

万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

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。

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

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	57

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	57
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	57
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	58
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 盈利投资者数量占比	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
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	60
§ 9 开放式基金份额变动	60
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	61
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	61
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	万家瑞丰	
基金主代码	001488	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 6 月 19 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	上海银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	149,201,142.44 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	万家瑞丰 A	万家瑞丰 C
下属分级基金的交 易代码	001488	001489
报告期末下属分级 基金的份额总额	118,597,090.03 份	30,604,052.41 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	1、资产配置策略；2、股票投资策略（（1）定性方面、（2）定量方面、（3）存托凭证投资策略）；3、权证投资策略；4、普通债券投资策略；5、中小企业私募债券投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、证券公司短期公司债券投资策略；8、股指期货投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%
风险收益特征	本基金是混合型基金，风险高于货币市场基金和债券型基金但低于股票型基金，属于中高风险、中高预期收益的证券投资基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		万家基金管理有限公司	上海银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	兰剑	周直毅
	联系电话	021-38909626	021-68475608
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	custody@bosscn.com
客户服务电话		4008880800	95594
传真		021-38909627	021-68476901
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）	上海市黄浦区中山南路 688 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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号 37 层
邮政编码		200122	200120

法定代表人	陈广益	顾建忠
-------	-----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.wjasset.com
基金中期报告置备地点	基金管理人办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	万家瑞丰 A	万家瑞丰 C
本期已实现收益	19,281,441.32	1,430,552.68
本期利润	28,171,703.21	3,537,119.79
加权平均基金份 额本期利润	0.2472	0.3528
本期加权平均净 值利润率	12.90%	19.26%
本期基金份额净 值增长率	14.27%	14.10%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	77,037,991.61	16,818,566.50
期末可供分配基 金份额利润	0.6496	0.5496
期末基金资产净 值	245,596,849.74	59,667,379.99
期末基金份额净 值	2.0709	1.9497
3.1.3 累计期 末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净	107.09%	94.97%

值增长率		
------	--	--

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

万家瑞丰 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	16.04%	1.33%	6.60%	0.63%	9.44%	0.70%
过去六个月	14.27%	1.21%	5.04%	0.57%	9.23%	0.64%
过去一年	41.13%	1.08%	13.76%	0.51%	27.37%	0.57%
过去三年	43.90%	0.76%	23.16%	0.55%	20.74%	0.21%
过去五年	45.20%	0.62%	11.67%	0.55%	33.53%	0.07%
过去七年	80.83%	0.55%	37.28%	0.57%	43.55%	-0.02%
过去十年	96.61%	0.48%	61.24%	0.57%	35.37%	-0.09%
自基金合同生效起至今	107.09%	0.46%	36.14%	0.66%	70.95%	-0.20%

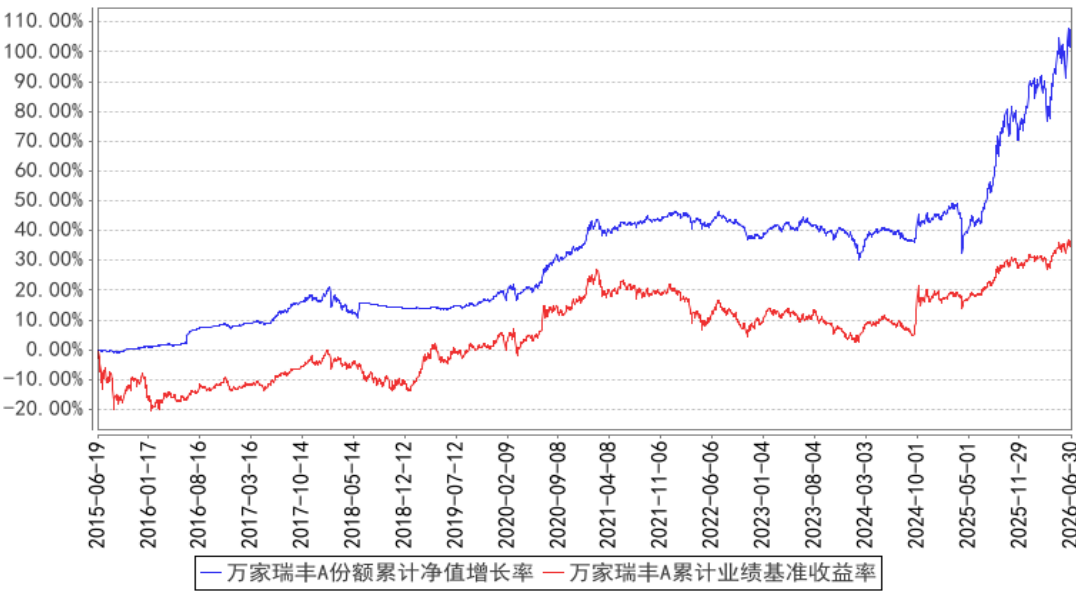
万家瑞丰 C

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	15.95%	1.32%	6.60%	0.63%	9.35%	0.69%
过去六个月	14.10%	1.21%	5.04%	0.57%	9.06%	0.64%
过去一年	40.70%	1.08%	13.76%	0.51%	26.94%	0.57%
过去三年	42.61%	0.76%	23.16%	0.55%	19.45%	0.21%
过去五年	43.01%	0.62%	11.67%	0.55%	31.34%	0.07%

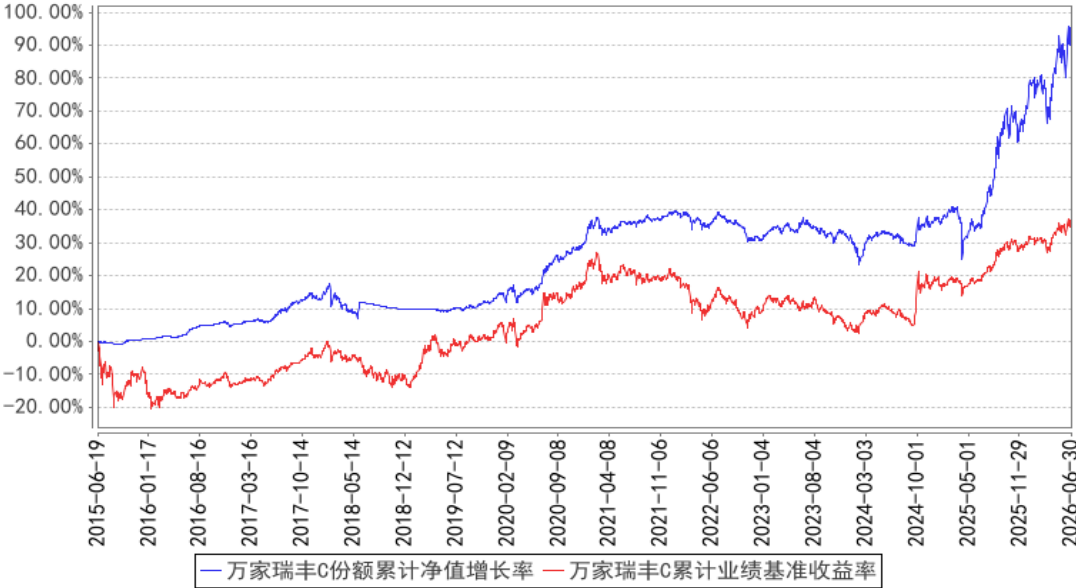
过去七年	77.26%	0.55%	37.28%	0.57%	39.98%	-0.02%
过去十年	89.59%	0.48%	61.24%	0.57%	28.35%	-0.09%
自基金合同 生效起至今	94.97%	0.46%	36.14%	0.66%	58.83%	-0.20%

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

万家瑞丰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



万家瑞丰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 2015 年 6 月 19 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		
张永强	万家中证 2000 指数增强型证券投资基金、万家元和债券型证券投资基金、万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金、万家创业板指数增强型证券投资基金、万家惠利债券型证券投资基金、万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金、万家民丰回	2023 年 1 月 3 日	-	11 年	国籍：中国；学历：复旦大学基础数学专业硕士，2019 月 7 月入职万家基金管理有限公司，现任量化投资部基金经理，历任量化投资部研究员、投资经理。曾任上海恒生聚源数据服务有限公司研发中心指标算法研究员，上海元普投资管理有限公司量化投资部量化策略研究员，上海寻乾资产管理有限公司量化投资部量化策略研究员，巨杉(上海)资产管理有限公司量化投资部量化策略研究员等职。

	报一年持有期混合型证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。				
--	---	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

数设置等进行事前控制，通过对投资交易系统的实时监控进行事中控制，通过对异常交易的监控和分析实现事后控制。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本产品策略采取量化方法进行积极的组合管理与风险控制，在力求有效跟踪中证 A500 指数基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。同时积极参与 A 股市场打新等事件性机会，增厚产品收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家瑞丰 A 的基金份额净值为 2.0709 元，本报告期基金份额净值增长率为 14.27%，同期业绩比较基准收益率为 5.04%；截至本报告期末万家瑞丰 C 的基金份额净值为 1.9497 元，本报告期基金份额净值增长率为 14.10%，同期业绩比较基准收益率为 5.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年上半年，A 股呈现极致的 K 型分化格局，科技股“一枝独秀”而多数行业承压。行业层面分化严重，在全球 AI 产业趋势与国内政策持续共振下，通信、电子行业涨幅较大，资金深度抱团算力硬件、半导体等科技主线；而传统消费板块则持续失血，共同演绎了这场极端分化的结构性行情。

展望后市，经过 7 月的调整，AI 相关板块杠杆资金已较为充分出清，市场风险释放基本完成，指数下行空间显著收敛，A 股有望逐步企稳走强。宏观层面，下半年国内经济预计延续“外需强于内需”的 K 型分化格局，7 月政治局会议定调“加大逆周期调节力度”，财政支出提速与货币适度宽松共同夯实政策底，资本市场政策更从“稳信心”升级为“提升韧性与信心”，投融资改革与中长期资金入市机制加速落地。资金层面，资金面托底力量显著，7 月股票 ETF 单月净流入约 4700 亿元，国有资本运营平台增持、上市公司回购、重要股东增持共同构筑坚实底部。总体而言，在政策呵护、盈利改善及资金面温和流入的支撑下，市场下行风险有限，A 股市场有望逐步企稳回升。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金的利润分配情况符合有关法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	19,283,755.78	24,330,176.03
结算备付金		34,395.17	-
存出保证金		120,620.33	28,987.52
交易性金融资产	6.4.7.2	285,776,029.58	225,071,008.10
其中：股票投资		285,758,029.34	225,071,008.10
基金投资		-	-
债券投资		18,000.24	-
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		52,232.23	115,888.25
应收股利		-	-
应收申购款		495,687.25	3,981.04
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		305,762,720.34	249,550,040.94
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	11,864.26
应付赎回款		39,505.25	10,377,941.50

应付管理人报酬		139,405.16	124,259.74
应付托管费		34,851.31	31,064.93
应付销售服务费		12,751.44	2,793.65
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2.62	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	271,974.83	139,031.96
负债合计		498,490.61	10,686,956.04
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	149,201,142.44	132,177,282.68
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	156,063,087.29	106,685,802.22
净资产合计		305,264,229.73	238,863,084.90
负债和净资产总计		305,762,720.34	249,550,040.94

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 149,201,142.44 份，其中万家瑞丰 A 基金份额净值 2.0709 元，基金份额总额 118,597,090.03 份；万家瑞丰 C 基金份额净值 1.9497 元，基金份额总额 30,604,052.41 份。

6.2 利润表

会计主体：万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		32,711,718.59	-1,585,161.68
1. 利息收入		51,778.23	46,511.50
其中：存款利息收入	6.4.7.10	51,778.23	42,762.43
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	3,749.07
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		21,660,827.54	2,827,458.64
其中：股票投资收益	6.4.7.11	19,544,168.70	367,203.55
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	286.12	136,969.39
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13	-	-

贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	2,116,372.72	2,323,285.70
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.17	10,996,829.00	-4,459,478.84
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.18	2,283.82	347.02
减：二、营业总支出		1,002,895.59	574,208.02
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	706,294.26	410,986.08
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	176,573.61	102,746.52
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	27,002.68	14,703.91
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		0.28	21.87
8. 其他费用	6.4.7.20	93,024.76	45,749.64
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		31,708,823.00	-2,159,369.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		31,708,823.00	-2,159,369.70
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		31,708,823.00	-2,159,369.70

6.3 净资产变动表

会计主体：万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净 资产	132,177,282.68	-	106,685,802.22	238,863,084.90

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	132,177,282.68	-	106,685,802.22	238,863,084.90
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	17,023,859.76	-	49,377,285.07	66,401,144.83
(一)、综合收益总额	-	-	31,708,823.00	31,708,823.00
(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)	17,023,859.76	-	17,668,462.07	34,692,321.83
其中：1. 基金申购款	73,102,439.55	-	66,848,007.93	139,950,447.48
2. 基金赎回款	-56,078,579.79	-	-49,179,545.86	-105,258,125.65
(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	149,201,142.44	-	156,063,087.29	305,264,229.73
项目	上年度可比期间			
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	7,973,476.47	-	3,012,600.54	10,986,077.01
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	7,973,476.47	-	3,012,600.54	10,986,077.01

资产				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	149,295,115.71	-	69,942,406.83	219,237,522.54
(一)、综合收益总额	-	-	-2,159,369.70	-2,159,369.70
(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)	149,295,115.71	-	72,101,776.53	221,396,892.24
其中：1. 基金申购款	150,581,233.12	-	72,606,059.35	223,187,292.47
2. 基金赎回款	-1,286,117.41	-	-504,282.82	-1,790,400.23
(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	157,268,592.18	-	72,955,007.37	230,223,599.55

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈广益

莫海波

尹超

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]1138 号文《关于核准万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的批准，由万家基金管理有限公司作为基金管理人于 2015 年 6 月 12 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具（2015）验字第 60778298_B18 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 2015 年 6 月 19

日正式生效，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 1,000,944,500.96 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 45,041.23 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,000,989,542.19 元，折合 1,000,989,542.19 份基金份额。本基金管理人为万家基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为上海银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、债券（含中小企业私募债、证券公司短期公司债券）、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times$ 50%+中证全债指数收益率 $\times$ 50%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本中期报告所采用的会计政策、会计估计与上年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

(一) 印花税

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

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

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

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

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

(二) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

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

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

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

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

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

(三) 企业所得税

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

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

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

(四) 个人所得税

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》的规定，对基金通过深港通投资香

港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	19,283,755.78
等于：本金	19,281,930.86
加：应计利息	1,824.92
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	19,283,755.78

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		238,415,783.32	-	285,758,029.34	47,342,246.02
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	18,000.00	0.24	18,000.24	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	18,000.00	0.24	18,000.24	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		238,433,783.32	0.24	285,776,029.58	47,342,246.02

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	18.45
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	97,572.62
其中：交易所市场	97,572.62
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	174,383.76
合计	271,974.83

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

万家瑞丰 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	125,632,800.78	125,632,800.78
本期申购	48,561,902.74	48,561,902.74
本期赎回（以“-”号填列）	-55,597,613.49	-55,597,613.49
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	118,597,090.03	118,597,090.03

万家瑞丰 C

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

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,544,481.90	6,544,481.90
本期申购	24,540,536.81	24,540,536.81
本期赎回（以“-”号填列）	-480,966.30	-480,966.30
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	30,604,052.41	30,604,052.41

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

万家瑞丰 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	56,204,174.69	45,843,429.43	102,047,604.12
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	56,204,174.69	45,843,429.43	102,047,604.12
本期利润	19,281,441.32	8,890,261.89	28,171,703.21
本期基金份额交易产生的变动数	1,552,375.60	-4,771,923.22	-3,219,547.62
其中：基金申购款	29,679,898.54	15,881,538.86	45,561,437.40
基金赎回款	-28,127,522.94	-20,653,462.08	-48,780,985.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	77,037,991.61	49,961,768.10	126,999,759.71

万家瑞丰 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,367,163.85	2,271,034.25	4,638,198.10
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,367,163.85	2,271,034.25	4,638,198.10
本期利润	1,430,552.68	2,106,567.11	3,537,119.79
本期基金份额交易产生的变动数	13,020,849.97	7,867,159.72	20,888,009.69
其中：基金申购款	13,240,903.21	8,045,667.32	21,286,570.53
基金赎回款	-220,053.24	-178,507.60	-398,560.84
本期已分配利润	-	-	-

本期末	16,818,566.50	12,244,761.08	29,063,327.58
-----	---------------	---------------	---------------

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	51,484.98
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	144.57
其他	148.68
合计	51,778.23

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	19,544,168.70
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	19,544,168.70

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	105,999,742.94
减：卖出股票成本总额	86,279,838.73
减：交易费用	175,735.51
买卖股票差价收入	19,544,168.70

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	78.12
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	208.00
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	286.12
----	--------

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	804,581.04
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	800,576.00
减：应计利息总额	3,797.04
减：交易费用	—
买卖债券差价收入	208.00

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,116,372.72
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	2,116,372.72

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1. 交易性金融资产	10,996,829.00
股票投资	10,996,829.00
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—

权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	10,996,829.00

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,268.09
基金转换费收入	15.73
合计	2,283.82

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	41.00
账户维护费	18,600.00
合计	93,024.76

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
上海银行股份有限公司（“上海银行”）	基金托管人
中泰证券股份有限公司（“中泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
中泰证券	240,639,902.64	100.00	232,673,125.37	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
中泰证券	1,601,360.00	100.00	31,946,274.11	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券回 购 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（%）
中泰证券	-	-	44,000,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
中泰证券	107,302.79	100.00	97,572.62	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			

	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
中泰证券	103,745.36	100.00	4,424.64	100.00

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	706,294.26	410,986.08
其中：应支付销售机构的客户维护费	82,897.01	47,572.37
应支付基金管理人的净管理费	623,397.25	363,413.71

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	176,573.61	102,746.52

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15%的年费率计提。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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家瑞丰 A	万家瑞丰 C	合计
万家基金	-	108.69	108.69
中泰证券	-	5.92	5.92
合计	-	114.61	114.61
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家瑞丰 A	万家瑞丰 C	合计
万家基金	-	124.05	124.05
中泰证券	-	3.62	3.62
合计	-	127.67	127.67

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 0.30%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.30% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海银行	19,283,755.78	51,484.98	14,111,554.09	41,964.78

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方所承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间没有需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股流通受	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-

				限						
001237	惠康科技	2026年5月15日	6个月	新股流通受限	53.26	58.74	101	5,379.26	5,932.74	-
001248	华润新能源	2026年6月24日	6个月	新股流通受限	10.11	10.11	7,732	78,170.52	78,170.52	-
001248	华润新能源	2026年6月24日	1个月内(含)	新股未上市	10.11	10.11	3,313	33,494.43	33,494.43	-
001257	盛龙股份	2026年3月24日	6个月	新股流通受限	7.82	20.74	941	7,358.62	19,516.34	-
001312	福恩股份	2026年4月14日	6个月	新股流通受限	18.38	16.78	84	1,543.92	1,409.52	-
001365	天海电子	2026年5月11日	6个月	新股流通受限	27.19	31.31	209	5,682.71	6,543.79	-
001399	惠科股份	2026年6月16日	6个月	新股流通受限	10.12	27.73	1,369	13,854.28	37,962.37	-
301513	尚水	2026年4	6个月	新股	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-

	智能	月 10 日		流通受限						
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	196	2,606.80	10,105.76	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	234	3,254.94	7,597.98	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	349	16,081.92	161,702.17	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	498	3,525.84	14,143.20	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	80	4,640.00	8,972.80	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	212	14,767.92	33,932.72	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通	78.38	121.77	52	4,075.76	6,332.04	-

				受限						
301687	新广益	2025年12月24日	6个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026年3月31日	6个月	新股流通受限	24.68	86.80	144	3,553.92	12,499.20	-
601112	振石股份	2026年1月21日	6个月	新股流通受限	11.18	17.59	240	2,683.20	4,221.60	-
603284	林平发展	2026年2月3日	6个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026年4月9日	6个月	新股流通受限	33.49	33.93	41	1,373.09	1,391.13	-
603352	至信股份	2026年1月8日	6个月	新股流通受限	21.88	25.52	87	1,903.56	2,220.24	-
603407	长裕集团	2026年4月29日	6个月	新股流通受限	13.86	73.46	113	1,566.18	8,300.98	-

603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	148	2,619.60	12,479.36	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	108	4,425.84	33,284.52	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,050	18,396.00	37,716.00	-
688765	禾元生物	2025 年 10 月 16 日	9 个月	新股流通受限	29.06	48.56	4,600	133,676.00	223,376.00	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	9 个月	新股流通受限	22.68	42.16	2,105	47,741.40	88,746.80	-
688783	西安奕材	2025 年 10 月 20 日	9 个月	新股流通受限	8.62	57.42	11,216	96,681.92	644,022.72	-
688785	恒运	2026 年 1	6 个月	新股	92.18	463.15	65	5,991.70	30,104.75	-

	昌	月 20 日		流 通 受 限						
688795	摩 尔 线 程	2025 年 11 月 26 日	9 个月	新 股 流 通 受 限	114.28	676.94	886	101,252.08	599,768.84	-
688797	臻 宝 科 技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	44.56	468.67	103	4,589.68	48,273.01	-
688802	沐 曦 股 份	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新 股 流 通 受 限	104.66	768.89	666	69,703.56	512,080.74	-
688808	联 讯 仪 器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	81.88	1,584.33	56	4,585.28	88,722.48	-
688811	有 研 复 材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	6.41	24.13	712	4,563.92	17,180.56	-
688813	泰 金 新 能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	26.28	172.09	173	4,546.44	29,771.57	-
688816	易 思 维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新 股 流 通	55.95	57.10	104	5,818.80	5,938.40	-

				受限						
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	752	7,121.44	52,745.28	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	332	6,533.76	46,974.68	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
111025	圣泉转债	2026 年 6 月 25 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	180	18,000.00	18,000.24	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	1,700	553,258.18	1,495,201.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	18,000.24	-
未评级	-	-

合计	18,000.24	-
----	-----------	---

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6. 4. 13. 4. 1. 1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	19,283,755.78	-	-	-	-	-	19,283,755.78
结算备付金	34,395.17	-	-	-	-	-	34,395.17
存出保证金	120,620.33	-	-	-	-	-	120,620.33
交易性金融资产	-	-	18,000.24	-	-	285,758,029.34	285,776,029.58
应收申购款	-	-	-	-	-	495,687.25	495,687.25
应收清算款	-	-	-	-	-	52,232.23	52,232.23
资产总计	19,438,771.28	-	18,000.24	-	-	286,305,948.82	305,762,720.34
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	39,505.25	39,505.25
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	139,405.16	139,405.16
应付托管费	-	-	-	-	-	34,851.31	34,851.31
应付销售服务费	-	-	-	-	-	12,751.44	12,751.44
应交税费	-	-	-	-	-	2.62	2.62
其他负债	-	-	-	-	-	271,974.83	271,974.83
负债总计	-	-	-	-	-	498,490.61	498,490.61
利率敏感度缺口	19,438,771.28	-	18,000.24	-	-	285,807,458.21	305,264,229.73
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	24,330,176.03	-	-	-	-	-	24,330,176.03
存出保证金	28,987.52	-	-	-	-	-	28,987.52
交易性金融资产	-	-	-	-	-	225,071,008.10	225,071,008.10
应收申购款	100.00	-	-	-	-	3,881.04	3,981.04
应收清算款	-	-	-	-	-	115,888.25	115,888.25
资产总计	24,359,263.55	-	-	-	-	225,190,777.39	249,550,040.94
负债							

应付赎回款	-	-	-	-	-	10,377,941.50	10,377,941.50
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	124,259.74	124,259.74
应付托管费	-	-	-	-	-	31,064.93	31,064.93
应付清算款	-	-	-	-	-	11,864.26	11,864.26
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,793.65	2,793.65
其他负债	-	-	-	-	-	139,031.96	139,031.96
负债总计	-	-	-	-	-	10,686,956.04	10,686,956.04
利率敏感度缺口	24,359,263.55	-	-	-	-	214,503,821.35	238,863,084.90

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	261.81	-
	市场利率上升 25 个基点	-261.81	-

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	285,758,029.34	93.61	225,071,008.10	94.23
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	285,758,029.34	93.61	225,071,008.10	94.23

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除股票基准指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	股票基准指数上升 100 个基点	3,464,519.08	2,590,666.15
	股票基准指数下降 100 个基点	-3,464,519.08	-2,590,666.15

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：
第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	281,306,948.20	221,827,814.81
第二层次	1,624,866.19	1,462,836.00
第三层次	2,844,215.19	1,780,357.29
合计	285,776,029.58	225,071,008.10

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	285,758,029.34	93.46
	其中：股票	285,758,029.34	93.46
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	18,000.24	0.01
	其中：债券	18,000.24	0.01
	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	19,318,150.95	6.32

8	其他各项资产	668,539.81	0.22
9	合计	305,762,720.34	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	899,927.00	0.29
B	采矿业	11,815,775.34	3.87
C	制造业	203,541,160.56	66.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,363,914.95	2.08
E	建筑业	3,490,395.00	1.14
F	批发和零售业	2,194,059.00	0.72
G	交通运输、仓储和邮政业	5,955,328.46	1.95
H	住宿和餐饮业	133,497.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,216,838.65	4.98
J	金融业	27,698,278.98	9.07
K	房地产业	1,294,162.00	0.42
L	租赁和商务服务业	1,944,991.60	0.64
M	科学研究和技术服务业	3,421,811.00	1.12
N	水利、环境和公共设施管理业	492,421.80	0.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	557,099.00	0.18
R	文化、体育和娱乐业	219,859.00	0.07
S	综合	518,510.00	0.17
	合计	285,758,029.34	93.61

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	9,700	12,319,000.00	4.04
2	300750	宁德时代	22,803	8,961,807.03	2.94
3	300502	新易盛	14,608	8,867,056.00	2.90
4	600519	贵州茅台	5,300	6,283,097.00	2.06
5	603986	兆易创新	5,800	4,727,000.00	1.55
6	601318	中国平安	92,000	4,392,080.00	1.44

7	688256	寒武纪	2,633	4,201,083.15	1.38
8	600036	招商银行	106,400	3,777,200.00	1.24
9	601899	紫金矿业	142,900	3,592,506.00	1.18
10	002371	北方华创	3,685	3,259,603.60	1.07
11	000333	美的集团	41,900	3,164,707.00	1.04
12	002475	立讯精密	43,900	3,090,560.00	1.01
13	688008	澜起科技	9,701	3,006,339.90	0.98
14	688041	海光信息	7,908	2,928,332.40	0.96
15	688012	中微公司	6,247	2,926,719.50	0.96
16	002384	东山精密	11,100	2,912,085.00	0.95
17	600900	长江电力	106,100	2,808,467.00	0.92
18	688981	中芯国际	17,447	2,770,932.54	0.91
19	000725	京东方 A	312,300	2,710,764.00	0.89
20	603259	药明康德	21,400	2,664,514.00	0.87
21	601166	兴业银行	146,800	2,431,008.00	0.80
22	600030	中信证券	83,800	2,407,574.00	0.79
23	300394	天孚通信	7,872	2,382,696.96	0.78
24	300059	东方财富	108,721	2,215,733.98	0.73
25	600183	生益科技	12,600	2,184,840.00	0.72
26	600276	恒瑞医药	38,600	2,008,744.00	0.66
27	300274	阳光电源	12,574	1,999,517.48	0.66
28	601398	工商银行	280,500	1,983,135.00	0.65
29	300408	三环集团	11,600	1,936,040.00	0.63
30	002594	比亚迪	23,400	1,864,980.00	0.61
31	600487	亨通光电	17,000	1,858,780.00	0.61
32	300476	胜宏科技	5,200	1,801,436.00	0.59
33	002463	沪电股份	11,700	1,787,760.00	0.59
34	601211	国泰海通	97,900	1,781,780.00	0.58
35	000988	华工科技	8,600	1,587,646.00	0.52
36	688525	佰维存储	3,200	1,583,136.00	0.52
37	601288	农业银行	249,100	1,512,037.00	0.50
38	688498	源杰科技	800	1,508,800.00	0.49
39	600176	中国巨石	20,600	1,501,328.00	0.49
40	688072	拓荆科技	1,700	1,495,201.00	0.49
41	601328	交通银行	231,200	1,486,616.00	0.49
42	301308	江波龙	2,100	1,477,980.00	0.48
43	000651	格力电器	38,500	1,443,750.00	0.47
44	600522	中天科技	23,700	1,438,116.00	0.47
45	603019	中科曙光	12,600	1,351,098.00	0.44
46	603993	洛阳钼业	75,700	1,328,535.00	0.44
47	600150	中国船舶	39,100	1,321,189.00	0.43
48	600887	伊利股份	54,900	1,315,404.00	0.43
49	688521	芯原股份	3,500	1,298,990.00	0.43

50	300604	长川科技	3,800	1,297,396.00	0.43
51	600584	长电科技	12,400	1,284,020.00	0.42
52	000338	潍柴动力	46,200	1,258,950.00	0.41
53	000858	五 粮 液	16,700	1,235,800.00	0.40
54	601816	京沪高铁	254,500	1,152,885.00	0.38
55	688347	华虹宏力	3,400	1,143,420.00	0.37
56	600309	万华化学	16,200	1,108,242.00	0.36
57	300124	汇川技术	16,400	1,087,812.00	0.36
58	002415	海康威视	31,800	1,087,560.00	0.36
59	002281	光迅科技	4,200	1,079,148.00	0.35
60	002008	大族激光	7,100	1,065,781.00	0.35
61	688120	华海清科	3,278	1,056,106.04	0.35
62	002916	深南电路	2,300	1,053,170.00	0.35
63	600111	北方稀土	21,900	1,052,295.00	0.34
64	300136	信维通信	8,400	1,001,700.00	0.33
65	000063	中兴通讯	27,600	998,844.00	0.33
66	600089	特变电工	43,900	987,750.00	0.32
67	600000	浦发银行	114,500	985,845.00	0.32
68	300857	协创数据	2,900	985,710.00	0.32
69	601857	中国石油	112,400	975,632.00	0.32
70	601088	中国神华	23,800	929,152.00	0.30
71	300433	蓝思科技	17,100	917,586.00	0.30
72	002028	思源电气	5,300	916,900.00	0.30
73	600031	三一重工	50,900	879,552.00	0.29
74	300014	亿纬锂能	13,100	851,893.00	0.28
75	601601	中国太保	29,800	849,896.00	0.28
76	002050	三花智控	19,300	845,919.00	0.28
77	300475	香农芯创	2,800	840,000.00	0.28
78	000001	平安银行	83,300	837,165.00	0.27
79	002714	牧原股份	23,500	822,265.00	0.27
80	300223	君正股份	3,300	821,370.00	0.27
81	000792	盐湖股份	27,000	815,130.00	0.27
82	600549	厦门钨业	9,500	809,400.00	0.27
83	002156	通富微电	10,600	804,222.00	0.26
84	600406	国电南瑞	34,800	795,180.00	0.26
85	002353	杰瑞股份	5,200	793,000.00	0.26
86	601668	中国建筑	179,100	777,294.00	0.25
87	000657	中钨高新	7,800	746,616.00	0.24
88	002436	兴森科技	14,600	743,870.00	0.24
89	601919	中远海控	53,900	714,714.00	0.23
90	002602	世纪华通	50,600	713,460.00	0.23
91	300760	迈瑞医疗	5,200	706,316.00	0.23
92	601988	中国银行	122,900	702,988.00	0.23

93	603501	豪威集团	7,400	701,890.00	0.23
94	300054	鼎龙股份	6,600	699,402.00	0.23
95	601728	中国电信	134,600	698,574.00	0.23
96	600660	福耀玻璃	13,800	696,072.00	0.23
97	601012	隆基绿能	52,500	688,800.00	0.23
98	601225	陕西煤业	33,600	683,760.00	0.22
99	600941	中国移动	7,900	680,427.00	0.22
100	002230	科大讯飞	16,600	677,944.00	0.22
101	600690	海尔智家	32,600	665,366.00	0.22
102	688783	西安奕材	11,416	656,406.72	0.22
103	002352	顺丰控股	20,800	650,208.00	0.21
104	601985	中国核电	71,300	643,839.00	0.21
105	002709	天赐材料	12,300	632,589.00	0.21
106	002938	鹏鼎控股	6,000	632,280.00	0.21
107	603799	华友钴业	13,100	632,206.00	0.21
108	600160	巨化股份	11,700	620,217.00	0.20
109	300757	罗博特科	1,000	619,000.00	0.20
110	688777	中控技术	5,257	617,697.50	0.20
111	000977	浪潮信息	8,800	616,000.00	0.20
112	300033	同花顺	2,500	602,500.00	0.20
113	688795	摩尔线程	886	599,768.84	0.20
114	002851	麦格米特	3,500	585,130.00	0.19
115	300442	润泽科技	7,000	581,490.00	0.19
116	688126	沪硅产业	14,411	574,854.79	0.19
117	002202	金风科技	23,900	571,210.00	0.19
118	000425	徐工机械	70,400	569,536.00	0.19
119	000938	紫光股份	19,700	568,542.00	0.19
120	300346	南大光电	6,120	567,018.00	0.19
121	601600	中国铝业	68,700	564,714.00	0.18
122	600028	中国石化	126,400	563,744.00	0.18
123	600938	中国海油	20,600	559,290.00	0.18
124	600460	士兰微	10,100	552,066.00	0.18
125	002466	天齐锂业	8,900	545,748.00	0.18
126	002600	领益智造	31,400	544,476.00	0.18
127	601766	中国中车	104,500	543,400.00	0.18
128	300661	圣邦股份	3,760	539,484.80	0.18
129	600050	中国联通	134,200	536,800.00	0.18
130	002837	英维克	6,590	524,300.40	0.17
131	002138	顺络电子	7,100	519,010.00	0.17
132	002407	多氟多	10,300	517,369.00	0.17
133	002185	华天科技	23,100	515,361.00	0.17
134	002049	紫光国微	5,800	514,750.00	0.17
135	002080	中材科技	5,700	513,000.00	0.17

136	688802	沐曦股份	666	512,080.74	0.17
137	601628	中国人寿	14,400	509,040.00	0.17
138	002179	中航光电	11,000	508,200.00	0.17
139	300567	精测电子	1,600	508,160.00	0.17
140	000568	泸州老窖	6,400	496,128.00	0.16
141	688002	睿创微纳	3,200	495,008.00	0.16
142	601100	恒立液压	4,600	494,776.00	0.16
143	601872	招商轮船	27,900	490,203.00	0.16
144	600879	航天电子	22,900	487,541.00	0.16
145	002241	歌尔股份	21,500	484,395.00	0.16
146	300395	菲利华	3,600	481,428.00	0.16
147	603288	海天味业	14,400	477,504.00	0.16
148	601006	大秦铁路	102,400	472,064.00	0.15
149	000408	藏格矿业	6,800	471,376.00	0.15
150	601658	邮储银行	95,500	470,815.00	0.15
151	300390	天华新能	5,000	467,550.00	0.15
152	688469	芯联集成	43,700	463,657.00	0.15
153	605117	德业股份	4,340	460,821.20	0.15
154	688017	绿的谐波	1,100	459,646.00	0.15
155	601888	中国中免	8,500	456,535.00	0.15
156	600905	三峡能源	122,700	455,217.00	0.15
157	600489	中金黄金	25,200	454,860.00	0.15
158	600893	航发动力	11,500	440,910.00	0.14
159	000630	铜陵有色	69,100	439,476.00	0.14
160	688396	华润微	4,500	438,975.00	0.14
161	600673	东阳光	13,000	436,540.00	0.14
162	600010	包钢股份	194,300	433,289.00	0.14
163	002273	水晶光电	12,100	429,308.00	0.14
164	601689	拓普集团	7,600	428,792.00	0.14
165	300058	蓝色光标	31,160	428,761.60	0.14
166	601127	赛力斯	7,000	428,750.00	0.14
167	002027	分众传媒	86,800	420,112.00	0.14
168	600118	中国卫星	5,100	418,455.00	0.14
169	300037	新宙邦	4,500	417,825.00	0.14
170	688271	联影医疗	4,100	415,043.00	0.14
171	600760	中航沈飞	9,900	406,890.00	0.13
172	600019	宝钢股份	74,800	406,164.00	0.13
173	688111	金山办公	1,900	404,795.00	0.13
174	000426	兴业银锡	12,200	402,112.00	0.13
175	000807	云铝股份	17,900	396,306.00	0.13
176	300751	迈为股份	1,400	395,444.00	0.13
177	601168	西部矿业	14,400	390,816.00	0.13
178	600362	江西铜业	9,000	389,700.00	0.13

179	600989	宝丰能源	19,100	388,303.00	0.13
180	600104	上汽集团	39,700	387,472.00	0.13
181	300450	先导智能	9,500	386,840.00	0.13
182	605589	圣泉集团	6,000	381,420.00	0.12
183	600875	东方电气	13,200	379,764.00	0.12
184	002001	新 和 成	13,300	377,986.00	0.12
185	600988	赤峰黄金	14,300	376,376.00	0.12
186	601727	上海电气	53,700	375,900.00	0.12
187	600885	宏发股份	10,800	372,492.00	0.12
188	002738	中矿资源	6,300	371,637.00	0.12
189	600667	太极实业	12,700	370,586.00	0.12
190	601390	中国中铁	88,800	370,296.00	0.12
191	002422	科伦药业	9,500	365,940.00	0.12
192	002126	银轮股份	7,300	363,540.00	0.12
193	000960	锡业股份	8,500	362,865.00	0.12
194	600392	盛和资源	12,100	360,217.00	0.12
195	688099	晶晨股份	3,500	360,150.00	0.12
196	000538	云南白药	7,600	360,012.00	0.12
197	600795	国电电力	76,700	358,189.00	0.12
198	600547	山东黄金	15,500	357,895.00	0.12
199	000831	中国稀土	6,400	355,136.00	0.12
200	600585	海螺水泥	20,800	352,560.00	0.12
201	600418	江淮汽车	13,600	351,288.00	0.12
202	601669	中国电建	74,000	347,800.00	0.11
203	600141	兴发集团	7,400	347,578.00	0.11
204	300316	晶盛机电	5,600	338,240.00	0.11
205	600096	云天化	11,100	337,440.00	0.11
206	002648	卫星化学	14,300	335,907.00	0.11
207	002129	TCL 中环	27,900	335,358.00	0.11
208	002812	恩捷股份	5,000	334,550.00	0.11
209	300015	爱尔眼科	40,400	333,704.00	0.11
210	601179	中国西电	22,000	328,240.00	0.11
211	301358	湖南裕能	4,300	326,241.00	0.11
212	600346	恒力石化	18,400	325,864.00	0.11
213	600482	中国动力	9,900	324,720.00	0.11
214	002195	岩山科技	49,100	321,114.00	0.11
215	601868	中国能建	120,200	320,934.00	0.11
216	300782	卓胜微	2,900	317,782.00	0.10
217	600497	驰宏锌锗	26,200	317,282.00	0.10
218	002558	巨人网络	11,500	316,940.00	0.10
219	000066	中国长城	16,600	316,230.00	0.10
220	300418	昆仑万维	7,800	314,808.00	0.10
221	600580	卧龙电驱	9,500	314,450.00	0.10

222	600066	宇通客车	11,500	308,315.00	0.10
223	600426	华鲁恒升	12,800	306,176.00	0.10
224	000625	长安汽车	42,700	306,159.00	0.10
225	600157	永泰能源	189,100	304,451.00	0.10
226	600895	张江高科	8,100	301,725.00	0.10
227	002532	天山铝业	27,800	298,294.00	0.10
228	000157	中联重科	42,300	294,831.00	0.10
229	600711	盛屯矿业	26,700	292,899.00	0.10
230	002340	格林美	44,300	292,823.00	0.10
231	600011	华能国际	38,100	289,179.00	0.09
232	000933	神火股份	13,600	288,320.00	0.09
233	600048	保利发展	62,200	287,986.00	0.09
234	600143	金发科技	18,400	284,280.00	0.09
235	300803	指南针	3,100	284,177.00	0.09
236	688036	传音控股	4,813	283,726.35	0.09
237	600438	通威股份	23,400	283,374.00	0.09
238	300017	网宿科技	21,600	281,016.00	0.09
239	600115	中国东航	73,700	280,797.00	0.09
240	002131	利欧股份	58,700	278,825.00	0.09
241	002236	大华股份	16,900	278,681.00	0.09
242	600570	恒生电子	13,100	277,589.00	0.09
243	600886	国投电力	20,800	276,848.00	0.09
244	002493	荣盛石化	25,700	276,275.00	0.09
245	002821	凯莱英	1,700	275,400.00	0.09
246	605499	东鹏饮料	2,220	274,014.60	0.09
247	600352	浙江龙盛	22,600	273,686.00	0.09
248	002456	欧菲光	28,900	273,394.00	0.09
249	600436	片仔癀	2,500	273,200.00	0.09
250	603659	璞泰来	9,300	269,049.00	0.09
251	601233	桐昆股份	12,400	268,460.00	0.09
252	003816	中国广核	68,200	266,662.00	0.09
253	601360	三六零	30,400	264,176.00	0.09
254	601058	赛轮轮胎	22,900	264,037.00	0.09
255	688047	龙芯中科	1,700	262,939.00	0.09
256	000301	东方盛虹	22,800	261,060.00	0.09
257	600026	中远海能	14,400	258,336.00	0.08
258	300759	康龙化成	8,900	257,477.00	0.08
259	002074	国轩高科	9,300	255,843.00	0.08
260	688578	艾力斯	2,300	251,160.00	0.08
261	600009	上海机场	10,800	249,480.00	0.08
262	600196	复星医药	11,100	249,417.00	0.08
263	300438	鹏辉能源	3,000	248,550.00	0.08
264	688213	思特威	2,300	246,261.00	0.08

265	000768	中航西飞	12,000	245,760.00	0.08
266	601111	中国国航	40,400	244,420.00	0.08
267	000975	山金国际	14,300	243,100.00	0.08
268	300207	欣旺达	12,800	243,072.00	0.08
269	300001	特锐德	6,400	242,112.00	0.08
270	600029	南方航空	46,700	241,906.00	0.08
271	600415	小商品城	23,800	241,808.00	0.08
272	002472	双环传动	5,800	240,758.00	0.08
273	300458	全志科技	6,100	240,706.00	0.08
274	688122	西部超导	3,800	238,678.00	0.08
275	600219	南山铝业	59,700	238,203.00	0.08
276	601186	中国铁建	39,900	237,405.00	0.08
277	002517	恺英网络	14,600	237,250.00	0.08
278	600674	川投能源	16,700	236,639.00	0.08
279	002128	电投能源	10,200	235,824.00	0.08
280	002601	龙佰集团	14,300	235,664.00	0.08
281	601117	中国化学	31,800	233,730.00	0.08
282	601877	正泰电器	9,300	233,151.00	0.08
283	300115	长盈精密	8,300	231,902.00	0.08
284	600233	圆通速递	14,700	231,525.00	0.08
285	603129	春风动力	900	230,220.00	0.08
286	002595	豪迈科技	4,940	230,204.00	0.08
287	688235	百济神州	900	229,149.00	0.08
288	600372	中航机载	21,000	227,850.00	0.07
289	002155	湖南黄金	9,500	226,765.00	0.07
290	301236	软通动力	5,300	224,985.00	0.07
291	688765	禾元生物	4,600	223,376.00	0.07
292	300568	星源材质	11,678	218,612.16	0.07
293	002465	海格通信	17,000	217,090.00	0.07
294	000963	华东医药	7,700	216,524.00	0.07
295	300454	深信服	2,200	211,640.00	0.07
296	300347	泰格医药	4,400	211,200.00	0.07
297	600741	华域汽车	13,500	209,520.00	0.07
298	002130	沃尔核材	11,000	208,560.00	0.07
299	300024	机器人	10,700	206,831.00	0.07
300	688506	百利天恒	700	205,821.00	0.07
301	603650	彤程新材	2,100	205,758.00	0.07
302	002920	德赛西威	2,500	203,750.00	0.07
303	002497	雅化集团	10,000	203,700.00	0.07
304	001979	招商蛇口	31,300	201,259.00	0.07
305	300012	华测检测	14,500	200,970.00	0.07
306	000878	云南铜业	12,600	200,088.00	0.07
307	000034	神州数码	7,100	197,025.00	0.06

308	300083	创世纪	14,400	196,128.00	0.06
309	002444	巨星科技	6,300	195,930.00	0.06
310	002271	东方雨虹	16,500	195,855.00	0.06
311	688331	荣昌生物	1,500	195,390.00	0.06
312	688676	金盘科技	2,300	194,672.00	0.06
313	002414	高德红外	14,600	193,596.00	0.06
314	000733	振华科技	3,400	192,576.00	0.06
315	300496	中科创达	3,100	191,549.00	0.06
316	601021	春秋航空	4,200	191,436.00	0.06
317	002432	九安医疗	2,700	190,836.00	0.06
318	300866	安克创新	1,800	188,100.00	0.06
319	300474	景嘉微	3,100	187,488.00	0.06
320	002756	永兴材料	3,300	186,912.00	0.06
321	688266	泽璟制药	1,600	186,656.00	0.06
322	601319	中国人保	27,600	186,576.00	0.06
323	600699	均胜电子	8,500	183,685.00	0.06
324	603979	金诚信	3,100	182,993.00	0.06
325	300763	锦浪科技	2,000	180,700.00	0.06
326	601615	明阳智能	15,600	180,492.00	0.06
327	002078	太阳纸业	14,400	179,856.00	0.06
328	000661	长春高新	2,700	179,820.00	0.06
329	601677	明泰铝业	10,800	179,280.00	0.06
330	300142	沃森生物	13,800	179,262.00	0.06
331	300748	金力永磁	5,800	178,930.00	0.06
332	300432	富临精工	8,900	178,801.00	0.06
333	300073	当升科技	3,700	177,748.00	0.06
334	000423	东阿阿胶	3,900	176,904.00	0.06
335	603606	东方电缆	4,260	176,832.60	0.06
336	601800	中国交建	30,900	176,439.00	0.06
337	002025	航天电器	2,300	175,306.00	0.06
338	600039	四川路桥	22,400	175,168.00	0.06
339	688599	天合光能	12,400	175,088.00	0.06
340	300919	中伟新材	4,000	175,000.00	0.06
341	600226	亨通股份	18,200	174,538.00	0.06
342	002252	上海莱士	40,000	173,600.00	0.06
343	688608	恒玄科技	1,020	170,533.80	0.06
344	603087	甘李药业	3,000	170,280.00	0.06
345	688223	晶科能源	35,600	169,100.00	0.06
346	688169	石头科技	1,760	167,147.20	0.05
347	600588	用友网络	17,900	164,322.00	0.05
348	001965	招商公路	17,800	163,048.00	0.05
349	601633	长城汽车	10,800	162,972.00	0.05
350	300724	捷佳伟创	2,300	162,380.00	0.05

351	301666	大普微	349	161,702.17	0.05
352	002064	华峰化学	17,000	161,330.00	0.05
353	000786	北新建材	8,800	159,192.00	0.05
354	002831	裕同科技	4,400	156,464.00	0.05
355	002294	信立泰	4,800	153,072.00	0.05
356	300677	英科医疗	3,900	152,763.00	0.05
357	688180	君实生物	4,500	152,190.00	0.05
358	688390	固德威	1,400	151,914.00	0.05
359	000519	中兵红箭	7,200	151,704.00	0.05
360	603806	福斯特	9,000	151,110.00	0.05
361	600516	方大炭素	24,400	150,548.00	0.05
362	600177	雅戈尔	19,900	149,847.00	0.05
363	601618	中国中冶	61,400	149,816.00	0.05
364	601607	上海医药	9,700	149,380.00	0.05
365	688065	凯赛生物	3,100	148,335.00	0.05
366	302132	中航成飞	2,500	145,800.00	0.05
367	000623	吉林敖东	8,200	145,386.00	0.05
368	603260	合盛硅业	3,000	144,780.00	0.05
369	000617	中油资本	21,900	144,321.00	0.05
370	300699	光威复材	5,000	143,250.00	0.05
371	300832	新产业	3,400	142,800.00	0.05
372	002085	万丰奥威	12,800	141,952.00	0.05
373	300251	光线传媒	12,700	140,843.00	0.05
374	002459	晶澳科技	17,200	139,320.00	0.05
375	300972	万辰集团	800	138,728.00	0.05
376	600085	同仁堂	6,000	138,660.00	0.05
377	002318	久立特材	5,800	138,620.00	0.05
378	688472	阿特斯	12,800	138,496.00	0.05
379	002065	东华软件	19,300	137,802.00	0.05
380	605090	九丰能源	3,700	137,529.00	0.05
381	300409	道氏技术	6,900	137,517.00	0.05
382	688188	柏楚电子	1,288	137,429.60	0.05
383	002266	浙富控股	27,100	137,126.00	0.04
384	300558	贝达药业	2,100	136,647.00	0.04
385	300342	天银机电	2,900	136,300.00	0.04
386	002044	美年健康	26,900	135,307.00	0.04
387	000400	许继电气	6,200	134,540.00	0.04
388	002405	四维图新	20,600	133,282.00	0.04
389	300003	乐普医疗	11,200	132,720.00	0.04
390	603596	伯特利	5,332	132,446.88	0.04
391	688617	惠泰医疗	725	131,631.00	0.04
392	600862	中航高科	7,300	131,619.00	0.04
393	601216	君正集团	29,400	131,124.00	0.04

394	600521	华海药业	9,100	131,040.00	0.04
395	002223	鱼跃医疗	5,100	130,866.00	0.04
396	000999	华润三九	5,770	129,767.30	0.04
397	000032	深桑达 A	5,200	129,740.00	0.04
398	000039	中集集团	15,800	128,138.00	0.04
399	301550	斯菱智驱	1,400	128,002.00	0.04
400	603766	隆鑫通用	10,700	127,651.00	0.04
401	600704	物产中大	26,800	126,496.00	0.04
402	600803	新奥股份	8,000	126,400.00	0.04
403	688005	容百科技	4,100	125,460.00	0.04
404	600312	平高电气	7,100	125,386.00	0.04
405	600332	白云山	6,200	124,248.00	0.04
406	000967	盈峰环境	11,700	123,201.00	0.04
407	000887	中鼎股份	6,800	121,652.00	0.04
408	300122	智飞生物	10,400	121,576.00	0.04
409	600765	中航重机	9,400	121,448.00	0.04
410	000830	鲁西化工	10,000	120,000.00	0.04
411	603605	珀莱雅	2,000	119,840.00	0.04
412	600153	建发股份	15,000	118,950.00	0.04
413	600166	福田汽车	40,700	118,437.00	0.04
414	688116	天奈科技	3,100	118,420.00	0.04
415	002007	华兰生物	9,500	115,805.00	0.04
416	002410	广联达	14,140	115,382.40	0.04
417	600323	瀚蓝环境	4,200	115,332.00	0.04
418	300896	爱美客	1,300	113,360.00	0.04
419	001248	华润新能源	11,045	111,664.95	0.04
420	603568	伟明环保	7,160	110,120.80	0.04
421	600398	海澜之家	20,800	108,784.00	0.04
422	601799	星宇股份	1,200	108,744.00	0.04
423	002389	航天彩虹	6,100	108,397.00	0.04
424	002603	以岭药业	7,200	108,000.00	0.04
425	688114	华大智造	2,100	107,268.00	0.04
426	600529	山东药玻	5,800	107,010.00	0.04
427	688009	中国通号	22,400	106,624.00	0.03
428	601000	唐山港	25,400	105,410.00	0.03
429	601018	宁波港	33,400	105,210.00	0.03
430	600316	洪都航空	3,700	103,378.00	0.03
431	600008	首创环保	37,800	102,816.00	0.03
432	000738	航发控制	5,600	102,424.00	0.03
433	000932	华菱钢铁	29,500	102,365.00	0.03
434	600170	上海建工	45,800	101,676.00	0.03
435	600486	扬农化工	2,000	101,400.00	0.03
436	600998	九州通	21,600	101,304.00	0.03

437	600161	天坛生物	8,600	99,588.00	0.03
438	600820	隧道股份	19,100	99,511.00	0.03
439	000002	万 科 A	33,400	98,864.00	0.03
440	300118	东方日升	7,900	98,355.00	0.03
441	601238	广汽集团	19,300	98,044.00	0.03
442	603885	吉祥航空	9,400	96,726.00	0.03
443	603486	科沃斯	1,900	96,425.00	0.03
444	688303	大全能源	5,400	94,122.00	0.03
445	603816	顾家家居	4,200	93,912.00	0.03
446	603939	益丰药房	5,200	93,496.00	0.03
447	601567	三星电气	6,200	92,628.00	0.03
448	688166	博瑞医药	2,600	91,026.00	0.03
449	603392	万泰生物	3,300	89,001.00	0.03
450	688781	视涯科技	2,105	88,746.80	0.03
451	688808	联讯仪器	56	88,722.48	0.03
452	600038	中直股份	3,500	88,515.00	0.03
453	600763	通策医疗	2,600	88,088.00	0.03
454	601880	辽港股份	63,800	88,044.00	0.03
455	300676	华大基因	2,500	87,650.00	0.03
456	600535	天士力	6,600	87,318.00	0.03
457	300573	兴齐眼药	2,114	86,166.64	0.03
458	600511	国药股份	3,300	85,932.00	0.03
459	300049	福瑞医科	2,200	85,536.00	0.03
460	002244	滨江集团	10,800	82,080.00	0.03
461	000833	粤桂股份	3,500	81,970.00	0.03
462	600816	建元信托	33,500	81,740.00	0.03
463	601155	新城控股	7,900	81,054.00	0.03
464	300100	双林股份	2,900	80,562.00	0.03
465	002120	韵达股份	12,600	80,136.00	0.03
466	300144	宋城演艺	13,600	79,016.00	0.03
467	600499	科达制造	5,700	78,660.00	0.03
468	000998	隆平高科	10,300	77,662.00	0.03
469	600064	南京高科	10,600	75,578.00	0.02
470	002544	普天科技	4,100	74,702.00	0.02
471	688063	派能科技	1,400	74,578.00	0.02
472	601866	中远海发	33,500	74,035.00	0.02
473	600635	大众公用	16,700	71,476.00	0.02
474	600754	锦江酒店	3,900	70,161.00	0.02
475	300457	赢合科技	3,300	69,564.00	0.02
476	000035	中国天楹	14,400	69,552.00	0.02
477	600655	豫园股份	16,800	69,048.00	0.02
478	300601	康泰生物	5,800	65,772.00	0.02
479	600663	陆家嘴	10,300	64,684.00	0.02

480	603899	晨光股份	3,100	63,953.00	0.02
481	600859	王府井	6,900	63,342.00	0.02
482	600258	首旅酒店	5,800	63,336.00	0.02
483	600004	白云机场	8,700	63,162.00	0.02
484	002091	江苏国泰	8,400	60,732.00	0.02
485	300070	碧水源	18,900	60,291.00	0.02
486	000069	华侨城 A	34,500	56,580.00	0.02
487	600864	哈投股份	10,800	56,052.00	0.02
488	688818	电科蓝天	752	52,745.28	0.02
489	301078	孩子王	7,700	52,052.00	0.02
490	002292	奥飞娱乐	7,700	50,512.00	0.02
491	688797	臻宝科技	103	48,273.01	0.02
492	688820	盛合晶微	332	46,974.68	0.02
493	603833	欧派家居	1,500	45,165.00	0.01
494	600325	华发股份	19,200	44,352.00	0.01
495	002891	中宠股份	1,600	42,752.00	0.01
496	001399	惠科股份	1,369	37,962.37	0.01
497	688712	北芯生命	1,050	37,716.00	0.01
498	002572	索菲亚	4,900	35,770.00	0.01
499	301682	宏明电子	212	33,932.72	0.01
500	688635	长进光子	108	33,284.52	0.01
501	688785	恒运昌	65	30,104.75	0.01
502	688813	泰金新能	173	29,771.57	0.01
503	001257	盛龙股份	941	19,516.34	0.01
504	688811	有研复材	712	17,180.56	0.01
505	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
506	301669	高特电子	498	14,143.20	0.00
507	301696	三瑞智能	144	12,499.20	0.00
508	603459	红板科技	148	12,479.36	0.00
509	301531	春光集团	196	10,105.76	0.00
510	301680	固德电材	80	8,972.80	0.00
511	603407	长裕集团	113	8,300.98	0.00
512	301599	理奇智能	234	7,597.98	0.00
513	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
514	001365	天海电子	209	6,543.79	0.00
515	301683	慧谷新材	52	6,332.04	0.00
516	688816	易思维	104	5,938.40	0.00
517	001237	惠康科技	101	5,932.74	0.00
518	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
519	601112	振石股份	240	4,221.60	0.00
520	603352	至信股份	87	2,220.24	0.00
521	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
522	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

523	001312	福恩股份	84	1,409.52	0.00
524	603293	埃泰克	41	1,391.13	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	4,667,254.00	1.95
2	300750	宁德时代	4,168,261.42	1.75
3	300502	新易盛	3,777,806.00	1.58
4	600519	贵州茅台	3,227,153.00	1.35
5	601318	中国平安	2,234,901.00	0.94
6	601899	紫金矿业	1,988,933.00	0.83
7	600036	招商银行	1,763,011.00	0.74
8	000333	美的集团	1,463,276.00	0.61
9	688256	寒武纪	1,387,402.58	0.58
10	002475	立讯精密	1,347,249.00	0.56
11	300394	天孚通信	1,321,530.00	0.55
12	600900	长江电力	1,261,015.00	0.53
13	601166	兴业银行	1,166,086.00	0.49
14	688498	源杰科技	1,150,282.00	0.48
15	301308	江波龙	1,084,074.00	0.45
16	002384	东山精密	1,030,601.00	0.43
17	688525	佰维存储	1,014,460.68	0.42
18	603986	兆易创新	1,005,774.00	0.42
19	002594	比亚迪	993,200.00	0.42
20	688041	海光信息	973,063.74	0.41

注：“买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	3,138,226.00	1.31
2	600519	贵州茅台	3,015,940.00	1.26
3	300308	中际旭创	2,101,879.00	0.88
4	601318	中国平安	1,887,190.00	0.79
5	601899	紫金矿业	1,753,511.00	0.73
6	600036	招商银行	1,440,710.00	0.60
7	300502	新易盛	1,431,251.00	0.60
8	000333	美的集团	1,145,273.00	0.48
9	688256	寒武纪	1,104,618.00	0.46
10	600900	长江电力	964,550.00	0.40
11	601166	兴业银行	939,121.00	0.39
12	002475	立讯精密	869,284.00	0.36

13	002594	比亚迪	814,700.00	0.34
14	600276	恒瑞医药	781,727.00	0.33
15	300059	东方财富	771,597.00	0.32
16	600030	中信证券	765,698.00	0.32
17	603259	药明康德	765,697.00	0.32
18	002371	北方华创	729,056.00	0.31
19	601088	中国神华	721,840.00	0.30
20	601398	工商银行	707,502.00	0.30

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	135,970,030.97
卖出股票收入（成交）总额	105,999,742.94

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
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）	18,000.24	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	18,000.24	0.01

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	111025	圣泉转债	180	18,000.24	0.01

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

在股指期货投资上，本基金以避险保值和有效管理为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中，将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约，通过研究现货和期货市场的发展趋势，运用定价模型对其进行合理估值，谨慎利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，及时调整投资组合仓位，以降低组合风险、提高组合的运作效率。

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 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	120,620.33
2	应收清算款	52,232.23
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	495,687.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	668,539.81
---	----	------------

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
万家瑞丰 A	4,350	27,263.70	113,463,855.61	95.67	5,133,234.42	4.33
万家瑞丰 C	1,165	26,269.57	23,861,271.28	77.97	6,742,781.13	22.03
合计	5,087	29,329.89	137,325,126.89	92.04	11,876,015.55	7.96

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（%）	98.14

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	万家瑞丰 A	21,452.04	0.0181
	万家瑞丰 C	29,215.67	0.0955

	合计	50,667.71	0.0340
--	----	-----------	--------

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	万家瑞丰 A	0
	万家瑞丰 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	万家瑞丰 A	0~10
	万家瑞丰 C	0~10
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家瑞丰 A	万家瑞丰 C
基金合同生效日 （2015 年 6 月 19 日） 基金份额总额	1,000,538,100.90	451,441.29
本报告期期初基金份额总额	125,632,800.78	6,544,481.90
本报告期基金总申购份额	48,561,902.74	24,540,536.81
减：本报告期基金总赎回份额	55,597,613.49	480,966.30
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	118,597,090.03	30,604,052.41

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金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

基金管理人：

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。

基金托管人：

2026 年 6 月，樊玲同志担任上海银行股份有限公司资产托管部见习总经理助理。上述人事变动已进行备案、公告。

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

报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的分管公募基金托管业务的高级管理人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中泰证券	2	240,639,902.64	100.00	107,302.79	100.00	—
广发证券	1	—	—	—	—	—

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准

为加强证券投资基金交易费用管理，管理人特制定《证券投资基金交易费用管理办法》。依据

该办法，管理人设立合作证券公司备选库，并按照业务类型进行分类管理。备选库具体分为被动股票型基金合作证券公司备选库和其他类型基金合作证券公司备选库。纳入备选库内的证券经营机构方可参与管理人基金产品的证券交易服务。

选择证券公司参与证券交易的标准如下：

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

2、选择证券公司参与证券交易的程序

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

3、基金专用交易席位的变更情况：

无。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中泰证券	1,601,360.00	100.00	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	万家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	万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金2025年第4季度报告	指定媒介	2026年1月21日

3	万家基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	指定媒介	2026 年 3 月 30 日
4	万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金 2025 年年度报告	指定媒介	2026 年 3 月 30 日
5	万家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	万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	指定媒介	2026 年 4 月 21 日
7	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
8	关于万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	指定媒介	2026 年 4 月 27 日
9	万家基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	指定媒介	2026 年 5 月 27 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	20260414-20260427	13,490,960.60	5,742,703.49	-	19,233,664.09	12.89
产品特有风险							
报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。 未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。
- 4、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金 2026 年中期报告原文。
- 5、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。

6、万家基金管理有限公司董事会决议。

7、本报告期内在中国证监会指定媒介公开披露的基金净值、更新招募说明书及其他临时公告。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司

2026 年 8 月 29 日