

万家启源稳健三个月持有期混合型发起式  
基金中基金（FOF）  
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：平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安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

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <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              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 12        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 13        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 13        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 14        |
| 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       | 14        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>14</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 14        |
| 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 | 14        |
| 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       | 14        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>14</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 14        |
| 6.2 利润表                                 | 16        |
| 6.3 净资产变动表                              | 17        |
| 6.4 报表附注                                | 19        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>40</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 40        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 40        |
| 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       | 40        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 40        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 41        |
| 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      | 41        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 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 ..... | 41        |
| 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 ..... | 41        |
| 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 .....    | 41        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 41        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 41        |
| 7.12 本报告期投资基金情况 .....                       | 41        |
| 7.13 投资组合报告附注 .....                         | 50        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>51</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 51        |
| 8.2 盈利投资者数量占比 .....                         | 52        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 52        |
| 8.4 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 .....      | 52        |
| 8.5 发起式基金发起资金持有份额情况 .....                   | 52        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>53</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>53</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 53        |
| 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 .....      | 53        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 54        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 54        |
| 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....               | 54        |
| 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 54        |
| 10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....          | 54        |
| 10.8 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 .....      | 55        |
| 10.9 其他重大事件 .....                           | 56        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>56</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 .....    | 56        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>57</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 57        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 57        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 57        |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

|                     |                              |                             |                                 |
|---------------------|------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|
| 基金名称                | 万家启源稳健三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF） |                             |                                 |
| 基金简称                | 万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）       |                             |                                 |
| 基金主代码               | 022560                       |                             |                                 |
| 基金运作方式              | 契约型开放式                       |                             |                                 |
| 基金合同生效日             | 2025 年 3 月 18 日              |                             |                                 |
| 基金管理人               | 万家基金管理有限公司                   |                             |                                 |
| 基金托管人               | 平安银行股份有限公司                   |                             |                                 |
| 报告期末基金份<br>额总额      | 86,114,644.10 份              |                             |                                 |
| 基金合同存续期             | 不定期                          |                             |                                 |
| 下属分级基金的基<br>金简称     | 万家启源稳健三个月持有期<br>混合发起式（FOF）A  | 万家启源稳健三个月持有期<br>混合发起式（FOF）C | 万家启源稳健三个月持<br>有期混合发起式（FOF）<br>E |
| 下属分级基金的交<br>易代码     | 022560                       | 022561                      | 022562                          |
| 报告期末下属分级<br>基金的份额总额 | 56,611,534.77 份              | 29,503,109.33 份             | -份                              |

2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                              |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 在控制风险的前提下，通过主动的资产配置、基金优选，力争实现基金资产长期稳健增值。                                                                                                                                                                                     |
| 投资策略   | 1、大类资产配置策略；2、基金筛选策略：（1）定量分析；（2）定性分析；（3）基金评价；（4）公开募集基础设施证券投资基金投资策略；3、基金调整策略；4、股票投资策略；5、港股通标的的证券投资基金投资策略；6、债券投资策略；7、资产支持证券投资基金投资策略；8、可转换债券与可交换债券投资策略；9、其他                                                                      |
| 业绩比较基准 | 中债新综合全价（总值）指数收益率*85%+中证 800 指数收益率*15%                                                                                                                                                                                        |
| 风险收益特征 | 本基金属于混合型基金中基金（FOF），本基金长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、股票型基金中基金（FOF），高于债券型基金、债券型基金中基金（FOF）、货币市场基金和货币型基金中基金（FOF）。<br>本基金可投资于港股通标的的证券，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险、港股通 ETF 价格较大波动的风险等。 |

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   | 平安银行股份有限公司    |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 兰剑           | 潘琦            |
|             | 联系电话 | 021-38909626 | 0755-22168257 |

|        |      |                                       |                               |
|--------|------|---------------------------------------|-------------------------------|
|        | 电子邮箱 | lanj@wjasset.com                      | PANQI003@pingan.com.cn        |
| 客户服务电话 |      | 4008880800                            | 95511-3                       |
| 传真     |      | 021-38909627                          | 0755-82080387                 |
| 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）  | 广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 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 | 广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 |
| 邮政编码   |      | 200122                                | 518001                        |
| 法定代表人  |      | 陈广益                                   | 谢永林                           |

## 2.4 信息披露方式

|                   |                 |
|-------------------|-----------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称    | 《中国证券报》         |
| 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) |                         |                         |
|---------------|-------------------------------------|-------------------------|-------------------------|
|               | 万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）A             | 万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）C | 万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）E |
| 本期已实现收益       | 990,142.83                          | 660,948.66              | —                       |
| 本期利润          | 1,606,480.56                        | 1,333,505.36            | —                       |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0278                              | 0.0286                  | —                       |
| 本期加权平均净值利润率   | 2.62%                               | 2.71%                   | —                       |
| 本期基金份额        | 2.65%                               | 2.44%                   | —                       |

|                           |                       |                  |   |
|---------------------------|-----------------------|------------------|---|
| 额 净 值 增 长<br>率            |                       |                  |   |
| 3.1.2 期<br>末 数 据 和<br>指 标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日) |                  |   |
| 期末可供分<br>配利润              | 2, 852, 302. 19       | 1, 323, 850. 44  | — |
| 期末可供分<br>配基金份额<br>利润      | 0. 0504               | 0. 0449          | — |
| 期末基金资<br>产净值              | 60, 925, 335. 01      | 31, 586, 825. 32 | — |
| 期末基金份<br>额净值              | 1. 0762               | 1. 0706          | — |
| 3.1.3 累<br>计期末指<br>标      | 报告期末(2026 年 6 月 30 日) |                  |   |
| 基金份额累<br>计净值增长<br>率       | 7. 62%                | 7. 06%           | — |

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

万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）A

| 阶段    | 份额净值增<br>长率① | 份额净值增<br>长率标准差<br>② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①－③     | ②－④    |
|-------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|---------|--------|
| 过去三个月 | 2. 50%       | 0. 26%              | 2. 56%         | 0. 21%                | -0. 06% | 0. 05% |
| 过去六个月 | 2. 65%       | 0. 26%              | 2. 50%         | 0. 19%                | 0. 15%  | 0. 07% |
| 过去一年  | 6. 79%       | 0. 22%              | 4. 10%         | 0. 17%                | 2. 69%  | 0. 05% |

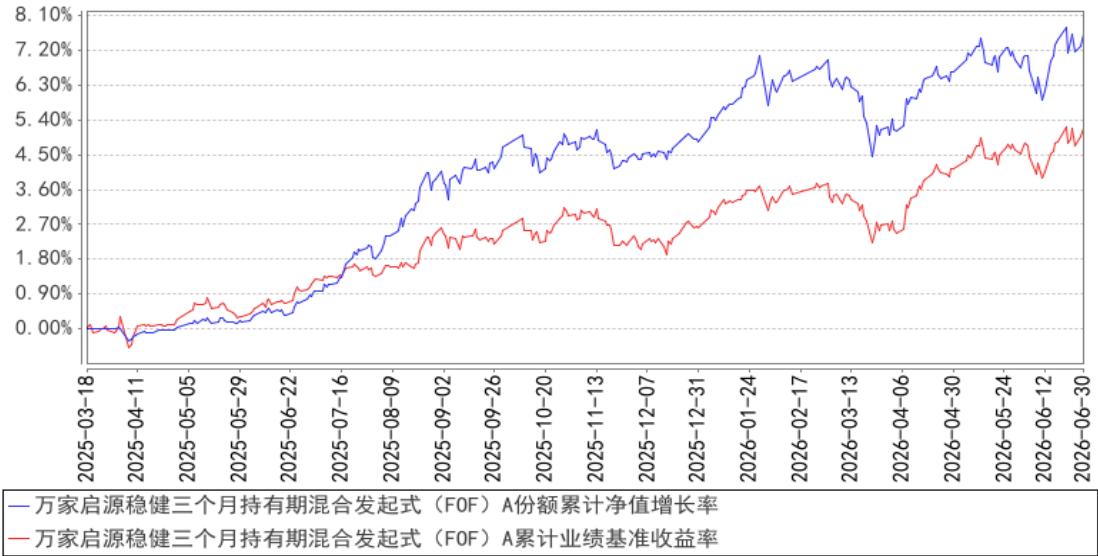
|                |       |       |       |       |       |       |
|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 自基金合同<br>生效起至今 | 7.62% | 0.19% | 5.17% | 0.16% | 2.45% | 0.03% |
|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|

万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）C

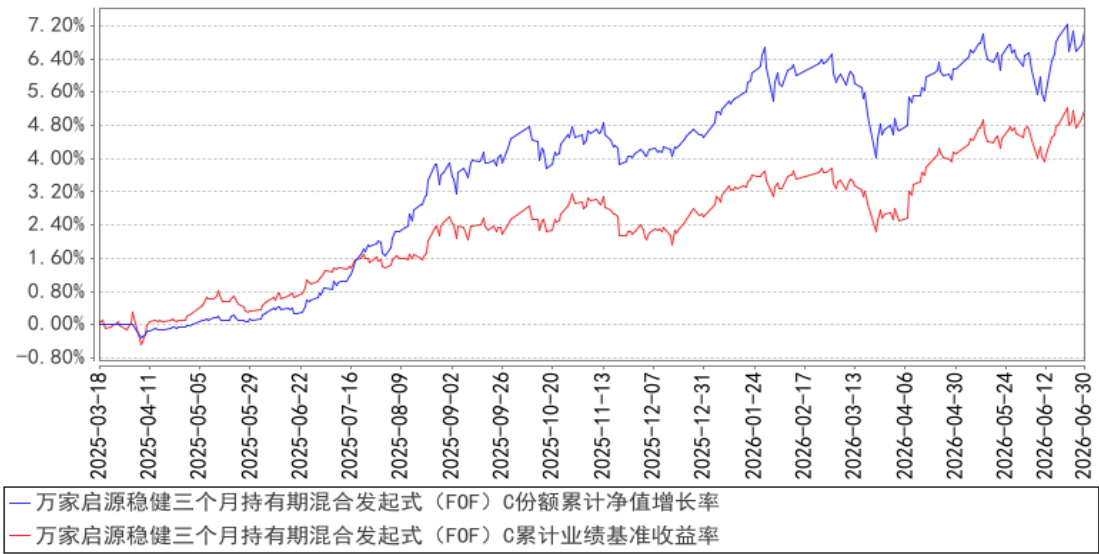
| 阶段             | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|----------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月          | 2.39%    | 0.26%       | 2.56%      | 0.21%         | -0.17% | 0.05% |
| 过去六个月          | 2.44%    | 0.26%       | 2.50%      | 0.19%         | -0.06% | 0.07% |
| 过去一年           | 6.35%    | 0.22%       | 4.10%      | 0.17%         | 2.25%  | 0.05% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 7.06%    | 0.19%       | 5.17%      | 0.16%         | 1.89%  | 0.03% |

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

万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）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



万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）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



注：本基金于 2025 年 3 月 18 日成立，根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务                          | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                  |
|----|-----------------------------|-----------------|------|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                             | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                                                                                                     |
| 任峥 | 公司领导，总经理助理；万家优选积极三个月持有期混合型发 | 2025 年 3 月 18 日 | -    | 28 年   | 国籍：中国；学历：上海财经大学国民经济学专业硕士，2023 年 8 月入职万家基金管理有限公司，现任公司总经理助理、基金经理。曾任海通证券股份有限公司客户资产管理部专务，汇添富基金管理有限公司投资理财总部高级经理，光大证券股份有限公司资产管理总部投资经理、执行董 |

|     |                                                                                                                                     |                 |   |        |                                                                                                                         |
|-----|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|---|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     | 起式基金中基金（FOF）、万家启尊价值三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、万家启泰稳健三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、万家启源稳健三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、万家聚优稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理。 |                 |   |        | 事，平安资产管理有限责任公司基金投资部投资团队负责人、执行总经理等职。                                                                                     |
| 贺嘉仪 | 万家启泰稳健三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、万家启源稳健三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、                                                                             | 2025 年 3 月 25 日 | - | 11.5 年 | 国籍：中国；学历：美国南加州大学金融工程专业硕士，2016 年 12 月入职万家基金管理有限公司，现任组合投资部基金经理、投顾主理人，历任组合投资部研究员、基金经理助理、投资经理。曾任上投摩根基金管理有限公司国际投资部绩效评估分析员等职。 |

|  |                                                                    |  |  |  |  |
|--|--------------------------------------------------------------------|--|--|--|--|
|  | 万家聚优<br>稳健养老<br>目标一年<br>持有期混<br>合型基金<br>中基金<br>（FOF）的<br>基金经<br>理。 |  |  |  |  |
|--|--------------------------------------------------------------------|--|--|--|--|

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，国内宏观经济呈现总量承压、结构 K 型分化的格局。需求端看，固定资产投资持续走弱，电子设备制造投资韧性较强，新兴动能持续发力。出口表现亮眼，高端制造产业链出口与大宗商品价格上行形成共振。消费复苏依旧疲软，社零增速持续回落。供给端看，工业增长放缓，传统制造及采矿业景气度下行，高新技术相关的制造业维持高增速。物价方面，CPI 温和修复，核心通胀小幅回暖，PPI 受上游原料涨价驱动大幅回升。

大类资产表现上，1 月和 2 月美联储主席换届及地缘冲突短暂冲击市场情绪，但降息预期仍支撑流动性，美元指数与美债利率整体下行，科技板块领涨股市，金价和油价探底回稳。3 月至 4 月中东地缘事件升级，推动油价上行，主要央行货币政策预期转向，黄金冲高回落。5 月至 6 月，高油价带来输入性通胀压力，多国央行加息，科技板块内部表现分化，油价与美元指数共振上行。A 股方面，1 月至 2 月政策预期催化下春季行情延续，3 月外部不确定性升温，大盘震荡回调。4 月以来，随着地缘局势边际缓和，市场风险偏好修复，资金高度抱团科技成长主线，金融、消费及传统周期板块持续承压，结构性虹吸行情演绎充分。

从上半年各类指数表现看，恒生指数下跌 10.73%，沪深 300 上涨 7.55%，恒生科技下跌 18.92%，中证 500 上涨 20.97%，创业板指上涨 35.58%，科创 50 上涨 64.25%，中证 1000 上涨 15.99%，中证 2000 上涨 9.10%，中证偏股型基金指数上涨 22.19%，成长风格显著跑赢价值风格。从申万一级行业看，上半年电子、通信、建筑材料、机械设备和综合表现最好，商贸零售、农林牧渔、美容护理、食品饮料和钢铁下跌最多。

2026 年上半年，债市在多重因素交织下整体呈现震荡偏强格局。年初市场对货币政策延续宽松的一致性预期较强，央行通过 MLF 增量投放、买断式逆回购等工具释放流动性。2 月上旬央行呵护跨节资金面，债市收益率先上后下，超长债出现补涨。春节前后，风险资产波动加大，避险情绪升温，10 年期国债收益率一度下破 1.80% 关口。3 月初中东地缘局势紧张，油价大幅上涨，输入性通胀压力带动国内 PPI 同比明显回升，长端和超长端利率有所上行。4 月随着地缘冲突边际缓和，通胀担忧逐步消退，在宽松资金面的驱动下，债市持续走强。5 月至 6 月资金面收敛，尽管偏弱的基本面与资产荒配置需求托底债市，但 10 年期国债收益率整体震荡上行。

本基金为稳健型低波固收+FOF，投资目标是以风险控制为导向，追求绝对收益，力争净值平

稳增长。在组合构建上，我们以固定收益类资产为主，以权益类资产为辅。固定收益类资产以纯债基金、固收+基金为主要持仓，权益类资产风格上偏向均衡低估值。根据各类资产的回报潜力和波动属性，确定中枢配置比例，并在管理过程中，综合对基本面、市场情绪和交易信号的判断，对部分资产进行仓位和结构上的调整，把握趋势性投资机会，控制下行风险。在报告期内，

随着春季躁动行情启动，我们顺势小幅提升权益仓位，整体保持大盘均衡的配置风格。债券基金方面，小幅下调货币基金和中短债基金权重，适度增配公司内部优质纯债基金，依托其 FOF 层面的费率优势，进一步增厚组合收益。此外小幅加仓低波稳健型一级债基，在严控波动的前提下提升组合收益弹性。二季度伴随权益市场情绪回暖，我们小幅提升权益仓位，结构上增加科技创新、高端制造板块配置，减仓价值、红利风格资产。债券基金方面，我们对业绩表现未达预期的个基开展优化调整。上半年我们稳定配置了一部分的黄金 ETF，1 月份产品业绩受益于金价的短期大涨，我们在金价大涨中高位止盈了一些获利头寸。2 月至 3 月国际金价出现了近 40 多年来最剧烈的一次快速杀跌，由此显著放大了我们组合短期净值的波动率。我们认为随着市场风险逐步释放，资产价格将重回由基本面驱动的运行轨道，主权信用重构与央行购金的长期配置逻辑并未发生改变。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）A 的基金份额净值为 1.0762 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.65%，同期业绩比较基准收益率为 2.50%；截至本报告期末万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）C 的基金份额净值为 1.0706 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.44%，同期业绩比较基准收益率为 2.50%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济有望维持平稳运行，出口将保持韧性。在油价高位运行背景下，新能源产业相关需求将维持强劲。国内 AI 投资继续保持增长，美国科技巨头 2026 年 AI 资本开支指引进一步上调，预计 AI 链出口仍将保持强势。此外，在供需紧平衡驱动下，资源品板块估值与盈利逐步修复，迎来战略布局期。

债市方面，国内货币政策相对宽松的基调仍在延续，实体融资需求偏弱和机构配置需求仍支撑债市表现，但政策预期、名义价格修复对债市形成明显制约。若后续稳增长政策出台力度无显著加码，预计国债利率大概率维持低位震荡。操作上我们会努力把握投资机会，不断寻找优秀管理人，对组合进行持续优化，力争给份额持有人带来更好的回报。

#### 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

本基金为发起式基金，存续期未满三年，不适用本项说明。

### § 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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：万家启源稳健三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产：        |         |                        |                          |
| 货币资金        | 6.4.7.1 | 5,627,999.05           | 7,870,830.34             |
| 结算备付金       |         | -                      | 64,093.83                |
| 存出保证金       |         | 4,465.30               | 5,712.59                 |
| 交易性金融资产     | 6.4.7.2 | 86,438,545.64          | 129,959,523.40           |
| 其中：股票投资     |         | -                      | -                        |
| 基金投资        |         | 82,297,839.59          | 125,513,405.26           |
| 债券投资        |         | 4,140,706.05           | 4,446,118.14             |
| 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        |         | -                      | 438.17                   |
| 应收申购款       |         | 1,190,180.74           | 27,539.52                |
| 递延所得税资产     |         | -                      | -                        |
| 其他资产        | 6.4.7.5 | 6,321.44               | 362.07                   |
| 资产总计        |         | 93,267,512.17          | 137,928,499.92           |
| 负 债 和 净 资 产 |         |                        |                          |
| 负 债：        |         |                        |                          |
| 短期借款        |         | -                      | -                        |
| 交易性金融负债     |         | -                      | -                        |
| 衍生金融负债      | 6.4.7.3 | -                      | -                        |
| 卖出回购金融资产款   |         | -                      | -                        |
| 应付清算款       |         | -                      | -                        |
| 应付赎回款       |         | 623,679.41             | 503.40                   |
| 应付管理人报酬     |         | 35,147.62              | 63,331.36                |
| 应付托管费       |         | 11,016.81              | 16,392.09                |
| 应付销售服务费     |         | 11,062.71              | 24,684.23                |
| 应付投资顾问费     |         | -                      | -                        |
| 应交税费        |         | 58.81                  | -                        |

|          |         |               |                |
|----------|---------|---------------|----------------|
| 应付利润     |         | -             | -              |
| 递延所得税负债  |         | -             | -              |
| 其他负债     | 6.4.7.6 | 74,386.48     | 106,000.00     |
| 负债合计     |         | 755,351.84    | 210,911.08     |
| 净资产：     |         |               |                |
| 实收基金     | 6.4.7.7 | 86,114,644.10 | 131,587,388.29 |
| 其他综合收益   | 6.4.7.8 | -             | -              |
| 未分配利润    | 6.4.7.9 | 6,397,516.23  | 6,130,200.55   |
| 净资产合计    |         | 92,512,160.33 | 137,717,588.84 |
| 负债和净资产总计 |         | 93,267,512.17 | 137,928,499.92 |

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 86,114,644.10 份，其中万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）A 基金份额净值 1.0762 元，基金份额总额 56,611,534.77 份；万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）C 基金份额净值 1.0706 元，基金份额总额 29,503,109.33 份；万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）E 基金份额总额 0 份。

6.2 利润表

会计主体：万家启源稳健三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 3 月 18 日（基金<br>合同生效日）至 2025 年 6<br>月 30 日 |
|-----------------------|----------|------------------------------------------|-------------------------------------------------------------|
| 一、营业总收入               |          | 3,469,004.24                             | 1,246,985.74                                                |
| 1. 利息收入               |          | 9,513.79                                 | 82,089.44                                                   |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.10 | 9,513.79                                 | 27,229.51                                                   |
| 债券利息收入                |          | -                                        | -                                                           |
| 资产支持证券利息<br>收入        |          | -                                        | -                                                           |
| 买入返售金融资产<br>收入        |          | -                                        | 54,859.93                                                   |
| 其他利息收入                |          | -                                        | -                                                           |
| 2. 投资收益（损失以“-”<br>填列） |          | 2,147,134.36                             | 223,293.87                                                  |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.11 | -                                        | -                                                           |
| 基金投资收益                | 6.4.7.12 | 1,878,938.55                             | 100,589.79                                                  |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13 | 29,199.27                                | -                                                           |
| 资产支持证券投资<br>收益        | 6.4.7.14 | -                                        | -                                                           |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.15 | -                                        | -                                                           |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.16 | -                                        | -                                                           |
| 股利收益                  | 6.4.7.17 | 238,996.54                               | 122,704.08                                                  |

|                            |                |                 |              |
|----------------------------|----------------|-----------------|--------------|
| 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. 18    | 1, 288, 894. 43 | 941, 399. 75 |
| 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. 19    | 23, 461. 66     | 202. 68      |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |                | 529, 018. 32    | 443, 688. 28 |
| 1. 管理人报酬                   | 6. 4. 10. 2. 1 | 274, 488. 80    | 215, 415. 45 |
| 其中：暂估管理人报酬                 |                | -               | -            |
| 2. 托管费                     | 6. 4. 10. 2. 2 | 80, 794. 04     | 49, 913. 30  |
| 3. 销售服务费                   | 6. 4. 10. 2. 3 | 98, 767. 98     | 130, 111. 95 |
| 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. 21    | -               | -            |
| 7. 税金及附加                   |                | 583. 74         | 288. 83      |
| 8. 其他费用                    | 6. 4. 7. 22    | 74, 383. 76     | 47, 958. 75  |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |                | 2, 939, 985. 92 | 803, 297. 46 |
| 减：所得税费用                    |                | -               | -            |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |                | 2, 939, 985. 92 | 803, 297. 46 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |                | -               | -            |
| <b>六、综合收益总额</b>            |                | 2, 939, 985. 92 | 803, 297. 46 |

注：本基金合同生效日为 2025 年 3 月 18 日，上年度可比期间为 2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日。

6.3 净资产变动表

会计主体：万家启源稳健三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

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<br>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 | 131, 587, 388. 29                     | -      | 6, 130, 200. 55 | 137, 717, 588. 84 |

|                                          |                                           |        |               |                |
|------------------------------------------|-------------------------------------------|--------|---------------|----------------|
| 加：会计政策变更                                 | -                                         | -      | -             | -              |
| 前期差错更正                                   | -                                         | -      | -             | -              |
| 其他                                       | -                                         | -      | -             | -              |
| 二、本期期初净资产                                | 131,587,388.29                            | -      | 6,130,200.55  | 137,717,588.84 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -45,472,744.19                            | -      | 267,315.68    | -45,205,428.51 |
| （一）、综合收益总额                               | -                                         | -      | 2,939,985.92  | 2,939,985.92   |
| （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）      | -45,472,744.19                            | -      | -2,672,670.24 | -48,145,414.43 |
| 其中：1. 基金申购款                              | 19,246,922.72                             | -      | 1,279,074.00  | 20,525,996.72  |
| 2. 基金赎回款                                 | -64,719,666.91                            | -      | -3,951,744.24 | -68,671,411.15 |
| （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                                | 86,114,644.10                             | -      | 6,397,516.23  | 92,512,160.33  |
| 项目                                       | 上年度可比期间                                   |        |               |                |
|                                          | 2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）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                                | -                                         | -      | -             | -              |
| 加：会计政策变更                                 | -                                         | -      | -             | -              |
| 前期差错更正                                   | -                                         | -      | -             | -              |
| 其他                                       | -                                         | -      | -             | -              |
| 二、本期期初净                                  | 127,641,326.98                            | -      | -             | 127,641,326.98 |

|                                          |                |   |             |                |
|------------------------------------------|----------------|---|-------------|----------------|
| 资产                                       |                |   |             |                |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -25,013,148.48 | - | 698,877.84  | -24,314,270.64 |
| （一）、综合收益总额                               | -              | - | 803,297.46  | 803,297.46     |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）      | -25,013,148.48 | - | -104,419.62 | -25,117,568.10 |
| 其中：1. 基金申购款                              | 124,236.73     | - | 683.27      | 124,920.00     |
| 2. 基金赎回款                                 | -25,137,385.21 | - | -105,102.89 | -25,242,488.10 |
| （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                                | 102,628,178.50 | - | 698,877.84  | 103,327,056.34 |

注：本基金合同生效日为 2025 年 3 月 18 日，上年度可比期间为 2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日。

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

基金管理人负责人

莫海波

主管会计工作负责人

尹超

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

万家启源稳健三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2024]1470 号文《关于准予万家启源稳健三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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 2025 年 3 月 3 日至 2025 年 3 月 14 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[2025]第 ZA30696 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 2025 年 3 月 18 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 127,622,812.05 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 18,514.93 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 127,641,326.98 元，折合 127,641,326.98 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，基金托管人为平安银行股份有限公司。

本基金的投资范围包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额（包含 QDII 基金、香港互认基金、公开募集基础设施证券投资基金及其他经中国证监会核准或注册的基金）、国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板以及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、港股通标的证券（包括股票和 ETF）、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债、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）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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：中债新综合全价（总值）指数收益率\*85%+中证 800 指数收益率\*15%。

#### 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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 5,627,999.05           |
| 等于：本金          | 5,627,647.59           |
| 加：应计利息         | 351.46                 |
| 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             | 5,627,999.05           |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |      |      |        |
|---------------|------------------------|------|------|--------|
|               | 成本                     | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票            | -                      | -    | -    | -      |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -    | -    | -      |

|        |       |               |           |               |              |
|--------|-------|---------------|-----------|---------------|--------------|
| 债券     | 交易所市场 | 4,103,518.00  | 38,626.05 | 4,140,706.05  | -1,438.00    |
|        | 银行间市场 | -             | -         | -             | -            |
|        | 合计    | 4,103,518.00  | 38,626.05 | 4,140,706.05  | -1,438.00    |
| 资产支持证券 |       | -             | -         | -             | -            |
| 基金     |       | 79,393,567.37 | -         | 82,297,839.59 | 2,904,272.22 |
| 其他     |       | -             | -         | -             | -            |
| 合计     |       | 83,497,085.37 | 38,626.05 | 86,438,545.64 | 2,902,834.22 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|-------|------------------------|
| 应收利息  | -                      |
| 其他应收款 | 6,321.44               |
| 待摊费用  | -                      |
| 合计    | 6,321.44               |

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 2.72                   |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 应付交易费用      | -                      |
| 其中：交易所市场    | -                      |
| 银行间市场       | -                      |
| 应付利息        | -                      |
| 预提费用        | 74,383.76              |
| 合计          | 74,386.48              |

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）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          | 60,041,043.57                   | 60,041,043.57  |
| 本期申购          | 14,603,203.59                   | 14,603,203.59  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -18,032,712.39                  | -18,032,712.39 |
| 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           | 56,611,534.77                   | 56,611,534.77  |

万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）C

| 项目            | 本期<br>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          | 71,546,344.72                         | 71,546,344.72  |
| 本期申购          | 4,643,719.13                          | 4,643,719.13   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -46,686,954.52                        | -46,686,954.52 |
| 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           | 29,503,109.33                         | 29,503,109.33  |

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

万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）A

| 项目             | 已实现部分        | 未实现部分        | 未分配利润合计       |
|----------------|--------------|--------------|---------------|
| 上年度末           | 1,994,233.89 | 911,961.38   | 2,906,195.27  |
| 加：会计政策变更       | -            | -            | -             |
| 前期差错更正         | -            | -            | -             |
| 其他             | -            | -            | -             |
| 本期期初           | 1,994,233.89 | 911,961.38   | 2,906,195.27  |
| 本期利润           | 990,142.83   | 616,337.73   | 1,606,480.56  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -132,074.53  | -66,801.06   | -198,875.59   |
| 其中：基金申购款       | 681,364.21   | 325,116.32   | 1,006,480.53  |
| 基金赎回款          | -813,438.74  | -391,917.38  | -1,205,356.12 |
| 本期已分配利润        | -            | -            | -             |
| 本期末            | 2,852,302.19 | 1,461,498.05 | 4,313,800.24  |

万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）C

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末           | 2,138,737.18  | 1,085,268.10  | 3,224,005.28  |
| 加：会计政策变更       | -             | -             | -             |
| 前期差错更正         | -             | -             | -             |
| 其他             | -             | -             | -             |
| 本期期初           | 2,138,737.18  | 1,085,268.10  | 3,224,005.28  |
| 本期利润           | 660,948.66    | 672,556.70    | 1,333,505.36  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,475,835.40 | -997,959.25   | -2,473,794.65 |
| 其中：基金申购款       | 160,710.11    | 111,883.36    | 272,593.47    |
| 基金赎回款          | -1,636,545.51 | -1,109,842.61 | -2,746,388.12 |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 1,323,850.44  | 759,865.55    | 2,083,715.99  |

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 9,485.50                              |
| 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 | 18.43                                 |
| 其他        | 9.86                                  |
| 合计        | 9,513.79                              |

6.4.7.11 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.12 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目                | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|-------------------|---------------------------------------|
| 卖出/赎回基金成交总额       | 99,391,023.96                         |
| 减：卖出/赎回基金成本总额     | 97,501,833.31                         |
| 减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额 | 4,748.00                              |
| 减：交易费用            | 5,504.10                              |
| 基金投资收益            | 1,878,938.55                          |

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|----|----------------------------|
|----|----------------------------|

|                              |           |
|------------------------------|-----------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 28,629.27 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 570.00    |
| 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                           | 29,199.27 |

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>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   | 4,456,920.00               |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 4,399,430.00               |
| 减：应计利息总额               | 56,920.00                  |
| 减：交易费用                 | —                          |
| 买卖债券差价收入               | 570.00                     |

#### 6.4.7.14 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。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | —                          |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | —                          |
| 基金投资产生的股利收益   | 238,996.54                 |
| 合计            | 238,996.54                 |

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 1,288,894.43               |
| 股票投资       | —                          |
| 债券投资       | -2,848.00                  |

|                        |              |
|------------------------|--------------|
| 资产支持证券投资               | -            |
| 基金投资                   | 1,291,742.43 |
| 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                     | 1,288,894.43 |

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 17,140.22                             |
| 销售服务费返还 | 6,321.44                              |
| 合计      | 23,461.66                             |

6.4.7.20 持有基金产生的费用

| 项目                   | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|----------------------|---------------------------------------|
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 85,766.32                             |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元）   | 236,597.75                            |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元）   | 56,678.48                             |

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

6.4.7.21 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 14,876.39                             |
| 信息披露费   | 59,507.37                             |
| 证券出借违约金 | -                                     |
| 合计      | 74,383.76                             |

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 |
| 平安银行股份有限公司（“平安银行”） | 基金托管人、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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

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基金交易。

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------|------------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 274,488.80                            | 215,415.45                                           |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 112,128.65                            | 101,353.04                                           |

|               |            |            |
|---------------|------------|------------|
| 应支付基金管理人的净管理费 | 162,360.15 | 114,062.41 |
|---------------|------------|------------|

注：本基金投资于本基金管理人所管理的基金的部分不收取管理费。本基金管理费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有本基金管理人管理的其他基金份额所对应的资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.60\%\div \text{当年天数}$$

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扣除前一日所持有的基金管理人管理的其他基金份额所对应的资产净值后的余额，若为负数，则 E 取 0。

基金管理费每日计算，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月初 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、公休日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|------------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 80,794.04                             | 49,913.30                                            |

注：本基金投资于本基金托管人所托管的基金的部分不收取托管费。本基金托管费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有基金托管人托管的其他基金份额所对应的资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.15%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.15\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值扣除前一日所持有的基金托管人托管的其他基金份额所对应的资产净值后的余额，若为负数，则 E 取 0。

基金托管费每日计算，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月初 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

|          |    |
|----------|----|
| 获得销售服务费的 | 本期 |
|----------|----|

| 各关联方名称             | 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                                     |                                 |                                 |            |
|                    | 万家启源稳健三<br>个月持有期混合<br>发起式（FOF）A                      | 万家启源稳健三<br>个月持有期混合<br>发起式（FOF）C | 万家启源稳健三<br>个月持有期混合<br>发起式（FOF）E | 合计         |
| 平安银行               | -                                                    | 32,005.88                       | -                               | 32,005.88  |
| 合计                 | -                                                    | 32,005.88                       | -                               | 32,005.88  |
| 获得销售服务费的<br>各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日 |                                 |                                 |            |
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费                                     |                                 |                                 |            |
|                    | 万家启源稳健三<br>个月持有期混合<br>发起式（FOF）A                      | 万家启源稳健三<br>个月持有期混合<br>发起式（FOF）C | 万家启源稳健三<br>个月持有期混合<br>发起式（FOF）E | 合计         |
| 平安银行               | -                                                    | 129,909.92                      | -                               | 129,909.92 |
| 合计                 | -                                                    | 129,909.92                      | -                               | 129,909.92 |

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 0.40%，E 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%。

C 类、E 类基金份额的销售服务费分别按前一日该类基金份额的基金资产净值，以该类基金份额对应的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{该类基金份额的基金销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$$

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该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，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月初 5 个工作日内从基金财产中一次性付给各销售机构，或一次性支付给基金管理人并由基金管理人代付给各基金销售机构。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

证券出借业务。

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                              | 本期                                        |                         |                         |
|---------------------------------|-------------------------------------------|-------------------------|-------------------------|
|                                 | 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日           |                         |                         |
|                                 | 万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）A                   | 万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）C | 万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）E |
| 基金合同生效日（2025 年 3 月 18 日）持有的基金份额 | -                                         | -                       | -                       |
| 报告期初持有的基金份额                     | 10,001,111.22                             | -                       | -                       |
| 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                     | 10,001,111.22                             | -                       | -                       |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例             | 17.6662%                                  | -                       | -                       |
| 项目                              | 上年度可比期间                                   |                         |                         |
|                                 | 2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日 |                         |                         |
|                                 | 万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）A                   | 万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）C | 万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）E |
| 基金合同生效日（2025 年 3 月 18 日）持有的基金份额 | 10,001,111.22                             | -                       | -                       |
| 报告期初持有的基                        | -                                         | -                       | -                       |

|                     |               |   |   |
|---------------------|---------------|---|---|
| 金份额                 |               |   |   |
| 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         | 10,001,111.22 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 84.2487%      | - | - |

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |          | 上年度可比期间<br>2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）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    |
| 平安银行  | 5,627,999.05                          | 9,485.50 | 18,835,792.68                                        | 27,094.56 |

注：本基金的银行存款由基金托管人平安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

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

截至报告期末（2026 年 6 月 30 日），本基金持有基金管理人万家基金管理有限公司所管理的基金合计 19,378,739.71 元（2025 年 12 月 31 日：7,580,222.46 元），占本基金资产净值的比例为 20.95%（2025 年 12 月 31 日：5.50%）。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

| 项目              | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日 |
|-----------------|---------------------------------------|------------------------------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费（元） | -                                     | -                                                    |
| 当期交易基金产生的赎回费（元） | -                                     | -                                                    |

|                      |           |   |
|----------------------|-----------|---|
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 6,321.44  | - |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元）   | 27,218.98 | - |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元）   | 7,606.44  | - |

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

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 2026 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                      | -                        |
| A-1 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 4,140,706.05           | 4,446,118.14             |
| 合计     | 4,140,706.05           | 4,446,118.14             |

注：未评级债券包括国债。

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。

本基金所持大部分证券为开放式基金，其余亦可在证券交易所或银行间同业市场交易；因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，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投资的公允价值。

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<br>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              | 5,627,999.05 | -     | -            | -    | -    | -             | 5,627,999.05  |
| 存出保证金             | 4,465.30     | -     | -            | -    | -    | -             | 4,465.30      |
| 交易性金融资产           | 2,329,038.60 | -     | 1,811,667.45 | -    | -    | 82,297,839.59 | 86,438,545.64 |
| 应收申购款             | -            | -     | -            | -    | -    | 1,190,180.74  | 1,190,180.74  |
| 其他资产              | -            | -     | -            | -    | -    | 6,321.44      | 6,321.44      |
| 资产总计              | 7,961,502.95 | -     | 1,811,667.45 | -    | -    | 83,494,341.77 | 93,267,512.17 |
| 负债                |              |       |              |      |      |               |               |
| 应付赎回款             | -            | -     | -            | -    | -    | 623,679.41    | 623,679.41    |
| 应付管理人报酬           | -            | -     | -            | -    | -    | 35,147.62     | 35,147.62     |

|                             |              |        |              |       |       |                |                |
|-----------------------------|--------------|--------|--------------|-------|-------|----------------|----------------|
| 应付托管费                       | -            | -      | -            | -     | -     | 11,016.81      | 11,016.81      |
| 应付销售服务费                     | -            | -      | -            | -     | -     | 11,062.71      | 11,062.71      |
| 应交税费                        | -            | -      | -            | -     | -     | 58.81          | 58.81          |
| 其他负债                        | -            | -      | -            | -     | -     | 74,386.48      | 74,386.48      |
| 负债总计                        | -            | -      | -            | -     | -     | 755,351.84     | 755,351.84     |
| 利率敏感度缺口                     | 7,961,502.95 | -      | 1,811,667.45 | -     | -     | 82,738,989.93  | 92,512,160.33  |
| 上年度末<br>2025 年 12 月<br>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                        | 7,870,830.34 | -      | -            | -     | -     | -              | 7,870,830.34   |
| 结算备付金                       | 64,093.83    | -      | -            | -     | -     | -              | 64,093.83      |
| 存出保证金                       | 5,712.59     | -      | -            | -     | -     | -              | 5,712.59       |
| 交易性金融资产                     | 1,617,848.11 | -      | 2,828,270.03 | -     | -     | 125,513,405.26 | 129,959,523.40 |
| 应收股利                        | -            | -      | -            | -     | -     | 438.17         | 438.17         |
| 应收申购款                       | -            | -      | -            | -     | -     | 27,539.52      | 27,539.52      |
| 其他资产                        | -            | -      | -            | -     | -     | 362.07         | 362.07         |
| 资产总计                        | 9,558,484.87 | -      | 2,828,270.03 | -     | -     | 125,541,745.02 | 137,928,499.92 |
| 负债                          |              |        |              |       |       |                |                |
| 应付赎回款                       | -            | -      | -            | -     | -     | 503.40         | 503.40         |
| 应付管理人报酬                     | -            | -      | -            | -     | -     | 63,331.36      | 63,331.36      |
| 应付托管费                       | -            | -      | -            | -     | -     | 16,392.09      | 16,392.09      |
| 应付销售服务费                     | -            | -      | -            | -     | -     | 24,684.23      | 24,684.23      |
| 其他负债                        | -            | -      | -            | -     | -     | 106,000.00     | 106,000.00     |
| 负债总计                        | -            | -      | -            | -     | -     | 210,911.08     | 210,911.08     |
| 利率敏感度缺口                     | 9,558,484.87 | -      | 2,828,270.03 | -     | -     | 125,330,833.94 | 137,717,588.84 |

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 | 2,841.31  | 2,175.40  |
|  | 市场利率上升 25 个基点 | -2,836.11 | -2,171.99 |

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。

本基金主要投资于开放式基金及证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的重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<br>2026 年 6 月 30 日 |              | 上年度末<br>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  | —                      | —            | —                        | —            |
| 交易性金融资产—基金投资  | 82,297,839.59          | 88.96        | 125,513,405.26           | 91.14        |
| 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            | 82,297,839.59          | 88.96        | 125,513,405.26           | 91.14        |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

|    |                      |                             |                        |
|----|----------------------|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | 除业绩比较基准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） |

|  |                |                  |                  |
|--|----------------|------------------|------------------|
|  | 业绩比较基准增加<br>5% | 6, 002, 283. 43  | 7, 557, 596. 69  |
|  | 业绩比较基准减少<br>5% | -6, 002, 283. 43 | -7, 557, 596. 69 |

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：<br><br>第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。<br><br>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。<br><br>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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 82, 297, 839. 59       | 125, 513, 405. 26        |
| 第二层次          | 4, 140, 706. 05        | 4, 446, 118. 14          |
| 第三层次          | -                      | -                        |
| 合计            | 86, 438, 545. 64       | 129, 959, 523. 40        |

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              | -             | -            |
|    | 其中：股票             | -             | -            |
| 2  | 基金投资              | 82,297,839.59 | 88.24        |
| 3  | 固定收益投资            | 4,140,706.05  | 4.44         |
|    | 其中：债券             | 4,140,706.05  | 4.44         |
|    | 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      | 5,627,999.05  | 6.03         |
| 8  | 其他各项资产            | 1,200,967.48  | 1.29         |
| 9  | 合计                | 93,267,512.17 | 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

本基金本报告期末未持有境内股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金报告期内未买入股票。

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

本基金报告期内未卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金报告期内未投资股票。

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      | 4,140,706.05 | 4.48         |
| 2  | 央行票据      | -            | -            |
| 3  | 金融债券      | -            | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -            | -            |
| 4  | 企业债券      | -            | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -            | -            |
| 6  | 中期票据      | -            | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -            | -            |
| 8  | 同业存单      | -            | -            |
| 9  | 其他        | -            | -            |
| 10 | 合计        | 4,140,706.05 | 4.48         |

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  | 019785 | 25 国债 13 | 23,000 | 2,329,038.60 | 2.52         |
| 2  | 019827 | 26 国债 01 | 18,000 | 1,811,667.45 | 1.96         |

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

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 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本基金为混合型基金中基金，在控制风险的前提下，通过主动的资产配置、基金优选，力争

实现基金资产长期稳健增值。本基金投资于公开募集的基金份额的比例不低于基金资产的 80%。本基金投资于权益类资产（股票、股票型基金、混合型基金）的比例为基金资产的 0%-30%；投资于 QDII 基金和香港互认基金的比例合计不超过基金资产的 20%，投资于货币市场基金的投资比例不超过基金资产的 15%；投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。

本基金长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、股票型基金中基金（FOF），高于债券型基金、债券型基金中基金（FOF）、货币市场基金和货币型基金中基金（FOF）。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

| 序号 | 基金代码   | 基金名称                           | 运作方式   | 持有份额（份）      | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） | 是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金 |
|----|--------|--------------------------------|--------|--------------|--------------|--------------|------------------------|
| 1  | 020798 | 万家信用恒利债券D                      | 契约型开放式 | 5,581,648.38 | 6,824,123.31 | 7.38         | 是                      |
| 2  | 020171 | 万家CFETS0-3年期山东省国有企业信用债精选指数发起式C | 契约型开放式 | 4,012,738.30 | 4,192,508.98 | 4.53         | 是                      |
| 3  | 016787 | 万家家享中短债D                       | 契约型开放式 | 2,818,233.07 | 2,968,163.07 | 3.21         | 是                      |
| 4  | 016928 | 万家鑫怡债券A                        | 契约型开放式 | 2,621,736.40 | 2,710,088.92 | 2.93         | 是                      |
| 5  | 016481 | 兴全恒信债券A                        | 契约型开放式 | 2,413,376.74 | 2,664,850.60 | 2.88         | 否                      |
| 6  | 004388 | 鹏华丰享债券                         | 契约型开放式 | 1,988,268.73 | 2,598,269.58 | 2.81         | 否                      |

|    |        |                      |                         |              |              |      |   |
|----|--------|----------------------|-------------------------|--------------|--------------|------|---|
| 7  | 675163 | 西部利得<br>汇盈债券<br>C    | 契约<br>型开<br>放式          | 2,272,633.09 | 2,497,851.03 | 2.70 | 否 |
| 8  | 020928 | 博时富腾<br>纯债债券<br>C    | 契约<br>型开<br>放式          | 2,242,623.76 | 2,479,444.83 | 2.68 | 否 |
| 9  | 003449 | 招商招华<br>纯债 C         | 契约<br>型开<br>放式          | 1,979,645.87 | 2,453,573.09 | 2.65 | 否 |
| 10 | 020089 | 广发纯债<br>债券 E         | 契约<br>型开<br>放式          | 1,934,448.19 | 2,417,479.90 | 2.61 | 否 |
| 11 | 019191 | 富国纯债<br>债券发起<br>式 E  | 契约<br>型开<br>放式          | 2,110,832.76 | 2,369,198.69 | 2.56 | 否 |
| 12 | 675113 | 西部利得<br>汇享债券<br>C    | 契约<br>型开<br>放式          | 1,419,386.42 | 1,951,798.27 | 2.11 | 否 |
| 13 | 159934 | 易方达黄<br>金 ETF        | 交易<br>型开<br>放式<br>(ETF) | 170,000.00   | 1,487,500.00 | 1.61 | 否 |
| 14 | 017534 | 富国天利<br>增长债券<br>C    | 契约<br>型开<br>放式          | 1,031,878.22 | 1,434,826.66 | 1.55 | 否 |
| 15 | 518880 | 华安黄金<br>易 (ETF)      | 交易<br>型开<br>放式<br>(ETF) | 170,000.00   | 1,424,260.00 | 1.54 | 否 |
| 16 | 013380 | 景顺长城<br>景泰纯利<br>债券 C | 契约<br>型开<br>放式          | 1,174,669.49 | 1,396,916.96 | 1.51 | 否 |
| 17 | 700006 | 平安添利<br>债券 C         | 契约<br>型开<br>放式          | 1,106,486.59 | 1,322,251.48 | 1.43 | 否 |
| 18 | 002665 | 万家瑞和                 | 契约                      | 911,537.93   | 1,217,358.91 | 1.32 | 是 |

|    |        |                        |                |              |              |      |   |
|----|--------|------------------------|----------------|--------------|--------------|------|---|
|    |        | C                      | 型开<br>放式       |              |              |      |   |
| 19 | 019287 | 鹏华丰诚<br>债券 D           | 契约<br>型开<br>放式 | 1,082,034.89 | 1,214,043.15 | 1.31 | 否 |
| 20 | 020620 | 汇添富投<br>资级信用<br>债指数 C  | 契约<br>型开<br>放式 | 1,148,135.58 | 1,195,094.33 | 1.29 | 否 |
| 21 | 022155 | 交银裕隆<br>纯债债券<br>D      | 契约<br>型开<br>放式 | 945,624.75   | 1,186,759.06 | 1.28 | 否 |
| 22 | 001423 | 景顺长城<br>安享回报<br>混合 C 类 | 契约<br>型开<br>放式 | 735,095.18   | 1,182,033.05 | 1.28 | 否 |
| 23 | 010653 | 农银金玉<br>债券             | 契约<br>型开<br>放式 | 1,117,231.12 | 1,122,146.94 | 1.21 | 否 |
| 24 | 006840 | 安信聚利<br>增强债券<br>C      | 契约<br>型开<br>放式 | 813,765.89   | 1,081,901.75 | 1.17 | 否 |
| 25 | 017499 | 淳厚添益<br>债券 C           | 契约<br>型开<br>放式 | 748,664.40   | 1,009,124.74 | 1.09 | 否 |
| 26 | 022229 | 富国兴利<br>增强债券<br>E      | 契约<br>型开<br>放式 | 472,935.16   | 913,568.85   | 0.99 | 否 |
| 27 | 001752 | 华商信用<br>增强债券<br>C      | 契约<br>型开<br>放式 | 449,762.23   | 899,974.22   | 0.97 | 否 |
| 28 | 023813 | 摩根双债<br>增利债券<br>D      | 契约<br>型开<br>放式 | 733,308.78   | 899,623.21   | 0.97 | 否 |
| 29 | 673083 | 西部利得<br>祥运混合<br>C      | 契约<br>型开<br>放式 | 866,017.85   | 872,339.78   | 0.94 | 否 |
| 30 | 012790 | 汇添富双                   | 契约             | 672,938.23   | 844,470.18   | 0.91 | 否 |

|    |        |              |        |            |            |      |   |
|----|--------|--------------|--------|------------|------------|------|---|
|    |        | 享回报债券 C      | 型开放式   |            |            |      |   |
| 31 | 012220 | 南方安泰混合 C     | 契约型开放式 | 700,896.91 | 839,113.78 | 0.91 | 否 |
| 32 | 020043 | 路博迈恒享债券 C    | 契约型开放式 | 726,028.21 | 831,883.12 | 0.90 | 否 |
| 33 | 004572 | 万家家瑞债券 C     | 契约型开放式 | 645,458.53 | 806,564.98 | 0.87 | 是 |
| 34 | 014847 | 博时恒乐债券 C     | 契约型开放式 | 616,740.47 | 776,661.27 | 0.84 | 否 |
| 35 | 000070 | 国投瑞银中高等级债券 C | 契约型开放式 | 652,295.57 | 756,662.86 | 0.82 | 否 |
| 36 | 008187 | 淳厚信睿 C       | 契约型开放式 | 134,358.53 | 736,593.77 | 0.80 | 否 |
| 37 | 021953 | 西部利得新动向混合 C  | 契约型开放式 | 340,871.87 | 736,283.24 | 0.80 | 否 |
| 38 | 006331 | 中银国有企业债 C    | 契约型开放式 | 567,095.80 | 707,055.04 | 0.76 | 否 |
| 39 | 018747 | 永赢匠心增利债券 C   | 契约型开放式 | 585,107.79 | 702,889.99 | 0.76 | 否 |
| 40 | 005657 | 光大保德信安泽债券 C  | 契约型开放式 | 542,441.57 | 699,152.94 | 0.76 | 否 |
| 41 | 022175 | 富国宝利增强债券 E   | 契约型开放式 | 456,061.82 | 670,638.91 | 0.72 | 否 |
| 42 | 016556 | 万家量化         | 契约     | 267,276.15 | 659,931.54 | 0.71 | 是 |

|    |        |                              |                |            |            |      |   |
|----|--------|------------------------------|----------------|------------|------------|------|---|
|    |        | 睿选 C                         | 型开<br>放式       |            |            |      |   |
| 43 | 020237 | 路博迈中<br>国动力股<br>票 C          | 契约<br>型开<br>放式 | 284,867.63 | 605,799.50 | 0.65 | 否 |
| 44 | 016594 | 易方达安<br>心回馈混<br>合 C          | 契约<br>型开<br>放式 | 204,947.91 | 591,069.77 | 0.64 | 否 |
| 45 | 023868 | 华宝安盈<br>混合 C                 | 契约<br>型开<br>放式 | 444,445.49 | 570,268.01 | 0.62 | 否 |
| 46 | 015257 | 鹏华畅享<br>债券 C                 | 契约<br>型开<br>放式 | 467,553.27 | 558,539.14 | 0.60 | 否 |
| 47 | 217008 | 招商安本<br>增利债券<br>C            | 契约<br>型开<br>放式 | 288,085.12 | 539,669.86 | 0.58 | 否 |
| 48 | 001258 | 兴业收益<br>增强债券<br>C            | 契约<br>型开<br>放式 | 331,729.76 | 530,104.16 | 0.57 | 否 |
| 49 | 011123 | 汇添富<br>ESG 可持<br>续成长股<br>票 C | 契约<br>型开<br>放式 | 405,845.03 | 527,517.37 | 0.57 | 否 |
| 50 | 023808 | 交银安心<br>收益债券<br>D            | 契约<br>型开<br>放式 | 474,836.03 | 523,411.76 | 0.57 | 否 |
| 51 | 022159 | 富国丰利<br>增强债券<br>E            | 契约<br>型开<br>放式 | 336,953.71 | 488,717.66 | 0.53 | 否 |
| 52 | 015161 | 南方宝嘉<br>混合 C                 | 契约<br>型开<br>放式 | 422,365.46 | 487,071.85 | 0.53 | 否 |
| 53 | 023546 | 永赢悦享<br>债券 B                 | 契约<br>型开<br>放式 | 467,777.29 | 486,488.38 | 0.53 | 否 |

|    |        |                     |              |            |            |      |   |
|----|--------|---------------------|--------------|------------|------------|------|---|
| 54 | 006551 | 中庚价值领航混合            | 契约型开放式       | 131,897.16 | 476,135.56 | 0.51 | 否 |
| 55 | 485011 | 工银双利债券 B            | 契约型开放式       | 241,517.88 | 471,684.42 | 0.51 | 否 |
| 56 | 022755 | 易方达科鑫量化选股股票发起式 C    | 契约型开放式       | 199,248.55 | 469,529.21 | 0.51 | 否 |
| 57 | 016720 | 富国稳健双盈债券发起式 C       | 契约型开放式       | 357,022.18 | 428,533.72 | 0.46 | 否 |
| 58 | 017493 | 东方红新动力混合 C          | 契约型开放式       | 67,198.88  | 415,221.88 | 0.45 | 否 |
| 59 | 012903 | 平安添悦债券 C            | 契约型开放式       | 338,198.23 | 411,925.44 | 0.45 | 否 |
| 60 | 513750 | 广发中证港股通非银 ETF       | 交易型开放式 (ETF) | 290,000.00 | 407,450.00 | 0.44 | 否 |
| 61 | 015159 | 申万菱信智能驱动股票 C        | 契约型开放式       | 35,952.52  | 405,997.43 | 0.44 | 否 |
| 62 | 630016 | 华商价值共享混合发起式         | 契约型开放式       | 73,850.22  | 381,067.14 | 0.41 | 否 |
| 63 | 021865 | 中欧中证 800 研究智选混合发起 C | 契约型开放式       | 216,322.99 | 361,107.97 | 0.39 | 否 |
| 64 | 012125 | 博道盛彦混合 C            | 契约型开放式       | 240,292.50 | 358,564.47 | 0.39 | 否 |

|    |        |                        |                |            |            |      |   |
|----|--------|------------------------|----------------|------------|------------|------|---|
| 65 | 023512 | 景顺长城<br>景颐丰利<br>债券 F 类 | 契约<br>型开<br>放式 | 197,348.02 | 338,866.29 | 0.37 | 否 |
| 66 | 011730 | 工银聚享<br>混合 C           | 契约<br>型开<br>放式 | 253,714.02 | 319,958.75 | 0.35 | 否 |
| 67 | 009520 | 中欧鼎利<br>债券 C           | 契约<br>型开<br>放式 | 211,339.25 | 317,642.89 | 0.34 | 否 |
| 68 | 630107 | 华商稳健<br>双利债券<br>B      | 契约<br>型开<br>放式 | 171,446.25 | 317,175.56 | 0.34 | 否 |
| 69 | 018949 | 东方红睿<br>华沪港深<br>混合 C   | 契约<br>型开<br>放式 | 138,899.88 | 310,524.57 | 0.34 | 否 |
| 70 | 016050 | 华商高端<br>装备制造<br>股票 C   | 契约<br>型开<br>放式 | 46,804.94  | 307,101.25 | 0.33 | 否 |
| 71 | 025541 | 华夏创新<br>前沿股票<br>C      | 契约<br>型开<br>放式 | 48,356.99  | 293,043.36 | 0.32 | 否 |
| 72 | 015007 | 中欧量化<br>动力混合<br>C      | 契约<br>型开<br>放式 | 176,793.43 | 283,081.64 | 0.31 | 否 |
| 73 | 014417 | 泰康研究<br>精选股票<br>发起 C   | 契约<br>型开<br>放式 | 112,049.03 | 269,791.65 | 0.29 | 否 |
| 74 | 022004 | 博道大盘<br>成长股票<br>C      | 契约<br>型开<br>放式 | 104,233.04 | 237,025.93 | 0.26 | 否 |
| 75 | 010812 | 中银战略<br>新兴产业<br>股票 C   | 契约<br>型开<br>放式 | 50,295.85  | 233,966.24 | 0.25 | 否 |
| 76 | 023097 | 安信比较<br>优势混合<br>C      | 契约<br>型开<br>放式 | 113,517.80 | 220,939.69 | 0.24 | 否 |

|    |        |                   |                |            |            |      |   |
|----|--------|-------------------|----------------|------------|------------|------|---|
| 77 | 590010 | 中邮稳定收益债券 C        | 契约型开放式         | 177,341.68 | 209,085.84 | 0.23 | 否 |
| 78 | 017087 | 嘉实 ESG 可持续投资混合 C  | 契约型开放式         | 106,680.11 | 204,975.16 | 0.22 | 否 |
| 79 | 004232 | 中欧价值发现混合 C        | 契约型开放式         | 68,799.45  | 200,832.47 | 0.22 | 否 |
| 80 | 005787 | 中欧新趋势混合 (LOF)C    | 上市契约型开放式 (LOF) | 117,477.44 | 192,334.06 | 0.21 | 否 |
| 81 | 005110 | 汇安多策略混合 C         | 契约型开放式         | 123,822.98 | 184,335.27 | 0.20 | 否 |
| 82 | 020487 | 华富成长企业精选股票 C      | 契约型开放式         | 131,665.43 | 183,962.94 | 0.20 | 否 |
| 83 | 019432 | 永赢睿信混合 C          | 契约型开放式         | 64,878.63  | 169,359.18 | 0.18 | 否 |
| 84 | 007497 | 中庚价值灵动灵活配置混合      | 契约型开放式         | 51,681.18  | 166,759.66 | 0.18 | 否 |
| 85 | 010150 | 南方君信灵活配置混合 C      | 契约型开放式         | 56,501.43  | 153,898.60 | 0.17 | 否 |
| 86 | 513010 | 易方达恒生科技 ETF(QDII) | 交易型开放式 (ETF)   | 260,000.00 | 151,840.00 | 0.16 | 否 |
| 87 | 010125 | 兴银景气优选混合 C        | 契约型开放式         | 143,123.85 | 150,680.79 | 0.16 | 否 |

|    |        |                        |                               |           |            |      |   |
|----|--------|------------------------|-------------------------------|-----------|------------|------|---|
| 88 | 006649 | 汇安多因子混合 C              | 契约<br>型开<br>放式                | 60,703.29 | 150,052.46 | 0.16 | 否 |
| 89 | 015321 | 长江新兴产业混合<br>型发起式<br>C  | 契约<br>型开<br>放式                | 82,688.29 | 145,746.38 | 0.16 | 否 |
| 90 | 009241 | 融通领先<br>成长混合<br>(LOF)C | 上市<br>契约<br>型开<br>放式<br>(LOF) | 55,046.00 | 125,339.74 | 0.14 | 否 |
| 91 | 017946 | 国富沪港<br>深成长精<br>选股票 C  | 契约<br>型开<br>放式                | 47,521.74 | 114,931.33 | 0.12 | 否 |
| 92 | 011470 | 东吴新产<br>业精选股<br>票 C    | 契约<br>型开<br>放式                | 18,541.46 | 93,738.21  | 0.10 | 否 |

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 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 | 4,465.30     |
| 2  | 应收清算款 | -            |
| 3  | 应收股利  | -            |
| 4  | 应收利息  | -            |
| 5  | 应收申购款 | 1,190,180.74 |
| 6  | 其他应收款 | 6,321.44     |
| 7  | 待摊费用  | -            |
| 8  | 其他    | -            |
| 9  | 合计    | 1,200,967.48 |

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.13.6 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<br>户数<br>(户) | 户均持有的基<br>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<br>额比例<br>(%) | 持有份额          | 占总<br>份额<br>比例<br>(%) |
| 万家启源<br>稳健三个<br>月持有期<br>混合发起<br>式（FOF）<br>A | 277              | 204,373.77    | 14,966,130.98 | 26.44             | 41,645,403.79 | 73.56                 |
| 万家启源<br>稳健三个<br>月持有期<br>混合发起<br>式（FOF）<br>C | 207              | 142,527.10    | 277,646.16    | 0.94              | 29,225,463.17 | 99.06                 |
| 万家启源<br>稳健三个<br>月持有期<br>混合发起<br>式（FOF）<br>E | —                | —             | —             | —                 | —             | —                     |
| 合计                                          | 477              | 180,533.85    | 15,243,777.14 | 17.70             | 70,870,866.96 | 82.30                 |

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 盈利投资者数量占比

| 项目           | 过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日） |
|--------------|--------------------------------------|
| 盈利投资者数量占比（%） | 97.81                                |

8.3 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 | 万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）A | 416,852.43 | 0.7363      |
|                  | 万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）C | -          | -           |
|                  | 万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）E | -          | -           |
|                  | 合计                      | 416,852.43 | 0.4841      |

8.4 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 | 万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）A | 10~50             |
|                                | 万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）C | 0                 |
|                                | 万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）E | 0                 |
|                                | 合计                      | 10~50             |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）A | 10~50             |
|                                | 万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）C | 0                 |
|                                | 万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）E | 0                 |
|                                | 合计                      | 10~50             |

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数        | 持有份额占基金总份额比例（%） | 发起份额总数        | 发起份额占基金总份额比例（%） | 发起份额承诺持有期限       |
|-------------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|------------------|
| 基金管理人固有资金   | 10,001,111.22 | 11.61           | 10,001,111.22 | 11.61           | 自基金合同生效日起不少于 3 年 |
| 基金管理人高级管理人员 | -             | -               | -             | -               | -                |
| 基金经理等人员     | -             | -               | -             | -               | -                |
| 基金管理人股东     | -             | -               | -             | -               | -                |

|    |               |       |               |       |                  |
|----|---------------|-------|---------------|-------|------------------|
| 其他 | -             | -     | -             | -     | -                |
| 合计 | 10,001,111.22 | 11.61 | 10,001,111.22 | 11.61 | 自基金合同生效日起不少于 3 年 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）A | 万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）C | 万家启源稳健三个月持有期混合发起式（FOF）E |
|--------------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 基金合同生效日（2025 年 3 月 18 日）基金份额总额 | 11,827,429.39           | 115,813,897.59          | -                       |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 60,041,043.57           | 71,546,344.72           | -                       |
| 本报告期基金总申购份额                    | 14,603,203.59           | 4,643,719.13            | -                       |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 18,032,712.39           | 46,686,954.52           | -                       |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -                       | -                       | -                       |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 56,611,534.77           | 29,503,109.33           | -                       |

§ 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重大人事变动如下：

2026 年 6 月 23 日，根据托管人工作安排，聘任宋卓先生为平安银行股份有限公司资产托管

部总经理。

### 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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期末本基金持有的施罗德恒享债券型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议表决投票时间自 2026 年 5 月 26 日起至 2026 年 6 月 21 日 17:00 止，审议《关于施罗德恒享债券型证券投资基金变更基金管理人并变更注册为路博迈恒享债券型证券投资基金有关事项的议案》。本基金的表决意见为同意，根据《施罗德基金管理（中国）有限公司关于施罗德恒享债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本次基金份额持有人大会于 6 月 22 日审议并通过了上述议案，大会决议自该日起生效，具体详见该基金的相关公告。

本报告期末本基金持有的施罗德中国动力股票型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议表决投票时间自 2026 年 5 月 26 日起至 2026 年 6 月 21 日 17:00 止，审议《关于施罗德中国动力股票型证券投资基金变更基金管理人并变更注册为路博迈中国动力股票型证券投资基金有关事项的议案》。本基金的表决意见为同意，根据《施罗德基金管理（中国）有限公司关于施罗德中国动力股票型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本次基金份额持有人大会于 6 月 22 日审议并通过了上述议案，大会决议自该日起生效，具体详见该基金的相关公告。

### 10.6 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。

### 10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

#### 10.7.1 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。

#### 10.7.2 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。

#### 10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门无受到调查或处罚等情况。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门相关从业人员无受到调查或处罚等情况。

10.8 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

10.8.1 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(%) |    |
| 中银国际证券 | 2      | -    | -               | -         | -             | -  |

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。

10.8.2 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 |                  | 基金交易         |                  |
|--------|--------------|------------------|--------|--------------------|------|------------------|--------------|------------------|
|        | 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 (%) | 成交金额         | 占当期基金成交总额的比例 (%) |
| 中银国际证券 | 4,103,518.00 | 100.00           | -      | -                  | -    | -                | 6,314,330.60 | 100.00           |

10.9 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                       | 法定披露方式 | 法定披露日期          |
|----|--------------------------------------------|--------|-----------------|
| 1  | 万家基金管理有限公司关于旗下基金2025 年第 4 季度报告提示性公告        | 指定媒介   | 2026 年 1 月 21 日 |
| 2  | 万家启源稳健三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）2025 年第 4 季度报告 | 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  | 万家启源稳健三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）2025 年年度报告     | 指定媒介   | 2026 年 3 月 30 日 |
| 5  | 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 |
| 6  | 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 |
| 7  | 万家启源稳健三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）2026 年第 1 季度报告 | 指定媒介   | 2026 年 4 月 21 日 |
| 8  | 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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## § 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、《万家启源稳健三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》。
- 3、《万家启源稳健三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）托管协议》。
- 4、万家启源稳健三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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](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

2026 年 8 月 29 日