

# 万家双利债券型证券投资基金

## 2026 年第 2 季度报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 7 月 21 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 7 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。  
本报告期自 2026 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

|                 |                                                                                                                                        |                 |
|-----------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|
| 基金简称            | 万家双利                                                                                                                                   |                 |
| 基金主代码           | 519190                                                                                                                                 |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式                                                                                                                                 |                 |
| 基金合同生效日         | 2013 年 3 月 6 日                                                                                                                         |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 499,183,235.39 份                                                                                                                       |                 |
| 投资目标            | 在严格控制风险并保持良好流动性的基础上，力争通过主动的组合管理实现超越业绩比较基准的收益。                                                                                          |                 |
| 投资策略            | 1、资产配置策略；2、利率预期策略；3、期限结构配置策略；4、债券品种选择策略；5、信用债券投资的风险管理；6、中小企业私募债券投资策略；7、资产支持证券投资策略；8、证券公司短期公司债券投资策略；9、股票投资策略：（1）定性方面；（2）定量方面；10、权证投资策略。 |                 |
| 业绩比较基准          | 中债总全价指数（总值）                                                                                                                            |                 |
| 风险收益特征          | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。                                                                            |                 |
| 基金管理人           | 万家基金管理有限公司                                                                                                                             |                 |
| 基金托管人           | 中国工商银行股份有限公司                                                                                                                           |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 万家双利 A                                                                                                                                 | 万家双利 C          |
| 下属分级基金的交易代码     | 519190                                                                                                                                 | 016580          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 403,666,137.69 份                                                                                                                       | 95,517,097.70 份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日） |                   |
|-----------------|-------------------------------------|-------------------|
|                 | 万家双利 A                              | 万家双利 C            |
| 1. 本期已实现收益      | 1, 277, 010. 14                     | 747, 677. 39      |
| 2. 本期利润         | 19, 035, 820. 15                    | 3, 810, 369. 92   |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0. 1505                             | 0. 1580           |
| 4. 期末基金资产净值     | 596, 742, 076. 75                   | 139, 489, 825. 84 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1. 4783                             | 1. 4604           |

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人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。

2、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。

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

万家双利 A

| 阶段         | 净值增长率①  | 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      | 9. 30%  | 0. 51%    | 0. 49%     | 0. 05%        | 8. 81%  | 0. 46% |
| 过去六个月      | 11. 44% | 0. 47%    | 0. 63%     | 0. 06%        | 10. 81% | 0. 41% |
| 过去一年       | 19. 00% | 0. 48%    | -1. 07%    | 0. 07%        | 20. 07% | 0. 41% |
| 过去三年       | 18. 82% | 0. 35%    | 4. 45%     | 0. 10%        | 14. 37% | 0. 25% |
| 过去五年       | 31. 68% | 0. 36%    | 7. 70%     | 0. 09%        | 23. 98% | 0. 27% |
| 过去七年       | 48. 02% | 0. 36%    | 9. 38%     | 0. 10%        | 38. 64% | 0. 26% |
| 过去十年       | 61. 40% | 0. 34%    | 9. 25%     | 0. 10%        | 52. 15% | 0. 24% |
| 自基金合同生效起至今 | 85. 10% | 0. 31%    | 21. 39%    | 0. 09%        | 63. 71% | 0. 22% |

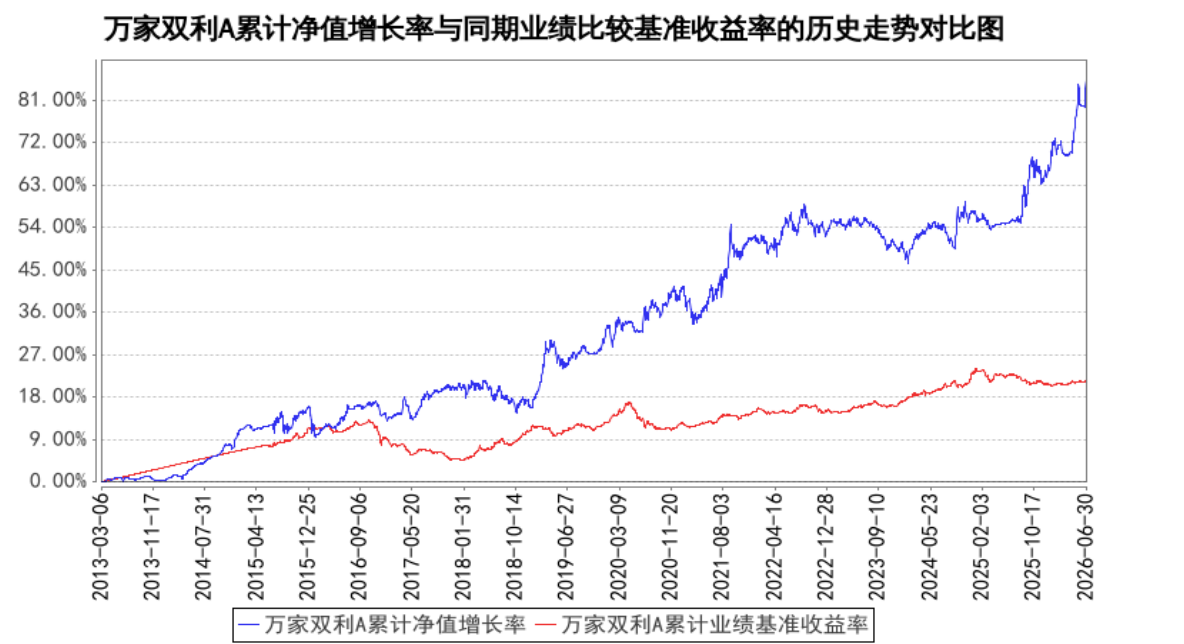
万家双利 C

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | ①—③ | ②—④ |
|----|--------|-----------|------------|--------------|-----|-----|
|----|--------|-----------|------------|--------------|-----|-----|

|                |        |       |        | ④     |        |       |
|----------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去三个月          | 9.21%  | 0.51% | 0.49%  | 0.05% | 8.72%  | 0.46% |
| 过去六个月          | 11.24% | 0.47% | 0.63%  | 0.06% | 10.61% | 0.41% |
| 过去一年           | 18.59% | 0.48% | -1.07% | 0.07% | 19.66% | 0.41% |
| 过去三年           | 17.59% | 0.35% | 4.45%  | 0.10% | 13.14% | 0.25% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 15.83% | 0.33% | 4.61%  | 0.09% | 11.22% | 0.24% |

注：万家双利 C 上述“自基金合同生效起至今”实际为“自基金份额类别首次确认起至今”，下同。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



万家双利C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金于 2013 年 3 月 6 日成立，根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

2、本基金自 2022 年 8 月 25 日起增设 C 类份额，2022 年 8 月 26 日起确认有 C 类基金份额登记在册。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务                                                           | 任本基金的基金经理期限     |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                         |
|-----|--------------------------------------------------------------|-----------------|------|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                                                              | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                                                                                                            |
| 周潜玮 | 固定收益部部门联席总经理；万家双利债券型证券投资基金、万家安恒纯债 3 个月持有期债券型发起式证券投资基金、万家民瑞祥和 | 2022 年 3 月 17 日 | -    | 20 年   | 国籍：中国；学历：上海交通大学管理学硕士，2016 年 9 月入职万家基金管理有限公司，现任固定收益部联席总经理、基金经理，历任固定收益部专户投资经理，固定收益部总监助理，债券投资部总监，固定收益部总监等职。曾任上海银行股份有限公司金融市场部债券交易员、固定收益部副主管等职。 |

|     |                                                                                      |                 |   |        |                                                                                                                                                                                                          |
|-----|--------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|---|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     | 6 个月持有期债券型证券投资基金、万家稳宁债券型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型证券投资基金、万家鑫璟纯债债券型证券投资基金的基金经理。 |                 |   |        |                                                                                                                                                                                                          |
| 陈贇  | 万家双利债券型证券投资基金、万家新机遇价值驱动灵活配置混合型证券投资基金、万家泓裕成长驱动混合型发起式证券投资基金的基金经理。                      | 2025 年 3 月 15 日 | - | 14.5 年 | 国籍：中国；学历：悉尼大学金融专业硕士，2023 年 1 月入职万家基金管理有限公司，现任权益投资部基金经理，历任专户投资部投资经理。曾任诺德基金管理有限公司投资研究部研究员，富安达基金管理有限公司投资研究部研究员，兴业全球基金管理有限公司专户投资部投资经理助理，长城国瑞证券有限公司投资管理事业部投资经理，蜂巢基金管理有限公司基金管理部拟任基金经理，西部利得基金管理有限公司专户投资部投资经理等职。 |
| 孙佳佳 | 万家双利债券型证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家                                                     | 2025 年 4 月 15 日 | - | 6.5 年  | 国籍：中国；学历：华东师范大学金融专业硕士，2019 年 11 月入职万家基金管理有限公司，现任固定收益部基金经理，历任固定收益部研究员。曾任立信会计师事务所（特殊普通合伙）国际业务一部审计员，中诚信证券评估有限公司公共融资部及评级技术与质量管理部分析师等职。                                                                       |

|  |                                                                                                         |  |  |  |  |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|--|
|  | 民瑞祥明 6 个月持 有期混合 型证券投资 基金、万 家稳安 60 天持有 期债券型 证券投资 基金、万 家稳康 30 天持有期 债券型证 券投资基 金、万家 鑫丰纯债 债券型证 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。

3、周潜玮先生因身体原因暂停履行基金经理职责，本基金由当前共同管理此基金的其他基金 经理管理。

4.1.1 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 公平交易专项说明

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，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 4 次，均为指数和量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

债券部分：

二季度，国内经济弱势修复，经济结构呈现明显分化：投资及消费承压，出口保持韧性，成为拉动经济的主要动力。传统投资领域低位运行，科技新兴行业快速发展，传统领域融资动力不足，拖累信贷增长。价格指数方面，受油价推动，PPI 高增，但 CPI 稳定，核心通胀回升较慢。政策层面，货币政策基调总体宽松，二季度末落地新隔夜逆回购工具，关键时点呵护态度明确，资金面在 4-5 月极度充裕、6 月开始有所纠偏，目前资金利率重回政策利率附近；财政方面，上半年政府债发行速度低于去年同期，下半年有较大空间，关注后续是否有新的刺激政策托底内需。

债券市场方面，二季度 10 年期国债收益率下行约 8BP 至季末 1.73%，1Y 国债下行约 10BP，收益率曲线呈陡峭化走势，10Y-1Y 期限利差走阔、30Y-10Y 利差趋平。信用债整体跟随利率债下行，但利差表现分化，中低等级以及中长期品种利差压缩更为显著，中高等级以及短久期品种利差小幅走扩。整体而言，二季度受资金宽松、机构欠配的共同作用，债市震荡偏强运行。展望后续，进入三季度，债市面临多重扰动，包括稳增长政策发力情况、供给压力以及流动性水平的配合情况等，但基本面压力下，预计货币政策以呵护为主，政策利率调降以前，预计债市震荡运



行为主；信用债方面，结合收益率、信用利差水平及下半年机构配置规律，信用利差存在向中枢略回归可能。

组合运作方面，二季度增加了信用债底仓，配置中短期限、中高评级品种提升静态收益率；同时，由于债市整体在较窄区间震荡运行，并无趋势性行情，组合谨慎开展利率波段交易，整体维持市场中性久期附近。

权益部分：

上半年，在外部复杂环境和国内结构调整的整体背景下，经济呈现出平稳调整、温和修复的态势，其中出口继续保持强势，内需修复的节奏则相对有所放缓。海外地缘扰动与宏观情形仍有反复，对国内冲击暂时有限，而科技板块在全球 AI 投资持续加码共振的背景下一骑绝尘。

但往下半年看，仍要谨防地缘博弈的升级，油价与全球供应链的变化，以及美联储加息预期的上升带来的阶段性风险偏好的下行。

从中观产业层面来说，突破封锁，力争科技独立自主背景下的国产芯片产业链是我们配置的主要方向，但由于担忧宏观层面的冲击，我们在二季度对科技仓位做了阶段性的增减，以规避或有的风险。

下半年我们仍将在景气度上行的科技方向上维持重点配置和关注，但同时关注着市场可能的变化所带来的整体风险。继续秉持谨慎但不悲观，防御但不缺席成长的总体投资策略来做好产品的管理。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家双利 A 的基金份额净值为 1.4783 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.30%，同期业绩比较基准收益率为 0.49%；截至本报告期末万家双利 C 的基金份额净值为 1.4604 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.21%，同期业绩比较基准收益率为 0.49%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金自 2026 年 4 月 10 日至 2026 年 5 月 13 日，连续 21 个工作日基金资产净值低于五千万元。

本报告期内，本基金基金份额持有人数量不存在低于二百人的情况。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目   | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资 | 142,788,727.00 | 18.73        |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
|   | 其中：股票             | 142,788,727.00 | 18.73  |
| 2 | 基金投资              | —              | —      |
| 3 | 固定收益投资            | 602,452,640.87 | 79.03  |
|   | 其中：债券             | 602,452,640.87 | 79.03  |
|   | 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      | 10,230,422.67  | 1.34   |
| 8 | 其他资产              | 6,811,900.14   | 0.89   |
| 9 | 合计                | 762,283,690.68 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | —              | —            |
| B  | 采矿业              | —              | —            |
| C  | 制造业              | 121,624,707.00 | 16.52        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | —              | —            |
| E  | 建筑业              | —              | —            |
| F  | 批发和零售业           | —              | —            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | —              | —            |
| H  | 住宿和餐饮业           | —              | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 21,164,020.00  | 2.87         |
| J  | 金融业              | —              | —            |
| K  | 房地产业             | —              | —            |
| L  | 租赁和商务服务业         | —              | —            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | —              | —            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | —              | —            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | —              | —            |
| P  | 教育               | —              | —            |
| Q  | 卫生和社会工作          | —              | —            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | —              | —            |
| S  | 综合               | —              | —            |
|    | 合计               | 142,788,727.00 | 19.39        |

### 5.2.2 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。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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  | 688120 | 华海清科 | 27,000 | 8,698,860.00 | 1.18         |
| 2  | 688256 | 寒武纪  | 5,000  | 7,977,750.00 | 1.08         |
| 3  | 688012 | 中微公司 | 17,000 | 7,964,500.00 | 1.08         |
| 4  | 688008 | 澜起科技 | 25,000 | 7,747,500.00 | 1.05         |
| 5  | 002371 | 北方华创 | 8,600  | 7,607,216.00 | 1.03         |
| 6  | 688041 | 海光信息 | 20,500 | 7,591,150.00 | 1.03         |
| 7  | 688072 | 拓荆科技 | 8,600  | 7,563,958.00 | 1.03         |
| 8  | 688037 | 芯源微  | 17,000 | 7,463,850.00 | 1.01         |
| 9  | 688981 | 中芯国际 | 45,600 | 7,242,192.00 | 0.98         |
| 10 | 688347 | 华虹宏力 | 20,000 | 6,726,000.00 | 0.91         |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 75,398,615.88  | 10.24        |
| 2  | 央行票据      | —              | —            |
| 3  | 金融债券      | 363,159,942.42 | 49.33        |
|    | 其中：政策性金融债 | 64,305,078.90  | 8.73         |
| 4  | 企业债券      | —              | —            |
| 5  | 企业短期融资券   | —              | —            |
| 6  | 中期票据      | 163,894,082.57 | 22.26        |
| 7  | 可转债（可交换债） | —              | —            |
| 8  | 同业存单      | —              | —            |
| 9  | 其他        | —              | —            |
| 10 | 合计        | 602,452,640.87 | 81.83        |

#### 5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码      | 债券名称            | 数量（张）   | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-----------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 250203    | 25 国开 03        | 400,000 | 39,964,953.42 | 5.43         |
| 2  | 092280069 | 22 华夏银行二级资本债 01 | 340,000 | 35,504,942.47 | 4.82         |
| 3  | 260010    | 26 附息国债 10      | 300,000 | 30,050,902.17 | 4.08         |
| 4  | 102381575 | 23 蜀道投资 MTN005  | 200,000 | 21,363,427.95 | 2.90         |
| 5  | 232380066 | 23 中行二级资本债 03A  | 200,000 | 21,299,393.97 | 2.89         |

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 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。

#### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.9.1 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。

##### 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 5.9.3 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。

#### 5.10 投资组合报告附注

##### 5.10.1 本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，中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局和中国人民银行的处罚，中国邮政储蓄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，华夏银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局和中国人民银行的处罚，中国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，交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局和中国人民银行的处罚，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。

##### 5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 15,895.82    |
| 2  | 应收证券清算款 | —            |
| 3  | 应收股利    | —            |
| 4  | 应收利息    | —            |
| 5  | 应收申购款   | 6,796,004.32 |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 其他      | —            |
| 8  | 合计      | 6,811,900.14 |

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1  | 688072 | 拓荆科技 | 7,563,958.00   | 1.03         | 重大事项停牌   |

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 万家双利 A         | 万家双利 C         |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 28,259,383.88  | 11,196,942.86  |
| 报告期期间基金总申购份额              | 388,854,685.53 | 119,065,242.54 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额            | 13,447,931.72  | 34,745,087.70  |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | —              | —              |
| 报告期期末基金份额总额               | 403,666,137.69 | 95,517,097.70  |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| 项目               | 万家双利 A       | 万家双利 C |
|------------------|--------------|--------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 9,329,530.74 | —      |
| 报告期期间买入/申购总份额    | —            | —      |

|                          |              |   |
|--------------------------|--------------|---|
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | -            | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 9,329,530.74 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 2.31         | - |

注：申购份额包括红利再投、转换入份额、因份额拆分而增加的份额；赎回份额包括转换出份额、因份额合并而减少的份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申赎及买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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              | 20260401-20260525       | 9,329,530.74 | -    | -    | 9,329,530.74 | 1.87    |
| 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。<br>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。 |                |                         |              |      |      |              |         |

§9 备查文件目录

9.1 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、《万家双利债券型证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家双利债券型证券投资基金托管协议》。
- 4、万家双利债券型证券投资基金 2026 年第 2 季度报告原文。
- 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。

9.2 存放地点

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

### 9.3 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 7 月 21 日