

万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

送出日期：2025 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，并由董事长签发。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 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 2025 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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
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	60
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	60

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	60
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	60
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	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	61
§ 8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	62
§ 9 开放式基金份额变动	63
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8 其他重大事件	65
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	66
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	66
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	万家瑞丰	
基金主代码	001488	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年6月19日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	上海银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	157,268,592.18份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	万家瑞丰 A	万家瑞丰 C
下属分级基金的交易代码	001488	001489
报告期末下属分级基金的份额总额	150,432,996.26份	6,835,595.92份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
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）存托凭证投资策略）；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	上海银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑
	联系电话	021-38909626
	电子邮箱	lanj@wjasset.com
客户服务电话	4008880800	95594
传真	021-38909627	021-68476901
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	上海市黄浦区中山南路 688 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（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号 37 层
邮政编码	200122	200120

法定代表人	方一天	顾建忠
-------	-----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.wjasset.com
基金中期报告备置地点	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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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(2025年1月1日-2025年6月30日)	
	万家瑞丰 A	万家瑞丰 C
本期已实现收益	1,995,192.93	304,916.21
本期利润	-2,252,686.98	93,317.28
加权平均基金份额 本期利润	-0.0246	0.0129
本期加权平均净 值利润率	-1.73%	0.94%
本期基金份额净 值增长率	1.23%	1.09%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2025年6月30日)	
期末可供分配利 润	56,037,501.91	2,006,183.81
期末可供分配基 金份额利润	0.3725	0.2935
期末基金资产净 值	220,751,581.61	9,472,017.94
期末基金份额净 值	1.4674	1.3857
3.1.3 累计期 末指标	报告期末(2025年6月30日)	

基金份额累计净值增长率	46.74%	38.57%
-------------	--------	--------

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

万家瑞丰 A

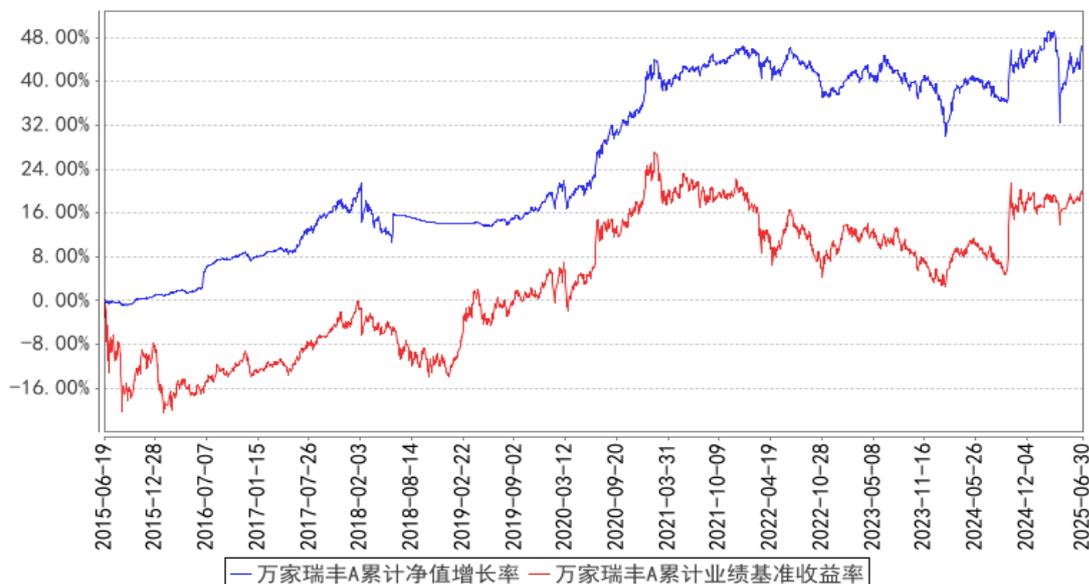
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.48%	0.57%	1.55%	0.28%	1.93%	0.29%
过去三个月	1.91%	1.12%	1.71%	0.51%	0.20%	0.61%
过去六个月	1.23%	0.85%	0.76%	0.48%	0.47%	0.37%
过去一年	5.48%	0.68%	10.21%	0.67%	-4.73%	0.01%
过去三年	0.51%	0.46%	2.79%	0.54%	-2.28%	-0.08%
自基金合同生效起至今	46.74%	0.34%	19.67%	0.67%	27.07%	-0.33%

万家瑞丰 C

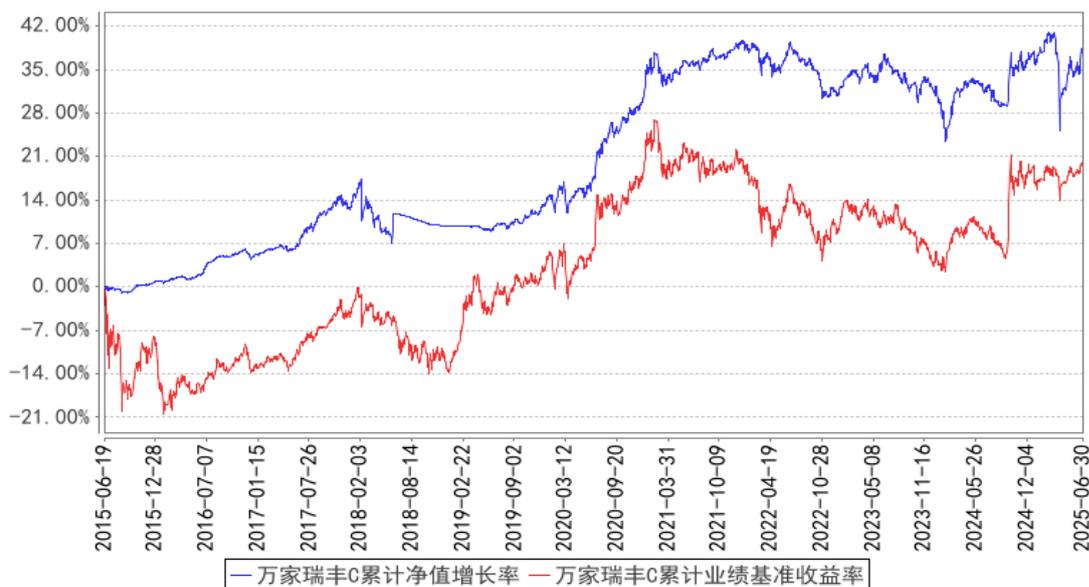
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.46%	0.57%	1.55%	0.28%	1.91%	0.29%
过去三个月	1.84%	1.12%	1.71%	0.51%	0.13%	0.61%
过去六个月	1.09%	0.85%	0.76%	0.48%	0.33%	0.37%
过去一年	5.17%	0.68%	10.21%	0.67%	-5.04%	0.01%
过去三年	-0.40%	0.46%	2.79%	0.54%	-3.19%	-0.08%
自基金合同生效起至今	38.57%	0.34%	19.67%	0.67%	18.90%	-0.33%

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

万家瑞丰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



万家瑞丰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 2015 年 6 月 19 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 2025 年 6 月 30 日，公司共管理 173 只开放式基金，其中包括 42 只股票型基金、73 只混合型基金、41 只债券型基金、5 只货币市场基金、4 只 QDII 基金、8 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	2023 年 1 月 3 日	-	10 年	国籍：中国；学历：复旦大学基础数学专业硕士，2019 年 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。

	配置混合型证券投资基金的基金经理。				
周慧	万家瑞丰债券型证券投资基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家民安增利12个月定期开放债券型证券投资基金、万家民瑞祥和6个月持有期债券型证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家鑫璟纯债债券型证券投资基金、万家鑫盛纯债债券型证券投资基金的基金经理。	2023年6月2日	2025年3月29日	12.5年	国籍：中国；学历：上海交通大学工商管理硕士，2012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，历任交易部债券交易员，债券投资部基金经理助理、基金经理等职。

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 1 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

2025 年上半年，A 股市场先抑后扬，经历关税波折后市场逐步走强。春节前，A 股市场在海外政策不确定性下震荡下行；春节之后，以 DeepSeek 为代表的大模型带动市场情绪提升。四月上

旬，在美国滥施关税和对华大幅提高关税税率的冲击下，市场出现了较大的调整；随后汇金增持 ETF 以及中美大幅调降关税，市场风险偏好提升，主要宽基指数走出反弹行情，在市场上涨中，中小盘表现较为活跃。

本基金策略从 2025 年 3 月中旬调整为复制跟踪中证 A500 指数，获取指数长期收益，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丰 A 的基金份额净值为 1.4674 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.23%，同期业绩比较基准收益率为 0.76%；截至本报告期末万家瑞丰 C 的基金份额净值为 1.3857 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.09%，同期业绩比较基准收益率为 0.76%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，随着市场风险偏好提升，在低利率市场环境下，资金逐步加配权益，有望带动市场整体上移。近期在“反内卷”政策持续推进落地、雅下水电工程正式开工带动基建需求以及外部环境缓和等利好因素作用下，对于后续企业盈利改善具有重要意义。7 月政治局会议表示今年以来主要经济指标表现良好，强调宏观政策要持续发力、适时加力、落实落细，有望使促进经济平稳回升。在经济高质量发展要求及政策支持下，科技创新和研发投入将不断加大，新兴产业有望加速发展。总体来看，当前国内潜在的财政货币等政策空间依然较大，当前主要指数的估值在经历上行后，依然处于相对合理中枢区间，中长期资金逐步入市，使得市场下行空间有限，下半年国内政策空间有望打开，A 股市场有望呈现震荡向上。

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，本基金自 2025 年 1 月 2 日至 2025 年 3 月 13 日，连续 45 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 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，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金的利润分配情况符合有关法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	14,111,554.09	63,032.91
结算备付金		-	42,575.95
存出保证金		201,846.31	5,918.45
交易性金融资产	6.4.7.2	216,083,383.39	10,911,127.70
其中：股票投资		216,083,383.39	1,401,330.45

基金投资		-	-
债券投资		-	9,509,797.25
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		-	110.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	17,050.00	-
资产总计		230,413,833.79	11,022,765.01
负债和净资产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024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		-	0.01
应付赎回款		433.87	14,985.31
应付管理人报酬		111,114.53	5,624.43
应付托管费		27,778.59	1,406.11
应付销售服务费		2,339.97	2,548.01
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	41.77
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	48,567.28	12,082.36
负债合计		190,234.24	36,688.00
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	157,268,592.18	7,973,476.47
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	72,955,007.37	3,012,600.54
净资产合计		230,223,599.55	10,986,077.01
负债和净资产总计		230,413,833.79	11,022,765.01

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额总额 157,268,592.18 份，其中万家瑞丰 A 基金份额净值 1.4674 元，基金份额总额 150,432,996.26 份；万家瑞丰 C 基金份额净值 1.3857 元，基金份额总额 6,835,595.92 份。

6.2 利润表

会计主体：万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-1,585,161.68	-1,672,709.09
1. 利息收入		46,511.50	22,972.37
其中：存款利息收入	6.4.7.10	42,762.43	12,563.02
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		3,749.07	10,409.35
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,827,458.64	-1,990,370.02
其中：股票投资收益	6.4.7.11	367,203.55	-2,705,518.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	136,969.39	687,702.20
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	2,323,285.70	27,446.58
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	-4,459,478.84	293,900.64
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	347.02	787.92
减：二、营业总支出		574,208.02	233,692.71
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	410,986.08	122,570.51

其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	102,746.52	30,642.66
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	14,703.91	16,870.27
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	73.45
其中：卖出回购金融资产支出		-	73.45
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		21.87	597.03
8. 其他费用	6.4.7.20	45,749.64	62,938.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,159,369.70	-1,906,401.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,159,369.70	-1,906,401.80
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,159,369.70	-1,906,401.80

6.3 净资产变动表

会计主体：万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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	7,973,476.47	-	3,012,600.54	10,986,077.01
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	7,973,476.47	-	3,012,600.54	10,986,077.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	149,295,115.71	-	69,942,406.83	219,237,522.54
（一）、综合收益总额	-	-	-2,159,369.70	-2,159,369.70
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数	149,295,115.71	-	72,101,776.53	221,396,892.24

(净资产减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	150,581,233.12	-	72,606,059.35	223,187,292.47
2. 基金赎回款	-1,286,117.41	-	-504,282.82	-1,790,400.23
(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	157,268,592.18	-	72,955,007.37	230,223,599.55
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	71,882,120.82	-	27,657,318.79	99,539,439.61
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	71,882,120.82	-	27,657,318.79	99,539,439.61
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-63,482,073.14	-	-24,937,240.29	-88,419,313.43
(一)、综合收益总额	-	-	-1,906,401.80	-1,906,401.80
(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)	-63,482,073.14	-	-23,030,838.49	-86,512,911.63
其中：1. 基金申购款	271,574.38	-	91,989.99	363,564.37
2. 基金赎回款	-63,753,647.52	-	-23,122,828.48	-86,876,476.00

（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	8,400,047.68	-	2,720,078.50	11,120,126.18

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>方一天</u>	<u>陈广益</u>	<u>尹超</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

万家瑞丰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]1138 号文《关于核准万家瑞丰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 2015 年 6 月 12 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具（2015）验字第 60778298_B18 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 2015 年 6 月 19 日正式生效，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 1,000,944,500.96 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 45,041.23 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,000,989,542.19 元，折合 1,000,989,542.19 份基金份额。本基金管理人为万家基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为上海银行股份有限公司。

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（含中小企业私募债、证券公司短期公司债券）、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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》、《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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债券利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的

股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	14,111,554.09
等于：本金	14,108,797.00
加：应计利息	2,757.09
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	14,111,554.09

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	220,524,525.21	-	216,083,383.39	-4,441,141.82
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	220,524,525.21	-	216,083,383.39	-4,441,141.82

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

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
应收利息	-
其他应收款	17,050.00
待摊费用	-
合计	17,050.00

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,424.64
其中：交易所市场	4,424.64
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	44,142.64
合计	48,567.28

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

万家瑞丰 A

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	713,817.47	713,817.47

本期申购	150,137,783.28	150,137,783.28
本期赎回（以“-”号填列）	-418,604.49	-418,604.49
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	150,432,996.26	150,432,996.26

万家瑞丰 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,259,659.00	7,259,659.00
本期申购	443,449.84	443,449.84
本期赎回（以“-”号填列）	-867,512.92	-867,512.92
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	6,835,595.92	6,835,595.92

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

万家瑞丰 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	232,621.72	88,216.63	320,838.35
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	232,621.72	88,216.63	320,838.35
本期利润	1,995,192.93	-4,247,879.91	-2,252,686.98
本期基金份额交易产生的变动数	53,809,687.26	18,440,746.72	72,250,433.98
其中：基金申购款	53,949,793.70	18,483,733.46	72,433,527.16
基金赎回款	-140,106.44	-42,986.74	-183,093.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	56,037,501.91	14,281,083.44	70,318,585.35

万家瑞丰 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,825,668.30	866,093.89	2,691,762.19

加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,825,668.30	866,093.89	2,691,762.19
本期利润	304,916.21	-211,598.93	93,317.28
本期基金份额交易产生的变动数	-124,400.70	-24,256.75	-148,657.45
其中：基金申购款	115,481.62	57,050.57	172,532.19
基金赎回款	-239,882.32	-81,307.32	-321,189.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,006,183.81	630,238.21	2,636,422.02

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2025年1月1日至2025年6月30日	
活期存款利息收入	41,964.78	
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	619.51	
其他	178.14	
合计	42,762.43	

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	
	2025年1月1日至2025年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	367,203.55	
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	367,203.55	

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	
	2025年1月1日至2025年6月30日	
卖出股票成交总额	7,241,899.90	
减：卖出股票成本总额	6,752,407.41	
减：交易费用	122,288.94	
买卖股票差价收入	367,203.55	

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 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	28,565.47
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	108,403.92
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	136,969.39

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	20,841,211.61
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	20,602,387.94
减：应计利息总额	129,664.73
减：交易费用	755.02
买卖债券差价收入	108,403.92

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,323,285.70
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	2,323,285.70

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1. 交易性金融资产	-4,459,478.84
股票投资	-4,439,780.12
债券投资	-19,698.72
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	-4,459,478.84

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	347.01
基金转换费收入	0.01
合计	347.02

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 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	9,293.02
信息披露费	34,849.62
证券出借违约金	-
银行费用	57.00
账户维护费	1,550.00
合计	45,749.64

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 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司（“万家基金”）	基金管理人、基金销售机构
上海银行股份有限公司（“上海银行”）	基金托管人
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 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	232,673,125.37	100.00	103,810,145.51	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 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	31,946,274.11	100.00	123,163,053.20	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 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	44,000,000.00	100.00	136,452,000.00	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 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	103,745.36	100.00	4,424.64	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	92,337.48	100.00	13,538.51	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 2025年1月1日至2025年6 月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	410,986.08
其中：应支付销售机构的客户维护 费	47,572.37	14,765.76
应支付基金管理人的净管理费	363,413.71	107,804.75

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

基金管理费每日计提，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5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6 月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 6月30日

当期发生的基金应支付的托管费	102,746.52	30,642.66
----------------	------------	-----------

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，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 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家瑞丰 A	万家瑞丰 C	合计
万家基金	-	124.05	124.05
中泰证券	-	3.62	3.62
合计	-	127.67	127.67
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家瑞丰 A	万家瑞丰 C	合计
万家基金	-	222.70	222.70
中泰证券	-	3.64	3.64
合计	-	226.34	226.34

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 0.30%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.30% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，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销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，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 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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
上海银行	14,111,554.09	41,964.78	1,284,422.67	8,493.60

注：本基金的银行存款由基金托管人上海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（2025 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
001388	信通电子	2025年6月24日	1个月内（含）	新股未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025年6月24日	6个月	新股流通受限	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001390	古麒绒材	2025年5月21日	6个月	新股流通受限	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
301590	优优绿能	2025年5月28日	6个月	新股流通受限	89.60	139.48	54	4,838.40	7,531.92	-
301595	太力科技	2025年5月12日	6个月	新股流通受限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301636	泽润新能	2025年4月30日	6个月	新股流通受限	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301678	新恒汇	2025年6月13日	6个月	新股流通受限	12.80	44.54	353	4,518.40	15,722.62	-
603014	威高血净	2025年5月12日	6个月	新股流通受限	26.50	32.68	115	3,047.50	3,758.20	-
603049	中策橡胶	2025年5月27日	6个月	新股流通受限	46.50	42.85	109	5,068.50	4,670.65	-
603382	海	2025	6个月	新股	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-

	阳科技	2025年6月5日		流通受限						
603400	华之杰	2025年6月12日	6个月	新股流通受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
688755	汉邦科技	2025年5月9日	6个月	新股流通受限	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
688775	影石创新	2025年6月4日	6个月	新股流通受限	47.27	124.16	185	8,744.95	22,969.60	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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 2025 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 2025 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%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	2,638,030.14
合计	-	2,638,030.14

注：未评级债券为国债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
AAA	-	169,658.98
AAA 以下	-	1,396,546.05
未评级	-	5,305,562.08
合计	-	6,871,767.11

注：未评级债券为国债。

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（2025 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 2025 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	14,111,554.09	-	-	-	-	-	14,111,554.09
存出保证金	201,846.31	-	-	-	-	-	201,846.31
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-216,083,383.39	216,083,383.39
其他资产	-	-	-	-	-	17,050.00	17,050.00
资产总计	14,313,400.40	-	-	-	-	-216,100,433.39	230,413,833.79
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	433.87	433.87
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	111,114.53	111,114.53
应付托管费	-	-	-	-	-	27,778.59	27,778.59
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,339.97	2,339.97
其他负债	-	-	-	-	-	48,567.28	48,567.28
负债总计	-	-	-	-	-	190,234.24	190,234.24
利率敏感度缺口	14,313,400.40	-	-	-	-	-215,910,199.15	230,223,599.55
上年度末 2024 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	63,032.91	-	-	-	-	-	63,032.91
结算备付金	42,575.95	-	-	-	-	-	42,575.95
存出保证金	5,918.45	-	-	-	-	-	5,918.45
交易性金融资产	984,119.72	191,825.61	5,662,736.58	2,671,115.34	-	1,401,330.45	10,911,127.70
应收申购款	-	-	-	-	-	110.00	110.00
资产总计	1,095,647.03	191,825.61	5,662,736.58	2,671,115.34	-	1,401,440.45	11,022,765.01
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	14,985.31	14,985.31
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,624.43	5,624.43
应付托管费	-	-	-	-	-	1,406.11	1,406.11
应付清算款	-	-	-	-	-	0.01	0.01
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,548.01	2,548.01
应交税费	-	-	-	-	-	41.77	41.77
其他负债	-	-	-	-	-	12,082.36	12,082.36
负债总计	-	-	-	-	-	36,688.00	36,688.00
利率敏感度缺	1,095,647.03	191,825.61	5,662,736.58	2,671,115.34	-	1,364,752.45	10,986,077.01

口							
---	--	--	--	--	--	--	--

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（2025年6月30日）	上年度末（2024年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	-	34,852.41
市场利率上升 25 个基点	-	-34,784.16	

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 2025年6月30日		上年度末 2024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	216,083,383.39	93.86	1,401,330.45	12.76
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	216,083,383.39	93.86	1,401,330.45	12.76

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（2025年6月30日）	上年度末（2024年12月31日）
	股票基准指数上升100个基点	2,336,048.36	17,046.57
	股票基准指数下降100个基点	-2,336,048.36	-17,046.57

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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	215,985,508.91	2,967,535.48
第二层次	15,385.54	7,943,592.22
第三层次	82,488.94	-
合计	216,083,383.39	10,911,127.70

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	216,083,383.39	93.78
	其中：股票	216,083,383.39	93.78
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	14,111,554.09	6.12
8	其他各项资产	218,896.31	0.10
9	合计	230,413,833.79	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	1,192,991.00	0.52
B	采矿业	10,877,473.00	4.72
C	制造业	125,252,870.46	54.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,762,522.00	2.94
E	建筑业	4,174,826.00	1.81
F	批发和零售业	1,546,868.00	0.67
G	交通运输、仓储和邮政业	7,500,249.00	3.26
H	住宿和餐饮业	189,168.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,507,885.60	6.30
J	金融业	35,215,719.73	15.30
K	房地产业	1,981,560.00	0.86
L	租赁和商务服务业	2,435,810.60	1.06
M	科学研究和技术服务业	2,439,760.00	1.06
N	水利、环境和公共设施管理业	480,708.00	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	834,134.00	0.36
R	文化、体育和娱乐业	690,838.00	0.30
S	综合	-	-
	合计	216,083,383.39	93.86

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	600519	贵州茅台	6,000	8,457,120.00	3.67
2	300750	宁德时代	25,300	6,381,166.00	2.77
3	601318	中国平安	102,900	5,708,892.00	2.48
4	600036	招商银行	118,400	5,440,480.00	2.36
5	601166	兴业银行	158,900	3,708,726.00	1.61
6	600900	长江电力	117,000	3,526,380.00	1.53
7	000333	美的集团	47,000	3,393,400.00	1.47
8	601899	紫金矿业	157,500	3,071,250.00	1.33
9	002594	比亚迪	8,700	2,887,617.00	1.25
10	300059	东方财富	120,921	2,796,902.73	1.21
11	600030	中信证券	93,300	2,576,946.00	1.12
12	601398	工商银行	335,200	2,544,168.00	1.11
13	600276	恒瑞医药	42,700	2,216,130.00	0.96

14	000858	五 粮 液	18,600	2,211,540.00	0.96
15	000651	格力电器	42,900	1,927,068.00	0.84
16	601328	交通银行	225,200	1,801,600.00	0.78
17	601288	农业银行	305,300	1,795,164.00	0.78
18	600887	伊利股份	60,500	1,686,740.00	0.73
19	688981	中芯国际	19,100	1,684,047.00	0.73
20	002475	立讯精密	48,500	1,682,465.00	0.73
21	600919	江苏银行	140,400	1,676,376.00	0.73
22	603259	药明康德	23,900	1,662,245.00	0.72
23	601816	京沪高铁	280,700	1,614,025.00	0.70
24	600000	浦发银行	112,300	1,558,724.00	0.68
25	000725	京东方 A	351,200	1,401,288.00	0.61
26	002371	北方华创	3,100	1,370,851.00	0.60
27	300760	迈瑞医疗	5,800	1,303,550.00	0.57
28	601088	中国神华	31,500	1,277,010.00	0.55
29	688041	海光信息	8,800	1,243,352.00	0.54
30	300308	中际旭创	8,500	1,239,810.00	0.54
31	601601	中国太保	32,700	1,226,577.00	0.53
32	300502	新易盛	9,520	1,209,230.40	0.53
33	300124	汇川技术	18,000	1,162,260.00	0.50
34	601728	中国电信	148,500	1,150,875.00	0.50
35	688256	寒武纪	1,900	1,142,850.00	0.50
36	601668	中国建筑	197,600	1,140,152.00	0.50
37	002352	顺丰控股	23,000	1,121,480.00	0.49
38	000001	平安银行	92,800	1,120,096.00	0.49
39	002714	牧原股份	26,100	1,096,461.00	0.48
40	002230	科大讯飞	22,100	1,058,148.00	0.46
41	601127	赛力斯	7,800	1,047,696.00	0.46
42	603501	豪威集团	8,100	1,033,965.00	0.45
43	600031	三一重工	56,700	1,017,765.00	0.44
44	000063	中兴通讯	30,800	1,000,692.00	0.43
45	603019	中科曙光	14,000	985,600.00	0.43
46	002415	海康威视	35,300	978,869.00	0.43
47	600309	万华化学	18,000	976,680.00	0.42
48	600941	中国移动	8,600	967,930.00	0.42
49	300274	阳光电源	13,874	940,240.98	0.41
50	601857	中国石油	108,400	926,820.00	0.40
51	601919	中远海控	60,300	906,912.00	0.39
52	688008	澜起科技	10,900	893,800.00	0.39
53	600690	海尔智家	35,900	889,602.00	0.39
54	600660	福耀玻璃	15,300	872,253.00	0.38
55	601012	隆基绿能	58,000	871,160.00	0.38
56	600406	国电南瑞	38,400	860,544.00	0.37

57	601766	中国中车	116,300	818,752.00	0.36
58	600050	中国联通	149,500	798,330.00	0.35
59	603986	兆易创新	6,300	797,139.00	0.35
60	000338	潍柴动力	51,800	796,684.00	0.35
61	000568	泸州老窖	7,000	793,800.00	0.34
62	600028	中国石化	139,500	786,780.00	0.34
63	300476	胜宏科技	5,800	779,404.00	0.34
64	688012	中微公司	4,200	765,660.00	0.33
65	601006	大秦铁路	115,600	762,960.00	0.33
66	601985	中国核电	78,700	733,484.00	0.32
67	601225	陕西煤业	37,100	713,804.00	0.31
68	600104	上汽集团	44,300	711,015.00	0.31
69	002027	分众传媒	96,700	705,910.00	0.31
70	600150	中国船舶	21,400	696,356.00	0.30
71	601988	中国银行	120,900	679,458.00	0.30
72	600418	江淮汽车	16,700	669,503.00	0.29
73	601628	中国人寿	15,900	654,921.00	0.28
74	605499	东鹏饮料	2,000	628,100.00	0.27
75	603288	海天味业	16,000	622,560.00	0.27
76	600760	中航沈飞	10,500	615,510.00	0.27
77	000425	徐工机械	78,700	611,499.00	0.27
78	000625	长安汽车	47,500	606,100.00	0.26
79	000792	盐湖股份	35,400	604,632.00	0.26
80	600111	北方稀土	24,200	602,580.00	0.26
81	688271	联影医疗	4,700	600,378.00	0.26
82	600938	中国海油	22,900	597,919.00	0.26
83	688111	金山办公	2,100	588,105.00	0.26
84	600905	三峡能源	136,800	582,768.00	0.25
85	601658	邮储银行	106,200	580,914.00	0.25
86	600436	片仔癀	2,900	580,029.00	0.25
87	600089	特变电工	48,300	576,219.00	0.25
88	002625	光启技术	14,400	575,712.00	0.25
89	300033	同花顺	2,100	573,321.00	0.25
90	601888	中国中免	9,300	567,021.00	0.25
91	603993	洛阳钼业	67,200	565,824.00	0.25
92	002050	三花智控	21,400	564,532.00	0.25
93	300015	爱尔眼科	44,600	556,608.00	0.24
94	600048	保利发展	68,700	556,470.00	0.24
95	600547	山东黄金	17,300	552,389.00	0.24
96	600019	宝钢股份	83,800	552,242.00	0.24
97	601390	中国中铁	98,200	550,902.00	0.24
98	002463	沪电股份	12,900	549,282.00	0.24
99	002241	歌尔股份	23,400	545,688.00	0.24

100	600415	小商品城	26,200	541,816.00	0.24
101	300014	亿纬锂能	11,700	535,977.00	0.23
102	601600	中国铝业	75,800	533,632.00	0.23
103	000977	浪潮信息	9,900	503,712.00	0.22
104	002179	中航光电	12,200	492,392.00	0.21
105	600585	海螺水泥	22,900	491,663.00	0.21
106	002384	东山精密	13,000	491,010.00	0.21
107	600893	航发动力	12,700	489,458.00	0.21
108	600570	恒生电子	14,500	486,330.00	0.21
109	603799	华友钴业	13,000	481,260.00	0.21
110	000538	云南白药	8,500	474,215.00	0.21
111	600584	长电科技	13,700	461,553.00	0.20
112	000938	紫光股份	19,100	458,209.00	0.20
113	000988	华工科技	9,600	451,296.00	0.20
114	601727	上海电气	60,500	447,095.00	0.19
115	002028	思源电气	6,000	437,460.00	0.19
116	600438	通威股份	25,800	432,150.00	0.19
117	002049	紫光国微	6,500	428,090.00	0.19
118	300408	三环集团	12,800	427,520.00	0.19
119	300433	蓝思科技	19,100	425,930.00	0.19
120	000002	万 科 A	65,100	417,942.00	0.18
121	600795	国电电力	85,300	412,852.00	0.18
122	600489	中金黄金	27,800	406,714.00	0.18
123	601669	中国电建	82,400	401,288.00	0.17
124	600988	赤峰黄金	15,900	395,592.00	0.17
125	601689	拓普集团	8,300	392,175.00	0.17
126	600010	包钢股份	216,500	387,535.00	0.17
127	300339	润和软件	7,600	386,308.00	0.17
128	002422	科伦药业	10,700	384,344.00	0.17
129	600009	上海机场	11,900	378,063.00	0.16
130	002456	欧菲光	31,800	376,830.00	0.16
131	600160	巨化股份	12,900	369,972.00	0.16
132	601100	恒立液压	5,100	367,200.00	0.16
133	000768	中航西飞	13,300	363,622.00	0.16
134	300394	天孚通信	4,480	357,683.20	0.16
135	601186	中国铁建	44,000	352,440.00	0.15
136	600183	生益科技	11,600	349,740.00	0.15
137	002252	上海莱士	50,800	348,996.00	0.15
138	000157	中联重科	47,500	343,425.00	0.15
139	688036	传音控股	4,300	342,710.00	0.15
140	601360	三六零	33,500	341,700.00	0.15
141	000963	华东医药	8,400	339,024.00	0.15
142	600886	国投电力	23,000	339,020.00	0.15

143	600989	宝丰能源	21,000	338,940.00	0.15
144	002074	国轩高科	10,300	334,338.00	0.15
145	601058	赛轮轮胎	25,200	330,624.00	0.14
146	600115	中国东航	81,800	329,654.00	0.14
147	300442	润泽科技	6,600	326,898.00	0.14
148	000408	藏格矿业	7,500	320,025.00	0.14
149	000807	云铝股份	19,900	318,002.00	0.14
150	002466	天齐锂业	9,900	317,196.00	0.14
151	600066	宇通客车	12,700	315,722.00	0.14
152	002517	恺英网络	16,300	314,753.00	0.14
153	002001	新和成	14,700	312,669.00	0.14
154	002340	格林美	49,000	311,150.00	0.14
155	600426	华鲁恒升	14,200	307,714.00	0.13
156	000661	长春高新	3,100	307,458.00	0.13
157	688169	石头科技	1,960	306,838.00	0.13
158	002558	巨人网络	13,000	306,150.00	0.13
159	600196	复星医药	12,200	306,098.00	0.13
160	002195	岩山科技	54,300	305,709.00	0.13
161	001979	招商蛇口	34,700	304,319.00	0.13
162	600029	南方航空	51,500	303,850.00	0.13
163	300661	圣邦股份	4,160	302,723.20	0.13
164	601800	中国交建	34,000	302,260.00	0.13
165	000975	山金国际	15,900	301,146.00	0.13
166	600011	华能国际	42,100	300,594.00	0.13
167	301236	软通动力	5,500	300,520.00	0.13
168	002236	大华股份	18,900	300,132.00	0.13
169	600674	川投能源	18,600	298,344.00	0.13
170	002156	通富微电	11,600	297,192.00	0.13
171	688126	沪硅产业	15,800	295,776.00	0.13
172	600487	亨通光电	18,900	289,170.00	0.13
173	600346	恒力石化	20,200	288,052.00	0.13
174	300251	光线传媒	14,000	283,780.00	0.12
175	300207	欣旺达	14,100	282,846.00	0.12
176	300418	昆仑万维	8,400	282,492.00	0.12
177	601111	中国国航	35,800	282,462.00	0.12
178	002648	卫星化学	16,100	279,013.00	0.12
179	600372	中航机载	23,100	278,586.00	0.12
180	688608	恒玄科技	800	278,384.00	0.12
181	600745	闻泰科技	8,300	278,299.00	0.12
182	601868	中国能建	124,000	276,520.00	0.12
183	688213	思特威	2,700	275,994.00	0.12
184	002920	德赛西威	2,700	275,751.00	0.12
185	600460	士兰微	11,100	275,502.00	0.12

186	000066	中国长城	18,500	273,800.00	0.12
187	003816	中国广核	75,200	273,728.00	0.12
188	688120	华海清科	1,600	269,920.00	0.12
189	002916	深南电路	2,500	269,525.00	0.12
190	688777	中控技术	6,000	269,460.00	0.12
191	601117	中国化学	35,000	268,450.00	0.12
192	600096	云天化	12,200	268,034.00	0.12
193	601319	中国人保	30,600	266,526.00	0.12
194	600741	华域汽车	15,100	266,515.00	0.12
195	601168	西部矿业	16,000	266,080.00	0.12
196	002273	水晶光电	13,300	265,601.00	0.12
197	002465	海格通信	19,000	264,860.00	0.12
198	600879	航天电子	25,200	263,844.00	0.11
199	600176	中国巨石	23,000	262,200.00	0.11
200	600588	用友网络	19,600	262,052.00	0.11
201	600256	广汇能源	43,500	261,870.00	0.11
202	601021	春秋航空	4,700	261,555.00	0.11
203	300347	泰格医药	4,900	261,268.00	0.11
204	300450	先导智能	10,500	260,925.00	0.11
205	002601	龙佰集团	16,000	259,360.00	0.11
206	688235	百济神州	1,100	257,004.00	0.11
207	300782	卓胜微	3,600	256,932.00	0.11
208	000786	北新建材	9,700	256,856.00	0.11
209	000831	中国稀土	7,100	256,452.00	0.11
210	002555	三七互娱	14,800	255,892.00	0.11
211	601633	长城汽车	11,900	255,612.00	0.11
212	600219	南山铝业	66,600	255,078.00	0.11
213	600352	浙江龙盛	24,900	252,984.00	0.11
214	000933	神火股份	15,100	251,264.00	0.11
215	002294	信立泰	5,300	250,849.00	0.11
216	300017	网宿科技	23,400	250,848.00	0.11
217	600885	宏发股份	11,200	249,872.00	0.11
218	600482	中国动力	10,800	249,156.00	0.11
219	600039	四川路桥	25,000	247,500.00	0.11
220	002185	华天科技	24,500	247,450.00	0.11
221	302132	中航成飞	2,800	246,232.00	0.11
222	000630	铜陵有色	73,400	245,156.00	0.11
223	300896	爱美客	1,400	244,734.00	0.11
224	002493	荣盛石化	29,000	240,120.00	0.10
225	600085	同仁堂	6,600	237,996.00	0.10
226	002129	TCL 中环	30,900	237,312.00	0.10
227	688002	睿创微纳	3,400	237,048.00	0.10
228	688506	百利天恒	800	236,896.00	0.10

229	688396	华润微	5,000	235,800.00	0.10
230	001965	招商公路	19,600	235,200.00	0.10
231	601877	正泰电器	10,300	233,501.00	0.10
232	600362	江西铜业	9,900	231,957.00	0.10
233	002709	天赐材料	12,800	231,936.00	0.10
234	002130	沃尔核材	9,600	228,672.00	0.10
235	688099	晶晨股份	3,200	227,232.00	0.10
236	300866	安克创新	2,000	227,200.00	0.10
237	002281	光迅科技	4,600	226,872.00	0.10
238	002131	利欧股份	64,800	226,800.00	0.10
239	300454	深信服	2,400	226,032.00	0.10
240	002085	万丰奥威	14,200	225,638.00	0.10
241	002595	豪迈科技	3,800	225,036.00	0.10
242	000423	东阿阿胶	4,300	224,890.00	0.10
243	300122	智飞生物	11,400	223,326.00	0.10
244	688122	西部超导	4,300	223,084.00	0.10
245	300058	蓝色光标	33,860	222,121.60	0.10
246	002738	中矿资源	6,900	221,904.00	0.10
247	002532	天山铝业	26,700	221,877.00	0.10
248	300002	神州泰岳	18,800	221,840.00	0.10
249	300223	北京君正	3,200	221,440.00	0.10
250	603392	万泰生物	3,600	219,600.00	0.10
251	300474	景嘉微	3,000	219,000.00	0.10
252	002180	纳思达	9,500	217,930.00	0.09
253	002472	双环传动	6,500	217,685.00	0.09
254	600161	天坛生物	11,300	216,847.00	0.09
255	002138	顺络电子	7,700	216,524.00	0.09
256	603129	春风动力	1,000	216,500.00	0.09
257	603596	伯特利	4,100	216,029.00	0.09
258	300832	新产业	3,800	215,536.00	0.09
259	002078	太阳纸业	16,000	215,360.00	0.09
260	688617	惠泰医疗	725	215,325.00	0.09
261	002436	兴森科技	16,200	214,488.00	0.09
262	600233	圆通速递	16,500	212,685.00	0.09
263	002410	广联达	15,840	212,414.40	0.09
264	002128	电投能源	10,700	211,646.00	0.09
265	002938	鹏鼎控股	6,600	211,398.00	0.09
266	000301	东方盛虹	25,300	210,749.00	0.09
267	300346	南大光电	6,620	209,456.80	0.09
268	600862	中航高科	8,000	208,640.00	0.09
269	300759	康龙化成	8,500	208,590.00	0.09
270	300136	信维通信	9,300	208,320.00	0.09
271	600143	金发科技	20,200	208,262.00	0.09

272	002353	杰瑞股份	5,900	206,500.00	0.09
273	300054	鼎龙股份	7,200	206,496.00	0.09
274	002223	鱼跃医疗	5,800	206,480.00	0.09
275	002065	东华软件	21,500	206,400.00	0.09
276	300024	机器人	12,000	206,160.00	0.09
277	688578	艾力斯	2,200	204,688.00	0.09
278	300395	菲利华	4,000	204,400.00	0.09
279	601618	中国中冶	68,300	203,534.00	0.09
280	000034	神州数码	5,400	203,256.00	0.09
281	002202	金风科技	19,800	202,950.00	0.09
282	603606	东方电缆	3,900	201,669.00	0.09
283	300496	中科创达	3,500	200,270.00	0.09
284	688047	龙芯中科	1,500	200,085.00	0.09
285	601615	明阳智能	17,400	199,926.00	0.09
286	000999	华润三九	6,370	199,253.60	0.09
287	688223	晶科能源	38,300	198,777.00	0.09
288	300383	光环新网	13,800	197,340.00	0.09
289	002624	完美世界	13,000	197,210.00	0.09
290	002271	东方雨虹	18,300	196,359.00	0.09
291	600845	宝信软件	8,300	196,046.00	0.09
292	002008	大族激光	8,000	194,960.00	0.08
293	002405	四维图新	22,700	193,858.00	0.08
294	688266	泽璟制药	1,800	193,518.00	0.08
295	601872	招商轮船	30,900	193,434.00	0.08
296	603659	璞泰来	10,200	191,556.00	0.08
297	603605	珀莱雅	2,300	190,417.00	0.08
298	600549	厦门钨业	9,100	190,372.00	0.08
299	600895	张江高科	7,400	190,180.00	0.08
300	002459	晶澳科技	19,000	189,620.00	0.08
301	300604	长川科技	4,200	188,622.00	0.08
302	300012	华测检测	16,100	188,209.00	0.08
303	300459	汤姆猫	33,600	188,160.00	0.08
304	000426	兴业银锡	11,900	188,020.00	0.08
305	002155	湖南黄金	10,500	187,425.00	0.08
306	603087	甘李药业	3,400	186,252.00	0.08
307	000733	振华科技	3,700	185,185.00	0.08
308	688072	拓荆科技	1,200	184,452.00	0.08
309	605117	德业股份	3,500	184,310.00	0.08
310	688599	天合光能	12,500	181,625.00	0.08
311	300627	华测导航	5,180	181,300.00	0.08
312	605589	圣泉集团	6,500	180,375.00	0.08
313	300253	卫宁健康	16,900	179,140.00	0.08
314	601216	君正集团	32,300	178,296.00	0.08

315	300699	光威复材	5,600	177,352.00	0.08
316	000617	中油资本	24,200	176,660.00	0.08
317	600332	白云山	6,700	176,612.00	0.08
318	600392	盛和资源	13,400	176,478.00	0.08
319	002444	巨星科技	6,900	176,019.00	0.08
320	300037	新宙邦	5,000	176,000.00	0.08
321	000519	中兵红箭	8,000	175,120.00	0.08
322	601799	星宇股份	1,400	175,000.00	0.08
323	000932	华菱钢铁	39,600	174,240.00	0.08
324	300003	乐普医疗	12,600	173,628.00	0.08
325	688180	君实生物	5,100	173,298.00	0.08
326	600153	建发股份	16,600	172,142.00	0.07
327	002389	航天彩虹	6,700	171,520.00	0.07
328	300073	当升科技	3,900	171,093.00	0.07
329	300316	晶盛机电	6,300	171,045.00	0.07
330	601233	桐昆股份	16,100	170,660.00	0.07
331	000878	云南铜业	13,400	170,448.00	0.07
332	300001	特锐德	7,100	170,187.00	0.07
333	300142	沃森生物	15,300	168,300.00	0.07
334	600803	新奥股份	8,900	168,210.00	0.07
335	002821	凯莱英	1,900	167,675.00	0.07
336	603979	金诚信	3,600	167,184.00	0.07
337	002414	高德红外	16,300	167,075.00	0.07
338	300628	亿联网络	4,800	166,848.00	0.07
339	002007	华兰生物	10,500	164,535.00	0.07
340	002812	恩捷股份	5,600	164,024.00	0.07
341	600699	均胜电子	9,400	163,936.00	0.07
342	600118	中国卫星	5,700	162,849.00	0.07
343	300568	星源材质	12,800	162,304.00	0.07
344	600521	华海药业	8,700	162,081.00	0.07
345	600177	雅戈尔	22,100	161,330.00	0.07
346	603260	合盛硅业	3,400	161,160.00	0.07
347	600398	海澜之家	23,000	160,080.00	0.07
348	002152	广电运通	11,900	159,936.00	0.07
349	601238	广汽集团	21,200	158,788.00	0.07
350	300315	掌趣科技	26,000	157,820.00	0.07
351	300413	芒果超媒	7,200	157,104.00	0.07
352	600704	物产中大	29,800	157,046.00	0.07
353	000738	航发控制	7,500	155,625.00	0.07
354	600316	洪都航空	4,100	154,570.00	0.07
355	600497	驰宏锌锗	29,200	154,468.00	0.07
356	000623	吉林敖东	9,100	154,245.00	0.07
357	002044	美年健康	29,900	153,686.00	0.07

358	000009	中国宝安	17,300	153,624.00	0.07
359	002318	久立特材	6,500	152,035.00	0.07
360	600141	兴发集团	7,400	151,922.00	0.07
361	600765	中航重机	9,000	151,920.00	0.07
362	600038	中直股份	3,900	151,359.00	0.07
363	601567	三星医疗	6,700	150,214.00	0.07
364	300757	罗博特科	1,000	149,970.00	0.07
365	000400	许继电气	6,800	148,036.00	0.06
366	300919	中伟股份	4,500	147,960.00	0.06
367	601677	明泰铝业	11,900	147,798.00	0.06
368	002409	雅克科技	2,700	147,663.00	0.06
369	688188	柏楚电子	1,120	147,459.20	0.06
370	300724	捷佳伟创	2,700	146,610.00	0.06
371	600637	东方明珠	19,300	144,171.00	0.06
372	000960	锡业股份	9,400	143,820.00	0.06
373	601607	上海医药	8,000	143,040.00	0.06
374	600498	烽火通信	6,800	143,004.00	0.06
375	300088	长信科技	23,900	142,444.00	0.06
376	603939	益丰药房	5,800	141,926.00	0.06
377	600563	法拉电子	1,300	141,817.00	0.06
378	002245	蔚蓝锂芯	11,000	141,130.00	0.06
379	300182	捷成股份	25,500	140,505.00	0.06
380	600529	山东药玻	6,300	139,482.00	0.06
381	300558	贝达药业	2,400	139,080.00	0.06
382	002407	多氟多	11,400	138,966.00	0.06
383	002841	视源股份	4,000	138,400.00	0.06
384	000039	中集集团	17,600	138,336.00	0.06
385	002739	万达电影	12,100	138,303.00	0.06
386	600026	中远海能	13,300	137,389.00	0.06
387	300068	南都电源	8,600	136,912.00	0.06
388	601018	宁波港	37,200	136,152.00	0.06
389	301358	湖南裕能	4,300	134,117.00	0.06
390	000887	中鼎股份	7,600	133,684.00	0.06
391	002025	航天电器	2,600	133,666.00	0.06
392	600486	扬农化工	2,300	133,400.00	0.06
393	300763	锦浪科技	2,300	131,997.00	0.06
394	300285	国瓷材料	7,600	131,860.00	0.06
395	688303	大全能源	6,100	130,052.00	0.06
396	603806	福斯特	10,000	129,600.00	0.06
397	300144	宋城演艺	15,000	128,250.00	0.06
398	603486	科沃斯	2,200	128,106.00	0.06
399	600820	隧道股份	21,000	128,100.00	0.06
400	688009	中国通号	24,800	127,472.00	0.06

401	600008	首创环保	42,100	127,142.00	0.06
402	300296	利亚德	20,700	126,270.00	0.05
403	002064	华峰化学	19,000	125,590.00	0.05
404	002497	雅化集团	11,000	125,400.00	0.05
405	600516	方大炭素	26,900	124,816.00	0.05
406	603568	伟明环保	6,500	124,020.00	0.05
407	002312	川发龙蟒	10,800	123,984.00	0.05
408	600998	九州通	24,100	123,874.00	0.05
409	600763	通策医疗	3,000	123,840.00	0.05
410	600166	福田汽车	45,400	123,034.00	0.05
411	600170	上海建工	51,000	121,890.00	0.05
412	601179	中国西电	19,600	120,344.00	0.05
413	600312	平高电气	7,800	120,042.00	0.05
414	603816	顾家家居	4,700	119,944.00	0.05
415	300676	华大基因	2,400	119,448.00	0.05
416	000683	博源化工	24,900	119,271.00	0.05
417	605358	立昂微	5,100	118,830.00	0.05
418	601155	新城控股	8,600	117,648.00	0.05
419	002432	九安医疗	3,200	116,576.00	0.05
420	002244	滨江集团	11,900	116,025.00	0.05
421	300567	精测电子	1,900	115,159.00	0.05
422	601000	唐山港	28,300	114,898.00	0.05
423	600323	瀚蓝环境	4,700	114,445.00	0.05
424	000708	中信特钢	9,700	114,072.00	0.05
425	603613	国联股份	4,800	113,712.00	0.05
426	000629	钒钛股份	44,400	113,664.00	0.05
427	000830	鲁西化工	11,000	113,300.00	0.05
428	603885	吉祥航空	8,400	113,148.00	0.05
429	002603	以岭药业	8,000	112,800.00	0.05
430	000818	航锦科技	5,000	112,500.00	0.05
431	600535	天士力	7,100	111,115.00	0.05
432	002439	启明星辰	6,900	110,331.00	0.05
433	600499	科达制造	11,000	107,800.00	0.05
434	601880	辽港股份	71,700	107,550.00	0.05
435	603000	人民网	5,300	107,113.00	0.05
436	300390	天华新能	5,600	106,792.00	0.05
437	002145	中核钛白	25,500	105,825.00	0.05
438	600511	国药股份	3,600	104,976.00	0.05
439	688005	容百科技	4,700	104,904.00	0.05
440	000563	陕国投 A	29,300	104,601.00	0.05
441	600859	王府井	7,500	104,175.00	0.05
442	603077	和邦生物	59,100	103,425.00	0.04
443	600655	豫园股份	18,600	103,230.00	0.04

444	600004	白云机场	11,300	102,830.00	0.04
445	600325	华发股份	21,100	102,757.00	0.04
446	601966	玲珑轮胎	7,000	102,690.00	0.04
447	603899	晨光股份	3,500	101,465.00	0.04
448	600131	国网信通	5,700	100,890.00	0.04
449	300529	健帆生物	4,600	99,222.00	0.04
450	600754	锦江酒店	4,400	98,736.00	0.04
451	002756	永兴材料	3,100	98,425.00	0.04
452	300601	康泰生物	6,400	97,216.00	0.04
453	000998	隆平高科	9,800	96,530.00	0.04
454	603833	欧派家居	1,700	95,965.00	0.04
455	300438	鹏辉能源	3,400	93,874.00	0.04
456	300070	碧水源	20,800	93,600.00	0.04
457	002120	韵达股份	13,900	93,130.00	0.04
458	601866	中远海发	37,600	92,872.00	0.04
459	600667	太极实业	14,100	92,778.00	0.04
460	600867	通化东宝	11,200	91,840.00	0.04
461	002544	普天科技	3,900	91,455.00	0.04
462	600258	首旅酒店	6,400	90,432.00	0.04
463	300751	迈为股份	1,300	90,428.00	0.04
464	000032	深桑达 A	4,400	89,012.00	0.04
465	000069	华侨城 A	38,400	86,400.00	0.04
466	002508	老板电器	4,500	85,545.00	0.04
467	300457	赢合科技	3,700	85,100.00	0.04
468	002831	裕同科技	3,600	84,312.00	0.04
469	000967	盈峰环境	12,100	84,095.00	0.04
470	300573	兴齐眼药	1,620	83,899.80	0.04
471	300118	东方日升	8,700	83,346.00	0.04
472	002292	奥飞娱乐	8,500	82,620.00	0.04
473	600129	太极集团	3,700	78,847.00	0.03
474	601636	旗滨集团	15,400	77,154.00	0.03
475	002572	索菲亚	5,500	77,055.00	0.03
476	002266	浙富控股	25,000	77,000.00	0.03
477	688063	派能科技	1,700	76,636.00	0.03
478	603650	彤程新材	2,300	73,945.00	0.03
479	000035	中国天楹	16,700	71,643.00	0.03
480	600864	哈投股份	11,900	71,043.00	0.03
481	300769	德方纳米	2,100	69,342.00	0.03
482	002091	江苏国泰	9,300	67,611.00	0.03
483	600315	上海家化	3,200	67,424.00	0.03
484	688390	固德威	1,500	65,175.00	0.03
485	002372	伟星新材	6,100	63,196.00	0.03
486	001914	招商积余	4,100	50,717.00	0.02

487	600007	中国国贸	1,900	39,102.00	0.02
488	600335	国机汽车	5,700	36,765.00	0.02
489	688775	影石创新	185	22,969.60	0.01
490	301381	赛维时代	1,100	21,945.00	0.01
491	301678	新恒汇	353	15,722.62	0.01
492	001388	信通电子	937	15,385.54	0.01
493	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
494	301590	优优绿能	54	7,531.92	0.00
495	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
496	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
497	603049	中策橡胶	109	4,670.65	0.00
498	603014	威高血净	115	3,758.20	0.00
499	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
500	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
501	603382	海阳科技	105	2,350.95	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	600519	贵州茅台	9,668,925.50	88.01
2	300750	宁德时代	6,654,813.00	60.57
3	601318	中国平安	5,492,459.00	49.99
4	600036	招商银行	5,350,572.00	48.70
5	601166	兴业银行	3,493,021.00	31.79
6	000333	美的集团	3,365,270.00	30.63
7	002594	比亚迪	3,240,771.00	29.50
8	600900	长江电力	3,225,155.00	29.36
9	300059	东方财富	2,944,206.51	26.80
10	601899	紫金矿业	2,761,190.00	25.13
11	000858	五粮液	2,636,937.00	24.00
12	600030	中信证券	2,620,713.00	23.85
13	601398	工商银行	2,278,720.00	20.74
14	600276	恒瑞医药	1,990,267.00	18.12
15	002475	立讯精密	1,985,489.00	18.07
16	000651	格力电器	1,859,627.00	16.93
17	688981	中芯国际	1,784,183.35	16.24
18	600887	伊利股份	1,779,959.00	16.20
19	601328	交通银行	1,625,915.00	14.80
20	601816	京沪高铁	1,597,991.00	14.55
21	601288	农业银行	1,565,177.00	14.25
22	000725	京东方 A	1,552,826.00	14.13
23	603259	药明康德	1,528,078.00	13.91
24	300124	汇川技术	1,508,215.00	13.73

25	300760	迈瑞医疗	1,450,296.00	13.20
26	688256	寒武纪	1,435,904.20	13.07
27	688041	海光信息	1,376,752.56	12.53
28	002371	北方华创	1,361,338.00	12.39
29	600919	江苏银行	1,312,009.00	11.94
30	600309	万华化学	1,261,956.00	11.49
31	601728	中国电信	1,196,994.00	10.90
32	601088	中国神华	1,178,732.00	10.73
33	002415	海康威视	1,177,866.00	10.72
34	600000	浦发银行	1,175,183.00	10.70
35	600031	三一重工	1,164,285.00	10.60
36	000063	中兴通讯	1,160,829.00	10.57
37	603501	豪威集团	1,144,140.00	10.41
38	002230	科大讯飞	1,114,258.00	10.14
39	000001	平安银行	1,107,631.00	10.08
40	601668	中国建筑	1,091,352.00	9.93
41	601988	中国银行	1,086,213.00	9.89
42	601601	中国太保	1,070,339.00	9.74
43	601127	赛力斯	1,030,573.00	9.38
44	002352	顺丰控股	1,019,759.00	9.28
45	601012	隆基绿能	1,017,996.00	9.27
46	000568	泸州老窖	1,013,937.00	9.23
47	002714	牧原股份	1,013,395.00	9.22
48	603019	中科曙光	1,002,195.00	9.12
49	600690	海尔智家	980,814.00	8.93
50	600941	中国移动	970,642.00	8.84
51	600050	中国联通	944,221.00	8.59
52	300274	阳光电源	944,174.78	8.59
53	600660	福耀玻璃	935,019.00	8.51
54	300308	中际旭创	906,210.00	8.25
55	601919	中远海控	888,956.00	8.09
56	601766	中国中车	873,679.00	7.95
57	600406	国电南瑞	871,931.00	7.94
58	601857	中国石油	868,763.00	7.91
59	688012	中微公司	851,980.90	7.76
60	000338	潍柴动力	836,450.00	7.61
61	688008	澜起科技	833,603.27	7.59
62	603986	兆易创新	821,680.00	7.48
63	600028	中国石化	809,575.00	7.37
64	601225	陕西煤业	770,565.00	7.01
65	601985	中国核电	755,939.00	6.88
66	601006	大秦铁路	755,096.00	6.87
67	688111	金山办公	737,175.18	6.71

68	000425	徐工机械	729,838.00	6.64
69	600104	上汽集团	691,925.00	6.30
70	600150	中国船舶	681,826.00	6.21
71	002027	分众传媒	678,253.00	6.17
72	002050	三花智控	666,354.00	6.07
73	603288	海天味业	664,473.00	6.05
74	300033	同花顺	663,364.00	6.04
75	300502	新易盛	661,624.00	6.02
76	000938	紫光股份	639,221.00	5.82
77	300015	爱尔眼科	633,218.00	5.76
78	600019	宝钢股份	631,205.00	5.75
79	002241	歌尔股份	629,588.00	5.73
80	600938	中国海油	627,471.00	5.71
81	000625	长安汽车	626,719.00	5.70
82	601628	中国人寿	624,822.00	5.69
83	000792	盐湖股份	622,250.00	5.66
84	688271	联影医疗	611,800.99	5.57
85	600089	特变电工	611,603.00	5.57
86	601600	中国铝业	604,461.00	5.50
87	600436	片仔癀	600,121.00	5.46
88	601888	中国中免	599,869.00	5.46
89	600048	保利发展	597,422.00	5.44
90	002625	光启技术	597,162.00	5.44
91	300014	亿纬锂能	585,999.00	5.33
92	600905	三峡能源	584,226.00	5.32
93	000977	浪潮信息	582,752.00	5.30
94	601390	中国中铁	580,026.00	5.28
95	601658	邮储银行	572,212.00	5.21
96	600111	北方稀土	572,062.00	5.21
97	600438	通威股份	562,833.00	5.12
98	600585	海螺水泥	562,527.00	5.12
99	600418	江淮汽车	559,188.00	5.09
100	603993	洛阳钼业	536,089.00	4.88
101	002179	中航光电	519,833.00	4.73
102	600584	长电科技	514,334.00	4.68
103	603799	华友钴业	508,425.00	4.63
104	300408	三环集团	502,700.00	4.58
105	600893	航发动力	492,499.00	4.48
106	000002	万 科 A	490,613.00	4.47
107	300433	蓝思科技	485,614.00	4.42
108	601727	上海电气	482,295.00	4.39
109	600760	中航沈飞	478,212.00	4.35
110	000538	云南白药	477,693.00	4.35

111	601689	拓普集团	477,687.00	4.35
112	300476	胜宏科技	468,084.00	4.26
113	605499	东鹏饮料	464,428.00	4.23
114	002463	沪电股份	462,686.00	4.21
115	300339	润和软件	460,590.00	4.19
116	600570	恒生电子	453,872.00	4.13
117	002049	紫光国微	452,689.00	4.12
118	601100	恒立液压	449,105.00	4.09
119	002456	欧菲光	443,423.00	4.04
120	002028	思源电气	442,683.00	4.03
121	600547	山东黄金	438,515.00	3.99
122	002384	东山精密	433,737.00	3.95
123	000988	华工科技	426,295.00	3.88
124	688036	传音控股	422,493.32	3.85
125	600010	包钢股份	414,851.00	3.78
126	601669	中国电建	407,797.00	3.71
127	601058	赛轮轮胎	390,672.00	3.56
128	600009	上海机场	388,965.00	3.54
129	002422	科伦药业	387,221.00	3.52
130	000157	中联重科	387,193.00	3.52
131	601360	三六零	383,496.00	3.49
132	600989	宝丰能源	370,342.00	3.37
133	601186	中国铁建	369,549.00	3.36
134	301236	软通动力	369,123.00	3.36
135	600489	中金黄金	368,497.00	3.35
136	000807	云铝股份	364,089.00	3.31
137	002236	大华股份	363,537.00	3.31
138	600795	国电电力	362,548.00	3.30
139	002252	上海莱士	357,862.00	3.26
140	600183	生益科技	355,554.00	3.24
141	002195	岩山科技	346,690.00	3.16
142	002648	卫星化学	346,049.00	3.15
143	688169	石头科技	343,050.73	3.12
144	000768	中航西飞	342,737.00	3.12
145	600066	宇通客车	342,266.00	3.12
146	002340	格林美	341,815.00	3.11
147	600588	用友网络	341,111.00	3.10
148	600415	小商品城	341,107.00	3.10
149	688777	中控技术	339,571.87	3.09
150	300251	光线传媒	335,412.00	3.05
151	300207	欣旺达	335,129.00	3.05
152	001979	招商蛇口	333,952.00	3.04
153	600160	巨化股份	333,552.00	3.04

154	002920	德赛西威	331,684.00	3.02
155	601800	中国交建	325,610.00	2.96
156	600886	国投电力	324,081.00	2.95
157	002001	新和成	323,120.00	2.94
158	002466	天齐锂业	321,838.00	2.93
159	002156	通富微电	321,252.00	2.92
160	600346	恒力石化	320,495.00	2.92
161	300418	昆仑万维	319,481.00	2.91
162	601633	长城汽车	318,530.00	2.90
163	600487	亨通光电	318,403.00	2.90
164	002273	水晶光电	316,676.00	2.88
165	600988	赤峰黄金	316,134.00	2.88
166	600426	华鲁恒升	313,093.00	2.85
167	300017	网宿科技	312,791.00	2.85
168	000661	长春高新	312,223.00	2.84
169	300394	天孚通信	311,301.00	2.83
170	600115	中国东航	310,952.00	2.83
171	300782	卓胜微	309,415.00	2.82
172	600196	复星医药	305,955.00	2.78
173	688126	沪硅产业	304,488.33	2.77
174	600029	南方航空	304,106.00	2.77
175	000066	中国长城	303,015.00	2.76
176	300896	爱美客	302,833.00	2.76
177	300661	圣邦股份	302,567.00	2.75
178	000933	神火股份	300,480.00	2.74
179	002601	龙佰集团	297,581.00	2.71
180	000963	华东医药	297,451.00	2.71
181	600745	闻泰科技	296,181.00	2.70
182	688608	恒玄科技	295,859.76	2.69
183	600885	宏发股份	294,591.00	2.68
184	000786	北新建材	292,619.00	2.66
185	300442	润泽科技	291,711.00	2.66
186	300122	智飞生物	291,285.00	2.65
187	002517	恺英网络	290,480.00	2.64
188	300347	泰格医药	288,854.00	2.63
189	300002	神州泰岳	288,665.00	2.63
190	601868	中国能建	287,668.00	2.62
191	600011	华能国际	287,188.00	2.61
192	000975	山金国际	287,041.00	2.61
193	600460	士兰微	286,131.00	2.60
194	600674	川投能源	285,158.00	2.60
195	600372	中航机载	281,011.00	2.56
196	300383	光环新网	280,433.00	2.55

197	000408	藏格矿业	280,176.00	2.55
198	002129	TCL 中环	279,627.00	2.55
199	600256	广汇能源	277,876.00	2.53
200	003816	中国广核	276,859.00	2.52
201	601168	西部矿业	276,758.00	2.52
202	600176	中国巨石	274,698.00	2.50
203	300759	康龙化成	274,415.00	2.50
204	600096	云天化	273,444.00	2.49
205	300454	深信服	273,045.00	2.49
206	600845	宝信软件	270,524.00	2.46
207	002916	深南电路	269,674.00	2.45
208	002131	利欧股份	269,307.00	2.45
209	002185	华天科技	269,216.00	2.45
210	002085	万丰奥威	266,741.00	2.43
211	600741	华域汽车	266,422.00	2.43
212	601111	中国国航	263,068.00	2.39
213	688223	晶科能源	263,047.25	2.39
214	002180	纳思达	263,038.00	2.39
215	600219	南山铝业	261,837.00	2.38
216	601117	中国化学	261,799.00	2.38
217	600482	中国动力	260,800.00	2.37
218	601877	正泰电器	259,245.00	2.36
219	002709	天赐材料	258,844.00	2.36
220	000630	铜陵有色	258,072.00	2.35
221	688099	晶晨股份	257,848.21	2.35
222	688120	华海清科	257,755.00	2.35
223	002065	东华软件	257,660.00	2.35
224	300474	景嘉微	257,247.00	2.34
225	688506	百利天恒	255,913.65	2.33
226	002493	荣盛石化	255,786.00	2.33
227	002938	鹏鼎控股	255,297.00	2.32
228	002271	东方雨虹	254,265.00	2.31
229	000423	东阿阿胶	253,740.00	2.31
230	688213	思特威	253,619.65	2.31
231	001965	招商公路	253,230.00	2.31
232	300223	北京君正	251,914.00	2.29
233	002532	天山铝业	250,850.00	2.28
234	300058	蓝色光标	249,142.00	2.27
235	600879	航天电子	248,738.00	2.26
236	000034	神州数码	248,201.00	2.26
237	002738	中矿资源	248,065.00	2.26
238	300450	先导智能	246,345.00	2.24
239	603596	伯特利	246,325.00	2.24

240	603392	万泰生物	245,427.00	2.23
241	600085	同仁堂	244,023.00	2.22
242	002202	金风科技	243,240.00	2.21
243	601021	春秋航空	242,829.00	2.21
244	002138	顺络电子	242,617.00	2.21
245	002281	光迅科技	241,197.00	2.20
246	002074	国轩高科	240,860.00	2.19
247	002472	双环传动	240,112.00	2.19
248	300024	机器人	239,733.00	2.18
249	002459	晶澳科技	239,301.00	2.18
250	600143	金发科技	239,178.00	2.18
251	600352	浙江龙盛	238,225.00	2.17
252	002595	豪迈科技	238,077.00	2.17
253	002555	三七互娱	237,731.00	2.16
254	688235	百济神州	237,689.76	2.16
255	688396	华润微	237,429.68	2.16
256	002465	海格通信	233,589.00	2.13
257	300136	信维通信	233,174.00	2.12
258	002078	太阳纸业	232,875.00	2.12
259	000301	东方盛虹	232,212.00	2.11
260	002008	大族激光	231,240.00	2.10
261	000831	中国稀土	231,103.00	2.10
262	300395	菲利华	231,063.00	2.10
263	600161	天坛生物	227,939.00	2.07
264	300496	中科创达	227,868.00	2.07
265	600233	圆通速递	227,648.00	2.07
266	002410	广联达	225,612.00	2.05
267	002130	沃尔核材	225,604.00	2.05
268	300832	新产业	225,585.40	2.05
269	002436	兴森科技	225,159.00	2.05
270	300459	汤姆猫	222,066.00	2.02
271	600362	江西铜业	220,430.00	2.01

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	601988	中国银行	435,076.00	3.96
2	688775	影石创新	296,192.00	2.70
3	600027	华电国际	190,527.00	1.73
4	300124	汇川技术	169,041.00	1.54
5	300999	金龙鱼	167,365.00	1.52
6	301678	新恒汇	157,965.60	1.44
7	002151	北斗星通	111,374.00	1.01

8	600816	建元信托	102,189.00	0.93
9	300212	易华录	98,990.00	0.90
10	603290	斯达半导	94,926.00	0.86
11	002368	太极股份	94,723.00	0.86
12	600755	厦门国贸	91,514.00	0.83
13	002268	电科网安	90,899.00	0.83
14	688755	汉邦科技	90,417.60	0.82
15	603688	石英股份	84,865.00	0.77
16	603456	九洲药业	78,822.00	0.72
17	002240	盛新锂能	78,756.00	0.72
18	301595	太力科技	77,403.92	0.70
19	600399	抚顺特钢	77,341.00	0.70
20	301636	泽润新能	77,287.50	0.70

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	225,874,240.47
卖出股票收入（成交）总额	7,241,899.90

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，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福建监管局的处罚，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到深圳市交通运输局的处罚，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。

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	201,846.31
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	17,050.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	218,896.31

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 (%)
万家瑞丰 A	238	632,071.41	149,693,157.22	99.51	739,839.04	0.49
万家瑞丰 C	780	8,763.58	-	-	6,835,595.92	100.00
合计	997	157,741.82	149,693,157.22	95.18	7,575,434.96	4.82

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	万家瑞丰 A	2,307.75	0.0015
	万家瑞丰 C	39,065.20	0.5715
	合计	41,372.95	0.0263

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

	合计	0~10
--	----	------

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家瑞丰 A	万家瑞丰 C
基金合同生效日 (2015 年 6 月 19 日) 基金份额总额	1,000,538,100.90	451,441.29
本报告期期初基金份额总额	713,817.47	7,259,659.00
本报告期基金总申购份额	150,137,783.28	443,449.84
减：本报告期基金总赎回份额	418,604.49	867,512.92
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	150,432,996.26	6,835,595.92

§ 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

报告期内本基金管理人、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

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产的诉讼，未发生涉及基金托管业务的重大诉讼。

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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用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	232,673,125.37	100.00	103,745.36	100.00	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准

为加强证券投资基金交易费用管理，管理人特制定《证券投资基金交易费用管理办法》。依据该办法，管理人设立合作证券公司备选库，并按照业务类型进行分类管理。备选库具体分为被动股票型基金合作证券公司备选库和其他类型基金合作证券公司备选库。纳入备选库内的证券经营机构方可参与管理人基金产品的证券交易服务。

选择证券公司参与证券交易的标准如下：

- (1) 财务状况稳健：证券公司应具备良好的财务状况，经营行为符合相关法律法规及行业规范；
- (2) 内控与风控能力强：证券公司具备完善的内部控制制度，合规管理和风险控制能力较强；
- (3) 技术支持完善：具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需求；
- (4) 专业能力与服务水平：具有较强的研究能力及金融服务水平，或在交易服务、券商结算等业务方面具备较强能力。

2、选择证券公司参与证券交易的程序

- (1) 管理人从财务状况、研究服务能力、风险管理能力、合规管理能力、交易服务水平、交易信息技术能力等方面对证券公司进行评估考察，经内部审批完成后，最终确定入选合作证券公司的备选库。
- (2) 与入选备选库证券公司达成合作意向后，双方签订协议，明确双方的权利义务，包括服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式等。

3、基金专用交易席位的变更情况：

本报告期内，本基金减少财达证券交易单元 1 个。

10.7.2 基金租用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	31,946,274.11	100.00	44,000,000.00	100.00	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

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	万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	指定媒介	2025 年 1 月 21 日
2	万家基金管理有限公司旗下基金季度报告提示性公告	指定媒介	2025 年 1 月 21 日
3	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在国泰君安证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2025 年 3 月 14 日
4	万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金基金暂停大额申购、大额转换转入、定期定额投资公告	指定媒介	2025 年 3 月 19 日
5	万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	指定媒介	2025 年 3 月 29 日
6	万家基金管理有限公司旗下基金年度报告提示性公告	指定媒介	2025 年 3 月 29 日
7	万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金 2024 年年度报告	指定媒介	2025 年 3 月 29 日
8	万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2025 年第 1 号）	指定媒介	2025 年 4 月 2 日
9	万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	指定媒介	2025 年 4 月 2 日
10	万家基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金更新招募说明书和基金产品资料概要的提示性公告	指定媒介	2025 年 4 月 2 日
11	万家基金管理有限公司旗下基金季度报告提示性公告	指定媒介	2025 年 4 月 21 日
12	万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	指定媒介	2025 年 4 月 21 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。
- 4、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金 2025 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

2025 年 8 月 29 日