二、营业总支出</b>		8,999,196.77	10,080,583.03
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,778,569.57	7,678,945.81
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,129,761.62	1,279,824.31
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,002,240.98	1,027,544.22
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	88,624.60	94,268.69
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		36,978,852.06	107,050,080.25
减：所得税费用		-	-

四、净利润(净亏损以“-”号填列)		36,978,852.06	107,050,080.25
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		36,978,852.06	107,050,080.25

### 6.3 净资产变动表

会计主体：万家战略发展产业混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	939,842,067.48	-	-169,076,945.81	770,765,121.67
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	939,842,067.48	-	-169,076,945.81	770,765,121.67
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,188,181,769.11	-	-77,519,296.10	1,110,662,473.01
(一)、综合收益总额	-	-	36,978,852.06	36,978,852.06
(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)	1,188,181,769.11	-	-114,498,148.16	1,073,683,620.95
其中：1. 基金申购款	1,671,456,706.41	-	-154,326,658.96	1,517,130,047.45
2. 基金赎回款	-483,274,937.30	-	39,828,510.80	-443,446,426.50
(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	2,128,023,836.59	-	-246,596,241.91	1,881,427,594.68
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,046,617,656.06	-	-57,908,343.12	988,709,312.94
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,046,617,656.06	-	-57,908,343.12	988,709,312.94
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-117,160,244.65	-	101,656,006.20	-15,504,238.45
（一）、综合收益总额	-	-	107,050,080.25	107,050,080.25
（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）	-117,160,244.65	-	-5,394,074.05	-122,554,318.70
其中：1. 基金申购款	163,303,036.48	-	5,053,222.40	168,356,258.88
2. 基金赎回款	-280,463,281.13	-	-10,447,296.45	-290,910,577.58
（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	929,457,411.41	-	43,747,663.08	973,205,074.49

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>方一天</u>	<u>陈广益</u>	<u>尹超</u>
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

万家战略发展产业混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]2760 号文《关于准予万家战略发展产业混合型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 2020 年 12 月 21 日至 2021 年 1 月 8 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[2021]第 ZA30011 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 2021 年 1 月 13 日生效，本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 3,427,600,199.30 元，有效认购资金在基金验资确认日之前产生的利息为人民币 248,514.78 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 3,427,848,714.08 元，折合 3,427,848,714.08 份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为万家基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的主要投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、中小板以及其他中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、股指期货、国债期货、股票期权以及债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、政府支持机构债、公开发行的次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、凭证类信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可参与融资业务。在未来条件许可的情况下，本基金可根据相关法律法规，在履行适当程序后，参与融券业务和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业

绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*70%+上证国债指数收益率\*30%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本中期报告所采用的会计政策、会计估计与上年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### (一) 印花税

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

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

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



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

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

## (二) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的

股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

### （三）企业所得税

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

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

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

### （四）个人所得税

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	105,848,201.15
等于：本金	105,837,467.98
加：应计利息	10,733.17
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	105,848,201.15

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,703,979,903.15	-	1,777,582,800.24	73,602,897.09
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	1,703,979,903.15	-	1,777,582,800.24	73,602,897.09

### 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

本基金本报告期末无其他资产余额。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,161.60
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,718,499.57
其中：交易所市场	1,718,499.57
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	197,077.00
合计	1,918,738.17

### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

万家战略发展产业混合 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	553,782,091.55	553,782,091.55
本期申购	1,216,988,337.92	1,216,988,337.92
本期赎回（以“-”号填列）	-397,688,776.64	-397,688,776.64
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	1,373,081,652.83	1,373,081,652.83
-----	------------------	------------------

万家战略发展产业混合 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	386,059,975.93	386,059,975.93
本期申购	454,468,368.49	454,468,368.49
本期赎回 (以“-”号填列)	-85,586,160.66	-85,586,160.66
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	754,942,183.76	754,942,183.76

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 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

万家战略发展产业混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-5,900,127.05	-90,960,703.45	-96,860,830.50
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-5,900,127.05	-90,960,703.45	-96,860,830.50
本期利润	-3,195,184.57	37,486,551.85	34,291,367.28
本期基金份额交易产生的变动数	-33,211,015.31	-55,898,756.84	-89,109,772.15
其中：基金申购款	-53,546,911.03	-61,703,525.48	-115,250,436.51
基金赎回款	20,335,895.72	5,804,768.64	26,140,664.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-42,306,326.93	-109,372,908.44	-151,679,235.37

万家战略发展产业混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-9,427,902.40	-62,788,212.91	-72,216,115.31
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-9,427,902.40	-62,788,212.91	-72,216,115.31
本期利润	-2,786,147.77	5,473,632.55	2,687,484.78
本期基金份额交易产	-22,797,795.27	-2,590,580.74	-25,388,376.01

生的变动数			
其中：基金申购款	-27,680,306.48	-11,395,915.97	-39,076,222.45
基金赎回款	4,882,511.21	8,805,335.23	13,687,846.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-35,011,845.44	-59,905,161.10	-94,917,006.54

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	140,238.66
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	22,108.33
其他	5,448.70
合计	167,795.69

#### 6.4.7.11 股票投资收益

##### 6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-14,199,082.38
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-14,199,082.38

##### 6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	1,239,226,092.92
减：卖出股票成本总额	1,249,273,252.47
减：交易费用	4,151,922.83
买卖股票差价收入	-14,199,082.38

#### 6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	15,545,788.23
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	15,545,788.23

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	42,960,184.40
股票投资	42,960,184.40
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	42,960,184.40

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,491,645.93
基金转换费收入	11,716.96
合计	1,503,362.89

#### 6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	17,404.66
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	2,547.60
账户维护费	9,000.00
合计	88,624.60

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

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

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

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
中泰证券	917,954,368.39	26.25	195,983,747.41	6.51



### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
中泰证券	-	-	1,404,888.00	13.51

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
中泰证券	868,291.67	26.25	617,645.60	35.94
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
中泰证券	178,383.01	6.88	-	-

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,778,569.57	7,678,945.81
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,975,558.95	2,537,403.42
应支付基金管理人的净管理费	4,803,010.62	5,141,542.39

注：2023年8月21日前，本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提；自2023年8月21日起，本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,129,761.62	1,279,824.31

注：2023 年 8 月 21 日前，本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提；自 2023 年 8 月 21 日起，本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家战略发展产业混 合 A	万家战略发展产业混 合 C	合计
万家基金	-	145,141.98	145,141.98
招商银行	-	46,010.21	46,010.21
中泰证券	-	150,669.38	150,669.38
合计	-	341,821.57	341,821.57
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		

方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家战略发展产业混合 A	万家战略发展产业混合 C	合计
中泰证券	-	135,280.27	135,280.27
招商银行	-	59,214.22	59,214.22
万家基金	-	9,655.15	9,655.15
合计	-	204,149.64	204,149.64

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.50%。销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据相关协议支付给各销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 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

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	105,848,201.15	140,238.66	63,919,471.52	132,113.55

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方所承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间没有需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	新股流通受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301587	中瑞股份	2024年3月27日	6个月	新股流通受限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
601033	永兴股份	2024年1月11日	6个月	新股流通受限	16.20	15.96	898	14,547.60	14,332.08	-
603375	盛景微	2024年1月17日	6个月	新股流通受限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永	2024	6个月	新股	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-

	臻股份	年6月19日		流通受限						
688530	欧莱新材	2024年4月29日	6个月	新股流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月	新股流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股流通受限	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个 月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
货币资金	105,848,201.15	-	-	-	-	-	105,848,201.15
结算备付金	4,092,777.36	-	-	-	-	-	4,092,777.36
存出保证金	384,684.05	-	-	-	-	-	384,684.05
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,777,582,800.24	1,777,582,800.24
应收申购款	10,800.73	-	-	-	-	250,043.02	260,843.75
资产总计	110,336,463.29	-	-	-	-	1,777,832,843.26	1,888,169,306.55
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,399,306.02	2,399,306.02
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,851,511.25	1,851,511.25
应付托管费	-	-	-	-	-	308,585.21	308,585.21
应付销售服务费	-	-	-	-	-	263,571.22	263,571.22
其他负债	-	-	-	-	-	1,918,738.17	1,918,738.17
负债总计	-	-	-	-	-	6,741,711.87	6,741,711.87
利率敏感度缺口	110,336,463.29	-	-	-	-	1,771,091,131.39	1,881,427,594.68
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个 月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计

资产							
货币资金	47,295,753.13	-	-	-	-	-	47,295,753.13
结算备付金	788,571.74	-	-	-	-	-	788,571.74
存出保证金	267,879.63	-	-	-	-	-	267,879.63
交易性金融资产	-	-	-	-	-	725,271,776.59	725,271,776.59
应收申购款	1,851.41	-	-	-	-	643,430.81	645,282.22
资产总计	48,354,055.91	-	-	-	-	725,915,207.40	774,269,263.31
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,586,017.86	1,586,017.86
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	806,595.62	806,595.62
应付托管费	-	-	-	-	-	134,432.61	134,432.61
应付销售服务费	-	-	-	-	-	139,588.70	139,588.70
其他负债	-	-	-	-	-	837,506.85	837,506.85
负债总计	-	-	-	-	-	3,504,141.64	3,504,141.64
利率敏感度缺口	48,354,055.91	-	-	-	-	722,411,065.76	770,765,121.67

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2023 年 12 月 31 日：同），货币资金、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2023 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元



项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,777,582,800.24	94.48	725,271,776.59	94.10
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	1,777,582,800.24	94.48	725,271,776.59	94.10

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除股票基准指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1. 股票基准指数下降 100 个基点	-15,536,154.54	-6,917,870.84
	2. 股票基准指数上升 100 个基点	15,536,154.54	6,917,870.84

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	1,777,499,141.22	725,057,248.82
第二层次	-	-
第三层次	83,659.02	214,527.77
合计	1,777,582,800.24	725,271,776.59

#### 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	1,777,582,800.24	94.14
	其中：股票	1,777,582,800.24	94.14
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	109,940,978.51	5.82
8	其他各项资产	645,527.80	0.03
9	合计	1,888,169,306.55	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	1,027,709,313.54	54.62
C	制造业	423,306,874.80	22.50
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	326,511,167.10	17.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	41,112.72	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	14,332.08	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	1,777,582,800.24	94.48

### 7.2.2 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。

## 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

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	601899	紫金矿业	9,531,900	167,475,483.00	8.90
2	000975	山金国际	8,979,100	146,269,539.00	7.77

3	603993	洛阳钼业	17,112,300	145,454,550.00	7.73
4	600026	中远海能	8,445,010	131,826,606.10	7.01
5	600489	中金黄金	8,549,100	126,526,680.00	6.73
6	601600	中国铝业	16,164,300	123,333,609.00	6.56
7	601872	招商轮船	12,564,920	106,173,574.00	5.64
8	000807	云铝股份	7,082,000	95,677,820.00	5.09
9	600547	山东黄金	3,434,300	94,031,134.00	5.00
10	601168	西部矿业	4,224,300	75,826,185.00	4.03
11	600988	赤峰黄金	4,352,500	71,119,850.00	3.78
12	601857	中国石油	6,310,600	65,125,392.00	3.46
13	601975	招商南油	15,571,000	55,899,890.00	2.97
14	600938	中国海油	1,656,400	54,661,200.00	2.91
15	000933	神火股份	2,414,300	48,841,289.00	2.60
16	002155	湖南黄金	2,618,800	47,400,280.00	2.52
17	000630	铜陵有色	13,076,600	47,206,526.00	2.51
18	000612	焦作万方	6,964,200	45,267,300.00	2.41
19	000039	中集集团	4,541,600	42,055,216.00	2.24
20	601919	中远海控	2,105,300	32,611,097.00	1.73
21	601225	陕西煤业	939,900	24,221,223.00	1.29
22	600362	江西铜业	638,200	15,112,576.00	0.80
23	601699	潞安环能	529,358	9,597,260.54	0.51
24	000657	中钨高新	629,600	5,754,544.00	0.31
25	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
26	601096	宏盛华源	3,918	16,024.62	0.00
27	601033	永兴股份	898	14,332.08	0.00
28	301516	中远通	604	11,252.52	0.00
29	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
30	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
31	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
32	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
33	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
34	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
35	001358	兴欣新材	122	2,503.44	0.00
36	600123	兰花科创	60	537.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000975	山金国际	156,418,508.00	20.29
2	601899	紫金矿业	142,287,413.22	18.46
3	601872	招商轮船	134,704,519.60	17.48
4	603993	洛阳钼业	131,999,528.88	17.13

5	601857	中国石油	128,303,579.40	16.65
6	600547	山东黄金	120,201,975.36	15.60
7	601600	中国铝业	115,538,665.08	14.99
8	600489	中金黄金	105,179,071.38	13.65
9	000807	云铝股份	97,416,119.61	12.64
10	600026	中远海能	87,255,579.00	11.32
11	601168	西部矿业	80,571,829.94	10.45
12	600988	赤峰黄金	78,893,967.00	10.24
13	601975	招商南油	77,542,579.90	10.06
14	000630	铜陵有色	77,494,022.00	10.05
15	000983	山西焦煤	65,428,457.85	8.49
16	000612	焦作万方	56,164,521.57	7.29
17	600362	江西铜业	55,394,496.00	7.19
18	000933	神火股份	50,849,867.23	6.60
19	600938	中国海油	47,338,229.00	6.14
20	000039	中集集团	46,809,885.40	6.07
21	601699	潞安环能	40,427,948.86	5.25
22	002155	湖南黄金	38,158,683.44	4.95
23	601919	中远海控	33,490,315.42	4.35
24	600123	兰花科创	29,328,797.58	3.81
25	000657	中钨高新	29,308,897.84	3.80
26	000708	中信特钢	26,891,143.25	3.49
27	601225	陕西煤业	25,437,254.00	3.30
28	600985	淮北矿业	25,367,829.08	3.29
29	600497	驰宏锌锗	24,964,902.00	3.24
30	002096	易普力	20,314,884.20	2.64
31	000960	锡业股份	19,232,551.48	2.50
32	002142	宁波银行	16,764,779.43	2.18

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	601857	中国石油	73,767,213.00	9.57
2	300394	天孚通信	69,383,726.82	9.00
3	000983	山西焦煤	62,888,276.82	8.16
4	300502	新易盛	53,025,151.24	6.88
5	300308	中际旭创	50,452,917.38	6.55
6	688166	博瑞医药	42,681,243.41	5.54
7	002317	众生药业	39,746,226.08	5.16
8	300487	蓝晓科技	38,676,292.29	5.02
9	688256	寒武纪	38,119,867.87	4.95
10	600362	江西铜业	37,584,929.00	4.88

11	300679	电连技术	36,085,444.45	4.68
12	603596	伯特利	33,876,994.00	4.40
13	600547	山东黄金	33,859,943.50	4.39
14	600675	中华企业	33,813,084.41	4.39
15	688516	奥特维	33,498,649.51	4.35
16	601872	招商轮船	31,200,082.68	4.05
17	000630	铜陵有色	30,936,510.00	4.01
18	000708	中信特钢	30,243,801.20	3.92
19	600123	兰花科创	29,095,597.50	3.77
20	601699	潞安环能	28,260,182.00	3.67
21	600985	淮北矿业	27,588,155.76	3.58
22	688301	奕瑞科技	27,175,220.41	3.53
23	000960	锡业股份	26,518,419.88	3.44
24	000657	中钨高新	25,778,922.80	3.34
25	600497	驰宏锌锗	25,255,359.00	3.28
26	601975	招商南油	24,071,971.31	3.12
27	001979	招商蛇口	21,732,444.48	2.82
28	003021	兆威机电	21,370,215.48	2.77
29	002096	易普力	19,821,348.12	2.57
30	600266	城建发展	17,110,455.00	2.22
31	002142	宁波银行	16,717,413.62	2.17

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	2,258,624,091.72
卖出股票收入（成交）总额	1,239,226,092.92

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

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

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

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

本报告期内，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。

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	384,684.05
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	260,843.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	645,527.80

### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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

份额级别	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	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
万家战略发展产业混合 A	15,766	87,091.31	833,685,935.20	60.72	539,395,717.63	39.28
万家战略发展产业混合 C	21,519	35,082.59	406,223,197.96	53.81	348,718,985.80	46.19
合计	36,379	58,495.94	1,239,909,133.16	58.27	888,114,703.43	41.73

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	万家战略发展产业混合 A	34,070.53	0.0025
	万家战略发展产业混合 C	27,585.16	0.0037
	合计	61,655.69	0.0029

### 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
----	------	--------------------



本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	万家战略发展产业混合 A	0
	万家战略发展产业混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	万家战略发展产业混合 A	0
	万家战略发展产业混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家战略发展产业混合 A	万家战略发展产业混合 C
基金合同生效日 (2021 年 1 月 13 日) 基金份额总额	2,332,300,053.42	1,095,548,660.66
本报告期期初基金份额总额	553,782,091.55	386,059,975.93
本报告期基金总申购份额	1,216,988,337.92	454,468,368.49
减：本报告期基金总赎回份额	397,688,776.64	85,586,160.66
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,373,081,652.83	754,942,183.76

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
申万宏源证券	1	1,195,561,166.51	34.19	1,130,874.03	34.18	-
西南证券	1	1,143,425,899.70	32.69	1,081,571.16	32.69	-
中泰证券	3	917,954,368.39	26.25	868,291.67	26.25	-
中信证券	2	240,355,910.71	6.87	227,363.43	6.87	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 财务状况良好，经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

(2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(3) 具有较强的金融服务能力和水平。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

(1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；

(2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

3、基金专用交易席位的变更情况：

无。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	万家战略发展产业混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	指定媒介	2024 年 1 月 19 日
2	万家基金管理有限公司旗下基金季度报告提示性公告	指定媒介	2024 年 1 月 19 日
3	万家战略发展产业混合型证券投资基金基金经理变更公告	指定媒介	2024 年 2 月 8 日
4	万家战略发展产业混合型证券投资基金招募说明书更新（2024 年第 1 号）	指定媒介	2024 年 2 月 19 日
5	万家战略发展产业混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	指定媒介	2024 年 2 月 19 日
6	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	2024 年 2 月 19 日
7	万家基金管理有限公司关于旗下基金在麦高证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2024 年 2 月 29 日
8	万家基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	指定媒介	2024 年 3 月 29 日
9	万家战略发展产业混合型证券投资基金 2023 年年度报告	指定媒介	2024 年 3 月 29 日
10	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在创金启富基金开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2024 年 4 月 8 日
11	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在创金启富基金开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2024 年 4 月 9 日

12	万家战略发展产业混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	指定媒介	2024 年 4 月 19 日
13	万家基金管理有限公司旗下基金季度报告提示性公告	指定媒介	2024 年 4 月 19 日
14	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在东莞证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2024 年 5 月 15 日
15	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在中金财富开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2024 年 5 月 17 日
16	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在渤海证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2024 年 5 月 30 日
17	万家战略发展产业混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	指定媒介	2024 年 6 月 17 日
18	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	2024 年 6 月 17 日
19	万家基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在交通银行股份有限公司定投起点的公告	指定媒介	2024 年 6 月 28 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240524-20240630	-	820,353,685.39	226,560,203.59	593,793,481.80	27.90
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。</p> <p>未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

## § 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、《万家战略发展产业混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家战略发展产业混合型证券投资基金托管协议》。
- 4、万家战略发展产业混合型证券投资基金 2024 年中期报告原文。
- 5、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。
- 7、本报告期内在中国证监会指定媒介公开披露的基金净值、更新招募说明书及其他临时公告。

## 12.2 存放地点

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

## 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日