

万家瑞盈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：宁波银行股份有限公司

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。

基金托管人宁波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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 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	54

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	54
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	54
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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 盈利投资者数量占比	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	58
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	58
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	万家瑞盈	
基金主代码	003734	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 11 月 11 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	148,826,034.30 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	万家瑞盈 A	万家瑞盈 C
下属分级基金的交 易代码	003734	003735
报告期末下属分级 基金的份额总额	122,272,368.17 份	26,553,666.13 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过灵活运用资产配置策略及多种股票市场、债券市场投资策略，充分挖掘潜在的投资机会，追求基金资产长期稳定增值。
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、权证投资策略；4、普通债券投资策略；5、中小企业私募债券债券投资策略；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	宁波银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	兰剑	柴飞犇
	联系电话	021-38909626	0574-81851181
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	custody-audit@nbc.cn
客户服务电话		4008880800	0574-83895886
传真		021-38909627	0574-89103213
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）	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 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	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号
邮政编码		200122	315100

法定代表人	陈广益	庄灵君
-------	-----	-----

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	万家基金管理有限公司	上海市浦东新区浦电路 360 号 陆家嘴投资大厦 9 楼、15 楼、 16 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	万家瑞盈 A	万家瑞盈 C
本期已实现收益	11,936,605.31	2,206,384.38
本期利润	16,845,603.73	2,925,060.65
加权平均基金份 额本期利润	0.1615	0.1376
本期加权平均净 值利润率	10.26%	8.86%
本期基金份额净 值增长率	10.31%	10.19%
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	61,002,168.66	12,903,367.51
期末可供分配基 金份额利润	0.4989	0.4859
期末基金资产净 值	205,611,910.27	44,271,382.64
期末基金份额净 值	1.6816	1.6672
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	68.16%	66.72%
-------------	--------	--------

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

万家瑞盈 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	14.23%	1.20%	6.60%	0.63%	7.63%	0.57%
过去六个月	10.31%	1.08%	5.04%	0.57%	5.27%	0.51%
过去一年	31.83%	0.97%	13.76%	0.51%	18.07%	0.46%
过去三年	36.60%	0.65%	23.16%	0.55%	13.44%	0.10%
过去五年	42.18%	0.51%	11.67%	0.55%	30.51%	-0.04%
过去七年	48.51%	0.44%	37.28%	0.57%	11.23%	-0.13%
自基金合同生效起至今	68.16%	0.38%	53.41%	0.57%	14.75%	-0.19%

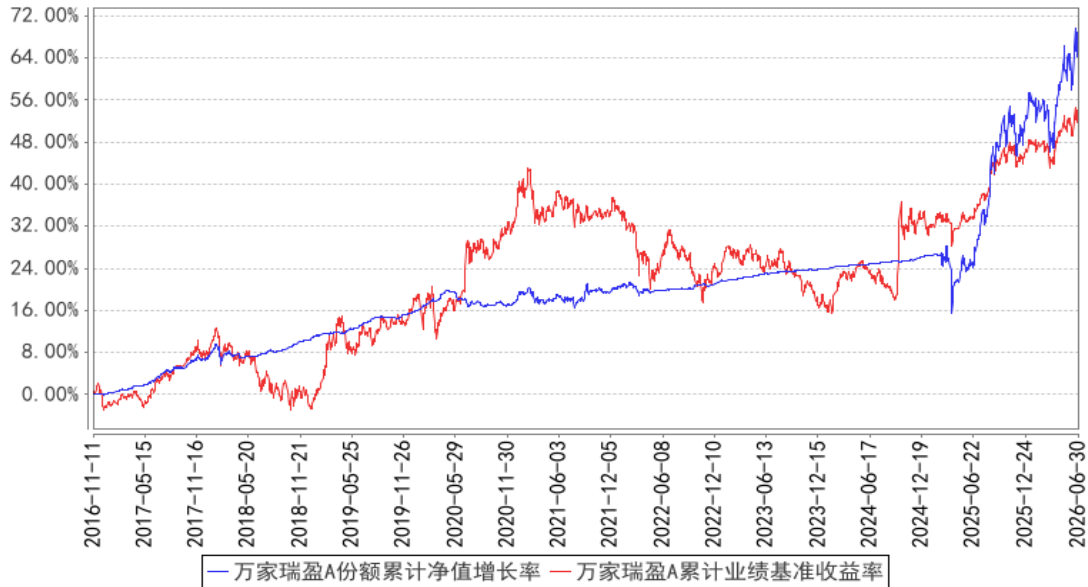
万家瑞盈 C

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	14.17%	1.20%	6.60%	0.63%	7.57%	0.57%
过去六个月	10.19%	1.08%	5.04%	0.57%	5.15%	0.51%
过去一年	31.57%	0.97%	13.76%	0.51%	17.81%	0.46%
过去三年	35.78%	0.65%	23.16%	0.55%	12.62%	0.10%
过去五年	41.17%	0.51%	11.67%	0.55%	29.50%	-0.04%
过去七年	47.44%	0.44%	37.28%	0.57%	10.16%	-0.13%

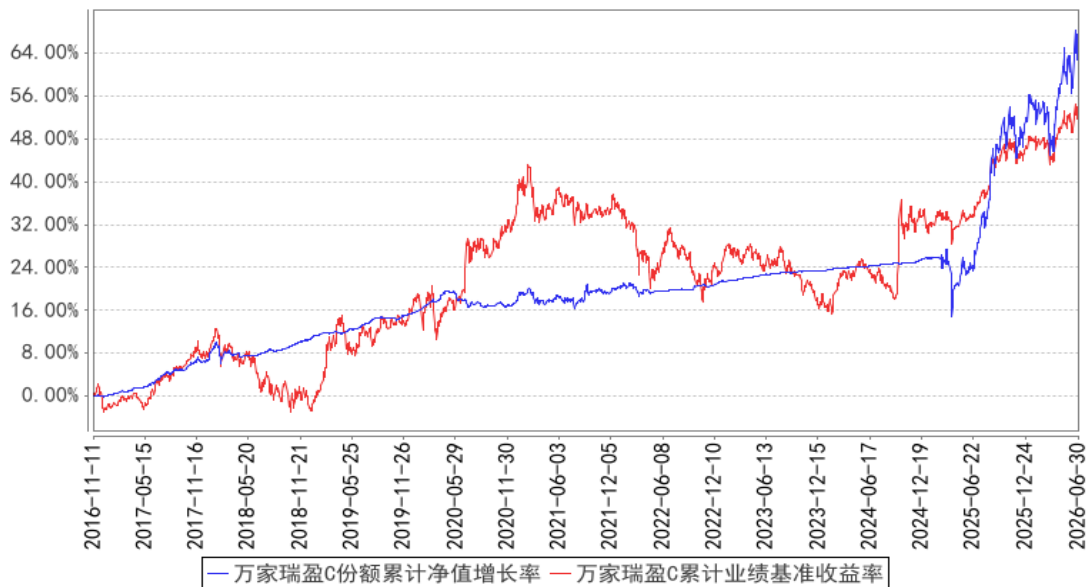
自基金合同 生效起至今	66.72%	0.38%	53.41%	0.57%	13.31%	-0.19%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

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

万家瑞盈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



万家瑞盈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 2016 年 11 月 11 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	2025 年 3 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。

	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。				
李自龙	万家上证科创板 100 指数增强型发起式证券投资基金、万家价值回报混合型发起式证券投资基金、万家元晟量化选股混合型发起式证券投资基金、万家周期视野股票型发起式证券投资基金、万家国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家	2025 年 5 月 22 日	-	9 年	国籍：中国；学历：复旦大学理论物理专业博士，2020 年 4 月入职万家基金管理有限公司，现任量化投资部基金经理，历任量化投资部投资经理助理、投资经理。曾任通联数据股份公司金融工程部量化研究员，上海鹤骑鹰投资管理有限公司投资研究部量化研究员，东兴期货有限责任公司投资咨询部研究员等职。

国证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家恒生港股通汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、万家数字经济股票型发起式证券投资基金、万家沪深300成长交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家港股通价值混合型发起式证券投资基金、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，在力求有效跟踪沪深 300 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盈 A 的基金份额净值为 1.6816 元，本报告期基金份额净值增长率为

10.31%，同期业绩比较基准收益率为 5.04%；截至本报告期末万家瑞盈 C 的基金份额净值为 1.6672 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.19%，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

本报告期内，本托管人在万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）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、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：“财务会计报告”中的“各关联方投资本基金的情况”、“金融工具风险及管理”部分以及“基金份额持有人信息”部分均未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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：万家瑞盈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	42,631,315.14	23,904,589.52
结算备付金		174,273.40	24,656.46
存出保证金		39,966.35	84,939.93
交易性金融资产	6.4.7.2	235,539,436.10	212,367,682.69
其中：股票投资		235,539,436.10	212,364,596.85
基金投资		-	-
债券投资		-	3,085.84

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		-	-
应收申购款		61,968.27	28,048.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		278,446,959.26	236,409,917.42
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		28,160,546.77	7,707,760.13
应付赎回款		44,784.44	13,941.91
应付管理人报酬		109,834.23	107,059.02
应付托管费		21,966.83	21,411.81
应付销售服务费		4,231.59	6,423.77
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	222,302.49	192,645.73
负债合计		28,563,666.35	8,049,242.37
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	148,826,034.30	149,988,478.17
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	101,057,258.61	78,372,196.88
净资产合计		249,883,292.91	228,360,675.05
负债和净资产总计		278,446,959.26	236,409,917.42

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 148,826,034.30 份，其中万家瑞盈 A 基金份额净值 1.6816 元，基金份额总额 122,272,368.17 份；万家瑞盈 C 基金份额净值 1.6672 元，基金份

额总额 26,553,666.13 份。

6.2 利润表

会计主体：万家瑞盈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		20,589,569.09	2,268,522.32
1. 利息收入		64,611.75	129,554.73
其中：存款利息收入	6.4.7.10	64,611.75	81,588.19
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		-	47,966.54
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		14,883,365.94	2,397,786.76
其中：股票投资收益	6.4.7.11	13,015,229.14	-408,730.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	15.05	-24,334.62
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
收益		-	-
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	1,868,121.75	2,830,851.89
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	5,627,674.69	-422,535.91
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	13,916.71	163,716.74
减：二、营业总支出		818,904.71	879,326.19
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	585,371.88	615,904.35
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	117,074.37	123,180.85
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	32,774.70	66,865.55

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		-	172. 68
8. 其他费用	6. 4. 7. 20	83, 683. 76	73, 202. 76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		19, 770, 664. 38	1, 389, 196. 13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19, 770, 664. 38	1, 389, 196. 13
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		19, 770, 664. 38	1, 389, 196. 13

6.3 净资产变动表

会计主体：万家瑞盈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	149, 988, 478. 17	-	78, 372, 196. 88	228, 360, 675. 05
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	149, 988, 478. 17	-	78, 372, 196. 88	228, 360, 675. 05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1, 162, 443. 87	-	22, 685, 061. 73	21, 522, 617. 86
（一）、综合收益总额	-	-	19, 770, 664. 38	19, 770, 664. 38
（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）	-1, 162, 443. 87	-	2, 914, 397. 35	1, 751, 953. 48
其中：1. 基金申	55, 258, 766. 46	-	34, 896, 968. 92	90, 155, 735. 38

购款				
2. 基金赎回款	-56,421,210.33	-	-31,982,571.57	-88,403,781.90
(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	148,826,034.30	-	101,057,258.61	249,883,292.91
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	34,601,789.25	-	8,882,227.74	43,484,016.99
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	34,601,789.25	-	8,882,227.74	43,484,016.99
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	168,509,671.08	-	46,754,099.94	215,263,771.02
(一)、综合收益总额	-	-	1,389,196.13	1,389,196.13
(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)	168,509,671.08	-	45,364,903.81	213,874,574.89
其中：1. 基金申购款	273,934,199.41	-	72,530,242.12	346,464,441.53
2. 基金赎回款	-105,424,528.33	-	-27,165,338.31	-132,589,866.64
(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	203,111,460.33	-	55,636,327.68	258,747,788.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈广益

基金管理人负责人

莫海波

主管会计工作负责人

尹超

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

万家瑞盈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]1959 号文《关于准予万家瑞盈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 2016 年 11 月 9 日至 2016 年 11 月 10 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明（2016）验字第 60778298_B15 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 2016 年 11 月 11 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 620,025,575.38 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 620,025,575.38 元，折合 620,025,575.38 份基金份额。本基金的基金管理机构为万家基金管理有限公司，注册登记机构为万家基金管理有限公司，基金托管人为宁波银行股份有限公司。

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（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券、可交换债券、中小企业私募债券、中期票据、证券公司短期公司债券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、货币市场工具等）、权证、股指期货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*50%+中证全债指数收益率*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	42,631,315.14
等于：本金	42,626,842.96
加：应计利息	4,472.18
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	42,631,315.14

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	201,126,325.51	-	235,539,436.10	34,413,110.59
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	201,126,325.51	-	235,539,436.10	34,413,110.59

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	34.24
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	47,884.49
其中：交易所市场	47,884.49
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	174,383.76
合计	222,302.49

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

万家瑞盈 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	124,753,682.59	124,753,682.59
本期申购	36,005,130.15	36,005,130.15
本期赎回（以“-”号填列）	-38,486,444.57	-38,486,444.57
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	122,272,368.17	122,272,368.17

万家瑞盈 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	25,234,795.58	25,234,795.58
本期申购	19,253,636.31	19,253,636.31
本期赎回（以“-”号填列）	-17,934,765.76	-17,934,765.76
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	26,553,666.13	26,553,666.13

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

万家瑞盈 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	48,566,837.64	16,860,455.47	65,427,293.11
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	48,566,837.64	16,860,455.47	65,427,293.11
本期利润	11,936,605.31	4,908,998.42	16,845,603.73
本期基金份额交易产生的变动数	498,725.71	567,919.55	1,066,645.26
其中：基金申购款	16,661,008.52	5,832,893.33	22,493,901.85
基金赎回款	-16,162,282.81	-5,264,973.78	-21,427,256.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	61,002,168.66	22,337,373.44	83,339,542.10

万家瑞盈 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,558,583.94	3,386,319.83	12,944,903.77
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	9,558,583.94	3,386,319.83	12,944,903.77
本期利润	2,206,384.38	718,676.27	2,925,060.65
本期基金份额交易产生的变动数	1,138,399.19	709,352.90	1,847,752.09
其中：基金申购款	9,298,619.77	3,104,447.30	12,403,067.07
基金赎回款	-8,160,220.58	-2,395,094.40	-10,555,314.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,903,367.51	4,814,349.00	17,717,716.51

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	64,405.79
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	93.73
其他	112.23
合计	64,611.75

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	13,015,229.14
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	13,015,229.14

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	84,818,928.86
减：卖出股票成本总额	71,673,094.78
减：交易费用	130,604.94
买卖股票差价收入	13,015,229.14

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	52.85
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-37.80
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	15.05

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	305,859.25
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	303,112.80
减：应计利息总额	2,784.25
减：交易费用	-

买卖债券差价收入	-37.80
----------	--------

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	1,868,121.75
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	1,868,121.75

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	5,627,674.69
股票投资	5,627,629.69
债券投资	45.00
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	5,627,674.69

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	13,911.41
基金转换费收入	5.30
合计	13,916.71

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	-
账户维护费	9,300.00
合计	83,683.76

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
宁波银行股份有限公司（“宁波银行”）	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 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	172,902,171.44	99.99	437,044,579.53	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	600,132.00	100.00	19,623,518.80	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	-	-	446,800,000.00	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	77,100.71	99.99	47,878.23	99.99
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	194,881.64	100.00	49,539.77	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	585,371.88	615,904.35
其中：应支付销售机构的客户维护费	90,388.69	57,464.21

应支付基金管理人的净管理费	494,983.19	558,440.14
---------------	------------	------------

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管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 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	上年度可比期间
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	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	117,074.37	123,180.85

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.12%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.12\%\div \text{当年天数}$$

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托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 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		
	万家瑞盈 A	万家瑞盈 C	合计
万家基金	-	19,601.11	19,601.11
中泰证券	-	175.82	175.82
合计	-	19,776.93	19,776.93
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		
获得销售服务费的各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	万家瑞盈 A	万家瑞盈 C	合计
万家基金	-	35,740.22	35,740.22
中泰证券	-	143.94	143.94
合计	-	35,884.16	35,884.16

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 0.20%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.20\%\div \text{当年天数}$$

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

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中划出，由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。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
宁波银行	42,631,315.14	64,405.79	15,947,764.34	79,490.72

注：本基金的银行存款由基金托管人宁波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	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	78	4,154.28	4,581.72	-
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	6,594	66,665.34	66,665.34	-
001248	华	2026	1 个月	新	10.11	10.11	2,825	28,560.75	28,560.75	-

	润 新 能 源	年 6 月 24 日	内(含)	股 未 上 市						
001257	盛 龙 股 份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	7.82	20.74	774	6,052.68	16,052.76	-
001312	福 恩 股 份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	18.38	16.78	64	1,176.32	1,073.92	-
001365	天 海 电 子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	27.19	31.31	196	5,329.24	6,136.76	-
001399	惠 科 股 份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	10.12	27.73	1,168	11,820.16	32,388.64	-
301513	尚 水 智 能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	26.66	50.96	115	3,065.90	5,860.40	-
301531	春 光 集 团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	13.30	51.56	216	2,872.80	11,136.96	-
301599	理 奇 智 能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新 股 流 通	13.91	32.47	228	3,171.48	7,403.16	-

				受限						
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股 流通 受限	46.08	463.33	262	12,072.96	121,392.46	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股 流通 受限	7.08	28.40	382	2,704.56	10,848.80	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股 流通 受限	58.00	112.16	62	3,596.00	6,953.92	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股 流通 受限	69.66	160.06	170	11,842.20	27,210.20	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	78.38	121.77	42	3,291.96	5,114.34	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	21.93	77.78	169	3,706.17	13,144.82	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股 流通 受限	24.68	86.80	117	2,887.56	10,155.60	-

601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	229	2,560.22	4,028.11	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	41	1,553.08	1,429.67	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	32	1,071.68	1,085.76	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	76	1,662.88	1,939.52	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通受限	13.86	73.46	124	1,718.64	9,109.04	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	86	1,355.36	4,017.06	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	121	2,141.70	10,202.72	-
688635	长进	2026 年 5	6 个月	新股	40.98	308.19	83	3,401.34	25,579.77	-

	光子	月 20 日		流通受限						
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,000	17,520.00	35,920.00	-
688765	禾元生物	2025 年 10 月 16 日	9 个月	新股流通受限	29.06	48.56	5,680	165,060.80	275,820.80	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	9 个月	新股流通受限	22.68	42.16	1,720	39,009.60	72,515.20	-
688783	西安奕材	2025 年 10 月 20 日	9 个月	新股流通受限	8.62	57.42	13,928	120,059.36	799,745.76	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	62	5,715.16	28,715.30	-
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	9 个月	新股流通受限	114.28	676.94	837	95,652.36	566,598.78	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通	44.56	468.67	89	3,965.84	41,711.63	-

				受限						
688802	沐曦股份	2025年12月9日	9个月	新股流通受限	104.66	768.89	566	59,237.56	435,191.74	-
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	44	3,602.72	69,710.52	-
688811	有研复材	2026年4月1日	6个月	新股流通受限	6.41	24.13	577	3,698.57	13,923.01	-
688813	泰金新能	2026年3月24日	6个月	新股流通受限	26.28	172.09	141	3,705.48	24,264.69	-
688816	易思维	2026年2月4日	6个月	新股流通受限	55.95	57.10	84	4,699.80	4,796.40	-
688818	电科蓝天	2026年2月3日	6个月	新股流通受限	9.47	70.14	611	5,786.17	42,855.54	-
688820	盛合晶微	2026年4月13日	6个月	新股流通受限	19.68	141.49	256	5,038.08	36,221.44	-

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	1,600	946,577.58	1,407,248.00	-

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	-	-
未评级	-	3,085.84
合计	-	3,085.84

注：未评级债券包括政策性金融债。

6.4.13.3 流动性风险

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

本基金所持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	42,631,315.14	-	-	-	-	-	42,631,315.14
结算备付金	174,273.40	-	-	-	-	-	174,273.40
存出保证金	39,966.35	-	-	-	-	-	39,966.35
交易性金融资产	-	-	-	-	-	235,539,436.10	235,539,436.10
应收申购款	-	-	-	-	-	61,968.27	61,968.27
资产总计	42,845,554.89	-	-	-	-	235,601,404.37	278,446,959.26
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	44,784.44	44,784.44
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	109,834.23	109,834.23
应付托管费	-	-	-	-	-	21,966.83	21,966.83
应付清算款	-	-	-	-	-	28,160,546.77	28,160,546.77
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,231.59	4,231.59

其他负债	-	-	-	-	-	-222,302.49	222,302.49
负债总计	-	-	-	-	-	28,563,666.35	28,563,666.35
利率敏感度缺口	42,845,554.89	-	-	-	-	207,037,738.02	249,883,292.91
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	23,904,589.52	-	-	-	-	-	23,904,589.52
结算备付金	24,656.46	-	-	-	-	-	24,656.46
存出保证金	84,939.93	-	-	-	-	-	84,939.93
交易性金融资产	-	3,085.84	-	-	-	212,364,596.85	212,367,682.69
应收申购款	-	-	-	-	-	28,048.82	28,048.82
资产总计	24,014,185.91	3,085.84	-	-	-	212,392,645.67	236,409,917.42
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	13,941.91	13,941.91
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	107,059.02	107,059.02
应付托管费	-	-	-	-	-	21,411.81	21,411.81
应付清算款	-	-	-	-	-	7,707,760.13	7,707,760.13
应付销售服务费	-	-	-	-	-	6,423.77	6,423.77
其他负债	-	-	-	-	-	192,645.73	192,645.73
负债总计	-	-	-	-	-	8,049,242.37	8,049,242.37
利率敏感度缺口	24,014,185.91	3,085.84	-	-	-	204,343,403.30	228,360,675.05

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	-	1.63

	基点		
	市场利率上升 25 个基点	-	-1.63

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，所面临的最大的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	235,539,436.10	94.26	212,364,596.85	93.00
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	235,539,436.10	94.26	212,364,596.85	93.00

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	2,634,756.77	2,292,872.34

	100 个基点		
	股票基准指数下降 100 个基点	-2, 634, 756. 77	-2, 292, 872. 34

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	231, 250, 541. 63	209, 052, 215. 29
第二层次	1, 502, 474. 09	1, 429, 665. 84
第三层次	2, 786, 420. 38	1, 885, 801. 56
合计	235, 539, 436. 10	212, 367, 682. 69

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	235,539,436.10	84.59
	其中：股票	235,539,436.10	84.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	42,805,588.54	15.37
8	其他各项资产	101,934.62	0.04
9	合计	278,446,959.26	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	1,319,696.00	0.53
B	采矿业	9,442,846.76	3.78
C	制造业	153,646,275.73	61.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,829,756.05	2.33
E	建筑业	2,636,692.70	1.06
F	批发和零售业	344,144.00	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	5,270,823.46	2.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,017,736.00	5.21
J	金融业	39,550,768.00	15.83
K	房地产业	460,360.00	0.18
L	租赁和商务服务业	1,057,532.00	0.42
M	科学研究和技术服务业	2,515,102.00	1.01
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	314,623.40	0.13
R	文化、体育和娱乐业	133,080.00	0.05
S	综合	-	-
	合计	235,539,436.10	94.26

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	9,200	11,684,000.00	4.68
2	300502	新易盛	16,072	9,755,704.00	3.90
3	300750	宁德时代	21,700	8,528,317.00	3.41
4	600519	贵州茅台	5,200	6,164,548.00	2.47
5	688256	寒武纪	2,884	4,601,566.20	1.84
6	603986	兆易创新	5,500	4,482,500.00	1.79
7	601318	中国平安	87,100	4,158,154.00	1.66
8	600036	招商银行	101,000	3,585,500.00	1.43
9	601899	紫金矿业	134,700	3,386,358.00	1.36
10	000333	美的集团	39,900	3,013,647.00	1.21
11	688008	澜起科技	9,600	2,975,040.00	1.19
12	002371	北方华创	3,330	2,945,584.80	1.18
13	002475	立讯精密	41,700	2,935,680.00	1.17
14	688012	中微公司	6,070	2,843,795.00	1.14
15	688041	海光信息	7,200	2,666,160.00	1.07
16	002384	东山精密	10,100	2,649,735.00	1.06
17	600900	长江电力	99,900	2,644,353.00	1.06
18	688981	中芯国际	16,300	2,588,766.00	1.04
19	000725	京东方 A	297,200	2,579,696.00	1.03
20	603259	药明康德	20,200	2,515,102.00	1.01
21	601138	工业富联	32,500	2,344,875.00	0.94
22	600030	中信证券	79,800	2,292,654.00	0.92
23	601166	兴业银行	138,300	2,290,248.00	0.92
24	300059	东方财富	103,500	2,109,330.00	0.84
25	600183	生益科技	11,600	2,011,440.00	0.80
26	600276	恒瑞医药	36,340	1,891,133.60	0.76
27	300274	阳光电源	11,800	1,876,436.00	0.75
28	601398	工商银行	264,500	1,870,015.00	0.75
29	300408	三环集团	10,800	1,802,520.00	0.72
30	002594	比亚迪	22,300	1,777,310.00	0.71
31	300476	胜宏科技	5,000	1,732,150.00	0.69
32	601211	国泰海通	92,500	1,683,500.00	0.67

33	300394	天孚通信	5,396	1,633,261.28	0.65
34	002463	沪电股份	10,600	1,619,680.00	0.65
35	301308	江波龙	2,200	1,548,360.00	0.62
36	000988	华工科技	8,200	1,513,802.00	0.61
37	600176	中国巨石	19,600	1,428,448.00	0.57
38	601288	农业银行	234,800	1,425,236.00	0.57
39	688072	拓荆科技	1,600	1,407,248.00	0.56
40	601328	交通银行	218,100	1,402,383.00	0.56
41	000651	格力电器	36,400	1,365,000.00	0.55
42	600522	中天科技	22,400	1,359,232.00	0.54
43	688521	芯原股份	3,600	1,336,104.00	0.53
44	600919	江苏银行	119,900	1,292,522.00	0.52
45	603019	中科曙光	12,000	1,286,760.00	0.51
46	603993	洛阳钼业	71,400	1,253,070.00	0.50
47	600150	中国船舶	36,800	1,243,472.00	0.50
48	600887	伊利股份	51,100	1,224,356.00	0.49
49	000338	潍柴动力	43,800	1,193,550.00	0.48
50	000858	五 粮 液	15,900	1,176,600.00	0.47
51	600584	长电科技	11,300	1,170,115.00	0.47
52	601816	京沪高铁	240,000	1,087,200.00	0.44
53	600309	万华化学	15,400	1,053,514.00	0.42
54	300124	汇川技术	15,500	1,028,115.00	0.41
55	002916	深南电路	2,240	1,025,696.00	0.41
56	002415	海康威视	29,900	1,022,580.00	0.41
57	600111	北方稀土	20,700	994,635.00	0.40
58	601688	华泰证券	47,900	987,698.00	0.40
59	000100	TCL 科技	165,100	960,882.00	0.38
60	000063	中兴通讯	26,400	955,416.00	0.38
61	600000	浦发银行	108,700	935,907.00	0.37
62	600089	特变电工	41,300	929,250.00	0.37
63	688783	西安奕材	15,928	923,585.76	0.37
64	601857	中国石油	105,800	918,344.00	0.37
65	002028	思源电气	5,100	882,300.00	0.35
66	601088	中国神华	22,500	878,400.00	0.35
67	300433	蓝思科技	16,300	874,658.00	0.35
68	600031	三一重工	48,400	836,352.00	0.33
69	300014	亿纬锂能	12,500	812,875.00	0.33
70	002050	三花智控	18,200	797,706.00	0.32
71	000001	平安银行	79,300	796,965.00	0.32
72	601601	中国太保	27,900	795,708.00	0.32
73	000792	盐湖股份	26,000	784,940.00	0.31
74	002714	牧原股份	22,400	783,776.00	0.31
75	002353	杰瑞股份	5,100	777,750.00	0.31

76	600549	厦门钨业	8,900	758,280.00	0.30
77	600406	国电南瑞	32,800	749,480.00	0.30
78	601668	中国建筑	169,000	733,460.00	0.29
79	601229	上海银行	83,200	722,176.00	0.29
80	000657	中钨高新	7,500	717,900.00	0.29
81	688795	摩尔线程	1,037	709,896.78	0.28
82	601919	中远海控	51,400	681,564.00	0.27
83	002602	世纪华通	48,200	679,620.00	0.27
84	300760	迈瑞医疗	5,000	679,150.00	0.27
85	601988	中国银行	116,900	668,668.00	0.27
86	601939	建设银行	69,200	666,396.00	0.27
87	600660	福耀玻璃	13,200	665,808.00	0.27
88	601728	中国电信	126,800	658,092.00	0.26
89	603501	豪威集团	6,900	654,465.00	0.26
90	600016	民生银行	202,800	653,016.00	0.26
91	601012	隆基绿能	49,400	648,128.00	0.26
92	601225	陕西煤业	31,800	647,130.00	0.26
93	600999	招商证券	30,400	641,440.00	0.26
94	002230	科大讯飞	15,700	641,188.00	0.26
95	600941	中国移动	7,400	637,362.00	0.26
96	600690	海尔智家	30,700	626,587.00	0.25
97	002352	顺丰控股	19,600	612,696.00	0.25
98	002460	赣锋锂业	9,300	608,220.00	0.24
99	601985	中国核电	67,300	607,719.00	0.24
100	688082	盛美上海	1,400	604,800.00	0.24
101	603799	华友钴业	12,500	603,250.00	0.24
102	600926	杭州银行	41,600	601,120.00	0.24
103	002938	鹏鼎控股	5,698	600,455.24	0.24
104	002709	天赐材料	11,600	596,588.00	0.24
105	601169	北京银行	120,900	592,410.00	0.24
106	000977	浪潮信息	8,400	588,000.00	0.24
107	300033	同花顺	2,420	583,220.00	0.23
108	600160	巨化股份	10,900	577,809.00	0.23
109	000776	广发证券	24,100	563,940.00	0.23
110	300442	润泽科技	6,700	556,569.00	0.22
111	002202	金风科技	22,700	542,530.00	0.22
112	000425	徐工机械	67,000	542,030.00	0.22
113	000938	紫光股份	18,700	539,682.00	0.22
114	688126	沪硅产业	13,500	538,515.00	0.22
115	300498	温氏股份	43,500	535,920.00	0.21
116	601600	中国铝业	64,800	532,656.00	0.21
117	600028	中国石化	119,000	530,740.00	0.21
118	600938	中国海油	19,500	529,425.00	0.21

119	600460	士兰微	9,600	524,736.00	0.21
120	601766	中国中车	99,400	516,880.00	0.21
121	002600	领益智造	29,800	516,732.00	0.21
122	002466	天齐锂业	8,400	515,088.00	0.21
123	600050	中国联通	127,800	511,200.00	0.20
124	002049	紫光国微	5,700	505,875.00	0.20
125	002837	英维克	6,300	501,228.00	0.20
126	601009	南京银行	50,600	500,434.00	0.20
127	601628	中国人寿	13,700	484,295.00	0.19
128	002179	中航光电	10,400	480,480.00	0.19
129	300661	圣邦股份	3,340	479,223.20	0.19
130	601100	恒立液压	4,400	473,264.00	0.19
131	000568	泸州老窖	6,000	465,120.00	0.19
132	601872	招商轮船	26,400	463,848.00	0.19
133	002241	歌尔股份	20,300	457,359.00	0.18
134	603288	海天味业	13,657	452,866.12	0.18
135	601006	大秦铁路	97,500	449,475.00	0.18
136	601658	邮储银行	90,100	444,193.00	0.18
137	000408	藏格矿业	6,400	443,648.00	0.18
138	601818	光大银行	151,600	438,124.00	0.18
139	688111	金山办公	2,056	438,030.80	0.18
140	688271	联影医疗	4,300	435,289.00	0.17
141	688802	沐曦股份	566	435,191.74	0.17
142	600905	三峡能源	116,700	432,957.00	0.17
143	601888	中国中免	8,000	429,680.00	0.17
144	688396	华润微	4,400	429,220.00	0.17
145	600489	中金黄金	23,700	427,785.00	0.17
146	605117	德业股份	4,020	426,843.60	0.17
147	600809	山西汾酒	3,900	426,543.00	0.17
148	000630	铜陵有色	66,300	421,668.00	0.17
149	600893	航发动力	10,800	414,072.00	0.17
150	600010	包钢股份	184,600	411,658.00	0.16
151	601127	赛力斯	6,700	410,375.00	0.16
152	601689	拓普集团	7,200	406,224.00	0.16
153	601336	新华保险	6,800	405,688.00	0.16
154	600958	东方证券	42,800	404,032.00	0.16
155	600118	中国卫星	4,900	402,045.00	0.16
156	002027	分众传媒	82,700	400,268.00	0.16
157	688183	生益电子	3,000	397,200.00	0.16
158	600019	宝钢股份	71,300	387,159.00	0.15
159	600760	中航沈飞	9,300	382,230.00	0.15
160	000807	云铝股份	17,100	378,594.00	0.15
161	601838	成都银行	21,000	371,700.00	0.15

162	600362	江西铜业	8,500	368,050.00	0.15
163	600104	上汽集团	37,700	367,952.00	0.15
164	300450	先导智能	9,000	366,480.00	0.15
165	600989	宝丰能源	17,900	363,907.00	0.15
166	600875	东方电气	12,600	362,502.00	0.15
167	601727	上海电气	51,500	360,500.00	0.14
168	002001	新 和 成	12,600	358,092.00	0.14
169	601825	沪农商行	47,500	355,775.00	0.14
170	002422	科伦药业	9,200	354,384.00	0.14
171	601390	中国中铁	83,600	348,612.00	0.14
172	601995	中金公司	9,600	347,040.00	0.14
173	000538	云南白药	7,300	345,801.00	0.14
174	603296	华勤技术	4,640	344,612.80	0.14
175	600547	山东黄金	14,800	341,732.00	0.14
176	601377	兴业证券	56,500	341,260.00	0.14
177	600795	国电电力	73,000	340,910.00	0.14
178	603893	瑞芯微	1,800	339,048.00	0.14
179	600015	华夏银行	52,000	332,280.00	0.13
180	600585	海螺水泥	19,600	332,220.00	0.13
181	300316	晶盛机电	5,500	332,200.00	0.13
182	601669	中国电建	70,300	330,410.00	0.13
183	000166	申万宏源	73,800	324,720.00	0.13
184	601916	浙商银行	123,400	324,542.00	0.13
185	002648	卫星化学	13,800	324,162.00	0.13
186	688765	禾元生物	6,480	316,620.80	0.13
187	300015	爱尔眼科	38,090	314,623.40	0.13
188	601698	中国卫通	10,400	314,600.00	0.13
189	601066	中信建投	10,600	308,142.00	0.12
190	600482	中国动力	9,300	305,040.00	0.12
191	601868	中国能建	114,210	304,940.70	0.12
192	600346	恒力石化	17,203	304,665.13	0.12
193	601998	中信银行	43,300	300,069.00	0.12
194	002311	海大集团	6,700	298,887.00	0.12
195	300418	昆仑万维	7,400	298,664.00	0.12
196	002558	巨人网络	10,700	294,892.00	0.12
197	000625	长安汽车	40,500	290,385.00	0.12
198	600426	华鲁恒升	12,100	289,432.00	0.12
199	600066	宇通客车	10,700	286,867.00	0.11
200	002532	天山铝业	26,500	284,345.00	0.11
201	000157	中联重科	40,500	282,285.00	0.11
202	600048	保利发展	58,600	271,318.00	0.11
203	688036	传音控股	4,600	271,170.00	0.11
204	600438	通威股份	22,200	268,842.00	0.11

205	605499	东鹏饮料	2,160	266,608.80	0.11
206	600011	华能国际	35,100	266,409.00	0.11
207	002236	大华股份	16,100	265,489.00	0.11
208	600115	中国东航	69,600	265,176.00	0.11
209	601077	渝农商行	43,400	265,174.00	0.11
210	600570	恒生电子	12,500	264,875.00	0.11
211	002493	荣盛石化	24,500	263,375.00	0.11
212	688047	龙芯中科	1,700	262,939.00	0.11
213	600436	片仔癀	2,400	262,272.00	0.10
214	600886	国投电力	19,600	260,876.00	0.10
215	300803	指南针	2,800	256,676.00	0.10
216	003816	中国广核	64,300	251,413.00	0.10
217	002736	国信证券	25,000	249,750.00	0.10
218	601058	赛轮轮胎	21,600	249,048.00	0.10
219	000301	东方盛虹	21,700	248,465.00	0.10
220	601360	三六零	28,500	247,665.00	0.10
221	600026	中远海能	13,700	245,778.00	0.10
222	002074	国轩高科	8,900	244,839.00	0.10
223	601901	方正证券	33,600	241,920.00	0.10
224	600196	复星医药	10,400	233,688.00	0.09
225	600009	上海机场	10,100	233,310.00	0.09
226	601788	光大证券	16,100	232,323.00	0.09
227	000768	中航西飞	11,300	231,424.00	0.09
228	000975	山金国际	13,500	229,500.00	0.09
229	600674	川投能源	16,100	228,137.00	0.09
230	600029	南方航空	44,000	227,920.00	0.09
231	600415	小商品城	22,400	227,584.00	0.09
232	601456	国联民生	25,600	226,304.00	0.09
233	600219	南山铝业	56,400	225,036.00	0.09
234	601186	中国铁建	37,700	224,315.00	0.09
235	601877	正泰电器	8,900	223,123.00	0.09
236	601881	中国银河	17,600	221,232.00	0.09
237	600233	圆通速递	14,000	220,500.00	0.09
238	601117	中国化学	29,900	219,765.00	0.09
239	301269	华大九天	1,800	214,956.00	0.09
240	600372	中航机载	19,700	213,745.00	0.09
241	601878	浙商证券	22,400	212,800.00	0.09
242	301236	软通动力	5,000	212,250.00	0.08
243	000963	华东医药	7,200	202,464.00	0.08
244	600741	华域汽车	13,000	201,760.00	0.08
245	300866	安克创新	1,900	198,550.00	0.08
246	002920	德赛西威	2,400	195,600.00	0.08
247	002304	洋河股份	5,000	190,750.00	0.08

248	000895	双汇发展	8,500	190,400.00	0.08
249	001979	招商蛇口	29,400	189,042.00	0.08
250	601111	中国国航	30,600	185,130.00	0.07
251	601898	中煤能源	14,900	181,482.00	0.07
252	601021	春秋航空	3,900	177,762.00	0.07
253	601319	中国人保	26,100	176,436.00	0.07
254	688506	百利天恒	600	176,418.00	0.07
255	600023	浙能电力	32,900	173,054.00	0.07
256	600039	四川路桥	21,400	167,348.00	0.07
257	601800	中国交建	29,000	165,590.00	0.07
258	688223	晶科能源	33,800	160,550.00	0.06
259	600588	用友网络	16,700	153,306.00	0.06
260	001965	招商公路	16,700	152,972.00	0.06
261	601633	长城汽车	10,100	152,409.00	0.06
262	600600	青岛啤酒	2,800	146,244.00	0.06
263	603369	今世缘	6,100	144,631.00	0.06
264	600027	华电国际	32,300	143,735.00	0.06
265	601618	中国中冶	58,300	142,252.00	0.06
266	601607	上海医药	9,200	141,680.00	0.06
267	302132	中航成飞	2,400	139,968.00	0.06
268	600061	国投资本	21,000	137,550.00	0.06
269	000617	中油资本	20,700	136,413.00	0.05
270	600025	华能水电	15,300	136,017.00	0.05
271	300628	亿联网络	4,000	135,280.00	0.05
272	603260	合盛硅业	2,800	135,128.00	0.05
273	300832	新产业	3,200	134,400.00	0.05
274	300251	光线传媒	12,000	133,080.00	0.05
275	600085	同仁堂	5,700	131,727.00	0.05
276	600930	华电新能	27,348	130,449.96	0.05
277	688472	阿特斯	12,000	129,840.00	0.05
278	601059	信达证券	8,000	129,520.00	0.05
279	000999	华润三九	5,600	125,944.00	0.05
280	300896	爱美客	1,400	122,080.00	0.05
281	301666	大普微	262	121,392.46	0.05
282	000596	古井贡酒	1,500	119,700.00	0.05
283	600803	新奥股份	7,500	118,500.00	0.05
284	600845	宝信软件	7,100	118,073.00	0.05
285	600018	上港集团	24,700	116,584.00	0.05
286	300999	金龙鱼	4,900	113,974.00	0.05
287	300122	智飞生物	9,700	113,393.00	0.05
288	000708	中信特钢	8,200	103,484.00	0.04
289	688009	中国通号	21,200	100,912.00	0.04
290	601018	宁波港	31,900	100,485.00	0.04

291	001280	中国铀业	1,500	100,050.00	0.04
292	001248	华润新能源	9,419	95,226.09	0.04
293	601238	广汽集团	18,000	91,440.00	0.04
294	300413	芒果超媒	6,100	89,243.00	0.04
295	301165	锐捷网络	1,100	88,495.00	0.04
296	688303	大全能源	5,000	87,150.00	0.03
297	603392	万泰生物	3,100	83,607.00	0.03
298	688781	视涯科技	1,920	82,721.20	0.03
299	688808	联讯仪器	44	69,710.52	0.03
300	601136	首创证券	4,600	64,170.00	0.03
301	001391	国货航	12,000	48,840.00	0.02
302	688712	北芯生命	1,200	43,376.00	0.02
303	688818	电科蓝天	611	42,855.54	0.02
304	688797	臻宝科技	89	41,711.63	0.02
305	688820	盛合晶微	256	36,221.44	0.01
306	001399	惠科股份	1,168	32,388.64	0.01
307	688785	恒运昌	62	28,715.30	0.01
308	301682	宏明电子	170	27,210.20	0.01
309	688635	长进光子	83	25,579.77	0.01
310	688813	泰金新能	141	24,264.69	0.01
311	001257	盛龙股份	874	18,830.76	0.01
312	301669	高特电子	482	14,961.80	0.01
313	688811	有研复材	577	13,923.01	0.01
314	301687	新广益	169	13,144.82	0.01
315	301531	春光集团	216	11,136.96	0.00
316	603459	红板科技	121	10,202.72	0.00
317	301696	三瑞智能	117	10,155.60	0.00
318	603407	长裕集团	124	9,109.04	0.00
319	301599	理奇智能	228	7,403.16	0.00
320	301680	固德电材	62	6,953.92	0.00
321	001365	天海电子	196	6,136.76	0.00
322	301513	尚水智能	115	5,860.40	0.00
323	301683	慧谷新材	42	5,114.34	0.00
324	688816	易思维	84	4,796.40	0.00
325	001237	惠康科技	78	4,581.72	0.00
326	601112	振石股份	229	4,028.11	0.00
327	603435	嘉德利	86	4,017.06	0.00
328	603352	至信股份	76	1,939.52	0.00
329	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
330	603284	林平发展	41	1,429.67	0.00
331	603293	埃泰克	32	1,085.76	0.00
332	001312	福恩股份	64	1,073.92	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	300502	新易盛	4,700,316.00	2.06
2	300308	中际旭创	3,762,361.00	1.65
3	300750	宁德时代	3,035,270.00	1.33
4	600519	贵州茅台	2,121,729.00	0.93
5	601318	中国平安	1,554,077.00	0.68
6	000988	华工科技	1,443,516.00	0.63
7	601899	紫金矿业	1,311,216.00	0.57
8	600036	招商银行	1,271,013.00	0.56
9	688256	寒武纪	1,270,796.36	0.56
10	301308	江波龙	1,268,484.00	0.56
11	603986	兆易创新	1,054,774.00	0.46
12	000333	美的集团	1,020,555.00	0.45
13	002475	立讯精密	984,732.00	0.43
14	688012	中微公司	967,219.58	0.42
15	688072	拓荆科技	946,577.58	0.41
16	600900	长江电力	910,242.00	0.40
17	688521	芯原股份	890,218.10	0.39
18	688008	澜起科技	854,913.48	0.37
19	002371	北方华创	850,332.00	0.37
20	002353	杰瑞股份	843,413.00	0.37

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	2,938,142.00	1.29
2	300308	中际旭创	2,541,397.00	1.11
3	600519	贵州茅台	2,388,748.00	1.05
4	601318	中国平安	1,935,106.00	0.85
5	601899	紫金矿业	1,744,367.00	0.76
6	300502	新易盛	1,724,869.00	0.76
7	600036	招商银行	1,416,091.00	0.62
8	000333	美的集团	1,110,494.00	0.49
9	600900	长江电力	972,699.00	0.43
10	601166	兴业银行	946,993.00	0.41
11	002475	立讯精密	882,604.00	0.39
12	002371	北方华创	834,875.00	0.37
13	300059	东方财富	825,018.00	0.36
14	600030	中信证券	800,486.00	0.35

15	688041	海光信息	798,724.38	0.35
16	002594	比亚迪	757,251.00	0.33
17	688981	中芯国际	745,431.58	0.33
18	601138	工业富联	745,269.00	0.33
19	600276	恒瑞医药	736,600.00	0.32
20	603259	药明康德	733,584.00	0.32

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	89,220,304.34
卖出股票收入（成交）总额	84,818,928.86

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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	39,966.35
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	61,968.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	101,934.62

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 (%)
万家瑞盈 A	1,951	62,671.64	119,435,001.35	97.68	2,837,366.82	2.32
万家瑞盈 C	2,193	12,108.37	18,198,362.15	68.53	8,355,303.98	31.47
合计	4,085	36,432.32	137,633,363.50	92.48	11,192,670.80	7.52

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（%）	80.19

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	万家瑞盈 A	30,147.00	0.0247
	万家瑞盈 C	3,174.82	0.0120
	合计	33,321.82	0.0224

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家瑞盈 A	万家瑞盈 C
基金合同生效日 (2016 年 11 月 11 日) 基金份额总额	2,686.50	620,022,888.88
本报告期期初基金份额总额	124,753,682.59	25,234,795.58
本报告期基金总申购份额	36,005,130.15	19,253,636.31
减：本报告期基金总赎回份额	38,486,444.57	17,934,765.76
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	122,272,368.17	26,553,666.13

§ 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

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：
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 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况未发生改变。

10.6 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，本基金托管人相关从业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	172,902,171.44	99.99	77,100.71	99.99	-
国投证券	1	12,526.00	0.01	6.26	0.01	-

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	600,132.00	100.00	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-

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	万家瑞盈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	万家瑞盈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	万家瑞盈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	关于万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、	指定媒介	2026年4月27日

	定期定额投资) 业务的公告		
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	20260101-20260122、20260527-20260630	31,256,544.50	12,127,956.34	13,000,000.00	30,384,500.84	20.42
	2	20260626-20260629	7,882,538.43	18,411,994.58	-	26,294,533.01	17.67
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、《万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。
- 4、万家瑞盈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