万家中证机器人交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第3季度报告

2025年9月30日

基金管理人: 万家基金管理有限公司基金托管人: 广发证券股份有限公司报告送出日期: 2025年10月25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。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定,于 2025 年 10 月 24 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2025年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

甘人然和	工会市工机 III II I I I I I I I I I I I I I I I
基金简称	万家中证机器人 ETF
场内简称	机器人产业 ETF
基金主代码	560630
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025年3月19日
报告期末基金份额总额	233, 394, 000. 00 份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	1、股票投资策略; 2、存托凭证投资策略; 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、股指期货交易策略; 7、国债期货交易策略; 8、股票期权投资策略; 9、参与融资与转融通证券出借业务策略; 10、其他。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率,即中证机器人指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金,其长期平均风险和预期收益率理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪中证机器人指数,其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	广发证券股份有限公司

§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(2025年7月1日-2025年9月30日)
1. 本期已实现收益	26, 379, 135. 91
2. 本期利润	89, 883, 608. 22
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 2543
4. 期末基金资产净值	279, 188, 726. 40
5. 期末基金份额净值	1. 1962

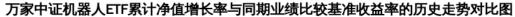
- 注:1、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
- 2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣 除相关费用和信用减值损失后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

阶段	净值增长率	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	28. 71%	1. 57%	28. 60%	1.59%	0. 11%	-0.02%
过去六个月	22. 12%	1.93%	20. 99%	1.96%	1. 13%	-0.03%
自基金合同	19.62%	1.87%	10. 47%	1.93%	9.15%	-0.06%
生效起至今	19.02%	1.07%	10.47%	1.95%	9. 15%	0.00%

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





- 注: 1、本基金合同生效日期为2025年3月19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。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	金经理期限	证券从业	说明
紅石	かガ	任职日期	离任日期	年限	<i>θ</i> ι <i>θ</i> ι,
贺方舟	万指投金上交放证基家创成型指投金上板家数资、证易式券金上板份开数资、证成家处基万50型指投、证50交放证基万科长级券。家0开数资万科0易式券。家创交	2025年3月19 日		•	国籍:中国;学历:复旦大学工商管理硕士,2022年6月入职万家基金管理有限公司,现任量化投资部基金经理,历任量化投资部基金经理助理。曾任汇添富基金管理股份有限公司基金营运部营运经理,大成基金管理有限公司指数与期货投资部研究员等职。

易型开放			
式指数证			
券投资基			
金、万家			
中证 800			
自由现金			
流交易型			
开放式指			
数证券投			
资基金、			
万家中证			
800 自由			
现金流交			
易型开放			
式指数证			
券投资基			
金联接基			
金、万家			
中证人工			
智能主题			
交易型开			
放式指数			
证券投资			
基金、万			
家中证全			
指公用事			
业交易型			
开放式指			
数证券投			
资基金、			
万家中证			
全指公用			
事业交易			
型开放式			
指数证券			
投资基金			
联接基			
金、万家			
中证半导			
体材料设			
备主题交			
易型开放			
式指数证			
券投资基			
金、万家			

中证材整设定放证整定的				
各主型开放证基本	中证半导			
易型指发证据 全发接式 企下, 企下, 企下, 企下, 企下, 企下, 是一个, 是一一个, 是一一个, 是一一个, 是一一个, 是一一个, 是一一个, 是一一个, 是一一个, 是一一个, 是一一一一, 是一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一	体材料设			
易型指发证据 全发接式 企下, 企下, 企下, 企下, 企下, 企下, 是一个, 是一一个, 是一一个, 是一一个, 是一一个, 是一一个, 是一一个, 是一一个, 是一一个, 是一一个, 是一一一一, 是一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一	备主题交			
式持投资基式 基本 中正 色 题 开数 资 不正 色 题 开数 资 不正 色 题 开数 资 不证 色 题 开数 资 无 平 有 主 型 指数 宏 起 基 家 器 型 指投 、 证 多 中 函 易 式 券 全 取 版 五 和 数 资 万 被 安 取 取 型 指 投 、 证 多 开 数 资 万 被 安 取 取 型 指 投 、 证 多 开 数 资 万 较 交 放 证 基 家 中 服 型 指 投 、 证 多 开 数 资 万 较 交 放 证 基 家 中 服 型 指 投 、 证 多 开 数 资 万 较 平 服 型 指 投 、 证 多 开 数 资 万 较 平 服 型 指 投 、 证 多 年 服 型 数 资 万 较 平 服 至 放 证 基 家 中 证 多 数 式 券 设 万 较 与 电 多 式 务 设 可 多 实 的 是 家 年 服 至 数 资 万 数 分 。 中 证 多 数 。 中 证 多 数 可 。 如 如 可 。 如 如 可 。 如 如 如 如				
券投资基 金收签,正工金额之政、正工金额之政武券 金额之政武券 金额之政武券 金额之政武券 金额之政武券 金额之政武券 金额之政武券 金额之工。 一年色额之政武券 金联安元, 一年创办, 一年为为资, 一年为为资, 一年为公司, 一年为一年, 一年, 一年, 一年, 一年, 一年, 一年, 一年, 一年, 一年,				
金发表、证色题开数资本、证色题开数资本、证色题开数资本、证色题开数资本、证色题开数资本。实业属易式券金联、证金变效证基本。实业属易式券金联、证交数证基本。企业,是新型指数资为港级、证金和数资为,是新型指数资为,是新型有投入。证务中服务开数资为,证基本中服务开数资本,证务实验证基本,是不是是一个企业,是一个一个企业,是一个一个企业,是一个				
联接基 方工工 馬易式 對投 大正也 是空放 政工 大正也 是空放 实工 大型 大型 大型 大型 大型 大型 大型 大型 大型 大型				
金中有主型开致资本,所正全是现于数资本,在一个有主型开致资本,在一个企业,是一个一个企业,是一个一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个一个,是一个一个,是一个一个,是一个一个,是一个一个,是一个一个,				
中证 化金属 是型形证券 经金额 在				
有色金属 主题开放式 转投。 一种有题对 一种有题对 一种有题对 一种有题对 一种有题对 一种有题对 一种有题对 一种有题对 一种有题对 一种一种的 一种的 一种的 一种的 一种的 一种的 一种的 一种的 一种的 一				
主题及式 舞戏证基 投资、证工金。易 型开放证基。 中一色题变成式 特资起式或以 一种色题变成式 特数起式或以 一种色题变成式 特数起式或以 一种变数,一种变数,一种变数,一种变数,一种变数,一种变数,一种变数,一种变数,				
型形放式券提金、万工金人公司,在公司,在公司,在公司,在公司,在公司,在公司,在公司,在公司,在公司,在				
指投资、证工业有色变为式券企业工程。 中证色变为式券企业工程。 中证色变为式券企业工程。 中证色变为式券企业基本联、证文文文、证本。中人发起基本,从发展工程数资为下级基本,工产,从对于发展,不是有效,不是有效,不是有效,不是有效,不是有效,不是有效,不是有效,不是有效				
投资 万家中中有 经				
金、下工业 有色题对 证金属 主题开放证券 投发或式 指数资基金 发发起式。证 我发发起式。证 为者指投、证创 为者指投、证创 为者指投、证创 为者指数 证 基。中通 为对 数。 证 的 对 数。 证 的 对 数。 证 的 对 数。 证 的 对 数 数 。 证 的 。 证 的 。 、 证 的 。 、 证 的 。 、 、 证 的 。 、 、 、 、 、 、 、 、 、 、 、 、 、 、 、 、 、 、				
中证工业 有色题交易 型开放证券 投资基金 发起或或 无形数证券 投资起式。 证的 多型指数。 证的 多型指数。 证的 多对指数。 证的 多对指数。 证务 处,证的 多对指数。 证务 处。证的 多对指数。 基金。 中证的 多对指数。 基金。 一证 多一证 的。 对于 数。 证券 是。 证, 证, 证, 证, 证, 证, 证, 等。 会。 证, 证, 证, 任, 任, 任, 任, 任, 任, 任, 任, 任, 任, 任, 任, 任,				
有色金属 主题交易型开放式 指数逐基金 发起基金。 发起基金。 发起基金。 发起基金。 发起基本。 万然器型形放 式指投资方。 中通创新型开放 或对新型, 或对数量。 证的新型开放 或对数量。 证较 中服务交易 是基金。证软 传及一个。 是基金。证实 传数是是一个。 是一个。				
主题交易型开放式 指数连基金 发起式联 接基金、 万家器一种证 机器型开放 式指数证 券投资基 金、万家 中证创新型开 放式为数据 通易型开数 证务金、证 下 下 下 下 下 下 下 下 下 下 下 下 下 下 下 下 下 下 下				
型开放证券投资基金发送基联接基金,以上,从上,从上,从上,从上,从上,从上,从上,从上,从上,从上,从上,从上,从上				
指数证券 投资基金 发起式联 接基金、 万都人交 易型开放 式指数 证券投资基金、证港服 通易型开放工学的型型 放工等的型型开放工学的型型 证券收、万 家中服务交 易型开放 式指数 证券交 易型开放 式指数 证券交 易型开放 式指数证券交 易型开放 式,可家中服务交 易型数 工、证软 件服务交 易型,可以工、工、工、工、工、工、工、工、工、工、工、工、工、工、工、工、工、工、工、				
投资基金 发起式联 接基金、 万家中证 机器型开数 式指数基金、证进新药 交及式推新药 交及式指数 证券投资 基金、证软 件服务交 易型开放 式指数 证券投资 基金、证软 件服务交 易型开放 式指数证券投资 基金、证软 件服务交 易型开放 式指数证券投资 基金、可家 中证软件 服务交易				
发起式联 接基金、 万都是一种				
接基金、万家中证机交易型开放工指数基金、证地数基金、证地数基金、证地数基金、证地新药交易型开放资本。证的易型开放资金。证的易型开放资金。证实,但是一个企业,是一个,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个一个企业,是一个企业,是				
万家中证 机器人交 易型开放 式指投资基金、证港数 通易型开放 证券投资 基金、证教 好及 万家中证教 件服 型开放 式指投资基金、证软 件服 型开放 式指投资基金、证软件 服务交易				
机器人交易型开放 式指数证 券投资基金、万家 中证制新药 交易型开放式指数 证券投入 方家中证软件服务交 易型开放 式指数证 券投交易型开放 式指数证 券投资基金、下家 中证软件服务交易				
易型开放 式指数证 券投资基 金、万家 中证的新药 交易型开 放式指数 证券投资 基金、万家 中服务交 易型开放 式指数 证券交 易型开放 式指数证 券投资基 金、万家 中证软件 服务交易				
式指数证 券投资基 金、万家 中证港股 通创新药 交易型开 放式指数 证券投资 基金、万 家中证软 件服务交 易型开放 式指数证 券投资基 金、、万家 中证软件 服务交易				
券投资基金、万家中证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金、万家中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金、万家中证软件服务交易对开放式指数证券投资基金、万家中证软件服务交易				
金、万家 中证港股 通创新药 交易型开 放式指数 证券投资 基金、万 家中证软 件服务交 易型开放 式指数证 券投资基 金、万家 中证软件 服务交易				
中证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金、万家中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金、万家中证软件取务交易型开放式指数证券投资基金、万家中证软件服务交易				
通创新药 交易型开 放式指数 证券投资 基金、万 家中证软 件服务交 易型开放 式指数证 券投资基 金、 万家 中证软件 服务交易				
交易型开 放式指数 证券投资 基金、万 家中证软 件服务交 易型开放 式指数证 券投资基 金、万家 中证软件 服务交易				
放式指数 证券投资 基金、万 家中证软 件服务交 易型开放 式指数证 券投资基 金、万家 中证软件 服务交易				
证券投资 基金、万 家中证软 件服务交 易型开放 式指数证 券投资基 金、万家 中证软件 服务交易				
基金、万 家中证软 件服务交 易型开放 式指数证 券投资基 金、万家 中证软件 服务交易				
件服务交 易型开放 式指数证 券投资基 金、万家 中证软件 服务交易				
件服务交 易型开放 式指数证 券投资基 金、万家 中证软件 服务交易	家中证软			
易型开放 式指数证 券投资基 金、万家 中证软件 服务交易				
券投资基 金、万家 中证软件 服务交易				
券投资基 金、万家 中证软件 服务交易				
金、万家 中证软件 服务交易				
服务交易	金、万家			
	中证软件			
型开放式	服务交易			
	型开放式	 	 	

指数证券			
投资基金			
发起式联			
接基金、			
万家国证			
航天航空			
行业交易			
型开放式			
指数证券			
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、万家			
深证 AAA			
科技创新			
公司债交			
易型开放			
式指数证			
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、			
万家国证			
新能源车			
电池指数			
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。

4.1.1 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 0 次。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度,A股整体维持强势格局,7月至8月呈现单边上涨态势,于8月底突破3800点关口;进入9月后则在高位展开震荡整理。从全季表现看,主要宽基指数普遍收涨,其中创业板50与科创50分别录得59.45%、49.02%的季度涨幅,成长与周期风格显著领跑,通信、电子、电力设备、有色等板块表现夺眼。

分阶段看,7月"反内卷"主题助推市场情绪回暖,资金自钢铁、光伏等品种向更广泛的顺周期板块扩散。雅江水电站正式开工,带动水泥、民爆等基建板块走强。创新药板块则在新的BD 第8页共15页

交易催化下继续维持高景气度。8月国产算力替代逻辑持续升温,寒武纪股价一度超越贵州茅台,半导体产业链延续强势,行情进一步扩散至自主可控相关板块。此外,国务院发布深入实施"人工智能+"行动意见,政策顶层设计显著强化算力主线。稀土产业链同步走强,推动有色板块维持高位运行。"93阅兵"后,军工板块阶段性利好兑现,出现明显回调。宁德时代带动新能源板块回归强势,产业与政策端利好叠加,储能、光伏、固态电池等细分赛道轮番走强。AI 算力产业链再迎催化,阿里云栖大会密集释放利好,板块热度再度升温。

展望后市,尽管短期仍存在中美博弈带来的不确定性与扰动风险,但市场对于"慢牛"格局的共识已逐步形成。中国科技产业的故事正在加速改善,"DeepSeek"时刻已从算力领域扩散至创新药等高景气赛道。叠加需求端政策持续加码与落地,为经济复苏与市场信心提供支撑,A股有望沿着高质量发展的主线,延续健康、稳步的上行趋势。

本基金作为被动投资的指数基金,其投资目标是通过跟踪、复制指数,为投资者获取市场长期的平均收益。报告期内我们严格按照基金合同规定,原则上采取完全复制的方法进行投资管理,努力拟合标的指数,减小跟踪误差,将基金跟踪误差控制在较低范围之内,导致跟踪误差的主要原因是基金申购现金替代、标的指数成分股调整、成分股分红、停牌等因素。同时,本基金采用有效的量化跟踪技术,降低管理成本。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家中证机器人 ETF 的基金份额净值为 1. 1962 元,本报告期基金份额净值增长率为 28. 71%,同期业绩比较基准收益率为 28. 60%。基金报告期内日跟踪偏离度为 0. 0221%,年化跟踪误差为 0. 4697%,符合基金合同中日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0. 2%,年跟踪误差不超过 2%的规定。

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	276, 248, 058. 90	98. 42
	其中: 股票	276, 248, 058. 90	98. 42
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	4, 376, 557. 34	1. 56
8	其他资产	67, 043. 36	0.02
9	合计	280, 691, 659. 60	100.00

注:上述股票投资包括可退替代款估值增值,而 5.2 的合计项中不含可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	_	_
В	采矿业	_	-
С	制造业	221, 503, 988. 16	79. 34
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	_	-
Н	住宿和餐饮业	_	-
I	信息传输、软件和信息技术服 务业	50, 401, 835. 80	18. 05
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	3, 410, 992. 20	1. 22
N	水利、环境和公共设施管理业	_	_
0	居民服务、修理和其他服务业	-	_
Р	教育	_	_
Q	卫生和社会工作		_
R	文化、体育和娱乐业		_
S	综合	_	_
	合计	275, 316, 816. 16	98. 61

5.2.2 报告期末积极投资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	_	_
В	采矿业	_	_

С	制造业	364, 816. 61	0. 13
D	电力、热力、燃气及水生产和		
D	供应业	534, 304. 22	0. 19
Е	建筑业	_	_
F	批发和零售业	18, 627. 99	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	_	_
Н	住宿和餐饮业	_	_
т	信息传输、软件和信息技术服		
Ι	务业	-	-
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	13, 408. 64	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	_	_
0	居民服务、修理和其他服务业	-	_
Р	教育	-	_
Q	卫生和社会工作	_	-
R	文化、体育和娱乐业	_	-
S	综合	_	-
	合计	931, 157. 46	0. 33

5.2.3 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 报告期末指数投资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	300124	汇川技术	331,050	27, 748, 611. 00	9. 94
2	002230	科大讯飞	434, 700	24, 364, 935. 00	8. 73
3	688169	石头科技	68, 809	14, 434, 752. 02	5. 17
4	002236	大华股份	660,010	13, 299, 201. 50	4. 76
5	688777	中控技术	210, 711	11, 605, 961. 88	4. 16
6	002008	大族激光	280, 500	11, 419, 155. 00	4.09
7	002472	双环传动	226, 200	11, 267, 022. 00	4.04
8	603486	科沃斯	76, 500	8, 223, 750. 00	2. 99
9	300024	机器人	417, 400	8, 139, 300. 00	2.92
10	688343	云天励飞	83,008	7, 344, 547. 84	2.63

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600930	华电新能	101, 386	534, 304. 22		0.19
2	688775	影石创新	410	108, 498. 30		0.04
3	688729	屹唐股份	2, 266	53, 273. 66		0.02
4	301656	联合动力	1,581	39, 461. 76		0.01
5	301678	新恒汇	382	28, 501. 02		0.01

5.4 报告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。

- 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本基金本报告期末未持有债券。
- 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

本基金将按照风险管理的原则,以套期保值为主要目的参与股指期货交易,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

本基金将按照风险管理的原则,同时基于谨慎原则,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

本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的,在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规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	_
2	应收证券清算款	22, 642. 57
3	应收股利	_
4	应收利息	_
5	应收申购款	_
6	其他应收款	_
7	待摊费用	44, 400. 79
8	其他	_
9	合计	67, 043. 36

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

	机曲化剂	股票名称	流通受限部分的公	占基金资产净	流通受限情况
序号	股票代码		允价值 (元)	值比例(%)	说明
1	600930	华电新能	534, 304. 22	0.19	新股流通受限
2	688775	影石创新	108, 498. 30	0.04	新股流通受限
3	688729	屹唐股份	53, 273. 66	0.02	新股流通受限
4	301656	联合动力	39, 461. 76	0.01	新股流通受限
5	301678	新恒汇	28, 501. 02	0.01	新股流通受限

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

报告期期初基金份额总额	520, 394, 000. 00
报告期期间基金总申购份额	111, 000, 000. 00
减:报告期期间基金总赎回份额	398, 000, 000. 00
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	233, 394, 000. 00

§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、《万家中证机器人交易型开放式指数证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家中证机器人交易型开放式指数证券投资基金托管协议》。
- 4、万家中证机器人交易型开放式指数证券投资基金2025年第3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 2025 年 10 月 25 日