

万家家瑞债券型证券投资基金

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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	7
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
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	44
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	60
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	60

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	61
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	61
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	61
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.11 投资组合报告附注	61
§ 8 基金份额持有人信息.....	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
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	66
§ 9 开放式基金份额变动.....	66
§ 10 重大事件揭示.....	67
10.1 基金份额持有人大会决议	67
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	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
10.4 基金投资策略的改变	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	68
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	68
10.8 其他重大事件	71
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	71
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	71
§ 12 备查文件目录.....	72
12.1 备查文件目录	72
12.2 存放地点	72
12.3 查阅方式	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家家瑞债券型证券投资基金		
基金简称	万家家瑞债券		
基金主代码	004571		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2017 年 9 月 20 日		
基金管理人	万家基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	2,528,002,880.22 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	万家家瑞债券 A	万家家瑞债券 C	万家家瑞债券 D
下属分级基金的交易代码	004571	004572	027171
报告期末下属分级基金的份额总额	1,435,099,472.94 份	308,043,817.73 份	784,859,589.55 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险并保持良好流动性的基础上，力争实现超越业绩比较基准的收益。
投资策略	（一）固定收益类资产投资策略：1、资产配置策略；2、利率预期策略；3、期限结构配置策略；4、债券品种选择策略；5、信用债券投资的风险管理；6、资产支持证券等品种投资策略；7、可转换债券投资策略； （二）股票投资策略：1、仓位配置策略；2、行业配置策略；3、个股投资策略；4、存托凭证投资策略； （三）衍生工具投资策略：国债期货的投资策略。
业绩比较基准	中债总全价指数（总值）收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金，属于中低风险/收益的产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		万家基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	郭明
	联系电话	021-38909626	010-66105799
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008880800	95588
传真		021-38909627	010-66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址	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 55 号
邮政编码	200122	100140
法定代表人	陈广益	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告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	万家基金管理有限公司	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

§ 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)		报告期(2026 年 4 月 10 日-2026 年 6 月 30 日)
	万家家瑞债券 A	万家家瑞债券 C	万家家瑞债券 D
本期已实现收益	15,815,354.12	3,661,365.68	3,802,691.44
本期利润	47,838,516.67	10,565,435.14	13,527,921.70
加权平均基金份额本期利润	0.1081	0.0900	0.0609
本期加权平均净值利润率	8.49%	7.36%	4.76%
本期基金份额净值增长率	7.83%	7.61%	4.47%
3.1.2 期末数据和	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		

指标			
期末可供分配利润	423,025,189.23	76,885,211.48	232,031,703.93
期末可供分配基金份额利润	0.2948	0.2496	0.2956
期末基金资产净值	1,858,124,662.17	384,929,029.21	1,016,891,293.48
期末基金份额净值	1.2948	1.2496	1.2956
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	41.23%	36.28%	4.47%

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）。

4、自 2026 年 4 月 10 日起，增设本基金 D 类份额，详情请参阅相关公告。

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

万家家瑞债券 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
过去三个月	5.76%	0.37%	1.62%	0.14%	4.14%	0.23%
过去六个月	7.83%	0.36%	1.37%	0.13%	6.46%	0.23%
过去一年	15.49%	0.32%	1.51%	0.11%	13.98%	0.21%
过去三年	12.10%	0.31%	7.18%	0.12%	4.92%	0.19%
过去五年	15.03%	0.28%	7.15%	0.12%	7.88%	0.16%
过去七年	32.19%	0.28%	12.52%	0.13%	19.67%	0.15%

自基金合同 生效起至今	41.23%	0.29%	17.40%	0.13%	23.83%	0.16%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

万家家瑞债券 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
过去三个月	5.66%	0.37%	1.62%	0.14%	4.04%	0.23%
过去六个月	7.61%	0.36%	1.37%	0.13%	6.24%	0.23%
过去一年	15.04%	0.32%	1.51%	0.11%	13.53%	0.21%
过去三年	10.66%	0.31%	7.18%	0.12%	3.48%	0.19%
过去五年	12.65%	0.28%	7.15%	0.12%	5.50%	0.16%
过去七年	28.40%	0.28%	12.52%	0.13%	15.88%	0.15%
自基金合同 生效起至今	36.28%	0.29%	17.40%	0.13%	18.88%	0.16%

万家家瑞债券 D

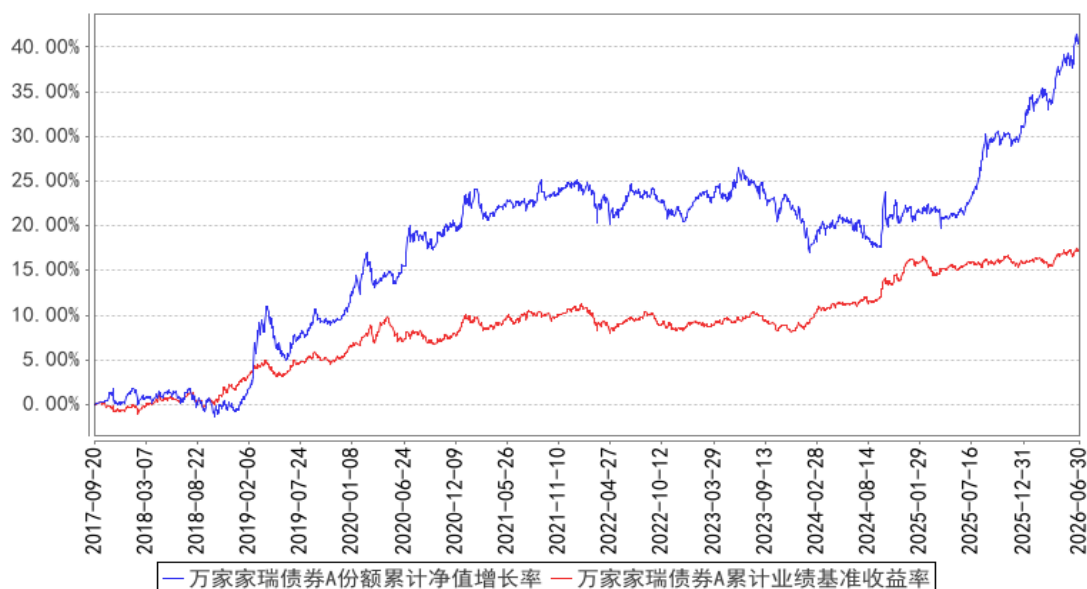
阶段	份额净值增 长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
自基金合同 生效起至今	4.47%	0.37%	1.08%	0.14%	3.39%	0.23%

注：1、万家家瑞债券 D 上述“自基金合同生效起至今”实际为“自基金份额类别首次确认起至今”，下同。

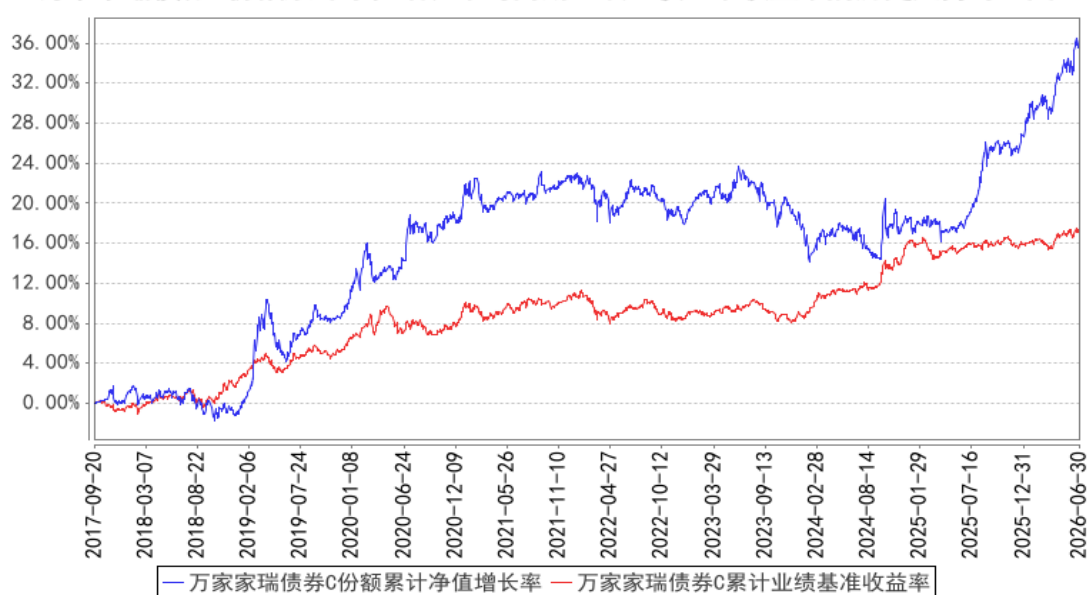
2、自 2026 年 4 月 10 日起，增设本基金 D 类份额，详情请参阅相关公告。

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

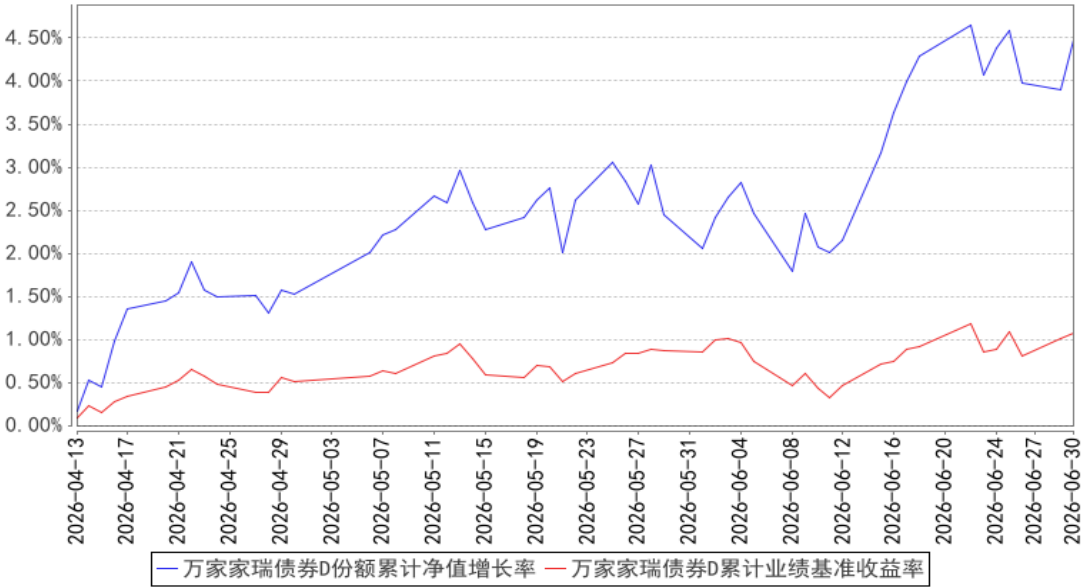
万家家瑞债券A份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



万家家瑞债券C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



万家瑞债券D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：1、本基金于 2017 年 9 月 20 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。

2、自 2026 年 4 月 10 日起增设本基金 D 类份额，2026 年 4 月 13 日起确认有 D 类份额登记在册。

§ 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		
乔亮	公司领导，首席量化投资官；万家	2022 年 12 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

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、万国家证 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				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。
--	--	--	--	--

	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。				
周慧	万家家瑞债券型证券投资基金、万年年恒荣定期开放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、万家民瑞祥和 6 个月持有期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、万家鑫璟纯债债券型证券投资基金、万家鑫盛纯债债券型证券投资基金的基金经理。	2023 年 6 月 2 日	-	13.5 年	国籍：中国；学历：上海交通大学工商管理硕士，2012 年 11 月入职万家基金管理有限公司，现任固定收益部基金经理，历任交易部债券交易员，债券投资部基金经理助理、基金经理等职。

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

本报告期末，本基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，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

债券部分：

1、市场回顾

利率债方面，一季度 10 年国债收益率先上后下再震荡，低点突破 1.8%后有所反弹，曲线两端走势分化，国开整体表现优于国债，3-7 年段涨幅领先，仅 30 年国债在通胀预期升温之下表现偏弱，TL 也在 3 月中创年内新低。二季度市场整体走强，在资金超预期宽松和负债端持续扩容的带动下，曲线由短及长相继大幅下行，10 年国债收益率最低下破 1.7%，随后触发小幅调整，债市情绪基本跟随资金面波动，6 月上旬 10 年国债收益率一度回升至 1.75%，待临近月末央行呵护跨季流动性后再度回落。

信用债方面，一季度信用债整体表现优异，持有体验好于利率债，尤其是 3 年内城投债收益率压至历史低位。信用利差方面，1 月利差以压缩为主，2 月略有分化，3 月则下行幅度不及利率、利差以走扩为主。二永债在 1 月领涨，2 月中长端也有较好表现，但 3 月在固收+负债端流失的环境下表现不及普通信用债。进入二季度，4 月信用债收益率续降，超长二永债领涨；5 年期内普通信用债中低等级优于中高等级，信用利差整体收窄。5 月收益率继续下行，3-5 年中高等级表现更佳，二永债强于普通信用债；利差分化，中低、中长端普通信用债利差小幅走阔。6 月各期限走势分化：短端收益率微升、利差普遍走扩；中长端收益率下行，利差小幅收窄或持平。

2、组合回顾

本组合债券底仓以利率债、中高等级普通信用债和二级资本债为主，以谋求稳定的票息收入。报告期内，1 月整体久期水平先降后升，下旬市场情绪回暖后提高了中段政金债的仓位；春节前考虑票息收益增持少量中等久期利率债，节后止盈；此后主要根据负债端变化调节仓位。自 5 月起，组合净资产规模大幅扩张，债券部分将原有利率债持仓置换为 1-5 年中高等级普通信用债和二级资本债，并维持部分利率债仓位以满足流动性需求。

权益部分：

本产品含权部分策略包含两块：一是股票部分的投资策略，采取相对均衡的投资策略，通过量化选股和行业配置策略，主动适应不同的市场风格，前瞻性选股，提高选股胜率，以追求能获得长期稳定的收益。本产品的股票投资在风格配置上相对均衡，行业配置偏向于行业景气度高的行业。在量化选股方面精选行业内质优个股组合，持股较为分散。二是量化可转债策略，通过量化模型对可转债进行优选，以期提升产品收益的稳健性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家家瑞债券 A 的基金份额净值为 1.2948 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.83%，同期业绩比较基准收益率为 1.37%；截至本报告期末万家家瑞债券 C 的基金份额净值为 1.2496 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.61%，同期业绩比较基准收益率为 1.37%；截至本报告期末万家家瑞债券 D 的基金份额净值为 1.2956 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.47%，

同期业绩比较基准收益率为 1.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

债券部分：

8 月以来央行在资金端进行收短放长的操作，资金价格在月初回落至 1.4% 下方，但幅度也较为有限，叠加 OMO 连续回到 10 亿的地量投放，不免让市场担心 6 月初的场景再现，因此关键期限的阻力位仍在。往后看，如果 10 年国债继续横盘，债市的做平交易空间也较为有限，叠加一级供给扰动渐起，波段仓位更适合边打边撤，等待调整后的参与机会。更为显著的趋势性行情，有待货币政策落地后由短及长打开债市的下行空间。

权益部分：

2026 年上半年，A 股市场呈现“科技领涨、指数震荡抬升”的结构分化格局。人工智能产业革命、国产替代加速与全球科技周期共振向上，三重驱动之下，资金深度抱团 AI 相关板块，科技成长走出独立行情；而传统价值板块则持续承压，资金流出与价格下跌并行，市场分化显著。

展望后市，7 月以来 AI 板块杠杆资金快速出清，市场经历大幅调整后估值已回归合理区间，A 股有望逐步企稳回升。从政策层面看，近期决策层对资本市场积极表态，稳定信号明确，维稳资金正有序入场，托底力度增强；从基本面看，二季度 PPI 中枢较一季度显著抬升，价格端改善正向企业盈利传导，上市公司盈利有望进一步上行，为市场走强提供有力支撑；从政策定调看，7 月政治局会议基调积极，强调高度重视经济运行中的困难挑战，要求及时谋划增量政策，加大逆周期调节与扩内需力度，财政与货币表述均较 4 月更为积极——财政端加快支出与债券资金使用进度，推进“两重”“两新”落地，货币端要求适时调整政策工具，降准降息预期升温，且股市表述从“稳信心”升级为“提升韧性信心”，政策呵护力度进一步加码。总体而言，市场调整已较为充分，叠加政策托底与基本面改善的双重支撑，A 股有望企稳回升。

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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——万家基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对万家基金管理有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：万家瑞瑞债券型证券投资基金

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	22,281,402.50	35,987.45

结算备付金		4,440,951.28	900,429.09
存出保证金		110,761.38	5,930.24
交易性金融资产	6.4.7.2	3,514,849,703.10	82,091,246.39
其中：股票投资		515,049,765.36	13,737,054.96
基金投资		—	—
债券投资		2,999,799,937.74	68,354,191.43
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	—	200,000.00
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		—	1,524,231.68
应收股利		—	—
应收申购款		23,000,770.73	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.5	—	—
资产总计		3,564,683,588.99	84,757,824.85
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		217,009,215.07	4,400,178.11
应付清算款		60,667,897.79	439,131.81
应付赎回款		24,149,933.21	1,049,368.41
应付管理人报酬		1,690,339.56	56,697.37
应付托管费		482,954.16	16,199.27
应付销售服务费		134,745.78	12,389.21
应付投资顾问费		—	—
应交税费		46,753.51	924.38
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.6	556,765.05	128,064.00
负债合计		304,738,604.13	6,102,952.56
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	2,528,002,880.22	66,424,273.89
其他综合收益	6.4.7.8	—	—

未分配利润	6.4.7.9	731,942,104.64	12,230,598.40
净资产合计		3,259,944,984.86	78,654,872.29
负债和净资产总计		3,564,683,588.99	84,757,824.85

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 2,528,002,880.22 份，其中万家家瑞债券 A 基金份额净值 1.2948 元，基金份额总额 1,435,099,472.94 份；万家家瑞债券 C 基金份额净值 1.2496 元，基金份额总额 308,043,817.73 份；万家家瑞债券 D 基金份额净值 1.2956 元，基金份额总额 784,859,589.55 份。

6.2 利润表

会计主体：万家家瑞债券型证券投资基金

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		75,987,315.46	383,320.27
1. 利息收入		128,021.88	2,115.73
其中：存款利息收入	6.4.7.10	29,744.73	1,258.30
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		98,277.15	857.43
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		26,663,723.39	56,202.33
其中：股票投资收益	6.4.7.11	22,621,510.88	-313,684.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	2,172,338.63	257,914.65
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	1,869,873.88	111,972.50
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	48,652,462.27	324,686.69
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	543, 107. 92	315. 52
减：二、营业总支出		4, 055, 441. 95	247, 178. 60
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	2, 767, 679. 66	131, 253. 81
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	790, 765. 65	37, 501. 12
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	274, 075. 35	426. 94
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		139, 785. 69	27, 306. 79
其中：卖出回购金融资产支出		139, 785. 69	27, 306. 79
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 19	-	-
7. 税金及附加		7, 622. 85	48. 24
8. 其他费用	6. 4. 7. 20	75, 512. 75	50, 641. 70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		71, 931, 873. 51	136, 141. 67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		71, 931, 873. 51	136, 141. 67
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		71, 931, 873. 51	136, 141. 67

6.3 净资产变动表

会计主体：万家家瑞债券型证券投资基金

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	66, 424, 273. 89	-	12, 230, 598. 40	78, 654, 872. 29
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	66, 424, 273. 89	-	12, 230, 598. 40	78, 654, 872. 29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2, 461, 578, 606. 33	-	719, 711, 506. 24	3, 181, 290, 112. 57
（一）、综合收益	-	-	71, 931, 873. 51	71, 931, 873. 51

总额				
(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)	2,461,578,606.33	-	647,779,632.73	3,109,358,239.06
其中：1. 基金申购款	3,238,005,838.98	-	860,923,300.92	4,098,929,139.90
2. 基金赎回款	-776,427,232.65	-	-213,143,668.19	-989,570,900.84
(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	2,528,002,880.22	-	731,942,104.64	3,259,944,984.86
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	7,416,508.08	-	787,773.53	8,204,281.61
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	7,416,508.08	-	787,773.53	8,204,281.61
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	38,852,755.78	-	4,811,217.77	43,663,973.55
(一)、综合收益总额	-	-	136,141.67	136,141.67
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数	38,852,755.78	-	4,675,076.10	43,527,831.88

(净资产减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	44,985,266.22	-	5,296,006.55	50,281,272.77
2. 基金赎回款	-6,132,510.44	-	-620,930.45	-6,753,440.89
(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	46,269,263.86	-	5,598,991.30	51,868,255.16

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

万家家瑞债券型证券投资基金（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[2017]502号文《关于核准万家家瑞债券型证券投资基金募集的批复》的批准，由万家基金管理有限公司作为管理人于2017年8月21日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资并出具安永华明（2017）验字第60778298_B03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2017年9月20日正式生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币286,881,975.30元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币39,850.15元，以上实收基金（本息）合计为人民币286,921,825.45元，折合286,921,825.45份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为万家基金管理有限公司，注册登记机构为万家基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《万家

家瑞债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，经与本基金基金托管人协商一致，2026 年 4 月 10 日起，本基金增设 D 类基金份额。

本基金的投资范围主要为国内依法发行的债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、国债期货等金融工具以及国内依法发行上市的股票（含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）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）。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：中债总全价指数（总值）收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%。

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	22,281,402.50
等于：本金	22,272,663.90
加：应计利息	8,738.60
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	22,281,402.50

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		460,789,786.69	-	515,049,765.36	54,259,978.67
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	237,585,778.39	1,079,234.82	231,319,941.32	-7,345,071.89
	银行间市场	2,741,122,382.16	25,037,996.42	2,768,479,996.42	2,319,617.84
	合计	2,978,708,160.55	26,117,231.24	2,999,799,937.74	-5,025,454.05
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	3,439,497,947.24	26,117,231.24	3,514,849,703.10	49,234,524.62

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 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	18,781.75
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	484,052.32
其中：交易所市场	410,006.27
银行间市场	74,046.05
应付利息	-
预提费用	53,930.98
合计	556,765.05

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

万家家瑞债券 A

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	38,445,840.18	38,445,840.18
本期申购	1,978,264,659.16	1,978,264,659.16
本期赎回（以“-”号填列）	-581,611,026.40	-581,611,026.40
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	1,435,099,472.94	1,435,099,472.94

万家家瑞债券 C

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	27,978,433.71	27,978,433.71
本期申购	429,720,396.20	429,720,396.20
本期赎回（以“-”号填列）	-149,655,012.18	-149,655,012.18
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	308,043,817.73	308,043,817.73

万家家瑞债券 D

项目	本期 2026 年 4 月 10 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	830,020,783.62	830,020,783.62
本期赎回（以“-”号填列）	-45,161,194.07	-45,161,194.07
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	784,859,589.55	784,859,589.55

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

万家家瑞债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	11,422,895.46	-3,701,927.58	7,720,967.88
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	11,422,895.46	-3,701,927.58	7,720,967.88
本期利润	15,815,354.12	32,023,162.55	47,838,516.67
本期基金份额交易产生的变动数	452,390,608.93	-84,924,904.25	367,465,704.68
其中：基金申购款	644,879,783.87	-110,463,467.09	534,416,316.78
基金赎回款	-192,489,174.94	25,538,562.84	-166,950,612.10
本期已分配利润	-	-	-

本期末	479,628,858.51	-56,603,669.28	423,025,189.23
-----	----------------	----------------	----------------

万家家瑞债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,121,362.03	-2,611,731.51	4,509,630.52
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	7,121,362.03	-2,611,731.51	4,509,630.52
本期利润	3,661,365.68	6,904,069.46	10,565,435.14
本期基金份额交易产生的变动数	77,940,331.07	-16,130,185.25	61,810,145.82
其中：基金申购款	119,791,330.09	-24,271,461.13	95,519,868.96
基金赎回款	-41,850,999.02	8,141,275.88	-33,709,723.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	88,723,058.78	-11,837,847.30	76,885,211.48

万家家瑞债券 D

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	3,802,691.44	9,725,230.26	13,527,921.70
本期基金份额交易产生的变动数	258,575,266.90	-40,071,484.67	218,503,782.23
其中：基金申购款	273,337,145.31	-42,350,030.13	230,987,115.18
基金赎回款	-14,761,878.41	2,278,545.46	-12,483,332.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	262,377,958.34	-30,346,254.41	232,031,703.93

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	27,708.09
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	1,980.96
其他	55.68
合计	29,744.73

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	22,621,510.88
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	22,621,510.88

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	267,600,625.50
减：卖出股票成本总额	244,355,896.55
减：交易费用	623,218.07
买卖股票差价收入	22,621,510.88

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	6,843,852.03
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-4,671,513.40
债券投资收益——赎回差价收入	—
债券投资收益——申购差价收入	—
合计	2,172,338.63

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,022,473,517.67
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,015,586,686.15
减：应计利息总额	11,467,392.73
减：交易费用	90,952.19
买卖债券差价收入	-4,671,513.40

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	1,869,873.88
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	1,869,873.88

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	48,652,462.27
股票投资	53,624,919.07
债券投资	-4,972,456.80
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	48,652,462.27

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	538,910.17
基金转换费收入	4,197.75
合计	543,107.92

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	4,959.40
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	12,281.77
账户维护费	18,600.00
合计	75,512.75

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、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	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：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 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	
	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	-	-	6,920,856.25	8.17

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：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	
	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	-	-	6,194,019.32	4.07

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	3,085.93	8.16	-	-

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	2,767,679.66	131,253.81
其中：应支付销售机构的客户维护费	997,810.59	9,767.68
应支付基金管理人的净管理费	1,769,869.07	121,486.13

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.70% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 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、公休假或不可抗力致使无法按时支付等，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 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	790,765.65	37,501.12

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付等，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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	万家家瑞债券 A	万家家瑞债券 C	万家家瑞债券 D	合计
工商银行	-	232,071.63	-	232,071.63
万家基金	-	1,241.10	-	1,241.10
中泰证券	-	75.67	-	75.67
合计	-	233,388.40	-	233,388.40
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费			
	万家家瑞债券 A	万家家瑞债券 C	万家家瑞债券 D	合计
工商银行	-	181.40	-	181.40
中泰证券	-	16.94	-	16.94
合计	-	198.34	-	198.34

注：1、本基金 A 类基金份额、D 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 0.40%。销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.40\%\div \text{当年天数}$$

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算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 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、公休假或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延。

2、自 2026 年 4 月 10 日起，本基金增设 D 类基金份额。

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

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		本期 2026 年 4 月 10 日至 2026 年 6 月 30 日
	万家家瑞债券 A	万家家瑞债券 C	万家家瑞债券 D
基金合同生效日 (2017 年 9 月 20 日) 持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基金 份额	23,403,474.33	-	-

报告期间申购/买入总份额	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额	23,403,474.33	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.6308%	-	-
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 -
	万家家瑞债券 A	万家家瑞债券 C	万家家瑞债券 D
基金合同生效日 (2017 年 9 月 20 日) 持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-	-
报告期间申购/买入总份额	40,263,474.33	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额	40,263,474.33	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	87.2523%	-	-

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 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
工商银行	22,281,402.50	27,708.09	50,495.27	643.58

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，存款按银行同业利率或约

定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方所承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间没有需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

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
688260	昀冢科技	2026 年 6 月 26 日	异常波动停牌	145.02	2026 年 7 月 1 日	132.00	10,700	626,913.65	1,551,714.00	-
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	900	511,479.00	791,577.00	-

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，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 217,009,215.07 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
190215	19 国开 15	2026 年 7 月 1 日	108.93	500,000	54,467,191.78
210210	21 国开 10	2026 年 7 月 1 日	108.99	500,000	54,497,109.59
220205	22 国开 05	2026 年 7 月 1 日	108.79	500,000	54,393,082.19

230203	23 国开 03	2026 年 7 月 1 日	103.33	290,000	29,965,406.03
250203	25 国开 03	2026 年 7 月 1 日	99.91	500,000	49,956,191.78
合计				2,290,000	243,278,981.37

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同责任，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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	3,528,275.23
合计	-	3,528,275.23

注：未评级债券包括国债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	1,385,606,115.83	1,281,796.55
AAA 以下	195,075,993.71	4,450,420.62
未评级	1,419,117,828.20	59,093,699.03
合计	2,999,799,937.74	64,825,916.20

注：未评级债券包括国债、政策性金融债、中期票据。

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 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	22,281,402.50	-	-	-	-	-	22,281,402.50
结算备付金	4,440,951.28	-	-	-	-	-	4,440,951.28
存出保证金	110,761.38	-	-	-	-	-	110,761.38
交易性金融资产	32,430,021.76	121,148,232.55	250,087,632.23	2,325,957,929.87	270,176,121.33	515,049,765.36	3,514,849,703.10
应收申购款	10.67	-	-	-	-	23,000,760.06	23,000,770.73
资产总计	59,263,147.59	121,148,232.55	250,087,632.23	2,325,957,929.87	270,176,121.33	538,050,525.42	3,564,683,588.99
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	24,149,933.21	24,149,933.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,690,339.56	1,690,339.56
应付托管费	-	-	-	-	-	482,954.16	482,954.16
应付清算款	-	-	-	-	-	60,667,897.79	60,667,897.79
卖出回购金融资产款	217,009,215.07	-	-	-	-	-	217,009,215.07

应付销售服务费	-	-	-	-	-	134,745.78	134,745.78
应交税费	-	-	-	-	-	46,753.51	46,753.51
其他负债	-	-	-	-	-	556,765.05	556,765.05
负债总计	217,009,215.07	-	-	-	-	87,729,389.06	304,738,604.13
利率敏感度缺口	-157,746,067.48	121,148,232.55	250,087,632.23	2,325,957,929.87	270,176,121.33	450,321,136.36	3,259,944,984.86
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	35,987.45	-	-	-	-	-	35,987.45
结算备付金	900,429.09	-	-	-	-	-	900,429.09
存出保证金	5,930.24	-	-	-	-	-	5,930.24
交易性金融资产	364,781.48	796,843.16	8,701,162.55	36,643,705.61	21,847,698.63	13,737,054.96	82,091,246.39
买入返售金融资产	200,000.00	-	-	-	-	-	200,000.00
应收清算款	-	-	-	-	-	1,524,231.68	1,524,231.68
资产总计	1,507,128.26	796,843.16	8,701,162.55	36,643,705.61	21,847,698.63	15,261,286.64	84,757,824.85
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,049,368.41	1,049,368.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	56,697.37	56,697.37
应付托管费	-	-	-	-	-	16,199.27	16,199.27
应付清算款	-	-	-	-	-	439,131.81	439,131.81
卖出回购金融资产款	4,400,178.11	-	-	-	-	-	4,400,178.11
应付销售服务费	-	-	-	-	-	12,389.21	12,389.21
应交税费	-	-	-	-	-	924.38	924.38
其他负债	-	-	-	-	-	128,064.00	128,064.00
负债总计	4,400,178.11	-	-	-	-	1,702,774.45	6,102,952.56
利率敏感度缺口	-2,893,049.85	796,843.16	8,701,162.55	36,643,705.61	21,847,698.63	13,558,512.19	78,654,872.29

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

假设	除市场利率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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	27,193,028.64	473,026.10
	市场利率上升 25 个基点	-26,673,186.15	-467,443.40

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 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	515,049,765.36	15.80	13,737,054.96	17.46
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	515,049,765.36	15.80	13,737,054.96	17.46

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（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	8,227,735.84	195,997.25
	股票基准指数下降 100 个基点	-8,227,735.84	-195,997.25

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	741,028,383.67	19,406,224.13
第二层次	2,773,821,319.43	62,685,022.26
第三层次	-	-
合计	3,514,849,703.10	82,091,246.39

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	515,049,765.36	14.45
	其中：股票	515,049,765.36	14.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,999,799,937.74	84.15
	其中：债券	2,999,799,937.74	84.15
	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	26,722,353.78	0.75
8	其他各项资产	23,111,532.11	0.65
9	合计	3,564,683,588.99	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	15,199,014.96	0.47
C	制造业	401,322,783.20	12.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	327,456.00	0.01
E	建筑业	7,780,237.00	0.24
F	批发和零售业	21,691,649.00	0.67
G	交通运输、仓储和邮政业	2,247,084.00	0.07

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,238,617.60	0.93
J	金融业	27,972,655.60	0.86
K	房地产业	14,858.00	0.00
L	租赁和商务服务业	1,237,543.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	5,575,218.00	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	1,442,649.00	0.04
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	515,049,765.36	15.80

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。

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	600105	永鼎股份	111,700	7,537,516.00	0.23
2	300475	香农芯创	23,800	7,140,000.00	0.22
3	300308	中际旭创	5,500	6,985,000.00	0.21
4	002916	深南电路	15,000	6,868,500.00	0.21
5	002384	东山精密	25,800	6,768,630.00	0.21
6	688630	芯基微装	11,700	6,427,863.00	0.20
7	688559	海目星	72,700	6,100,984.00	0.19
8	300236	上海新阳	45,600	5,996,400.00	0.18
9	300223	君正股份	24,000	5,973,600.00	0.18
10	688498	源杰科技	3,165	5,969,190.00	0.18
11	688002	睿创微纳	37,700	5,831,813.00	0.18
12	688257	新锐股份	52,780	5,378,282.00	0.16
13	300857	协创数据	15,720	5,343,228.00	0.16
14	688525	佰维存储	10,100	4,996,773.00	0.15
15	002460	赣锋锂业	75,700	4,950,780.00	0.15
16	688627	精智达	6,900	4,933,500.00	0.15
17	002466	天齐锂业	80,200	4,917,864.00	0.15
18	600015	华夏银行	749,700	4,790,583.00	0.15
19	300394	天孚通信	15,420	4,667,325.60	0.14
20	600183	生益科技	26,600	4,612,440.00	0.14
21	603986	兆易创新	5,600	4,564,000.00	0.14
22	300548	长芯博创	16,300	4,531,400.00	0.14

23	601077	渝农商行	712,700	4,354,597.00	0.13
24	301219	腾远钴业	78,704	4,312,979.20	0.13
25	300861	美畅股份	170,300	4,289,857.00	0.13
26	600502	安徽建工	946,200	4,115,970.00	0.13
27	688416	恒烁股份	28,600	4,004,000.00	0.12
28	688025	杰普特	8,500	3,995,000.00	0.12
29	300502	新易盛	6,520	3,957,640.00	0.12
30	301191	菲菱科思	34,680	3,937,914.00	0.12
31	601869	长飞光纤	6,900	3,766,710.00	0.12
32	300073	当升科技	77,300	3,713,492.00	0.11
33	002281	光迅科技	14,300	3,674,242.00	0.11
34	601225	陕西煤业	178,700	3,636,545.00	0.11
35	002240	盛新锂能	80,433	3,605,811.39	0.11
36	002758	浙农股份	450,500	3,558,950.00	0.11
37	300842	帝科股份	39,500	3,522,215.00	0.11
38	301377	鼎泰高科	6,340	3,492,706.00	0.11
39	600489	中金黄金	189,700	3,424,085.00	0.11
40	301086	鸿富瀚	16,320	3,415,449.60	0.10
41	600971	恒源煤电	485,300	3,348,570.00	0.10
42	601009	南京银行	335,900	3,322,051.00	0.10
43	600487	亨通光电	29,300	3,203,662.00	0.10
44	603799	华友钴业	64,600	3,117,596.00	0.10
45	300490	华自科技	235,200	3,111,696.00	0.10
46	001309	德明利	3,300	3,111,570.00	0.10
47	688045	必易微	38,100	3,077,718.00	0.09
48	300590	移为通信	213,900	3,069,465.00	0.09
49	300975	商络电子	58,700	3,037,725.00	0.09
50	603126	中材节能	476,900	3,004,470.00	0.09
51	688170	德龙激光	31,200	2,995,512.00	0.09
52	300408	三环集团	17,900	2,987,510.00	0.09
53	301099	雅创电子	31,200	2,979,600.00	0.09
54	600176	中国巨石	40,000	2,915,200.00	0.09
55	300480	光力科技	67,200	2,868,096.00	0.09
56	603083	剑桥科技	11,200	2,854,544.00	0.09
57	300418	昆仑万维	70,200	2,833,272.00	0.09
58	002353	杰瑞股份	18,500	2,821,250.00	0.09
59	002415	海康威视	82,300	2,814,660.00	0.09
60	600801	华新建材	180,100	2,809,560.00	0.09
61	600549	厦门钨业	32,800	2,794,560.00	0.09
62	002414	高德红外	207,200	2,747,472.00	0.08
63	688313	仕佳光子	14,500	2,677,425.00	0.08
64	301589	诺瓦星云	17,700	2,636,946.00	0.08
65	300811	铂科新材	27,580	2,617,066.20	0.08

66	688766	普冉股份	3,400	2,606,440.00	0.08
67	300476	胜宏科技	7,400	2,563,582.00	0.08
68	688337	普源精电	34,200	2,562,606.00	0.08
69	688668	鼎通科技	6,800	2,538,440.00	0.08
70	688610	埃科光电	9,600	2,528,640.00	0.08
71	300769	德方纳米	38,000	2,527,000.00	0.08
72	002463	沪电股份	16,337	2,496,293.60	0.08
73	688503	聚和材料	18,500	2,454,950.00	0.08
74	688700	东威科技	27,400	2,449,560.00	0.08
75	300442	润泽科技	29,300	2,433,951.00	0.07
76	300882	万胜智能	146,500	2,428,970.00	0.07
77	002805	丰元股份	84,000	2,401,560.00	0.07
78	603256	宏和科技	8,800	2,334,904.00	0.07
79	002008	大族激光	15,300	2,296,683.00	0.07
80	002080	中材科技	24,300	2,187,000.00	0.07
81	300731	科创新源	37,320	2,177,995.20	0.07
82	300429	强力新材	122,500	2,170,700.00	0.07
83	000630	铜陵有色	340,100	2,163,036.00	0.07
84	605399	晨光新材	146,300	2,149,147.00	0.07
85	605060	联德股份	37,100	2,105,054.00	0.06
86	601138	工业富联	29,000	2,092,350.00	0.06
87	300620	光库科技	5,400	2,042,280.00	0.06
88	688182	灿勤科技	46,400	1,998,448.00	0.06
89	600710	苏美达	208,400	1,992,304.00	0.06
90	603019	中科曙光	18,300	1,962,309.00	0.06
91	688556	高测股份	146,800	1,949,504.00	0.06
92	300745	欣锐科技	45,400	1,916,788.00	0.06
93	300856	科思股份	177,300	1,890,018.00	0.06
94	601187	厦门银行	274,500	1,874,835.00	0.06
95	001389	广合科技	7,800	1,850,550.00	0.06
96	688392	骄成超声	8,141	1,849,472.38	0.06
97	300604	长川科技	5,400	1,843,668.00	0.06
98	300567	精测电子	5,800	1,842,080.00	0.06
99	688031	星环科技	15,800	1,819,844.00	0.06
100	600875	东方电气	62,400	1,795,248.00	0.06
101	002491	通鼎互联	55,100	1,785,240.00	0.05
102	301165	锐捷网络	22,160	1,782,772.00	0.05
103	688378	奥来德	28,600	1,773,200.00	0.05
104	603444	吉比特	4,900	1,756,258.00	0.05
105	300252	金信诺	97,800	1,687,050.00	0.05
106	688388	嘉元科技	36,970	1,626,680.00	0.05
107	000001	平安银行	161,200	1,620,060.00	0.05
108	601677	明泰铝业	97,400	1,616,840.00	0.05

109	601800	中国交建	278,400	1,589,664.00	0.05
110	688531	日联科技	8,800	1,564,992.00	0.05
111	002154	报喜鸟	436,600	1,554,296.00	0.05
112	688260	昀冢科技	10,700	1,551,714.00	0.05
113	002142	宁波银行	49,600	1,472,624.00	0.05
114	002557	洽洽食品	81,500	1,463,740.00	0.04
115	688522	纳睿雷达	72,620	1,453,852.40	0.04
116	300042	朗科科技	18,500	1,409,145.00	0.04
117	688097	博众精工	22,300	1,406,015.00	0.04
118	600522	中天科技	23,100	1,401,708.00	0.04
119	603268	松发股份	10,000	1,392,800.00	0.04
120	000988	华工科技	7,400	1,366,114.00	0.04
121	688167	炬光科技	3,780	1,338,913.80	0.04
122	002948	青岛银行	259,100	1,316,228.00	0.04
123	603345	安井食品	16,400	1,315,116.00	0.04
124	603061	金海通	2,600	1,305,772.00	0.04
125	688256	寒武纪	800	1,276,440.00	0.04
126	002284	亚太股份	134,300	1,274,507.00	0.04
127	688779	五矿新能	156,500	1,269,215.00	0.04
128	601666	平煤股份	176,600	1,262,690.00	0.04
129	600026	中远海能	69,300	1,243,242.00	0.04
130	301215	中汽股份	239,500	1,243,005.00	0.04
131	600323	瀚蓝环境	45,200	1,241,192.00	0.04
132	688390	固德威	11,400	1,237,014.00	0.04
133	603124	江南新材	6,600	1,234,068.00	0.04
134	603993	洛阳钼业	70,200	1,232,010.00	0.04
135	000657	中钨高新	12,800	1,225,216.00	0.04
136	301510	固高科技	38,100	1,216,533.00	0.04
137	605599	莱百股份	85,800	1,175,460.00	0.04
138	601997	贵阳银行	221,100	1,134,243.00	0.03
139	002819	东方中科	50,200	1,121,970.00	0.03
140	002961	瑞达期货	57,300	1,121,934.00	0.03
141	688521	芯原股份	3,000	1,113,420.00	0.03
142	002028	思源电气	6,400	1,107,200.00	0.03
143	002837	英维克	13,750	1,093,950.00	0.03
144	688599	天合光能	77,100	1,088,652.00	0.03
145	300870	欧陆通	3,120	1,078,552.80	0.03
146	300491	通合科技	28,100	1,073,139.00	0.03
147	301169	零点有数	15,100	1,066,966.00	0.03
148	002345	潮宏基	115,500	1,059,135.00	0.03
149	000603	盛达资源	45,400	1,048,740.00	0.03
150	601998	中信银行	149,600	1,036,728.00	0.03
151	601665	齐鲁银行	178,900	1,032,253.00	0.03

152	688311	盟升电子	39,200	1,026,648.00	0.03
153	301511	德福科技	7,000	1,006,950.00	0.03
154	688636	智明达	27,642	1,001,469.66	0.03
155	688328	深科达	10,400	995,280.00	0.03
156	688225	亚信安全	79,800	991,116.00	0.03
157	002582	好想你	117,000	988,650.00	0.03
158	688308	欧科亿	5,400	981,774.00	0.03
159	688261	东微半导	9,227	968,189.11	0.03
160	000977	浪潮信息	13,800	966,000.00	0.03
161	000800	一汽解放	161,800	962,710.00	0.03
162	002738	中矿资源	16,100	949,739.00	0.03
163	603185	弘元绿能	56,900	949,661.00	0.03
164	000776	广发证券	40,300	943,020.00	0.03
165	601872	招商轮船	53,100	932,967.00	0.03
166	688787	海天瑞声	6,900	927,705.00	0.03
167	002624	完美世界	74,500	925,290.00	0.03
168	301308	江波龙	1,300	914,940.00	0.03
169	688333	铂力特	8,700	890,880.00	0.03
170	688127	蓝特光学	9,100	888,160.00	0.03
171	688347	华虹宏力	2,600	874,380.00	0.03
172	002558	巨人网络	31,700	873,652.00	0.03
173	605358	立昂微	11,200	869,120.00	0.03
174	600562	国睿科技	39,800	844,556.00	0.03
175	601963	重庆银行	81,700	823,536.00	0.03
176	688206	概伦电子	18,400	816,408.00	0.03
177	300570	太辰光	3,300	814,143.00	0.02
178	688676	金盘科技	9,600	812,544.00	0.02
179	002897	意华股份	9,200	809,416.00	0.02
180	603115	海星股份	6,600	808,302.00	0.02
181	301150	中一科技	12,740	804,021.40	0.02
182	002297	博云新材	27,500	797,225.00	0.02
183	688072	拓荆科技	900	791,577.00	0.02
184	603998	方盛制药	87,600	791,028.00	0.02
185	002156	通富微电	10,400	789,048.00	0.02
186	688372	伟测科技	4,200	781,200.00	0.02
187	301095	广立微	6,500	767,325.00	0.02
188	688173	希荻微	39,800	761,772.00	0.02
189	301200	大族数控	2,100	757,365.00	0.02
190	300691	联合光电	47,800	755,718.00	0.02
191	688711	宏微科技	16,600	754,470.00	0.02
192	603936	博敏电子	27,800	742,538.00	0.02
193	002379	宏桥控股	50,000	738,500.00	0.02
194	600262	北方股份	37,200	736,188.00	0.02

195	688090	瑞松科技	6,500	691,925.00	0.02
196	688535	华海诚科	3,700	691,900.00	0.02
197	002912	中新赛克	37,500	691,500.00	0.02
198	301326	捷邦科技	4,900	682,913.00	0.02
199	300697	电工合金	45,000	681,750.00	0.02
200	688320	禾川科技	16,300	675,635.00	0.02
201	688023	安恒信息	18,300	671,976.00	0.02
202	000983	山西焦煤	113,000	655,400.00	0.02
203	688027	国盾量子	1,300	655,213.00	0.02
204	600775	南京熊猫	68,200	651,992.00	0.02
205	688507	索辰科技	2,400	647,232.00	0.02
206	300353	东土科技	31,100	646,258.00	0.02
207	688041	海光信息	1,739	643,951.70	0.02
208	601825	沪农商行	85,800	642,642.00	0.02
209	688059	华锐精密	3,200	639,072.00	0.02
210	688158	优刻得	17,300	635,948.00	0.02
211	600366	宁波韵升	43,300	635,644.00	0.02
212	301205	联特科技	1,900	634,790.00	0.02
213	601229	上海银行	72,200	626,696.00	0.02
214	600601	方正科技	44,800	620,032.00	0.02
215	603703	盛洋科技	55,600	617,160.00	0.02
216	603067	振华股份	13,300	615,657.00	0.02
217	301235	华康洁净	8,200	615,082.00	0.02
218	003031	中瓷电子	3,400	613,020.00	0.02
219	002237	恒邦股份	41,508	609,752.52	0.02
220	300014	亿纬锂能	9,300	604,779.00	0.02
221	301237	和顺科技	8,100	600,048.00	0.02
222	688095	福昕软件	10,000	594,300.00	0.02
223	688400	凌云光	8,800	582,560.00	0.02
224	601117	中国化学	77,800	571,830.00	0.02
225	688207	格灵深瞳	27,900	560,790.00	0.02
226	688070	纵横股份	15,000	559,950.00	0.02
227	300757	罗博特科	900	557,100.00	0.02
228	300438	鹏辉能源	6,700	555,095.00	0.02
229	688202	美迪西	6,700	540,757.00	0.02
230	301382	蜂助手	11,700	538,200.00	0.02
231	600498	烽火通信	7,300	537,280.00	0.02
232	300593	新雷能	17,600	529,056.00	0.02
233	300395	菲利华	3,900	521,547.00	0.02
234	002587	奥拓电子	66,600	520,146.00	0.02
235	603308	应流股份	8,600	519,440.00	0.02
236	002851	麦格米特	3,100	518,258.00	0.02
237	688083	中望软件	8,000	518,000.00	0.02

238	301176	逸豪新材	7,600	516,800.00	0.02
239	603929	亚翔集成	1,800	489,636.00	0.02
240	601360	三六零	54,900	477,081.00	0.01
241	688012	中微公司	1,015	475,527.50	0.01
242	688356	键凯科技	6,003	462,711.24	0.01
243	688239	航宇科技	7,700	460,691.00	0.01
244	688307	中润光学	5,520	441,324.00	0.01
245	688062	迈威生物	15,600	440,700.00	0.01
246	688039	当虹科技	11,700	436,644.00	0.01
247	603093	南华期货	24,000	435,600.00	0.01
248	301487	盟固利	22,400	428,960.00	0.01
249	600961	株冶集团	13,200	427,548.00	0.01
250	002017	东信和平	28,900	422,807.00	0.01
251	688327	云从科技	33,600	418,656.00	0.01
252	688387	信科移动	21,100	418,624.00	0.01
253	000933	神火股份	19,700	417,640.00	0.01
254	688682	霍莱沃	10,700	416,230.00	0.01
255	603323	苏农银行	105,880	409,755.60	0.01
256	688292	浩瀚深度	21,700	403,620.00	0.01
257	688551	科威尔	5,700	400,539.00	0.01
258	603678	火炬电子	4,800	398,400.00	0.01
259	601186	中国铁建	66,900	398,055.00	0.01
260	688220	翱捷科技	3,200	397,824.00	0.01
261	688301	奕瑞科技	3,200	396,800.00	0.01
262	688686	奥普特	2,300	387,297.00	0.01
263	002271	东方雨虹	32,600	386,962.00	0.01
264	600685	中船防务	15,200	386,688.00	0.01
265	301251	威尔高	7,200	383,616.00	0.01
266	300672	国科微	1,300	383,500.00	0.01
267	300531	优博讯	24,700	374,205.00	0.01
268	688609	九联科技	33,100	364,431.00	0.01
269	301085	亚康股份	5,900	357,599.00	0.01
270	002446	盛路通信	33,100	355,494.00	0.01
271	605117	德业股份	3,300	350,394.00	0.01
272	002151	北斗星通	11,000	349,250.00	0.01
273	688283	坤恒顺维	10,400	344,344.00	0.01
274	000034	神州数码	12,400	344,100.00	0.01
275	002902	铭普光磁	11,600	344,056.00	0.01
276	688519	南亚新材	900	342,036.00	0.01
277	688499	利元亨	6,500	341,575.00	0.01
278	002792	通宇通讯	9,600	341,472.00	0.01
279	300127	银河磁体	11,900	332,605.00	0.01
280	300818	耐普矿机	16,850	318,465.00	0.01

281	002396	星网锐捷	16,470	315,729.90	0.01
282	300762	上海瀚讯	6,900	314,985.00	0.01
283	300033	同花顺	1,300	313,300.00	0.01
284	301369	联动科技	1,265	309,925.00	0.01
285	002222	福晶科技	3,300	304,524.00	0.01
286	688035	德邦科技	3,300	302,940.00	0.01
287	688150	莱特光电	4,400	301,928.00	0.01
288	000810	创维数字	22,200	294,150.00	0.01
289	688205	德科立	1,400	291,466.00	0.01
290	688147	微导纳米	1,800	291,384.00	0.01
291	300153	科泰电源	12,800	289,536.00	0.01
292	688063	派能科技	5,400	287,658.00	0.01
293	603889	新澳股份	56,090	286,619.90	0.01
294	688778	厦钨新能	5,200	282,880.00	0.01
295	301002	崧盛股份	7,300	281,780.00	0.01
296	688258	卓易信息	2,300	272,642.00	0.01
297	600929	雪天盐业	59,400	269,676.00	0.01
298	301468	博盈特焊	6,450	269,029.50	0.01
299	002475	立讯精密	3,800	267,520.00	0.01
300	301217	铜冠铜箔	1,600	264,112.00	0.01
301	603527	众源新材	22,000	262,240.00	0.01
302	688010	福光股份	5,100	248,013.00	0.01
303	301600	慧翰股份	2,700	246,780.00	0.01
304	002465	海格通信	19,100	243,907.00	0.01
305	603236	移远通信	4,680	239,475.60	0.01
306	002236	大华股份	14,300	235,807.00	0.01
307	002849	威星智能	13,600	230,112.00	0.01
308	000960	锡业股份	5,000	213,450.00	0.01
309	605118	力鼎光电	6,100	212,829.00	0.01
310	688291	金橙子	3,500	204,680.00	0.01
311	688480	赛恩斯	2,300	201,457.00	0.01
312	600742	富维股份	27,800	201,272.00	0.01
313	600919	江苏银行	18,500	199,430.00	0.01
314	688449	联芸科技	2,300	198,513.00	0.01
315	603556	海兴电力	9,000	198,000.00	0.01
316	300750	宁德时代	500	196,505.00	0.01
317	300136	信维通信	1,600	190,800.00	0.01
318	688153	唯捷创芯	5,900	189,508.00	0.01
319	300557	理工光科	5,450	187,643.50	0.01
320	300638	广和通	10,000	185,100.00	0.01
321	002975	博杰股份	1,300	184,600.00	0.01
322	600711	盛屯矿业	16,500	181,005.00	0.01
323	688433	华曙高科	2,100	179,760.00	0.01

324	002518	科士达	3,300	176,847.00	0.01
325	688515	裕太微	700	174,132.00	0.01
326	301607	富特科技	3,300	172,425.00	0.01
327	300751	迈为股份	600	169,476.00	0.01
328	688112	鼎阳科技	2,300	168,958.00	0.01
329	688275	万润新能	1,300	165,815.00	0.01
330	600795	国电电力	35,300	164,851.00	0.01
331	300139	晓程科技	4,500	164,475.00	0.01
332	688418	震有科技	3,400	163,472.00	0.01
333	301117	佳缘科技	6,960	162,516.00	0.00
334	002736	国信证券	16,000	159,840.00	0.00
335	300399	天利科技	8,300	158,364.00	0.00
336	000426	兴业银锡	4,801	158,240.96	0.00
337	002115	三维通信	15,000	154,500.00	0.00
338	688001	华兴源创	1,800	154,260.00	0.00
339	002534	西子洁能	8,300	153,965.00	0.00
340	300933	中辰股份	25,100	152,608.00	0.00
341	301662	宏工科技	1,500	151,980.00	0.00
342	688691	灿芯股份	1,300	150,709.00	0.00
343	300184	力源信息	8,500	149,175.00	0.00
344	002532	天山铝业	13,700	147,001.00	0.00
345	300656	民德电子	3,800	144,742.00	0.00
346	600973	宝胜股份	20,100	142,509.00	0.00
347	688733	壹石通	3,400	140,590.00	0.00
348	002812	恩捷股份	2,100	140,511.00	0.00
349	300693	盛弘股份	2,800	136,500.00	0.00
350	000338	潍柴动力	5,000	136,250.00	0.00
351	300496	中科创达	2,200	135,938.00	0.00
352	688084	晶品特装	2,600	130,728.00	0.00
353	603712	七一二	10,100	130,189.00	0.00
354	002056	横店东磁	4,200	128,016.00	0.00
355	603516	淳中科技	900	121,149.00	0.00
356	000510	新金路	4,800	119,232.00	0.00
357	688702	盛科通信	300	116,997.00	0.00
358	301626	苏州天脉	300	115,188.00	0.00
359	601126	四方股份	1,800	113,760.00	0.00
360	300634	彩讯股份	5,800	113,506.00	0.00
361	301321	翰博高新	2,500	110,375.00	0.00
362	002636	金安国纪	900	107,973.00	0.00
363	300066	三川智慧	19,100	106,578.00	0.00
364	300756	金马游乐	3,200	105,760.00	0.00
365	002943	宇晶股份	2,390	105,709.70	0.00
366	002560	通达股份	14,140	105,201.60	0.00

367	603659	璞泰来	3,600	104,148.00	0.00
368	688223	晶科能源	21,700	103,075.00	0.00
369	301128	强瑞技术	660	102,894.00	0.00
370	600704	物产中大	21,700	102,424.00	0.00
371	300711	广哈通信	6,200	101,680.00	0.00
372	002488	金固股份	11,400	101,574.00	0.00
373	688048	长光华芯	200	100,400.00	0.00
374	603688	石英股份	1,200	99,132.00	0.00
375	600496	精工钢构	31,900	98,890.00	0.00
376	301358	湖南裕能	1,300	98,631.00	0.00
377	300990	同飞股份	900	94,563.00	0.00
378	300843	胜蓝股份	600	93,750.00	0.00
379	688349	三一重能	6,110	92,749.80	0.00
380	601211	国泰海通	5,000	91,000.00	0.00
381	002169	智光电气	6,200	90,768.00	0.00
382	601696	中银证券	7,000	88,550.00	0.00
383	688037	芯源微	200	87,810.00	0.00
384	688148	芳源股份	10,100	86,658.00	0.00
385	300563	神宇股份	3,000	85,170.00	0.00
386	601208	东材科技	1,200	84,948.00	0.00
387	688183	生益电子	600	79,440.00	0.00
388	301153	中科江南	4,800	78,192.00	0.00
389	002911	佛燃能源	8,100	76,869.00	0.00
390	300619	金银河	2,470	76,841.70	0.00
391	601166	兴业银行	4,600	76,176.00	0.00
392	300726	宏达电子	900	76,113.00	0.00
393	688312	燕麦科技	900	75,591.00	0.00
394	603386	骏亚科技	3,800	74,974.00	0.00
395	001287	中电港	2,400	74,760.00	0.00
396	300299	富春股份	15,200	74,480.00	0.00
397	301366	一博科技	1,200	73,404.00	0.00
398	301182	凯旺科技	700	72,289.00	0.00
399	002039	黔源电力	3,800	71,516.00	0.00
400	688120	华海清科	220	70,879.60	0.00
401	600233	圆通速递	4,500	70,875.00	0.00
402	000555	神州信息	6,800	70,040.00	0.00
403	300277	汽轮科技	4,600	69,184.00	0.00
404	688229	博睿数据	900	69,030.00	0.00
405	600166	福田汽车	23,700	68,967.00	0.00
406	300322	硕贝德	2,700	68,040.00	0.00
407	688279	峰岬科技	300	67,332.00	0.00
408	301338	凯格精机	400	65,156.00	0.00
409	688080	映翰通	1,500	64,875.00	0.00

410	001267	汇绿生态	1,200	64,200.00	0.00
411	688365	光云科技	4,000	63,080.00	0.00
412	000807	云铝股份	2,800	61,992.00	0.00
413	688330	宏力达	1,800	60,894.00	0.00
414	000970	中科三环	4,000	60,760.00	0.00
415	300304	云意电气	3,400	60,690.00	0.00
416	688720	艾森股份	600	60,600.00	0.00
417	601336	新华保险	1,000	59,660.00	0.00
418	300389	艾比森	4,600	58,972.00	0.00
419	002202	金风科技	2,400	57,360.00	0.00
420	603296	华勤技术	760	56,445.20	0.00
421	002255	海陆重工	5,700	55,974.00	0.00
422	603039	泛微网络	1,480	53,383.60	0.00
423	300748	金力永磁	1,700	52,445.00	0.00
424	601899	紫金矿业	1,900	47,766.00	0.00
425	688176	亚虹医药	4,800	47,616.00	0.00
426	000612	焦作万方	4,200	44,478.00	0.00
427	002049	紫光国微	500	44,375.00	0.00
428	300369	绿盟科技	8,100	44,064.00	0.00
429	301110	青木科技	1,100	41,646.00	0.00
430	002497	雅化集团	2,000	40,740.00	0.00
431	300720	海川智能	400	38,480.00	0.00
432	600410	华胜天成	2,400	37,992.00	0.00
433	688629	华丰科技	200	37,502.00	0.00
434	300724	捷佳伟创	500	35,300.00	0.00
435	688125	安达智能	200	32,700.00	0.00
436	601918	新集能源	3,800	32,642.00	0.00
437	688280	精进电动	5,900	32,391.00	0.00
438	688767	博拓生物	900	29,259.00	0.00
439	300206	理邦仪器	2,300	28,129.00	0.00
440	300700	岱勒新材	1,300	27,664.00	0.00
441	300579	数字认证	1,300	26,910.00	0.00
442	002829	星网宇达	1,500	26,340.00	0.00
443	300606	金太阳	600	25,536.00	0.00
444	300810	中科海讯	1,000	25,380.00	0.00
445	002511	中顺洁柔	3,600	23,940.00	0.00
446	688231	隆达股份	650	23,874.50	0.00
447	600031	三一重工	1,300	22,464.00	0.00
448	688455	科捷智能	1,200	22,392.00	0.00
449	300667	必创科技	1,300	22,165.00	0.00
450	002405	四维图新	3,200	20,704.00	0.00
451	300170	汉得信息	1,300	19,812.00	0.00
452	688309	恒誉科技	300	18,264.00	0.00

453	601600	中国铝业	2,100	17,262.00	0.00
454	000547	航天发展	900	17,235.00	0.00
455	688135	利扬芯片	400	16,832.00	0.00
456	300802	矩子科技	700	16,226.00	0.00
457	300061	旗天科技	2,300	16,077.00	0.00
458	603031	安孚科技	300	15,975.00	0.00
459	300735	光弘科技	700	15,918.00	0.00
460	600266	城建发展	3,800	14,858.00	0.00
461	600361	创新新材	4,000	14,400.00	0.00
462	601375	中原证券	3,600	14,364.00	0.00
463	600803	新奥股份	900	14,220.00	0.00
464	002362	汉王科技	900	13,995.00	0.00
465	688171	纬德信息	300	13,188.00	0.00
466	300945	曼卡龙	1,100	11,913.00	0.00
467	300333	兆日科技	1,400	11,844.00	0.00
468	601128	常熟银行	2,000	11,640.00	0.00
469	300499	高澜股份	300	11,610.00	0.00
469	301066	万事利	1,000	11,610.00	0.00
470	301101	明月镜片	400	10,896.00	0.00
471	600879	航天电子	500	10,645.00	0.00
472	300602	飞荣达	200	10,240.00	0.00
473	002483	润邦股份	2,060	10,176.40	0.00
474	603486	科沃斯	200	10,150.00	0.00
475	002440	闰土股份	900	9,225.00	0.00
476	002189	中光学	400	8,944.00	0.00
477	300520	科大国创	300	8,082.00	0.00
478	002298	中电鑫龙	1,000	7,620.00	0.00
479	300378	鼎捷数智	200	7,220.00	0.00
480	688088	虹软科技	200	7,110.00	0.00
481	301137	哈焊华通	200	6,872.00	0.00
482	000688	国城矿业	200	6,846.00	0.00
483	002838	道恩股份	200	6,124.00	0.00
484	300759	康龙化成	200	5,786.00	0.00
485	002272	川润股份	200	4,906.00	0.00
486	603786	科博达	100	4,091.00	0.00
487	300652	雷迪克	100	3,351.00	0.00
488	301060	兰卫医学	400	3,268.00	0.00
489	600061	国投资本	200	1,310.00	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	300308	中际旭创	7,814,869.00	9.94

2	300475	香农芯创	7,357,048.00	9.35
3	300502	新易盛	7,264,216.16	9.24
4	002384	东山精密	6,775,856.00	8.61
5	002460	赣锋锂业	6,744,555.00	8.57
6	300394	天孚通信	6,732,832.00	8.56
7	600105	永鼎股份	6,577,883.00	8.36
8	001309	德明利	6,536,042.00	8.31
9	300548	长芯博创	6,506,401.00	8.27
10	688525	佰维存储	6,381,114.60	8.11
11	002466	天齐锂业	6,325,660.00	8.04
12	603083	剑桥科技	6,274,742.00	7.98
13	002916	深南电路	6,121,022.00	7.78
14	600183	生益科技	6,016,985.00	7.65
15	688559	海目星	5,982,811.90	7.61
16	002240	盛新锂能	5,941,737.87	7.55
17	600015	华夏银行	5,728,514.00	7.28
18	688498	源杰科技	5,679,662.66	7.22
19	301219	腾远钴业	5,646,229.40	7.18
20	688002	睿创微纳	5,626,943.87	7.15
21	300490	华自科技	5,549,882.00	7.06
22	300236	上海新阳	5,534,285.00	7.04
23	688416	恒烁股份	5,274,449.10	6.71
24	601077	渝农商行	5,271,721.00	6.70
25	600502	安徽建工	5,211,843.00	6.63
26	688045	必易微	5,184,226.15	6.59
27	601225	陕西煤业	5,057,306.00	6.43
28	002758	浙农股份	4,990,470.00	6.34
29	301099	雅创电子	4,989,368.00	6.34
30	300975	商络电子	4,876,858.00	6.20
31	688630	芯碁微装	4,858,761.25	6.18
32	300857	协创数据	4,846,329.00	6.16
33	688313	仕佳光子	4,750,059.52	6.04
34	600489	中金黄金	4,636,914.00	5.90
35	300223	君正股份	4,573,889.00	5.82
36	300476	胜宏科技	4,460,795.00	5.67
37	300073	当升科技	4,373,913.00	5.56
38	002463	沪电股份	4,285,702.37	5.45
39	600971	恒源煤电	4,265,066.00	5.42
40	301191	菲菱科思	4,241,965.00	5.39
41	300480	光力科技	4,216,452.00	5.36
42	688025	杰普特	4,206,607.00	5.35
43	688257	新锐股份	4,183,649.92	5.32
44	600801	华新建材	4,008,216.00	5.10

45	300861	美畅股份	3,963,644.00	5.04
46	603126	中材节能	3,935,261.00	5.00
47	601009	南京银行	3,932,554.00	5.00
48	603799	华友钴业	3,910,228.00	4.97
49	301086	鸿富瀚	3,875,057.00	4.93
50	300842	帝科股份	3,801,569.00	4.83
51	002281	光迅科技	3,768,407.00	4.79
52	300418	昆仑万维	3,687,469.00	4.69
53	300590	移为通信	3,647,786.00	4.64
54	300769	德方纳米	3,646,421.00	4.64
55	603986	兆易创新	3,635,333.00	4.62
56	002414	高德红外	3,600,734.00	4.58
57	688170	德龙激光	3,533,253.21	4.49
58	301377	鼎泰高科	3,504,371.80	4.46
59	601869	长飞光纤	3,447,389.00	4.38
60	301308	江波龙	3,442,866.00	4.38
61	301589	诺瓦星云	3,355,497.00	4.27
62	300042	朗科科技	3,302,295.00	4.20
63	002028	思源电气	3,250,210.00	4.13
64	002353	杰瑞股份	3,203,403.00	4.07
65	688031	星环科技	3,084,009.89	3.92
66	688627	精智达	3,061,976.00	3.89
67	688556	高测股份	3,022,275.55	3.84
68	600487	亨通光电	2,977,476.00	3.79
69	002582	好想你	2,976,331.00	3.78
70	300882	万胜智能	2,951,610.00	3.75
71	300811	铂科新材	2,946,272.00	3.75
72	000603	盛达资源	2,945,213.00	3.74
73	601138	工业富联	2,944,252.00	3.74
74	600549	厦门钨业	2,933,826.00	3.73
75	300620	光库科技	2,932,259.00	3.73
76	300745	欣锐科技	2,879,583.00	3.66
77	002415	海康威视	2,793,060.00	3.55
78	688167	炬光科技	2,781,666.89	3.54
79	300442	润泽科技	2,772,920.00	3.53
80	300731	科创新源	2,768,735.00	3.52
81	002008	大族激光	2,664,209.00	3.39
82	600710	苏美达	2,650,000.00	3.37
83	300604	长川科技	2,622,848.00	3.33
84	688668	鼎通科技	2,617,086.74	3.33
85	688337	普源精电	2,580,746.43	3.28
86	000630	铜陵有色	2,572,744.00	3.27
87	002080	中材科技	2,469,171.00	3.14

88	600875	东方电气	2,392,136.00	3.04
89	603444	吉比特	2,322,939.00	2.95
90	300408	三环集团	2,311,448.00	2.94
91	002948	青岛银行	2,284,524.00	2.90
92	605060	联德股份	2,226,607.00	2.83
93	688700	东威科技	2,221,690.61	2.82
94	605599	菜百股份	2,189,102.00	2.78
95	600176	中国巨石	2,181,743.00	2.77
96	688779	五矿新能	2,120,483.28	2.70
97	002805	丰元股份	2,071,157.00	2.63
98	688503	聚和材料	2,047,380.90	2.60
99	002154	报喜鸟	2,045,635.00	2.60
100	688072	拓荆科技	2,043,999.00	2.60
101	601677	明泰铝业	2,043,787.00	2.60
102	001389	广合科技	2,043,615.00	2.60
103	601187	厦门银行	2,034,883.00	2.59
104	600323	瀚蓝环境	2,024,866.00	2.57
105	603998	方盛制药	2,020,703.00	2.57
106	000983	山西焦煤	2,016,958.00	2.56
107	603019	中科曙光	1,994,060.00	2.54
108	000001	平安银行	1,990,770.00	2.53
109	688261	东微半导	1,984,106.21	2.52
110	603993	洛阳钼业	1,971,417.00	2.51
111	601800	中国交建	1,967,364.41	2.50
112	002557	洽洽食品	1,960,897.00	2.49
113	688378	奥来德	1,951,568.28	2.48
114	300856	科思股份	1,950,872.00	2.48
115	300429	强力新材	1,929,159.00	2.45
116	688182	灿勤科技	1,926,336.88	2.45
117	605399	晨光新材	1,922,440.00	2.44
118	600601	方正科技	1,917,704.00	2.44
119	688610	埃科光电	1,890,828.00	2.40
120	688311	盟升电子	1,879,420.31	2.39
121	002284	亚太股份	1,868,493.00	2.38
122	688522	纳睿雷达	1,840,322.14	2.34
123	301169	零点有数	1,836,306.00	2.33
124	688256	寒武纪	1,807,122.80	2.30
125	688512	慧智微	1,800,407.79	2.29
126	600026	中远海能	1,767,859.00	2.25
127	300252	金信诺	1,758,369.00	2.24
128	601998	中信银行	1,752,806.00	2.23
129	688766	普冉股份	1,749,598.00	2.22
130	002738	中矿资源	1,732,828.00	2.20

131	603256	宏和科技	1,719,998.00	2.19
132	600775	南京熊猫	1,694,115.00	2.15
133	601666	平煤股份	1,686,559.00	2.14
134	000426	兴业银锡	1,676,854.54	2.13
135	301215	中汽股份	1,668,802.00	2.12
136	000988	华工科技	1,667,675.00	2.12
137	601997	贵阳银行	1,665,014.00	2.12
138	002379	宏桥控股	1,657,922.00	2.11
139	002491	通鼎互联	1,653,941.00	2.10
140	002345	潮宏基	1,649,180.00	2.10
141	301165	锐捷网络	1,639,083.00	2.08
142	688183	生益电子	1,638,611.02	2.08
143	688531	日联科技	1,626,163.91	2.07
144	301510	固高科技	1,621,975.00	2.06
145	300491	通合科技	1,595,818.00	2.03
146	688390	固德威	1,589,114.93	2.02
147	002142	宁波银行	1,587,163.00	2.02
148	688012	中微公司	1,584,786.00	2.01

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	300502	新易盛	5,629,224.00	7.16
2	300975	商络电子	5,372,702.00	6.83
3	001309	德明利	5,288,733.00	6.72
4	600183	生益科技	5,200,216.00	6.61
5	603083	剑桥科技	4,974,888.00	6.32
6	300475	香农芯创	4,231,039.00	5.38
7	688525	佰维存储	4,094,741.36	5.21
8	301099	雅创电子	3,899,476.00	4.96
9	300394	天孚通信	3,620,591.00	4.60
10	688416	恒烁股份	3,224,722.30	4.10
11	002463	沪电股份	3,173,126.00	4.03
12	301308	江波龙	3,136,710.00	3.99
13	688498	源杰科技	3,082,386.53	3.92
14	300308	中际旭创	3,020,515.00	3.84
15	688045	必易微	2,906,061.68	3.69
16	300548	长芯博创	2,836,214.00	3.61
17	688313	仕佳光子	2,641,289.30	3.36
18	300620	光库科技	2,059,495.00	2.62
19	300042	朗科科技	2,045,516.00	2.60
20	603986	兆易创新	2,029,807.00	2.58
21	002028	思源电气	2,020,686.00	2.57

22	300476	胜宏科技	1,967,072.00	2.50
23	688630	芯碁微装	1,959,496.00	2.49
24	688183	生益电子	1,901,950.16	2.42
25	688167	炬光科技	1,886,999.00	2.40
26	002384	东山精密	1,817,871.00	2.31
27	301086	鸿富瀚	1,800,191.00	2.29
28	688072	拓荆科技	1,756,988.60	2.23
29	688512	慧智微	1,742,692.24	2.22
30	300480	光力科技	1,737,444.00	2.21
31	002240	盛新锂能	1,664,496.00	2.12
32	688170	德龙激光	1,615,281.00	2.05
33	600601	方正科技	1,605,769.00	2.04

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	692,043,687.88
卖出股票收入（成交）总额	267,600,625.50

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	102,378,907.63	3.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,123,128,614.82	65.13
	其中：政策性金融债	815,270,117.83	25.01
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	542,972,473.97	16.66
7	可转债（可交换债）	231,319,941.32	7.10
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,999,799,937.74	92.02

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	232680007	26 兴业银行二级资本债 01	1,200,000	120,856,464.66	3.71
2	250405	25 农发 05	1,000,000	100,391,232.88	3.08
3	232380089	23 中信银行二	900,000	94,928,764.93	2.91

		级资本债 01A			
4	232480033	24 建行二级资本债 02A	800,000	83,027,274.52	2.55
5	232680005	26 农行二级资本债 01A(BC)	800,000	80,628,712.33	2.47

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。

7.10.2 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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，中国农业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，中国建设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和中国人民银行的处罚，中国农业发展银行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，兴业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，中国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，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局北京市分局和中国人民银行的处罚，中信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、国家金融监督管理总局云南监管局和中国人民银行的处罚，本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 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。

7.11.3 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	110,761.38
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	23,000,770.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,111,532.11

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123107	温氏转债	5,064,826.14	0.16
2	127034	绿茵转债	4,443,437.70	0.14
3	123183	海顺转债	4,437,639.77	0.14
4	123188	水羊转债	4,373,969.65	0.13
5	113649	丰山转债	4,272,440.85	0.13
6	110095	双良转债	4,212,913.62	0.13
7	123216	科顺转债	4,097,733.05	0.13
8	123178	花园转债	4,047,484.54	0.12
9	113056	重银转债	3,813,024.80	0.12
10	113042	上银转债	3,785,801.39	0.12
11	127040	国泰转债	3,749,290.17	0.12
12	113691	和邦转债	3,740,573.66	0.11
13	113658	密卫转债	3,635,232.82	0.11
14	113636	甬金转债	3,471,755.51	0.11
15	113659	莱克转债	3,354,674.07	0.10
16	110098	南药转债	3,317,337.03	0.10
17	127067	恒逸转 2	3,272,708.14	0.10
18	127103	东南转债	3,243,707.39	0.10
19	128142	新乳转债	3,091,115.79	0.09
20	123092	天壕转债	2,998,032.01	0.09
21	113661	福 22 转债	2,992,173.85	0.09
22	127031	洋丰转债	2,967,352.54	0.09
23	127108	太能转债	2,810,029.64	0.09
24	113046	金田转债	2,758,355.06	0.08
25	118024	冠宇转债	2,594,341.00	0.08

26	127030	盛虹转债	2,533,691.31	0.08
27	123196	正元转 02	2,441,030.24	0.07
28	113067	燃 23 转债	2,399,615.37	0.07
29	113694	清源转债	2,309,382.19	0.07
30	111002	特纸转债	2,289,582.39	0.07
31	127045	牧原转债	2,243,899.63	0.07
32	127099	盛航转债	2,234,822.62	0.07
33	123172	漱玉转债	2,225,066.68	0.07
34	113052	兴业转债	2,224,644.16	0.07
35	123150	九强转债	2,222,915.20	0.07
36	127084	柳工转 2	2,202,839.98	0.07
37	127105	龙星转债	2,194,377.75	0.07
38	113062	常银转债	2,191,163.18	0.07
39	111004	明新转债	2,190,816.56	0.07
40	127082	亚科转债	2,182,485.23	0.07
41	123109	昌红转债	2,083,780.70	0.06
42	127054	双箭转债	2,064,467.94	0.06
43	118031	天 23 转债	2,056,606.19	0.06
44	110099	福能转债	2,055,813.38	0.06
45	113650	博 22 转债	2,049,013.20	0.06
46	118034	晶能转债	2,048,882.88	0.06
47	127110	广核转债	1,993,226.42	0.06
48	123155	中陆转债	1,988,790.53	0.06
49	111015	东亚转债	1,937,502.48	0.06
50	113049	长汽转债	1,881,063.28	0.06
51	113054	绿动转债	1,859,445.66	0.06
52	113665	汇通转债	1,813,356.11	0.06
53	123112	万讯转债	1,793,175.12	0.06
54	127059	永东转 2	1,735,215.66	0.05
55	113648	巨星转债	1,717,112.00	0.05
56	110090	爱迪转债	1,697,788.33	0.05
57	110097	天润转债	1,694,930.37	0.05
58	113624	正川转债	1,679,052.83	0.05
59	127050	麒麟转债	1,677,669.83	0.05
60	113070	渝水转债	1,670,084.54	0.05
61	123237	佳禾转债	1,661,059.79	0.05
62	123225	翔丰转债	1,653,085.15	0.05
63	113680	丽岛转债	1,620,467.72	0.05
64	113695	华辰转债	1,578,230.22	0.05
65	123213	天源转债	1,576,950.20	0.05
66	113634	珀莱转债	1,564,534.45	0.05
67	127062	垒知转债	1,555,015.75	0.05
68	113631	皖天转债	1,554,073.07	0.05

69	123243	严牌转债	1,554,015.61	0.05
70	111017	蓝天转债	1,546,962.91	0.05
71	113058	友发转债	1,534,240.32	0.05
72	113688	国检转债	1,530,712.14	0.05
73	113048	晶科转债	1,519,477.84	0.05
74	110093	神马转债	1,508,718.29	0.05
75	113673	岱美转债	1,306,432.67	0.04
76	123122	富瀚转债	1,298,762.86	0.04
77	118012	微芯转债	1,277,296.76	0.04
78	123133	佩蒂转债	1,275,795.53	0.04
79	118015	芯海转债	1,258,270.29	0.04
80	123119	康泰转 2	1,241,342.83	0.04
81	127078	优彩转债	1,236,199.80	0.04
82	123223	九典转 02	1,227,833.55	0.04
83	113627	太平转债	1,227,030.99	0.04
84	123151	康医转债	1,226,411.90	0.04
85	123193	海能转债	1,218,460.72	0.04
86	118052	浩瀚转债	1,215,203.17	0.04
87	113679	芯能转债	1,213,794.12	0.04
88	127046	百润转债	1,210,907.39	0.04
89	123168	惠云转债	1,199,495.02	0.04
90	127098	欧晶转债	1,165,554.74	0.04
91	123247	万凯转债	1,152,919.50	0.04
92	127049	希望转 2	993,645.63	0.03
93	113647	禾丰转债	975,547.23	0.03
94	127056	中特转债	969,097.83	0.03
95	127060	湘佳转债	836,023.32	0.03
96	118042	奥维转债	801,229.56	0.02
97	127064	杭氧转债	703,578.15	0.02
98	127095	广泰转债	702,586.39	0.02
99	123165	回天转债	689,830.52	0.02
100	113043	财通转债	688,664.52	0.02
101	110075	南航转债	649,337.23	0.02
102	127025	冀东转债	648,914.65	0.02
103	123071	天能转债	648,792.82	0.02
104	110076	华海转债	647,841.70	0.02
105	113652	伟 22 转债	645,526.61	0.02
106	123090	三诺转债	644,899.07	0.02
107	113655	欧 22 转债	642,647.12	0.02
108	113605	大参转债	642,211.04	0.02
109	113640	苏利转债	640,605.01	0.02
110	127027	能化转债	640,261.71	0.02
111	123241	欧通转债	638,518.66	0.02

112	123088	威唐转债	634,228.48	0.02
113	110086	精工转债	624,199.71	0.02
114	128134	鸿路转债	521,188.02	0.02
115	123104	卫宁转债	518,678.06	0.02
116	113616	韦尔转债	510,923.86	0.02
117	127089	晶澳转债	506,373.22	0.02
118	113698	凯众转债	460,920.92	0.01
119	113696	伯 25 转债	460,200.00	0.01
120	123253	永贵转债	454,662.25	0.01
121	113692	保隆转债	452,332.21	0.01
122	113671	武进转债	448,539.18	0.01
123	118053	正帆转债	389,901.48	0.01
124	111000	起帆转债	368,005.50	0.01
125	118036	力合转债	360,205.74	0.01
126	113667	春 23 转债	358,539.43	0.01
127	118044	赛特转债	342,087.51	0.01
128	123224	宇邦转债	341,860.47	0.01
129	127044	蒙娜转债	341,622.77	0.01
130	127104	姚记转债	341,229.95	0.01
131	110087	天业转债	339,781.45	0.01
132	111014	李子转债	338,641.63	0.01
133	110085	通 22 转债	338,092.14	0.01
134	113053	隆 22 转债	337,026.72	0.01
135	123215	铭利转债	140,069.15	0.00
136	127102	浙建转债	139,803.13	0.00
137	111018	华康转债	138,390.59	0.00
138	123113	仙乐转债	137,811.20	0.00
139	123117	健帆转债	137,741.63	0.00

7.11.5 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。

7.11.6 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。

§ 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	户均持有的基 金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
万家瑞家 债券 A	2,795	513,452.41	860,734,730.06	59.98	574,364,742.88	40.02
万家瑞家 债券 C	11,442	26,922.20	93,303,906.04	30.29	214,739,911.69	69.71
万家瑞家 债券 D	102	7,694,701.86	783,112,229.14	99.78	1,747,360.41	0.22
合计	14,286	176,956.66	1,737,150,865.24	68.72	790,852,014.98	31.28

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	万家瑞家债券 A	331,711.62	0.0231
	万家瑞家债券 C	83.12	0.0000
	万家瑞家债券 D	2,609.37	0.0003
	合计	334,404.11	0.0132

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	万家瑞家债券 A	10~50
	万家瑞家债券 C	0
	万家瑞家债券 D	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	万家瑞家债券 A	10~50
	万家瑞家债券 C	0
	万家瑞家债券 D	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家瑞家债券 A	万家瑞家债券 C	万家瑞家债券 D
----	----------	----------	----------

基金合同生效日（2017 年 9 月 20 日）基金份额总额	203,920,067.29	83,001,758.16	—
本报告期期初基金份额总额	38,445,840.18	27,978,433.71	—
本报告期基金总申购份额	1,978,264,659.16	429,720,396.20	830,020,783.62
减：本报告期基金总赎回份额	581,611,026.40	149,655,012.18	45,161,194.07
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—
本报告期期末基金份额总额	1,435,099,472.94	308,043,817.73	784,859,589.55

§ 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、本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

本报告期内托管人无受调查或处罚等情况。

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 (%)	
东方财富证券	2	454,814,619.71	47.39	202,802.61	47.39	-
国信证券	2	253,415,901.53	26.41	112,999.55	26.41	-
招商证券	1	251,413,792.14	26.20	112,107.30	26.20	-
财通证券	3	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
国元证券	3	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华源证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-

湘财证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-

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、基金专用交易席位的变更情况：
无。

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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)

东方财 富证券	331,856,666 .59	49.06	372,083,000. 00	100.00	-	-
国信证 券	160,581,286 .88	23.74	-	-	-	-
招商证 券	184,001,579 .58	27.20	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
第一创 业证券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
东亚前 海证券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国元证 券	-	-	-	-	-	-
华宝证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
华源证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
银泰证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-

中信建投	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

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	万家瑞瑞债券型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	指定媒介	2026 年 1 月 21 日
2	万家基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	指定媒介	2026 年 1 月 21 日
3	万家基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	指定媒介	2026 年 3 月 30 日
4	万家瑞瑞债券型证券投资基金 2025 年年度报告	指定媒介	2026 年 3 月 30 日
5	万家瑞瑞债券型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	指定媒介	2026 年 4 月 10 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基金产品资料概要的提示性公告	指定媒介	2026 年 4 月 10 日
7	万家瑞瑞债券型证券投资基金基金合同（更新）	指定媒介	2026 年 4 月 10 日
8	关于万家瑞瑞债券型证券投资基金增设 D 类基金份额并修改基金合同与托管协议的公告	指定媒介	2026 年 4 月 10 日
9	万家瑞瑞债券型证券投资基金更新招募说明书（2026 年第 1 号）	指定媒介	2026 年 4 月 10 日
10	万家瑞瑞债券型证券投资基金托管协议（更新）	指定媒介	2026 年 4 月 10 日
11	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
12	万家瑞瑞债券型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	指定媒介	2026 年 4 月 21 日
13	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
14	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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		超过 20%的时间区间					(%)
机构	1	20260101-20260423	23,403,474.33	-	-	23,403,474.33	0.93
	2	20260424-20260506	-	39,688,760.12	-	39,688,760.12	1.57
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。							

§ 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、《万家瑞瑞债券型证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家瑞瑞债券型证券投资基金托管协议》。
- 4、万家瑞瑞债券型证券投资基金 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