

万家元利债券型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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 2 月 4 日（基金合同生效日）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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
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	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	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	12
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	13
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	13
§ 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	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	55

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	55
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	55
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	55
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.11 本报告期投资基金情况	56
7.12 投资组合报告附注	57
§ 8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	59
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 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	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	60
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	60
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	61
10.9 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	63
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家元利债券型证券投资基金	
基金简称	万家元利债券	
基金主代码	025979	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 2 月 4 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	252,610,671.18 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	万家元利债券 A	万家元利债券 C
下属分级基金的交 易代码	025979	025980
报告期末下属分级 基金的份额总额	135,169,770.20 份	117,440,900.98 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险并保持良好流动性的基础上，力争为投资者提供长期稳定的投资回报。
投资策略	1、资产配置策略；2、利率预期策略；3、期限结构配置策略；4、属类配置策略；5、债券品种选择策略；6、股票投资策略；7、证券公司短期公司债券投资策略；8、可转换债券和可交换债券投资策略；9、国债期货交易策略；10、信用衍生品投资策略；11、基金投资策略。
业绩比较基准	中债新综合指数（全价）收益率×84%+沪深 300 指数收益率×10%+恒生指数收益率（经估值汇率调整）×1%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金可投资于港股，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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	兰剑	汪小敏
	联系电话	021-38909626	021-31888888
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	wangxm8@spdb.com.cn

客户服务电话	4008880800	95528
传真	021-38909627	021-63602540
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）	上海市中山东一路 12 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	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码	200122	200126
法定代表人	陈广益	张为忠

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
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	2026 年 2 月 4 日（基金合同生效日）-2026 年 6 月 30 日	
	万家元利债券 A	万家元利债券 C
本期已实现收益	3,068,831.89	2,743,011.19
本期利润	3,429,805.07	3,232,667.60
加权平均基金份 额本期利润	0.0123	0.0102
本期加权平均净 值利润率	1.22%	1.02%
本期基金份额净 值增长率	1.18%	1.02%
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	1,597,017.14	1,196,070.22
期末可供分配基	0.0118	0.0102

金份额利润		
期末基金资产净值	136,767,971.91	118,637,989.45
期末基金份额净值	1.0118	1.0102
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	1.18%	1.02%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4、本基金合同生效于 2026 年 2 月 4 日。

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

万家元利债券 A

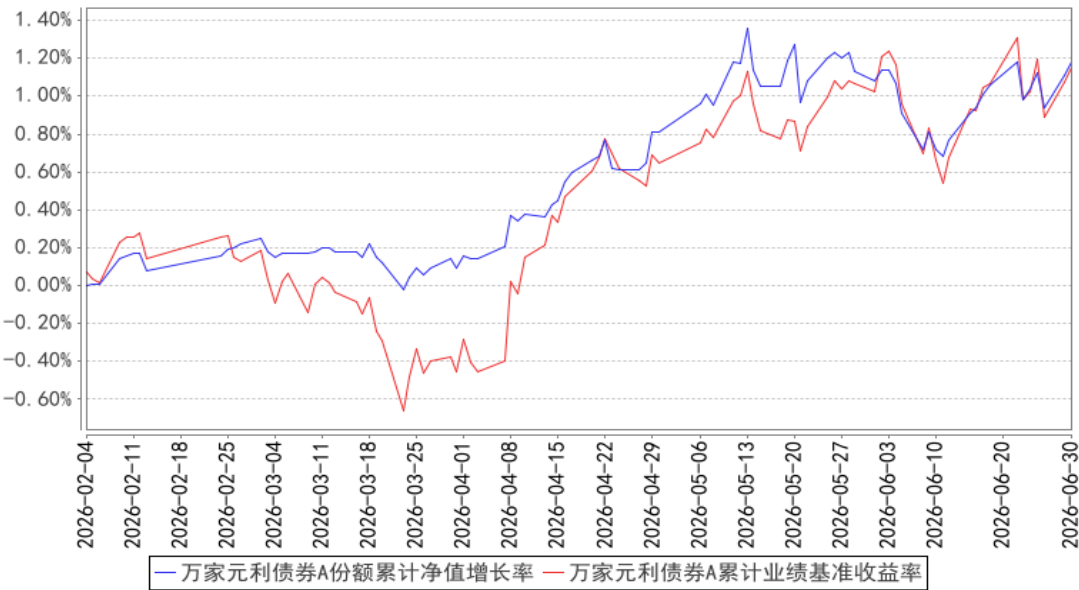
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.09%	0.11%	1.61%	0.14%	-0.52%	-0.03%
自基金合同生效起至今	1.18%	0.09%	1.15%	0.14%	0.03%	-0.05%

万家元利债券 C

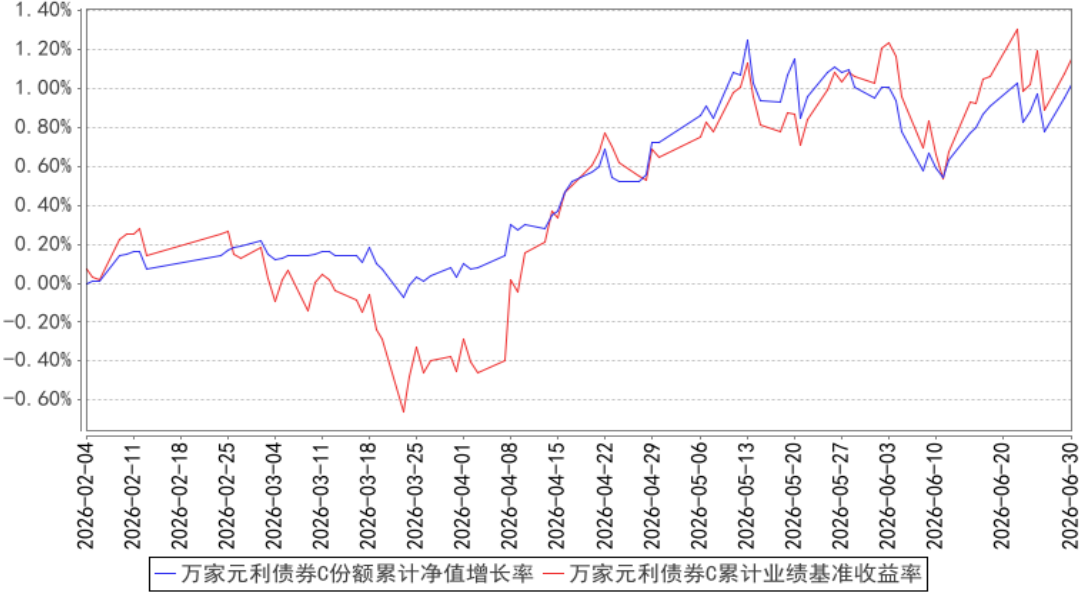
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.99%	0.11%	1.61%	0.14%	-0.62%	-0.03%
自基金合同生效起至今	1.02%	0.09%	1.15%	0.14%	-0.13%	-0.05%

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

万家元利债券A份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



万家元利债券C份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日期为 2026 年 2 月 4 日，基金合同生效未满一年。

2、根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。截至报告期末本基金尚处于建仓期。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		
杨若愚	万家元利债券型证券投资基金、万家民瑞祥和 6 个月持有期债券型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家集利债券型发起式证券投资基金的基金经理。	2026 年 2 月 4 日	-	8 年	国籍：中国；学历：复旦大学金融专业硕士，2021 年 10 月入职万家基金管理有限公司，现任固定收益部基金经理，历任固定收益部可转债研究员、基金经理助理，曾任融通基金管理有限公司固定收益部研究员等职。
段博卿	万家 1-3 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家 CFETS0-3 年期政策性金融债指数证券投资基金、万家元利债券型证券投资	2026 年 2 月 4 日	-	10 年	国籍：中国；学历：美国杜克大学经济学专业硕士，2021 年 4 月入职万家基金管理有限公司，现任固定收益部基金经理，历任债券投资部基金经理等职。曾任渣打银行（中国）有限公司金融市场部管培生，泰康资产管理有限公司集中交易室固定收益交易经理，平安银行股份有限公司资产管理事业部组合投资经理，长信基金管理有限公司现金理财部基金经理助理、基金经理等职。

	资基金、 万家玖盛 纯债 9 个 月定期开 放债券型 证券投资 基金、万 家鑫怡债 券型证券 投 资 基 金、万家 鑫耀纯债 债券型证 券投资基 金、万家 陆家嘴金 融城金融 债一年定 期开放债 券型发起 式证券投资 基金、 万家集利 债券型发 起式证券 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

二季度国内宏观经济总体平稳、结构分化，生产端韧性较强，出口保持较高增速，消费与投资修复节奏有所放缓。权益市场方面，二季度整体震荡上行，成长风格表现突出，科技成长板块交易活跃，结构性行情特征明显。债券市场方面，收益率曲线震荡下行，中短端在资金面水平下移的带动下逐步下行，长端在较为陡峭的曲线期限利差以及宽松预期加持下也明显下行。转债市场估值高位收敛，内部表现分化加剧，高价偏股类及科技赛道映射个券占优。本基金二季度在控制整体风险预算的基础上，对资产配置进行了动态调整。权益仓位在标配与高配之间进行灵活切换，结构上突出硬科技成长。债券仓位上，保持中性久期配置，积极开展交易性操作，积极把握市场波段机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家元利债券 A 的基金份额净值为 1.0118 元，本报告期基金份额净值增长率

为 1.18%，同期业绩比较基准收益率为 1.15%；截至本报告期末万家元利债券 C 的基金份额净值为 1.0102 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.02%，同期业绩比较基准收益率为 1.15%。

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 2026 年下半年，权益市场在政策托底与新质生产力驱动下，有望延续震荡上行格局；债券市场收益率预计在货币政策松紧适度的环境下维持低位震荡；转债市场需坚持精选个券，把握结构性机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对万家元利债券型证券投资基金的托管过程中，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、托管协议的规定，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人依照《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、托管协议的规定，对万家元利债券型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由万家基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、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：万家元利债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	20,703,425.56
结算备付金		9,229,688.73
存出保证金		120,461.03
交易性金融资产	6.4.7.2	258,289,210.62
其中：股票投资		14,806,403.60
基金投资		5,833,761.60
债券投资		237,649,045.42
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		1,074.17
应收申购款		120.32

递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		288,343,980.43
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 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		23,600,000.00
应付清算款		3,183,024.29
应付赎回款		5,773,528.95
应付管理人报酬		142,323.24
应付托管费		23,687.83
应付销售服务费		45,787.92
应付投资顾问费		-
应交税费		4,592.34
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	165,074.50
负债合计		32,938,019.07
净资产:		
实收基金	6.4.7.7	252,610,671.18
其他综合收益	6.4.7.8	-
未分配利润	6.4.7.9	2,795,290.18
净资产合计		255,405,961.36
负债和净资产总计		288,343,980.43

注：1、报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 252,610,671.18 份，其中万家元利债券 A 基金份额净值 1.0118 元 基金份额总额 135,169,770.20 份；万家元利债券 C 基金份额净值 1.0102 元，基金份额总额 117,440,900.98 份。

2、本基金基金合同生效日为 2026 年 2 月 4 日，无上年度末对比数据。

6.2 利润表

会计主体：万家元利债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		9,393,382.99
1. 利息收入		1,491,929.78

其中：存款利息收入	6.4.7.10	1,022,615.04
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		469,314.74
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		7,050,787.02
其中：股票投资收益	6.4.7.11	990,061.70
基金投资收益	6.4.7.12	843,044.49
债券投资收益	6.4.7.13	4,874,562.67
资产支持证券投资收益	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	89,216.65
股利收益	6.4.7.17	253,901.51
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	850,629.59
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	36.60
减：二、营业总支出		2,730,910.32
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,466,649.41
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	244,380.03
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	522,808.18
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		399,467.96
其中：卖出回购金融资产支出		399,467.96
6. 信用减值损失	6.4.7.21	-
7. 税金及附加		7,350.32
8. 其他费用	6.4.7.22	90,254.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,662,472.67
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,662,472.67
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		6,662,472.67

注：1、本财务报表的实际编制期间为 2026 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日。
2、本基金合同生效日为 2026 年 2 月 4 日，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：万家元利债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2026 年 2 月 4 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,008,993,749.55	-	-	1,008,993,749.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-756,383,078.37	-	2,795,290.18	-753,587,788.19
（一）、综合收益总额	-	-	6,662,472.67	6,662,472.67
（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）	-756,383,078.37	-	-3,867,182.49	-760,250,260.86
其中：1. 基金申购款	4,350,178.78	-	32,749.48	4,382,928.26
2. 基金赎回款	-760,733,257.15	-	-3,899,931.97	-764,633,189.12
（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	252,610,671.18	-	2,795,290.18	255,405,961.36

注：1、本财务报表的实际编制期间为 2026 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日。

2、本基金合同生效日为 2026 年 2 月 4 日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>陈广益</u>	<u>莫海波</u>	<u>尹超</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

万家元利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2025]2361 号文《关于准予万家元利债券型证券投资基金注册的批复》的核准，由万家基金管理有限公司作为基金管理人于 2026 年 1 月 20 日至 2026 年 2 月 2 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[2026]第 ZA30261 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 2026 年 2 月 4 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 1,008,647,047.11 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 346,702.44 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,008,993,749.55 元，折合 1,008,993,749.55 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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

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（包括主板、创业板以及其他中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（不含 QDI 基金、香港互认基金、基金中基金、货币市场基金和其他投资范围包含基金的公开募集证券投资基金）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、证券公司短期公司债、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、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：中债新综合指数（全价）收益率×84%+沪深 300 指数收益率×10%+恒生指数收益率（经估值汇率调整）×1%+银行活期存款利率（税后）×5%。

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 2 月 4 日（基金合同生效日）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 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2026 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

1、金融资产分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金持有的股票投资、债券投资和基金投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的以摊余成本计量的金融资产，包括货币资金、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

2、金融负债分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和以摊余成本计量的金融负债。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在债券投资的账面价值中。对于其他金融资产和以摊余成本计量的金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于其他金融资产和以摊余成本计量的金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，按照未来 12 个月内（若预期存续期少于 12 个月，则为预期存续期内）的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用

损失计量损失准备。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者（3）该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（2）不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

（3）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1）具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2）交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率或者合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

其他金融资产在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和基金投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

(4)对于基金投资，根据中基协发[2017]3号《关于发布〈基金中基金估值业务指引(试行)〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引(试行)》，采用如下方法估值：

(a)对于交易型开放式指数基金、境内上市定期开放式基金及封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值；

(b) 对于境内上市开放式基金 (LOF) 及其他境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值；

(c) 对于境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份 (百份) 收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间 (含节假日) 的万份 (百份) 收益计提估值日基金收益；

(d) 对于境内非上市货币市场基金按所投资基金前一估值日后至估值日期间 (含节假日) 的万份收益计提估值日基金收益。

如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，本基金根据以下原则进行估值：

(a) 以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与基金中基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值；

(b) 以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价，确定公允价值；

(c) 如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

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	20,703,425.56
等于：本金	20,702,178.02
加：应计利息	1,247.54
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	20,703,425.56

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		14,415,946.00	-	14,806,403.60	390,457.60
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	38,017,316.00	279,479.57	38,312,052.47	15,256.90
	银行间市场	196,652,442.44	2,439,992.95	199,336,992.95	244,557.56
	合计	234,669,758.44	2,719,472.52	237,649,045.42	259,814.46
资产支持证券		-	-	-	-
基金		5,633,404.07	-	5,833,761.60	200,357.53
其他		-	-	-	-
合计		254,719,108.51	2,719,472.52	258,289,210.62	850,629.59

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	94,016.17
其中：交易所市场	48,703.30
银行间市场	45,312.87
应付利息	-
预提费用	71,058.33
合计	165,074.50

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

万家元利债券 A

项目	本期 2026 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	419,453,476.97	419,453,476.97
本期申购	1,890,811.12	1,890,811.12
本期赎回（以“-”号填列）	-286,174,517.89	-286,174,517.89
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	135,169,770.20	135,169,770.20

万家元利债券 C

项目	本期 2026 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	589,540,272.58	589,540,272.58
本期申购	2,459,367.66	2,459,367.66
本期赎回（以“-”号填列）	-474,558,739.26	-474,558,739.26
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	117,440,900.98	117,440,900.98

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

万家元利债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	3,068,831.89	360,973.18	3,429,805.07
本期基金份额交易产生的变动数	-1,471,814.75	-359,788.61	-1,831,603.36
其中：基金申购款	19,050.22	-95.74	18,954.48
基金赎回款	-1,490,864.97	-359,692.87	-1,850,557.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,597,017.14	1,184.57	1,598,201.71

万家元利债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	2,743,011.19	489,656.41	3,232,667.60
本期基金份额交易产生的变动数	-1,546,940.97	-488,638.16	-2,035,579.13
其中：基金申购款	11,028.73	2,766.27	13,795.00
基金赎回款	-1,557,969.70	-491,404.43	-2,049,374.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,196,070.22	1,018.25	1,197,088.47

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	971,285.53
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	51,227.35
其他	102.16
合计	1,022,615.04

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2月4日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	990,061.70
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	990,061.70

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2月4日（基金合同生效日）至2026年6月30日
卖出股票成交总额	143,887,375.10
减：卖出股票成本总额	142,658,435.28
减：交易费用	238,878.12
买卖股票差价收入	990,061.70

6.4.7.12 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年2月4日（基金合同生效日）至2026年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	103,677,845.06
减：卖出/赎回基金成本总额	102,794,430.33
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	31,886.28
减：交易费用	8,483.96
基金投资收益	843,044.49

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 2026年2月4日（基金合同生效日）至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	3,130,198.73
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,744,363.94
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	4,874,562.67
----	--------------

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 2026年2月4日（基金合同生效日）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	1,601,964,811.37
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,583,431,909.58
减：应计利息总额	16,745,545.21
减：交易费用	42,992.64
买卖债券差价收入	1,744,363.94

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

单位：人民币元

项目	本期 2026年2月4日（基金合同生效日）至2026年6月30日
国债期货投资收益	89,216.65

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年2月4日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	253,901.51
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	253,901.51

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年2月4日（基金合同生效日）至2026年6月30日
1. 交易性金融资产	850,629.59
股票投资	390,457.60
债券投资	259,814.46
资产支持证券投资	—
基金投资	200,357.53

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	850,629.59

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	36.60
合计	36.60

6.4.7.20 持有基金产生的费用

项目	本期 2026 年 2 月 4 日（基金合同生效日）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）	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	6,762.07
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	1,446.89

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 2026 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	22,205.82
信息披露费	48,852.51
证券出借违约金	-
银行费用	19,196.09
合计	90,254.42

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
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人、基金销售机构
中泰证券股份有限公司（“中泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
中泰证券	300,961,756.38	100.00

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

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 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
中泰证券	192,635,074.82	100.00

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

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 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
中泰证券	3,142,300,000.00	100.00

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期基金 成交总额的比例（%）
中泰证券	212,105,679.46	100.00

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.5 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.6 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2月4日（基金合同生效日）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	135,026.11	100.00	48,703.30	100.00

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

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 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,466,649.41
其中：应支付销售机构的客户维护费	732,888.10
应支付基金管理人的净管理费	733,761.31

注：1、本基金投资于本基金管理人所管理的其他基金的部分不收取管理费。本基金的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 E 取 0

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	244,380.03

注：1、本基金投资于本基金托管人所托管的其他基金的部分不收取托管费。本基金的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 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H=E\times 0.10\%\div \text{当年天数}$

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

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

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 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家元利债券 A	万家元利债券 C	合计
浦发银行	-	521,587.73	521,587.73
万家基金	-	5.30	5.30

合计	-	521,593.03	521,593.03
----	---	------------	------------

注：1、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%。

销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.40\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据相关协议支付给各销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

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

单位：人民币元

本期 2026 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
浦发银行	30,694,125.44	224,749,001.23	-	-	-	-

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

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

本基金本报告期末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。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

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

本基金本报告期末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。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

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

本基金本报告期末发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

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

本基金本报告期末无除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

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 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
	浦发银行	20,703,425.56
		971,285.53

注：1、本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展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。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方所承销的证券。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

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

本基金本报告期没有需作说明的其他关联交易事项。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

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

本基金本报告期无因交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金而产生的费用。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆	2026	重大事	879.53	2026	890.99	200	110,468.00	175,906.00	-

	科技	年 6 月 29 日	项停牌		年 7 月 13 日					
--	----	------------------	-----	--	---------------	--	--	--	--	--

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，本基金因从事证券交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 23,600,000.00 元，将于 2026 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	38,310,479.45
合计	38,310,479.45

注：1、未评级债券为国债。
2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日
AAA	84,504,982.46
AAA 以下	1,573.02
未评级	114,832,010.49
合计	199,338,565.97

注：1、未评级债券包含国债和政策性金融债。
2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 6 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	20,703,425.56	-	-	-	-	-	20,703,425.56

金							
结算 备付金	9,229,688.73	-	-	-	-	-	9,229,688.73
存出 保证金	120,461.03	-	-	-	-	-	120,461.03
交易性 金融资产	-	-	38,312,052.47	104,731,804.38	94,605,188.57	20,640,165.20	258,289,210.62
应收股利	-	-	-	-	-	1,074.17	1,074.17
应收申 购款	0.38	-	-	-	-	119.94	120.32
资产 总计	30,053,575.70	-	38,312,052.47	104,731,804.38	94,605,188.57	20,641,359.31	288,343,980.43
负 债							
应付 赎回款	-	-	-	-	-	5,773,528.95	5,773,528.95
应付 管理人 报酬	-	-	-	-	-	142,323.24	142,323.24

应付托管费	-	-	-	-	-	23,687.83	23,687.83
应付清算款	-	-	-	-	-	3,183,024.29	3,183,024.29
卖出回购金融资产款	23,600,000.00	-	-	-	-	-	23,600,000.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	45,787.92	45,787.92
应交税费	-	-	-	-	-	4,592.34	4,592.34
其他负债	-	-	-	-	-	165,074.50	165,074.50
负债总计	23,600,000.00	-	-	-	-	9,338,019.07	32,938,019.07
利率敏感度缺口	6,453,575.70	-	38,312,052.47	104,731,804.38	94,605,188.57	11,303,340.24	255,405,961.36

注：1、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。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

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）
	市场利率下降 25 个基点	2,364,140.19
	市场利率上升 25 个基点	-2,322,557.13

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

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 2026 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	14,806,403.60	5.80
交易性金融资产—基金投资	5,833,761.60	2.28
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	20,640,165.20	8.08

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

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）
	股票基准指数上升100个基点	149,616.85
	股票基准指数下降100个基点	-149,616.85

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

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
第一层次	20,465,832.22
第二层次	237,823,378.40
第三层次	-
合计	258,289,210.62

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

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	14,806,403.60	5.13
	其中：股票	14,806,403.60	5.13
2	基金投资	5,833,761.60	2.02
3	固定收益投资	237,649,045.42	82.42
	其中：债券	237,649,045.42	82.42
	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	29,933,114.29	10.38
8	其他各项资产	121,655.52	0.04
9	合计	288,343,980.43	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	68,311.00	0.03
B	采矿业	736,527.00	0.29
C	制造业	9,453,115.40	3.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	731,570.00	0.29
E	建筑业	230,235.00	0.09
F	批发和零售业	203,986.00	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	601,722.00	0.24
H	住宿和餐饮业	46,741.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	782,460.90	0.31
J	金融业	1,079,781.30	0.42
K	房地产业	107,265.00	0.04
L	租赁和商务服务业	233,659.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	287,038.00	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	78,206.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	113,736.00	0.04
Q	卫生和社会工作	16,360.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	35,690.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	14,806,403.60	5.80

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688498	源杰科技	290	546,940.00	0.21
2	688256	寒武纪	298	475,473.90	0.19
3	300308	中际旭创	300	381,000.00	0.15
4	300750	宁德时代	900	353,709.00	0.14
5	600900	长江电力	9,000	238,230.00	0.09
6	603259	药明康德	1,800	224,118.00	0.09
7	000651	格力电器	5,800	217,500.00	0.09
8	002128	电投能源	8,500	196,520.00	0.08
9	688072	拓荆科技	200	175,906.00	0.07
10	000708	中信特钢	13,300	167,846.00	0.07
11	600183	生益科技	900	156,060.00	0.06
12	600233	圆通速递	9,300	146,475.00	0.06
13	300502	新易盛	240	145,680.00	0.06

14	000807	云铝股份	6,500	143,910.00	0.06
15	600887	伊利股份	5,900	141,364.00	0.06
16	000792	盐湖股份	4,400	132,836.00	0.05
17	002384	东山精密	500	131,175.00	0.05
18	601857	中国石油	14,800	128,464.00	0.05
19	688981	中芯国际	800	127,056.00	0.05
20	002648	卫星化学	5,300	124,497.00	0.05
21	002415	海康威视	3,600	123,120.00	0.05
22	688578	艾力斯	1,100	120,120.00	0.05
23	600519	贵州茅台	100	118,549.00	0.05
24	600177	雅戈尔	15,300	115,209.00	0.05
25	605098	行动教育	2,100	113,736.00	0.04
26	688041	海光信息	300	111,090.00	0.04
27	601229	上海银行	12,500	108,500.00	0.04
28	601328	交通银行	16,800	108,024.00	0.04
29	603444	吉比特	300	107,526.00	0.04
30	000100	TCL 科技	18,300	106,506.00	0.04
31	601169	北京银行	21,600	105,840.00	0.04
32	601818	光大银行	36,600	105,774.00	0.04
33	000538	云南白药	2,200	104,214.00	0.04
34	600008	首创环保	38,300	104,176.00	0.04
35	688388	嘉元科技	2,330	102,520.00	0.04
36	600332	白云山	5,100	102,204.00	0.04
37	600064	南京高科	14,200	101,246.00	0.04
38	002818	富森美	9,700	100,783.00	0.04
39	600461	洪城环境	11,100	100,566.00	0.04
40	603061	金海通	200	100,444.00	0.04
41	600035	楚天高速	29,700	100,089.00	0.04
42	601006	大秦铁路	21,700	100,037.00	0.04
43	600016	民生银行	30,900	99,498.00	0.04
44	688525	佰维存储	200	98,946.00	0.04
45	000963	华东医药	3,500	98,420.00	0.04
46	603156	养元饮品	2,000	98,140.00	0.04
47	601633	长城汽车	6,500	98,085.00	0.04
48	600901	江苏金租	17,000	97,750.00	0.04
49	600028	中国石化	21,700	96,782.00	0.04
50	688025	杰普特	200	94,000.00	0.04
51	688012	中微公司	200	93,700.00	0.04
52	688008	澜起科技	300	92,970.00	0.04
53	601208	东材科技	1,300	92,027.00	0.04
54	000895	双汇发展	4,100	91,840.00	0.04
55	600285	羚锐制药	4,700	91,086.00	0.04
56	601318	中国平安	1,900	90,706.00	0.04

57	688120	华海清科	280	90,210.40	0.04
58	002371	北方华创	100	88,456.00	0.03
59	601117	中国化学	12,000	88,200.00	0.03
60	300628	亿联网络	2,600	87,932.00	0.03
61	600150	中国船舶	2,600	87,854.00	0.03
62	688361	中科飞测	200	86,000.00	0.03
63	300054	鼎龙股份	800	84,776.00	0.03
64	002027	分众传媒	17,500	84,700.00	0.03
65	603929	亚翔集成	300	81,606.00	0.03
66	688059	华锐精密	400	79,884.00	0.03
67	688503	聚和材料	600	79,620.00	0.03
68	300274	阳光电源	500	79,510.00	0.03
69	600036	招商银行	2,200	78,100.00	0.03
70	688127	蓝特光学	800	78,080.00	0.03
71	600961	株冶集团	2,400	77,736.00	0.03
72	002463	沪电股份	500	76,400.00	0.03
73	001286	陕西能源	7,400	75,036.00	0.03
74	688629	华丰科技	400	75,004.00	0.03
75	000933	神火股份	3,400	72,080.00	0.03
76	603979	金诚信	1,200	70,836.00	0.03
77	600750	华润江中	3,200	70,624.00	0.03
78	601899	紫金矿业	2,800	70,392.00	0.03
79	301308	江波龙	100	70,380.00	0.03
80	301031	中熔电气	588	70,236.60	0.03
81	300476	胜宏科技	200	69,286.00	0.03
82	603588	高能环境	3,600	69,120.00	0.03
83	600968	海油发展	20,700	68,931.00	0.03
84	601577	长沙银行	7,900	68,809.00	0.03
85	002293	罗莱生活	6,900	68,241.00	0.03
86	000333	美的集团	900	67,977.00	0.03
87	600236	桂冠电力	7,600	66,728.00	0.03
88	600487	亨通光电	600	65,604.00	0.03
89	688390	固德威	600	65,106.00	0.03
90	601600	中国铝业	7,900	64,938.00	0.03
91	002275	桂林三金	5,300	64,607.00	0.03
92	603031	安孚科技	1,200	63,900.00	0.03
93	002475	立讯精密	900	63,360.00	0.02
94	688046	药康生物	2,600	62,920.00	0.02
95	601877	正泰电器	2,500	62,675.00	0.02
96	603998	方盛制药	6,900	62,307.00	0.02
97	688002	睿创微纳	400	61,876.00	0.02
98	600801	华新建材	3,700	57,720.00	0.02
99	605028	世茂能源	2,700	57,510.00	0.02

100	605117	德业股份	540	57,337.20	0.02
101	000725	京东方 A	6,400	55,552.00	0.02
102	600030	中信证券	1,800	51,714.00	0.02
103	601000	唐山港	12,100	50,215.00	0.02
104	600598	北大荒	4,600	49,864.00	0.02
105	605016	百龙创园	1,900	49,115.00	0.02
106	000938	紫光股份	1,700	49,062.00	0.02
107	002956	西麦食品	2,360	48,993.60	0.02
108	601233	桐昆股份	2,200	47,630.00	0.02
109	601128	常熟银行	8,070	46,967.40	0.02
110	002154	报喜鸟	12,800	45,568.00	0.02
111	600502	安徽建工	10,300	44,805.00	0.02
112	603558	健盛集团	4,000	44,360.00	0.02
113	002034	旺能环境	2,900	43,935.00	0.02
114	002216	三全食品	3,800	43,814.00	0.02
115	603889	新澳股份	8,560	43,741.60	0.02
116	003010	若羽臣	1,800	43,740.00	0.02
117	600166	福田汽车	14,900	43,359.00	0.02
118	000088	盐田港	10,500	42,945.00	0.02
119	688111	金山办公	200	42,610.00	0.02
120	002283	天润工业	4,400	42,460.00	0.02
121	300394	天孚通信	140	42,375.20	0.02
122	600276	恒瑞医药	800	41,632.00	0.02
123	601677	明泰铝业	2,500	41,500.00	0.02
124	002709	天赐材料	800	41,144.00	0.02
125	002961	瑞达期货	2,100	41,118.00	0.02
126	601339	百隆东方	6,000	40,620.00	0.02
127	002594	比亚迪	500	39,850.00	0.02
128	300124	汇川技术	600	39,798.00	0.02
129	600754	锦江酒店	2,200	39,578.00	0.02
130	002946	新乳业	2,800	39,424.00	0.02
131	301358	湖南裕能	500	37,935.00	0.01
132	000988	华工科技	200	36,922.00	0.01
133	300972	万辰集团	200	34,682.00	0.01
134	601975	招商南油	9,200	34,316.00	0.01
135	300604	长川科技	100	34,142.00	0.01
136	002851	麦格米特	200	33,436.00	0.01
137	300408	三环集团	200	33,380.00	0.01
138	601139	深圳燃气	5,800	32,828.00	0.01
139	300059	东方财富	1,600	32,608.00	0.01
140	688599	天合光能	2,200	31,064.00	0.01
141	688047	龙芯中科	200	30,934.00	0.01
142	002563	森马服饰	6,100	30,744.00	0.01

143	600761	安徽合力	1,800	29,448.00	0.01
144	301511	德福科技	200	28,770.00	0.01
145	603871	嘉友国际	2,700	27,567.00	0.01
146	300760	迈瑞医疗	200	27,166.00	0.01
147	688183	生益电子	200	26,480.00	0.01
148	603993	洛阳钼业	1,500	26,325.00	0.01
149	601019	山东出版	4,100	26,240.00	0.01
150	002281	光迅科技	100	25,694.00	0.01
151	603083	剑桥科技	100	25,487.00	0.01
152	600057	厦门象屿	4,700	25,474.00	0.01
153	000612	焦作万方	2,400	25,416.00	0.01
154	688220	翱捷科技	200	24,864.00	0.01
155	002507	涪陵榨菜	2,300	24,840.00	0.01
156	600111	北方稀土	500	24,025.00	0.01
157	002738	中矿资源	400	23,596.00	0.01
158	688777	中控技术	200	23,500.00	0.01
159	002867	周大生	2,100	23,415.00	0.01
160	301526	国际复材	500	23,335.00	0.01
161	601816	京沪高铁	5,100	23,103.00	0.01
162	600482	中国动力	700	22,960.00	0.01
163	601699	潞安环能	1,600	22,848.00	0.01
164	605599	菜百股份	1,600	21,920.00	0.01
165	600908	无锡银行	4,300	21,844.00	0.01
166	002170	芭田股份	2,000	21,720.00	0.01
167	002020	京新药业	1,700	21,233.00	0.01
168	600309	万华化学	300	20,523.00	0.01
169	002812	恩捷股份	300	20,073.00	0.01
170	688126	沪硅产业	500	19,945.00	0.01
171	601088	中国神华	500	19,520.00	0.01
172	603323	苏农银行	4,970	19,233.90	0.01
173	603508	思维列控	900	19,224.00	0.01
174	600031	三一重工	1,100	19,008.00	0.01
175	688169	石头科技	200	18,994.00	0.01
176	600210	紫江企业	3,000	18,600.00	0.01
177	002466	天齐锂业	300	18,396.00	0.01
178	600096	云天化	600	18,240.00	0.01
179	002588	史丹利	2,300	18,170.00	0.01
180	603100	川仪股份	1,000	18,050.00	0.01
181	000848	承德露露	2,400	17,760.00	0.01
182	688249	晶合集成	300	17,709.00	0.01
183	002714	牧原股份	500	17,495.00	0.01
184	603885	吉祥航空	1,700	17,493.00	0.01
185	002532	天山铝业	1,600	17,168.00	0.01

186	605305	中际联合	400	16,768.00	0.01
187	301217	铜冠铜箔	100	16,507.00	0.01
188	600406	国电南瑞	700	15,995.00	0.01
189	601668	中国建筑	3,600	15,624.00	0.01
190	600660	福耀玻璃	300	15,132.00	0.01
191	688469	芯联集成	1,400	14,854.00	0.01
192	002602	世纪华通	1,000	14,100.00	0.01
193	603268	松发股份	100	13,928.00	0.01
194	002558	巨人网络	500	13,780.00	0.01
195	688187	时代电气	200	13,732.00	0.01
196	300395	菲利华	100	13,373.00	0.01
197	300953	震裕科技	100	13,370.00	0.01
198	688819	天能股份	600	13,320.00	0.01
199	600428	中远海特	1,700	13,277.00	0.01
200	300014	亿纬锂能	200	13,006.00	0.01
201	601156	东航物流	800	12,896.00	0.01
202	301536	星辰科技	100	12,871.00	0.01
203	000589	贵州轮胎	3,100	12,586.00	0.00
204	605499	东鹏饮料	100	12,343.00	0.00
205	002230	科大讯飞	300	12,252.00	0.00
206	300136	信维通信	100	11,925.00	0.00
207	601880	辽港股份	8,300	11,454.00	0.00
208	600436	片仔癀	100	10,928.00	0.00
209	002493	荣盛石化	1,000	10,750.00	0.00
210	601888	中国中免	200	10,742.00	0.00
211	300015	爱尔眼科	1,300	10,738.00	0.00
212	300433	蓝思科技	200	10,732.00	0.00
213	601216	君正集团	2,300	10,258.00	0.00
214	600398	海澜之家	1,900	9,937.00	0.00
215	600256	广汇能源	2,000	9,880.00	0.00
216	600546	山煤国际	900	9,837.00	0.00
217	600623	华谊集团	1,200	9,684.00	0.00
218	300568	星源材质	500	9,360.00	0.00
219	300390	天华新能	100	9,351.00	0.00
220	300346	南大光电	100	9,265.00	0.00
221	002033	丽江股份	1,100	9,086.00	0.00
222	301150	中一科技	140	8,835.40	0.00
223	600019	宝钢股份	1,600	8,688.00	0.00
224	600941	中国移动	100	8,613.00	0.00
225	600295	鄂尔多斯	800	8,576.00	0.00
226	600380	健康元	900	8,478.00	0.00
227	688297	中无人机	200	8,310.00	0.00
228	300442	润泽科技	100	8,307.00	0.00

229	300438	鹏辉能源	100	8,285.00	0.00
230	300450	先导智能	200	8,144.00	0.00
231	600893	航发动力	200	7,668.00	0.00
232	689009	九号公司	200	7,630.00	0.00
233	603939	益丰药房	400	7,192.00	0.00
234	000973	佛塑科技	500	7,175.00	0.00
235	601001	晋控煤业	400	6,956.00	0.00
236	000408	藏格矿业	100	6,932.00	0.00
237	300058	蓝色光标	500	6,880.00	0.00
238	603565	中谷物流	700	6,867.00	0.00
239	600585	海螺水泥	400	6,780.00	0.00
240	002668	TCL 智家	600	6,648.00	0.00
241	600258	首旅酒店	600	6,552.00	0.00
242	688728	格科微	300	6,312.00	0.00
243	300316	晶盛机电	100	6,040.00	0.00
244	600048	保利发展	1,300	6,019.00	0.00
245	601083	锦江航运	600	5,964.00	0.00
246	002487	大金重工	100	5,797.00	0.00
247	000513	丽珠集团	200	5,778.00	0.00
248	601666	平煤股份	800	5,720.00	0.00
249	002756	永兴材料	100	5,664.00	0.00
250	002039	黔源电力	300	5,646.00	0.00
251	300244	迪安诊断	300	5,622.00	0.00
252	300458	全志科技	140	5,524.40	0.00
253	600535	天士力	400	5,292.00	0.00
254	600033	福建高速	1,600	5,152.00	0.00
255	600415	小商品城	500	5,080.00	0.00
256	300073	当升科技	100	4,804.00	0.00
257	603766	隆鑫通用	400	4,772.00	0.00
258	688223	晶科能源	1,000	4,750.00	0.00
259	000719	中原传媒	400	4,572.00	0.00
260	000423	东阿阿胶	100	4,536.00	0.00
261	600131	国网信通	300	4,380.00	0.00
262	688472	阿特斯	400	4,328.00	0.00
263	001386	马可波罗	300	4,248.00	0.00
264	301236	软通动力	100	4,245.00	0.00
265	600163	中闽能源	800	4,120.00	0.00
266	603456	九洲药业	300	4,098.00	0.00
267	000893	亚钾国际	100	4,089.00	0.00
268	300418	昆仑万维	100	4,036.00	0.00
269	002004	华邦健康	1,000	3,930.00	0.00
270	300017	网宿科技	300	3,903.00	0.00
271	002727	一心堂	400	3,836.00	0.00

272	300207	欣旺达	200	3,798.00	0.00
273	600729	重百集团	200	3,756.00	0.00
274	000957	中通客车	400	3,744.00	0.00
275	600211	西藏药业	100	3,739.00	0.00
276	688538	和辉光电	1,400	3,640.00	0.00
277	000506	招金黄金	300	3,516.00	0.00
278	688303	大全能源	200	3,486.00	0.00
279	600216	浙江医药	300	3,420.00	0.00
280	000617	中油资本	500	3,295.00	0.00
281	000550	江铃汽车	200	3,244.00	0.00
282	301510	固高科技	100	3,193.00	0.00
283	300748	金力永磁	100	3,085.00	0.00
284	002838	道恩股份	100	3,062.00	0.00
285	601568	北元化工	900	3,060.00	0.00
286	002697	红旗连锁	700	2,912.00	0.00
287	688009	中国通号	600	2,856.00	0.00
288	000915	华特达因	100	2,831.00	0.00
289	600167	联美控股	500	2,795.00	0.00
290	300115	长盈精密	100	2,794.00	0.00
291	002488	金固股份	300	2,673.00	0.00
292	600551	时代出版	400	2,660.00	0.00
293	600858	银座股份	600	2,646.00	0.00
294	301522	上大股份	100	2,617.00	0.00
295	605196	华通线缆	100	2,610.00	0.00
296	603876	鼎胜新材	100	2,601.00	0.00
297	003022	联泓新科	100	2,590.00	0.00
298	000949	新乡化纤	400	2,536.00	0.00
299	002810	山东赫达	100	2,470.00	0.00
300	601008	连云港	600	2,412.00	0.00
301	002202	金风科技	100	2,390.00	0.00
302	000404	长虹华意	300	2,358.00	0.00
303	300251	光线传媒	200	2,218.00	0.00
304	002043	兔宝宝	200	2,216.00	0.00
305	002773	康弘药业	100	2,045.00	0.00
306	000650	仁和药业	400	2,036.00	0.00
307	002918	蒙娜丽莎	200	2,010.00	0.00
308	000019	深粮控股	300	1,701.00	0.00
309	001338	永顺泰	200	1,678.00	0.00
310	002390	信邦制药	600	1,566.00	0.00
311	300228	富瑞特装	200	1,480.00	0.00
312	600897	厦门空港	100	1,460.00	0.00
313	600218	全柴动力	200	1,444.00	0.00
314	605228	神通科技	100	1,343.00	0.00

315	603367	辰欣药业	100	1,283.00	0.00
316	300389	艾比森	100	1,282.00	0.00
317	600814	杭州解百	200	1,220.00	0.00
318	600351	亚宝药业	200	1,150.00	0.00
319	300658	延江股份	100	1,143.00	0.00
320	600449	宁夏建材	100	1,118.00	0.00
321	300407	凯发电气	100	1,080.00	0.00
322	600354	敦煌种业	200	952.00	0.00
323	300509	新美星	100	838.00	0.00
324	600738	丽尚国潮	200	720.00	0.00
325	002511	中顺洁柔	100	665.00	0.00
326	601007	金陵饭店	100	611.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600989	宝丰能源	2,725,861.00	1.07
2	300750	宁德时代	2,125,548.00	0.83
3	601229	上海银行	2,104,439.00	0.82
4	000807	云铝股份	1,979,142.00	0.77
5	600900	长江电力	1,965,577.00	0.77
6	601601	中国太保	1,568,359.00	0.61
6	02601	中国太保	342,254.48	0.13
7	601872	招商轮船	1,899,761.00	0.74
8	300308	中际旭创	1,682,724.00	0.66
9	000651	格力电器	1,667,279.00	0.65
10	600519	贵州茅台	1,642,965.00	0.64
11	600941	中国移动	1,435,095.00	0.56
11	00941	中国移动	179,009.56	0.07
12	688981	中芯国际	1,290,061.06	0.51
12	00981	中芯国际	320,673.83	0.13
13	603929	亚翔集成	1,601,874.00	0.63
14	600236	桂冠电力	1,559,950.00	0.61
15	600938	中国海油	1,370,142.00	0.54
15	00883	中国海洋石油	138,438.69	0.05
16	002293	罗莱生活	1,467,076.00	0.57
17	000792	盐湖股份	1,451,784.00	0.57
18	000933	神火股份	1,450,199.00	0.57
19	601318	中国平安	1,271,000.00	0.50
19	02318	中国平安	130,670.71	0.05
20	601319	中国人保	1,376,788.00	0.54

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600989	宝丰能源	2,859,604.00	1.12
2	601872	招商轮船	2,125,097.00	0.83
3	601229	上海银行	1,996,523.00	0.78
4	601601	中国太保	1,495,470.00	0.59
4	02601	中国太保	314,542.94	0.12
5	000807	云铝股份	1,784,792.00	0.70
6	300750	宁德时代	1,733,833.00	0.68
7	600900	长江电力	1,723,694.00	0.67
8	603929	亚翔集成	1,654,490.00	0.65
9	300308	中际旭创	1,652,610.00	0.65
10	600941	中国移动	1,420,559.00	0.56
10	00941	中国移动	181,615.25	0.07
11	600236	桂冠电力	1,590,484.00	0.62
12	600938	中国海油	1,431,354.00	0.56
12	00883	中国海洋石油	136,155.33	0.05
13	688981	中芯国际	1,235,728.82	0.48
13	00981	中芯国际	325,329.72	0.13
14	000651	格力电器	1,422,811.00	0.56
15	600519	贵州茅台	1,413,724.00	0.55
16	601126	四方股份	1,411,985.00	0.55
17	002293	罗莱生活	1,407,017.00	0.55
18	000933	神火股份	1,355,238.00	0.53
19	601319	中国人保	1,312,398.00	0.51
20	002532	天山铝业	1,300,451.00	0.51

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	157,074,381.28
卖出股票收入（成交）总额	143,887,375.10

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	58,407,358.44	22.87
2	央行票据	-	-
3	金融债券	179,240,113.96	70.18
	其中：政策性金融债	94,735,131.50	37.09

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）	1,573.02	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	237,649,045.42	93.05

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	019827	26 国债 01	220,000	22,142,602.19	8.67
2	232380057	23 中行二级资本债 02A	200,000	21,227,178.08	8.31
3	232380036	23 工行二级资本债 02A	200,000	21,142,454.79	8.28
4	232380089	23 中信银行二级资本债 01A	200,000	21,095,281.10	8.26
5	019792	25 国债 19	160,000	16,167,877.26	6.33

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

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

7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金基于谨慎原则，主要投资流动性好、交易活跃的国债期货合约，以降低投资组合的整体风险为目的，力争提升组合收益的同时，将回撤保持在可控范围内。

本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

7.11 本报告期投资基金情况

7.11.1 投资政策及风险说明

本基金采用定量分析和定性分析相结合的方式，一方面通过严格的量化规则筛选有潜在投资价值的标的纳入研究范围，另一方面结合所选基金的基金管理人的基本情况和投研文化等定性因素进行二次研判，双重维度筛选出中长期业绩稳定的优秀基金。本基金仅限于投资全市场股票 ETF 以及由本基金管理人管理的权益类基金。

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

7.11.2 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	159558	易方达中证半导体材料设备主题 ETF	交易型开放式 (ETF)	159,000.00	738,555.00	0.29	否
2	588200	嘉实上证科创板芯片 ETF	交易型开放式 (ETF)	145,200.00	716,707.20	0.28	否
3	510500	南方中证 500ETF	交易型开放式 (ETF)	73,400.00	674,839.60	0.26	否
4	159516	国泰中证半导体材料设备主题 ETF	交易型开放式 (ETF)	331,600.00	654,910.00	0.26	否
5	512500	华夏中证 500ETF	交易型开放式	125,600.00	641,816.00	0.25	否

			(ETF)				
6	510300	华泰柏瑞沪深300ETF	交易型开放式(ETF)	127,400.00	639,420.60	0.25	否
7	510310	沪深300ETF易方达	交易型开放式(ETF)	130,900.00	638,792.00	0.25	否
8	159761	国泰中证新材料主题ETF	交易型开放式(ETF)	621,800.00	636,101.40	0.25	否
9	562950	易方达中证消费电子主题ETF	交易型开放式(ETF)	228,700.00	492,619.80	0.19	否

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

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

7.12.2 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	120,461.03
2	应收清算款	-
3	应收股利	1,074.17
4	应收利息	-
5	应收申购款	120.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	121,655.52

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688072	拓荆科技	175,906.00	0.07	重大事项停牌

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（%）
万家元利债券 A	345	391,796.44	1,304,513.57	0.97	133,865,256.63	99.03
万家元利债券 C	409	287,141.57	-	-	117,440,900.98	100.00
合计	738	342,290.88	1,304,513.57	0.52	251,306,157.61	99.48

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

额)。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	万家元利债券 A	265,342.43	0.1963
	万家元利债券 C	55,009.61	0.0468
	合计	320,352.04	0.1268

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	万家元利债券 A	0
	万家元利债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	万家元利债券 A	10~50
	万家元利债券 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家元利债券 A	万家元利债券 C
基金合同生效日 （2026 年 2 月 4 日） 基金份额总额	419,453,476.97	589,540,272.58
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	1,890,811.12	2,459,367.66
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	286,174,517.89	474,558,739.26
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	135,169,770.20	117,440,900.98

§ 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：

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 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基金未发生包括转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同、召开基金份额持有人大会及大会表决意见等重大影响事件。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

自基金合同生效日起由立信会计师事务所（特殊普通合伙）为基金进行审计。

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

报告期内，托管人无受调查或处罚等情况。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

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(%)	
中泰证券	2	300,961,756.38	100.00	135,026.11	100.00	-
银河证券	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：

本基金为本报告期内成立的基金，上述席位均为新增交易单元。

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 (%)
中泰证券	192,635,074.82	100.00	3,142,300,000.00	100.00	-	-	212,105,679.46	100.00
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	万家元利债券型证券投资基金基金合同生效公告	指定媒介	2026 年 2 月 5 日
2	关于万家元利债券型证券投资基金开放申购、赎回、基金转换及定期定额投资业务的公告	指定媒介	2026 年 3 月 3 日
3	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
4	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
5	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、《万家元利债券型证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家元利债券型证券投资基金托管协议》。
- 4、万家元利债券型证券投资基金 2026 年中期报告原文。
- 5、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。
- 7、本报告期内在中国证监会指定媒介公开披露的基金净值、更新招募说明书及其他临时公告。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司

2026 年 8 月 29 日