

万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资
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：招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。

基金托管人招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	万家招瑞回报一年持有期混合	
基金主代码	012435	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 8 月 17 日	
报告期末基金份额总额	187,319,403.03 份	
投资目标	在有效控制投资组合风险的前提下，谋求实现基金财产的长期稳健增值。	
投资策略	1、大类资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、可转换债券与可交换债券投资策略；6、证券公司短期公司债券投资策略；7、股指期货投资策略；8、国债期货投资策略；9、股票期权投资策略；10、融资交易策略；11、信用衍生品投资策略。	
业绩比较基准	中债新综合指数（全价）收益率×85% +沪深 300 指数收益率×10%+恒生指数收益率×5%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。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。	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	万家招瑞回报一年持有期混	万家招瑞回报一年持有期混

	合 A	合 C
下属分级基金的交易代码	012435	012436
报告期末下属分级基金的份额总额	54,251,390.34 份	133,068,012.69 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）	
	万家招瑞回报一年持有期混合 A	万家招瑞回报一年持有期混合 C
1. 本期已实现收益	1,007,057.63	2,256,677.06
2. 本期利润	2,170,870.08	5,017,720.29
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0396	0.0377
4. 期末基金资产净值	62,648,438.18	150,709,663.39
5. 期末基金份额净值	1.1548	1.1326

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

万家招瑞回报一年持有期混合 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	3.55%	0.28%	1.32%	0.17%	2.23%	0.11%
过去六个月	4.42%	0.27%	1.04%	0.17%	3.38%	0.10%
过去一年	11.47%	0.26%	1.82%	0.15%	9.65%	0.11%
过去三年	18.31%	0.30%	8.91%	0.16%	9.40%	0.14%
自基金合同生效起至今	15.48%	0.27%	7.05%	0.17%	8.43%	0.10%

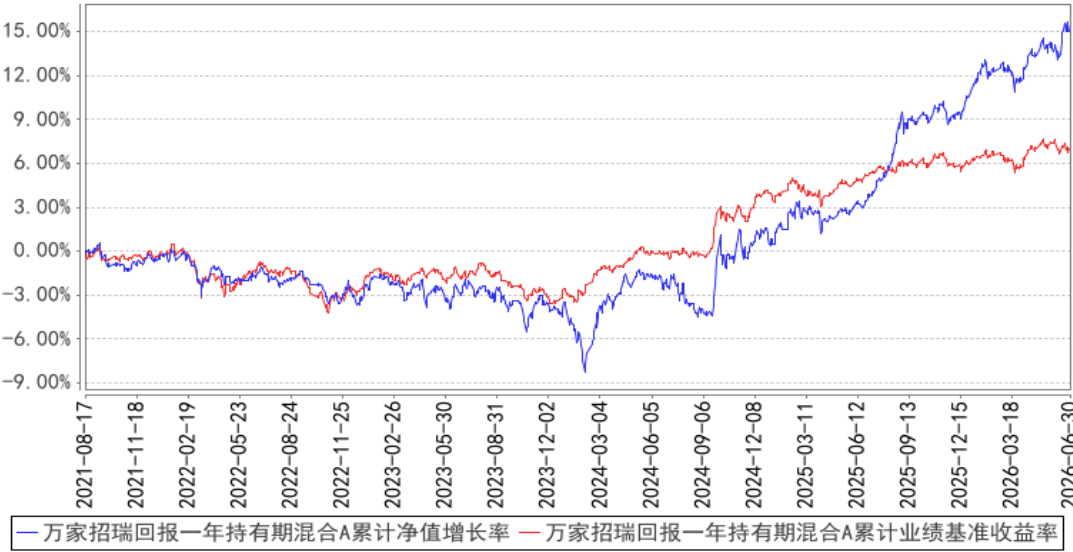
万家招瑞回报一年持有期混合 C

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④	①－③	②－④
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

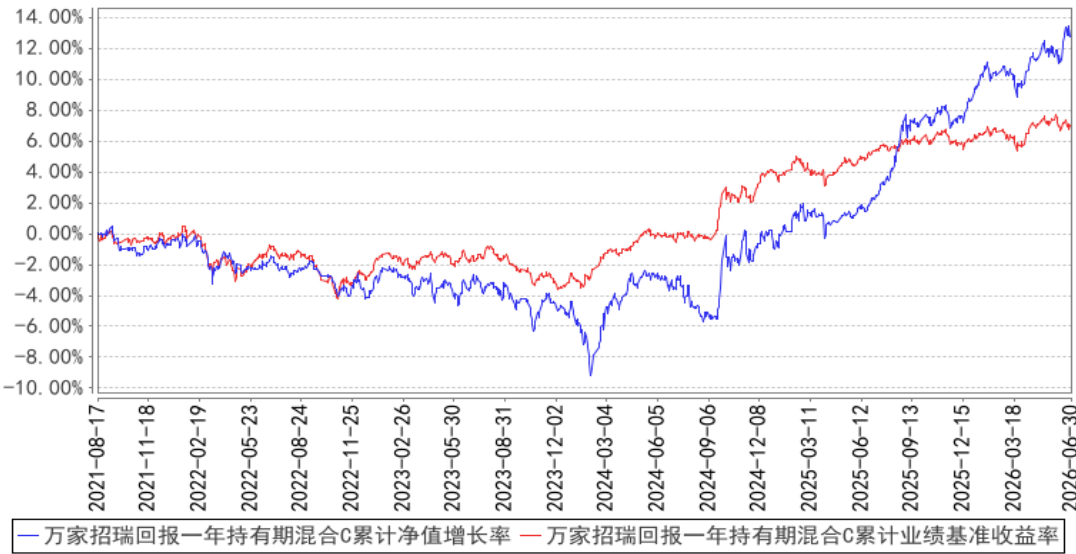
		准差②	收益率③	收益率标准差 ④		
过去三个月	3.44%	0.28%	1.32%	0.17%	2.12%	0.11%
过去六个月	4.22%	0.27%	1.04%	0.17%	3.18%	0.10%
过去一年	11.04%	0.26%	1.82%	0.15%	9.22%	0.11%
过去三年	16.91%	0.30%	8.91%	0.16%	8.00%	0.14%
自基金合同 生效起至今	13.26%	0.27%	7.05%	0.17%	6.21%	0.10%

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

万家招瑞回报一年持有期混合A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



万家招瑞回报一年持有期混合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：本基金于 2021 年 8 月 17 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		
苏谋东	公司领导、总经理助理；万家信用恒利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、万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金、万	2021 年 8 月 17 日	—	18 年	国籍：中国；学历：复旦大学经济学硕士，2013 年 3 月入职万家基金管理有限公司，现任公司总经理助理、基金经理，历任固定收益部副总监、固定收益部总监、现金管理部总监。曾任宝钢集团财务有限责任公司资金运用部投资经理等职。

	家民丰回报一年持有期混合型证券投资基金、万家瑞和灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞泽回报一年持有期混合型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。				
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	2023 年 8 月 1 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。

	期混合型证券投资基金、万家民丰回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。

4.1.1 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 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,执行交易系统中的公平交易程序;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:

二季度国内经济较一季度边际有所走弱,结构分化更加明显。具体看,二季度国内消费和投资均走弱,仅出口超预期,显示内需弱、外需强的格局仍在持续,并且由于财政力度不强,内需弱化的情况有所增加,受益于 AI 产业发展,算力相关产业亮点突出。二季度宏观层面的货币条件合理偏松,对实体经济的支撑较好。物价方面,美伊冲突导致油价大幅反弹并推高 PPI,不过进入二季度后期,随着双方阶段性停火,油价逐步回落,物价压力开始缓解。

二季度国内债市震荡为主。前述基本面走弱对债券市场形成利多,利率方向以下行为主。但是进入 5 月份后,央行出于稳定预期的目的,对银行间市场流动性进行了逆周期调控,资金面开始有所波动,资金价格也有所反弹,带动债券收益率出现同等方向的波动。本基金延续对经济基本面的核心关注,继续坚持积极的配置策略,较一季度不同的是,考虑到一季度信用债下行较多,票息有所降低,而利率品种仍然存在期限利差较大的地方,因而,本基金债券部分在二季度适度增配了有期限利差优势的利率品种。

展望后市,我们对宏观经济的看法基本不变,经济仍处于结构转型期,时间是解决很多问题的最佳答案。在这个过程中,财政和货币政策会相机抉择,对转型过程中出现的超预期的地方进行处理和平滑。此种情况下,我们的基本判断是利率仍将维持低位,因而,我们对债券仍然维持积极配置。

权益部分:

2026 年二季度，A 股主要宽基指数整体呈现震荡向上的格局，市场逐步对美伊冲突脱敏，成交金额持续攀升。指数震荡向上的同时，市场呈现出极致的风格分化，从申万一级行业来看，与 AI 相关产业链表现强势，比如电子、通信、建筑材料涨幅位居前三，而传统板块如石油石化、农林牧渔、钢铁跌幅居前。

展望后市，上半年 AI 相关产业链在高景气预期下表现亮眼，而传统板块跌幅较大，这种极致的行情有望在下半年得到缓解，7 到 8 月上市公司将陆续发布中期业绩，交易有望围绕景气与业绩高增展开，同时也会关注 AI 相关半年报的业绩匹配情况，整体市场风格有望趋于均衡。整体来看，6 月制造业 PMI 为 50.3，超市场预期和前值，连续四个月维持在 50 荣枯线上方，经济逐步企稳；另外市场资金较为宽裕，A 股主要宽基指数有望继续呈现偏强震荡格局。

本产品含权部分策略包含两块：一是股票部分的投资策略，为主动量化选股策略，运用量化选股模型和行业配置策略，来主动适应不同的市场风格，前瞻性选股，提高选股胜率，力争能获得长期稳定的超额收益。本基金的股票投资在行业和风格配置上相对均衡，在量化选股方面精选行业内质优个股组合，持股较为分散。二是量化可转债策略，通过量化模型对可转债进行优选，以期提升产品收益的稳健性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家招瑞回报一年持有期混合 A 的基金份额净值为 1.1548 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.55%，同期业绩比较基准收益率为 1.32%；截至本报告期末万家招瑞回报一年持有期混合 C 的基金份额净值为 1.1326 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.44%，同期业绩比较基准收益率为 1.32%。

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 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	34,001,492.45	13.69
	其中：股票	34,001,492.45	13.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	212,895,072.67	85.70
	其中：债券	212,895,072.67	85.70

	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	1,496,426.08	0.60
8	其他资产	25,258.27	0.01
9	合计	248,418,249.47	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 975,954.05 元，占净值比例 0.46%。

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	135,032.00	0.06
B	采矿业	837,100.00	0.39
C	制造业	23,544,750.30	11.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	217,893.00	0.10
E	建筑业	114,707.00	0.05
F	批发和零售业	1,523,756.00	0.71
G	交通运输、仓储和邮政业	770,033.00	0.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,377,418.00	1.58
J	金融业	1,408,128.10	0.66
K	房地产业	103,844.00	0.05
L	租赁和商务服务业	427,474.00	0.20
M	科学研究和技术服务业	22,836.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	277,899.00	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	24,045.00	0.01
Q	卫生和社会工作	16,049.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	224,574.00	0.11
S	综合	-	-
	合计	33,025,538.40	15.48

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
材料	-	-

可选消费品	270,847.77	0.13
必需消费品	40,880.92	0.02
能源	—	—
金融	25,778.56	0.01
医疗保健	108,880.56	0.05
工业	15,060.66	0.01
信息技术	191,270.35	0.09
通信服务	323,235.23	0.15
公用事业	—	—
房地产	—	—
合计	975,954.05	0.46

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	688503	聚和材料	3,600	477,720.00	0.22
2	002558	巨人网络	17,000	468,520.00	0.22
3	300442	润泽科技	4,600	382,122.00	0.18
4	688498	源杰科技	200	377,200.00	0.18
5	600105	永鼎股份	5,500	371,140.00	0.17
6	600961	株冶集团	11,400	369,246.00	0.17
7	603444	吉比特	1,000	358,420.00	0.17
8	688627	精智达	500	357,500.00	0.17
9	300476	胜宏科技	1,000	346,430.00	0.16
10	688521	芯原股份	900	334,026.00	0.16

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	606,295.40	0.28
2	央行票据	—	—
3	金融债券	203,545,945.38	95.40
	其中：政策性金融债	30,306,268.49	14.20
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	8,742,831.89	4.10
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	212,895,072.67	99.78

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	232580001	25 工行二级资本 债 01BC	115,000	11,710,355.48	5.49
2	2228017	22 邮储银行二级 01	110,000	11,275,250.14	5.28
3	232480020	24 兴业银行二级 资本债 01	100,000	10,264,917.81	4.81
4	232400018	24 宁波银行二级 资本债 01	100,000	10,260,753.42	4.81
5	250220	25 国开 20	100,000	10,222,186.30	4.79

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股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易以套期保值为目的，利用股指期货剥离部分多头股票资产的系统性风险。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金可基于谨慎原则，以套期保值为主要目的，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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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，中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局和中国人民银行的处罚，中国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，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局北京市分局和中国人民银行的处罚，宁波银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行宁波市分行的处罚，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。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	6,701.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	6,004.28
4	应收利息	-
5	应收申购款	152.00
6	其他应收款	12,400.00
7	其他	-
8	合计	25,258.27

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110095	双良转债	206,201.68	0.10
2	127030	盛虹转债	205,559.28	0.10
3	110098	南药转债	183,709.10	0.09
4	113624	正川转债	147,768.24	0.07
5	113691	和邦转债	146,105.08	0.07
6	113056	重银转债	143,253.14	0.07
7	123092	天壕转债	142,707.27	0.07
8	123188	水羊转债	142,174.92	0.07
9	127045	牧原转债	140,830.52	0.07
10	127040	国泰转债	140,537.28	0.07
11	123107	温氏转债	139,887.79	0.07
12	127034	绿茵转债	139,430.75	0.07
13	123216	科顺转债	139,100.87	0.07
14	123172	漱玉转债	138,986.24	0.07
15	113042	上银转债	138,631.73	0.06
16	127103	东南转债	136,859.21	0.06
17	118052	浩瀚转债	126,839.39	0.06
18	118042	奥维转债	124,373.87	0.06
19	123183	海顺转债	123,758.88	0.06
20	123225	翔丰转债	123,523.89	0.06
21	110085	通 22 转债	123,146.15	0.06
22	127064	杭氧转债	121,831.72	0.06
23	123165	回天转债	119,970.53	0.06
24	111015	东亚转债	118,925.98	0.06
25	127095	广泰转债	118,271.06	0.06
26	123109	昌红转债	117,796.57	0.06
27	118031	天 23 转债	116,480.35	0.05
28	123178	花园转债	114,363.81	0.05
29	127031	洋丰转债	114,218.60	0.05
30	113658	密卫转债	113,996.85	0.05
31	113054	绿动转债	113,843.61	0.05
32	113694	清源转债	90,660.10	0.04
33	127046	百润转债	84,423.30	0.04
34	113636	甬金转债	82,848.71	0.04
35	111002	特纸转债	82,739.65	0.04
36	113661	福 22 转债	82,533.08	0.04
37	127049	希望转 2	82,532.31	0.04
38	113648	巨星转债	82,327.29	0.04
39	127108	太能转债	82,244.77	0.04

40	123150	九强转债	81,896.88	0.04
41	118024	冠宇转债	81,844.51	0.04
42	127099	盛航转债	81,842.29	0.04
43	127105	龙星转债	81,793.93	0.04
44	113052	兴业转债	81,712.23	0.04
45	110097	天润转债	81,588.26	0.04
46	127082	亚科转债	81,474.62	0.04
47	127056	中特转债	81,248.79	0.04
48	113062	常银转债	81,154.19	0.04
49	127084	柳工转 2	81,128.31	0.04
50	111004	明新转债	81,096.52	0.04
51	127050	麒麟转债	80,918.58	0.04
52	113647	禾丰转债	80,910.32	0.04
53	113067	燃 23 转债	80,885.91	0.04
54	113665	汇通转债	80,383.45	0.04
55	118034	晶能转债	80,168.70	0.04
56	113659	莱克转债	79,994.12	0.04
57	127067	恒逸转 2	73,722.67	0.03
58	110090	爱迪转债	68,340.34	0.03
59	113698	凯众转债	67,620.13	0.03
60	113696	伯 25 转债	67,600.00	0.03
61	113692	保隆转债	66,408.88	0.03
62	123253	永贵转债	66,132.69	0.03
63	127110	广核转债	65,848.25	0.03
64	113070	渝水转债	65,614.89	0.03
65	123237	佳禾转债	65,396.05	0.03
66	123155	中陆转债	65,185.29	0.03
67	113671	武进转债	65,150.94	0.03
68	123213	天源转债	64,806.17	0.03
69	113667	春 23 转债	61,371.61	0.03
70	118012	微芯转债	60,754.77	0.03
71	113046	金田转债	60,022.23	0.03
72	123243	严牌转债	58,800.59	0.03
73	127072	博实转债	58,589.13	0.03
74	127044	蒙娜转债	58,529.78	0.03
75	113051	节能转债	58,399.95	0.03
76	113695	华辰转债	58,066.96	0.03
77	111014	李子转债	58,019.02	0.03
78	127060	湘佳转债	57,852.36	0.03
79	127104	姚记转债	57,811.68	0.03
80	113631	皖天转债	57,801.53	0.03
81	113680	丽岛转债	57,667.89	0.03

82	118022	锂科转债	57,577.28	0.03
83	113058	友发转债	57,486.11	0.03
84	111017	蓝天转债	57,427.86	0.03
85	127054	双箭转债	57,143.69	0.03
86	113048	晶科转债	56,885.61	0.03
87	110086	精工转债	56,638.16	0.03
88	110099	福能转债	56,169.76	0.03
89	110093	神马转债	55,225.67	0.03
90	123241	欧通转债	25,039.95	0.01
91	113043	财通转债	24,734.64	0.01
92	123194	百洋转债	24,136.92	0.01
93	113640	苏利转债	24,054.34	0.01
94	123112	万讯转债	23,959.44	0.01
95	110076	华海转债	23,867.85	0.01
96	128142	新乳转债	23,760.41	0.01
97	123113	仙乐转债	23,721.60	0.01
98	113605	大参转债	23,577.68	0.01
99	113049	长汽转债	23,566.85	0.01
100	123117	健帆转债	23,516.86	0.01
101	123090	三诺转债	23,511.95	0.01
102	127027	能化转债	23,383.47	0.01
103	113655	欧 22 转债	23,368.99	0.01
104	127089	晶澳转债	23,183.35	0.01
105	127025	冀东转债	23,175.52	0.01
106	110075	南航转债	23,033.92	0.01
107	110077	洪城转债	22,870.50	0.01
108	111018	华康转债	22,864.53	0.01

5.11.5 报告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。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家招瑞回报一年持有期 混合 A	万家招瑞回报一年持有期 混合 C
报告期期初基金份额总额	55,006,481.18	131,351,550.85
报告期期间基金总申购份额	1,671,221.02	2,265,681.61
减：报告期期间基金总赎回份额	2,426,311.86	549,219.77

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	54,251,390.34	133,068,012.69

§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

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。

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

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。

§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、《万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金托管协议》。
- 4、万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金 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。

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