

万家量化睿选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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	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	10
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	11
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	12
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	12
§ 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等内容真实、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	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50

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	50
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	50
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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8 其他重大事件	56
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	56
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	56
§ 12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	万家量化睿选	
基金主代码	004641	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 8 月 4 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	90,166,673.28 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	万家量化睿选 A	万家量化睿选 C
下属分级基金的交 易代码	004641	016556
报告期末下属分级 基金的份额总额	79,149,059.25 份	11,017,614.03 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在坚持风险收益合理定价的理念基础上，利用行业内领先的机器学习算法，并引入多维度数据，建立有效因子组合，在合理控制风险的基础上，寻求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、股票资产的量化投资策略（对于存托凭证的投资，本基金将根据投资目标，依照境内上市交易的股票投资策略执行，并最大限度避免由于存托凭证在交易规则、上市公司治理结构等方面的差异而或有的负面影响。）；2、债券资产投资策略；3、中小企业私募债券投资策略；4、股指期货投资策略；5、国债期货投资策略；6、股票期权投资策略；7、权证投资策略；8、融资交易策略。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*90%+一年期银行定期存款收益率（税后）*10%
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，属于较高风险、较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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	兰剑	王小飞
	联系电话	021-38909626	021-60637103
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		4008880800	021-60637228
传真		021-38909627	021-60635778
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）	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200122	100033
法定代表人	方一天	张金良

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)	
	万家量化睿选 A	万家量化睿选 C
本期已实现收益	2,989,085.47	263,799.51
本期利润	5,354,996.75	637,964.05
加权平均基金份额本期利润	0.0550	0.0510
本期加权平均净值利润率	4.68%	4.41%
本期基金份额净值增长率	4.71%	4.41%
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	17,540,479.87	2,214,013.15
期末可供分配基金份额利润	0.2216	0.2010
期末基金资产净值	96,689,539.12	13,231,627.18
期末基金份额净值	1.2216	1.2010

值		
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	22.16%	-18.84%

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

万家量化睿选 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	3.68%	0.69%	3.89%	0.72%	-0.21%	-0.03%
过去三个月	2.72%	1.16%	0.99%	1.35%	1.73%	-0.19%
过去六个月	4.71%	1.18%	3.16%	1.22%	1.55%	-0.04%
过去一年	14.97%	1.64%	18.10%	1.55%	-3.13%	0.09%
过去三年	-15.37%	1.34%	-6.57%	1.22%	-8.80%	0.12%
自基金合同生效起至今	22.16%	1.35%	9.03%	1.13%	13.13%	0.22%

万家量化睿选 C

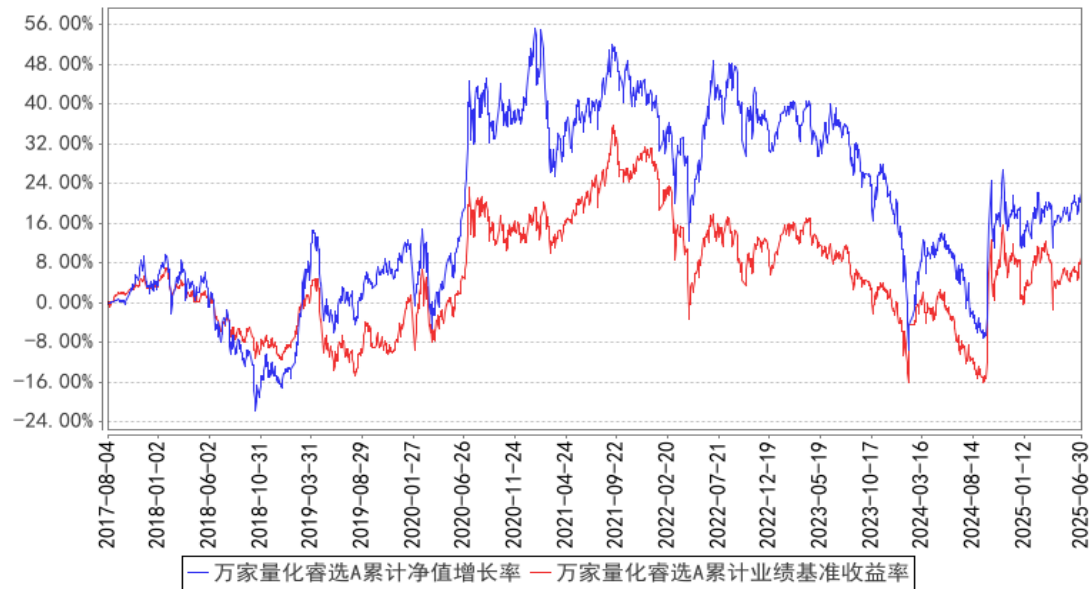
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.64%	0.69%	3.89%	0.72%	-0.25%	-0.03%
过去三个月	2.57%	1.16%	0.99%	1.35%	1.58%	-0.19%
过去六个月	4.41%	1.18%	3.16%	1.22%	1.25%	-0.04%
过去一年	14.28%	1.64%	18.10%	1.55%	-3.82%	0.09%
自基金合同生效起	-18.84%	1.35%	-4.87%	1.23%	-13.97%	0.12%

至今					%	
----	--	--	--	--	---	--

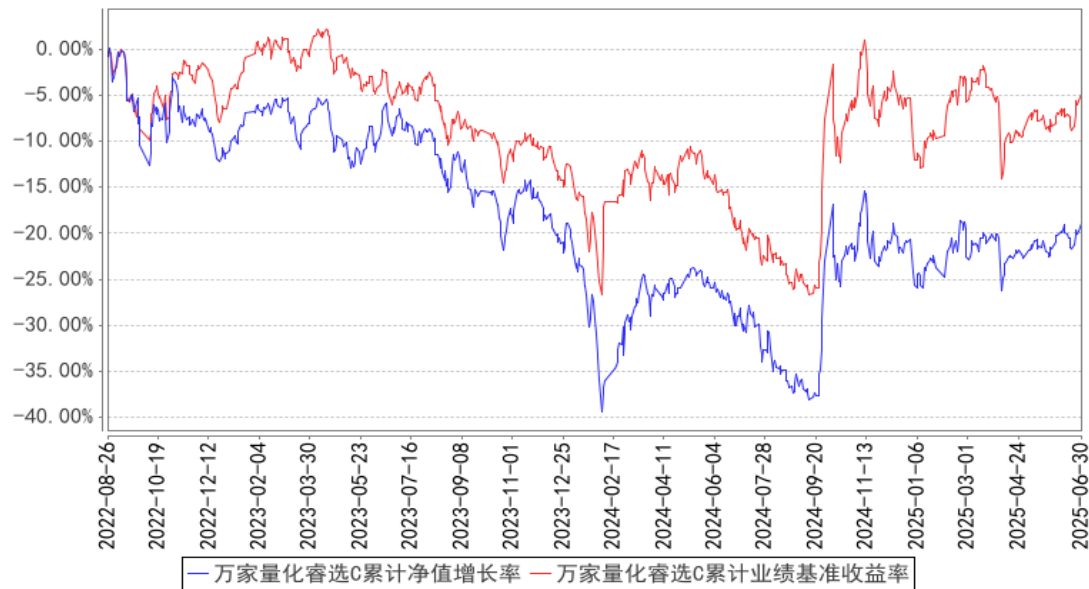
注：万家量化睿选 C 上述“自基金合同生效起至今”实际为“自基金份额类别首次确认起至今”，下同。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

万家量化睿选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



万家量化睿选C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金于 2017 年 8 月 4 日成立，根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

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

册。

§ 4 管理人报告

4.1 基金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		
乔亮	公司领导，首席量化投资官；万家上证科创板 100 指数增强型发起式证券投资基金、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家中证 2000 指数增强型证券投资基金、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、万家元贞量	2019 年 8 月 21 日	—	18.5 年	国籍：中国；学历：美国斯坦福大学工商管理博士，2019 年 7 月入职万家基金管理有限公司，现任公司首席量化投资官、基金经理，历任公司总经理助理、量化投资部总监（兼）、副总经理。曾任美国巴克莱国际投资管理公司投资部基金经理，加拿大退休基金国际投资管理公司量化投资部基金经理，南方基金管理有限公司数量化投资部投资经理，通联数据股份公司联合创始人、首席投资官，上海寻乾资产管理有限公司投资总监、总经理，巨杉（上海）资产管理有限公司量化投资部投资总监等职。

化选股股票型证券投资基金、万家创业板指数增强型证券投资基金、万家国证2000指数增强型证券投资基金、万家瑞债券型证券投资基金、万家沪深300指数增强型证券投资基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家颐达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 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

自 2021 年 7 月份以来，本产品开始切换为主动量化选股策略，运用量化选股模型和行业配置策略，主动适应不同的市场风格，前瞻性选股，提高选股胜率，以追求能获得长期稳定的超额收益。万家量化睿选在风格上配置相对均衡，行业配置偏向于行业景气度高的行业。在量化选股方面精选行业内质优个股组合，持股较为分散。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家量化睿选 A 的基金份额净值为 1.2216 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.71%，同期业绩比较基准收益率为 3.16%；截至本报告期末万家量化睿选 C 的基金份额净值为 1.2010 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.41%，同期业绩比较基准收益率为 3.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年上半年，A 股市场虽有波折，但整体呈现震荡上行走势，年初至 1 月中旬受风险情绪

压制快速下跌，春节之后至 3 月中旬，以 Deepseek 引领 TMT 板块走出“中国资产价值重估”行情；四月上旬受美国“对等关税”政策影响，A 股单日大幅下挫，但随后得益于政策维稳以及中美大幅调降关税，市场风险偏好提升，主要宽基指数稳步上涨，6 月末在金融股带动下进一步走强，上证指数创出年内新高。

展望后市，7 月政治局会议更加强调存量政策的落地，弱化增量预期，落实与细化存量的确定性更高，会议指出，“当前我国经济运行依然面临不少风险挑战，要正确把握形势，增强忧患意识，坚持底线思维，用好发展机遇、潜力和优势，巩固拓展经济回升向好势头”，因此对于下半年的经济工作，会议强调要“保持政策连续性稳定性，增强灵活性预见性，着力稳就业、稳企业、稳市场、稳预期，有力促进国内国际双循环。从 5 月份关税纠纷缓和以来，A 股各板块“轮动上涨、低位补涨”的特征明显，赚钱效应的持续性更好，同时市场增量资金来源较为广泛，在低利率市场环境下以及资产配置荒格局下，后续“居民配置资金入市与股市慢涨”的正反馈效应也有望加强，A 股市场有望震荡上行。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，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，本基金利润分配情况符合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真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 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：万家量化睿选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	8,931,185.88	10,968,593.53
结算备付金		608,843.89	1,335,912.29
存出保证金		53,015.80	130,135.23
交易性金融资产	6.4.7.2	101,624,382.31	148,712,656.22
其中：股票投资		101,624,382.31	148,712,656.22
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		14,489.05	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,028.98	1,371.41
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		111,233,945.91	161,148,668.68
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		1.21	0.36
应付赎回款		709,136.54	232,025.94
应付管理人报酬		107,226.26	191,854.66
应付托管费		17,871.05	31,975.81
应付销售服务费		6,808.79	9,032.09
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	471,735.76	719,155.95
负债合计		1,312,779.61	1,184,044.81
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	90,166,673.28	137,328,198.60
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	19,754,493.02	22,636,425.27
净资产合计		109,921,166.30	159,964,623.87
负债和净资产总计		111,233,945.91	161,148,668.68

注： 报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额总额 90,166,673.28 份，其中万家量化睿选 A 基金份额净值 1.2216 元，基金份额总额 79,149,059.25 份；万家量化睿选 C 基金份额净值 1.2010 元，基金份额总额 11,017,614.03 份。

6.2 利润表

会计主体： 万家量化睿选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		6,988,286.87	-166,899,153.67
1. 利息收入		20,435.11	123,114.15
其中：存款利息收入	6.4.7.10	20,435.11	123,114.15
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,063,811.17	-171,590,680.29
其中：股票投资收益	6.4.7.11	2,689,744.27	-175,182,649.84
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
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	1,374,066.90	3,591,969.55
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	2,740,075.82	3,511,473.31
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	163,964.77	1,056,939.16
减：二、营业总支出		995,326.07	4,074,983.16
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	770,259.64	3,104,976.45
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	128,376.58	517,496.07
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	43,202.67	358,146.53
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		-	-

8. 其他费用	6.4.7.20	53,487.18	94,364.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,992,960.80	-170,974,136.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,992,960.80	-170,974,136.83
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5,992,960.80	-170,974,136.83

6.3 净资产变动表

会计主体：万家量化睿选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	137,328,198.60	-	22,636,425.27	159,964,623.87
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	137,328,198.60	-	22,636,425.27	159,964,623.87
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-47,161,525.32	-	-2,881,932.25	-50,043,457.57
（一）、综合收益总额	-	-	5,992,960.80	5,992,960.80
（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）	-47,161,525.32	-	-8,874,893.05	-56,036,418.37
其中：1. 基金申购款	19,429,156.82	-	3,316,582.89	22,745,739.71
2. 基金赎回款	-66,590,682.14	-	-12,191,475.94	-78,782,158.08
（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	90,166,673.28	-	19,754,493.02	109,921,166.30
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	1,037,239,572.52	-	213,059,204.43	1,250,298,776.95
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,037,239,572.52	-	213,059,204.43	1,250,298,776.95
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-747,973,544.76	-	-195,279,935.19	-943,253,479.95
（一）、综合收益总额	-	-	-170,974,136.83	-170,974,136.83
（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）	-747,973,544.76	-	-24,305,798.36	-772,279,343.12
其中：1. 基金申购款	23,886,055.38	-	3,485,247.75	27,371,303.13
2. 基金赎回款	-771,859,600.14	-	-27,791,046.11	-799,650,646.25
（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	289,266,027.76	-	17,779,269.24	307,045,297.00

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：

方一天

基金管理人负责人

陈广益

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

万家量化睿选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”）《关于准予万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2017]569 号文）批准，由万家基金管理有限公司作为基金管理人于 2017 年 7 月 3 日至 2017 年 7 月 28 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）验资并出具安永华明（2017）验字第 60778298_B03 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 2017 年 8 月 4 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定期。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 937,133,525.86 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 315,926.82 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 937,449,452.68 元，折合 937,449,452.68 份基金份额。本基金的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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，经与本基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，2022 年 8 月 25 日起，本基金增设 C 类基金份额。

本基金主要投资具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、股指期货、国债期货、股票期权、权证以及债券等金融工具（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可交换公司债券、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具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的相关规定）。本基金可参与融资业

务。本基金为混合型基金，股票资产占基金资产的 0%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证投资占基金资产净值的 0-3%。其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*90%+一年期银行定期存款收益率（税后）*10%。

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	8,931,185.88
等于：本金	8,930,308.47
加：应计利息	877.41
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	8,931,185.88

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		98,307,858.68	-	101,624,382.31	3,316,523.63
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		98,307,858.68	-	101,624,382.31	3,316,523.63

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1.93
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	237,021.65
其中：交易所市场	237,021.65
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	234,712.18
合计	471,735.76

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

万家量化睿选 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	122,742,521.47	122,742,521.47
本期申购	18,203,561.86	18,203,561.86
本期赎回（以“-”号填列）	-61,797,024.08	-61,797,024.08
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	79,149,059.25	79,149,059.25

万家量化睿选 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	14,585,677.13	14,585,677.13
本期申购	1,225,594.96	1,225,594.96
本期赎回（以“-”号填列）	-4,793,658.06	-4,793,658.06
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	11,017,614.03	11,017,614.03

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

万家量化睿选 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	43,998,235.50	-23,553,982.20	20,444,253.30
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	43,998,235.50	-23,553,982.20	20,444,253.30
本期利润	2,989,085.47	2,365,911.28	5,354,996.75
本期基金份额交易产生的变动数	-16,470,741.43	8,211,971.25	-8,258,770.18
其中：基金申购款	6,567,371.59	-3,435,829.13	3,131,542.46
基金赎回款	-23,038,113.02	11,647,800.38	-11,390,312.64
本期已分配利润	-	-	-

本期末	30,516,579.54	-12,976,099.67	17,540,479.87
万家量化睿选 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,985,795.05	-2,793,623.08	2,192,171.97
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	4,985,795.05	-2,793,623.08	2,192,171.97
本期利润	263,799.51	374,164.54	637,964.05
本期基金份额交易产生的变动数	-1,228,099.13	611,976.26	-616,122.87
其中：基金申购款	442,450.42	-257,409.99	185,040.43
基金赎回款	-1,670,549.55	869,386.25	-801,163.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,021,495.43	-1,807,482.28	2,214,013.15

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	18,590.84
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	1,448.67
其他	395.60
合计	20,435.11

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	2,689,744.27
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	2,689,744.27

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	595,795,565.57

减：卖出股票成本总额	592,227,680.65
减：交易费用	878,140.65
买卖股票差价收入	2,689,744.27

6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

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	1,374,066.90
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	1,374,066.90

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	2,740,075.82
股票投资	2,740,075.82
债券投资	—
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	2,740,075.82

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	163,884.27
基金转换费收入	80.50
合计	163,964.77

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	14,876.39
信息披露费	19,835.79
证券出借违约金	-
银行费用	175.00
账户维护费	18,600.00
合计	53,487.18

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
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、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

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股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

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债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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	770,259.64	3,104,976.45
其中：应支付销售机构的客户维护费	195,886.72	255,648.97
应支付基金管理人的净管理费	574,372.92	2,849,327.48

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 1.20\%\div \text{当年天数}$$

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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。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	128,376.58	517,496.07

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.20\%\div \text{当年天数}$$

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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。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		
	万家量化睿选 A	万家量化睿选 C	合计
万家基金	-	2,070.86	2,070.86
合计	-	2,070.86	2,070.86
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		
	万家量化睿选 A	万家量化睿选 C	合计
万家财富	-	5.47	5.47
万家基金	-	243,851.07	243,851.07
合计	-	243,856.54	243,856.54

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 0.60%。

销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。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

份额单位：份

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	万家量化睿选 A	万家量化睿选 C
基金合同生效日（ 2017 年 8 月 4 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	11,071,972.32	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	11,071,972.32	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	13.9888%	-
项目	上年度可比期间	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	万家量化睿选 A	万家量化睿选 C
基金合同生效日（ 2017 年 8 月 4 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	11,071,972.32	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-

报告期末持有的基金份额	11,071,972.32	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.2045%	-

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
建设银行	8,931,185.88	18,590.84	22,685,941.67	75,665.10

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设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
001335	信凯科技	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001382	新亚电缆	2025 年 3 月 13 日	6 个月	新股流通受限	7.40	20.21	344	2,545.60	6,952.24	-
301275	汉朔科技	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股流通受限	27.50	56.19	156	4,290.00	8,765.64	-

301458	钧崑电子	2025年1月2日	6个月	新股流通受限	10.40	34.11	456	4,742.40	15,554.16	-
301479	弘景光电	2025年3月6日	6个月	新股流通受限	29.88	77.87	136	4,064.30	10,590.32	含转增股
301501	恒鑫生活	2025年3月11日	6个月	新股流通受限	27.51	45.22	148	4,071.84	6,692.56	含转增股
301535	浙江华远	2025年3月18日	6个月	新股流通受限	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301601	惠通科技	2025年1月8日	6个月	新股流通受限	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
301602	超研股份	2025年1月15日	6个月	新股流通受限	6.70	24.80	611	4,093.70	15,152.80	-
301658	首航新能	2025年3月26日	6个月	新股流通受限	11.80	22.98	248	2,926.40	5,699.04	-
301665	泰禾股份	2025年4月2日	6个月	新股流通受限	10.27	22.39	264	2,711.28	5,910.96	-
603072	天和磁材	2024年12月24日	6个月	新股流通受限	12.30	54.45	159	1,955.70	8,657.55	-
603120	肯特催化	2025年4月9日	6个月	新股流通受限	15.00	33.43	61	915.00	2,039.23	-
603124	江南新材	2025年3月12日	6个月	新股流通受限	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603210	泰鸿万立	2025年4月1日	6个月	新股流通受限	8.60	15.61	163	1,401.80	2,544.43	-
603257	中国瑞林	2025年3月28日	6个月	新股流通受限	20.52	37.47	45	923.40	1,686.15	-
603271	永杰新材	2025年3月4日	6个月	新股流通受限	20.60	35.08	77	1,586.20	2,701.16	-
603409	汇通	2025	6个月	新股	24.18	33.32	59	1,426.62	1,965.88	-

	控股	年 2 月 25 日		流通受限						
688545	兴福电子	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新股流通受限	11.68	26.95	485	5,664.80	13,070.75	-
688583	思看科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	25.76	79.68	200	5,152.84	15,936.00	含转增股
688757	胜科纳米	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
688758	赛分科技	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股流通受限	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-

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
688313	仕佳光子	2025 年 6 月 30 日	重大事项停牌	38.05	2025 年 7 月 11 日	39.98	4,200	155,572.93	159,810.00	-

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 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。

于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。(2024 年 12 月 31 日：同)

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	8,931,185.88	-	-	-	-	-	8,931,185.88
结算备付金	608,843.89	-	-	-	-	-	608,843.89
存出保证金	53,015.80	-	-	-	-	-	53,015.80
交易性金融资产	-	-	-	-	-	101,624,382.31	101,624,382.31
应收申购款	0.15	-	-	-	-	2,028.83	2,028.98
应收清算款	-	-	-	-	-	14,489.05	14,489.05
资产总计	9,593,045.72	-	-	-	-	101,640,900.19	111,233,945.91
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	709,136.54	709,136.54
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	107,226.26	107,226.26
应付托管费	-	-	-	-	-	17,871.05	17,871.05
应付清算款	-	-	-	-	-	1.21	1.21
应付销售服务费	-	-	-	-	-	6,808.79	6,808.79

其他负债	-	-	-	-	-	471,735.76	471,735.76
负债总计	-	-	-	-	-	1,312,779.61	1,312,779.61
利率敏感度缺口	9,593,045.72	-	-	-	-	-100,328,120.58	109,921,166.30
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	10,968,593.53	-	-	-	-	-	10,968,593.53
结算备付金	1,335,912.29	-	-	-	-	-	1,335,912.29
存出保证金	130,135.23	-	-	-	-	-	130,135.23
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-148,712,656.22	148,712,656.22
应收申购款	0.21	-	-	-	-	1,371.20	1,371.41
资产总计	12,434,641.26	-	-	-	-	-148,714,027.42	161,148,668.68
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	232,025.94	232,025.94
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	191,854.66	191,854.66
应付托管费	-	-	-	-	-	31,975.81	31,975.81
应付清算款	-	-	-	-	-	0.36	0.36
应付销售服务费	-	-	-	-	-	9,032.09	9,032.09
其他负债	-	-	-	-	-	719,155.95	719,155.95
负债总计	-	-	-	-	-	1,184,044.81	1,184,044.81
利率敏感度缺口	12,434,641.26	-	-	-	-	-147,529,982.61	159,964,623.87

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

于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2024 年 12 月 31 日：同），货币资金、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2024 年 12 月 31 日：同）。

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	101,624,382.31	92.45	148,712,656.22	92.97
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	101,624,382.31	92.45	148,712,656.22	92.97

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	1,293,145.41	1,653,114.68
	股票基准指数下降 100 个基点	-1,293,145.41	-1,653,114.68

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	101,281,729.27	148,225,761.59
第二层次	159,810.00	19,544.70
第三层次	182,843.04	467,349.93
合计	101,624,382.31	148,712,656.22

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	101,624,382.31	91.36
	其中：股票	101,624,382.31	91.36
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	9,540,029.77	8.58
8	其他各项资产	69,533.83	0.06
9	合计	111,233,945.91	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	43,036.00	0.04
B	采矿业	5,779,596.42	5.26
C	制造业	70,695,166.78	64.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,553,036.00	1.41
E	建筑业	194,978.00	0.18
F	批发和零售业	2,880,532.00	2.62
G	交通运输、仓储和邮政业	1,506,871.00	1.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,346,471.62	6.68
J	金融业	5,701,877.20	5.19
K	房地产业	490,131.00	0.45
L	租赁和商务服务业	1,435,685.00	1.31
M	科学研究和技术服务业	2,557,002.29	2.33
N	水利、环境和公共设施管理业	237,976.00	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	98,000.00	0.09
R	文化、体育和娱乐业	840,022.00	0.76
S	综合	264,001.00	0.24
	合计	101,624,382.31	92.45

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	300888	稳健医疗	35,800	1,471,380.00	1.34
2	603259	药明康德	20,500	1,425,775.00	1.30
3	600685	中船防务	52,152	1,418,012.88	1.29
4	300502	新易盛	11,140	1,415,002.80	1.29
5	002624	完美世界	88,000	1,334,960.00	1.21
6	600262	北方股份	57,900	1,320,120.00	1.20
7	600183	生益科技	43,500	1,311,525.00	1.19
8	688235	百济神州	5,600	1,308,384.00	1.19
9	603379	三美股份	24,600	1,183,752.00	1.08
10	600489	中金黄金	80,500	1,177,715.00	1.07
11	002284	亚太股份	106,200	1,173,510.00	1.07
12	600160	巨化股份	40,800	1,170,144.00	1.06
13	688428	诺诚健华	46,500	1,135,995.00	1.03
14	688035	德邦科技	26,700	1,084,554.00	0.99
15	002728	特一药业	123,489	1,038,542.49	0.94
16	600166	福田汽车	382,800	1,037,388.00	0.94
17	002155	湖南黄金	56,630	1,010,845.50	0.92
18	603236	移远通信	11,500	986,700.00	0.90
19	688266	泽璟制药	9,151	983,824.01	0.90
20	002885	京泉华	66,620	942,673.00	0.86
21	603979	金诚信	20,268	941,245.92	0.86
22	601665	齐鲁银行	147,800	934,096.00	0.85
23	300871	回盛生物	43,600	911,240.00	0.83
24	300363	博腾股份	52,746	900,901.68	0.82
25	600668	尖峰集团	63,600	899,940.00	0.82
26	002267	陕天然气	118,100	894,017.00	0.81
27	002469	三维化学	106,200	882,522.00	0.80
28	603500	祥和实业	96,000	879,360.00	0.80
29	600793	宜宾纸业	34,100	878,757.00	0.80
30	689009	九号公司	14,700	869,799.00	0.79
31	002999	天禾股份	122,800	857,144.00	0.78
32	000960	锡业股份	55,700	852,210.00	0.78
33	002876	三利谱	33,400	841,346.00	0.77
34	600179	安通控股	297,700	821,652.00	0.75
35	600201	生物股份	102,200	819,644.00	0.75
36	688162	巨一科技	29,900	814,476.00	0.74
37	600299	安迪苏	83,300	803,845.00	0.73
38	300609	汇纳科技	23,600	788,712.00	0.72
39	002582	好想你	79,500	788,640.00	0.72
40	688256	寒武纪	1,300	781,950.00	0.71
41	002588	史丹利	88,500	779,685.00	0.71
42	300241	瑞丰光电	136,200	776,340.00	0.71

43	688488	艾迪药业	54,800	758,980.00	0.69
44	603612	索通发展	39,800	731,524.00	0.67
45	002128	电投能源	35,800	708,124.00	0.64
46	000426	兴业银锡	44,800	707,840.00	0.64
47	300119	瑞普生物	36,100	701,062.00	0.64
48	601398	工商银行	91,600	695,244.00	0.63
49	600195	中牧股份	94,300	691,219.00	0.63
50	601818	光大银行	163,800	679,770.00	0.62
51	603087	甘李药业	12,400	679,272.00	0.62
52	601009	南京银行	57,800	671,636.00	0.61
53	002758	浙农股份	73,700	658,141.00	0.60
54	000902	新洋丰	46,000	636,180.00	0.58
55	601658	邮储银行	114,000	623,580.00	0.57
56	688578	艾力斯	6,600	614,064.00	0.56
57	600585	海螺水泥	28,600	614,042.00	0.56
58	603101	汇嘉时代	81,500	611,250.00	0.56
59	600163	中闽能源	116,900	598,528.00	0.54
60	002948	青岛银行	119,000	592,620.00	0.54
61	688608	恒玄科技	1,700	591,566.00	0.54
62	000975	山金国际	30,200	571,988.00	0.52
63	300471	厚普股份	53,500	569,240.00	0.52
64	300322	硕贝德	38,000	568,100.00	0.52
65	000906	浙商中拓	89,100	567,567.00	0.52
66	002454	松芝股份	73,500	567,420.00	0.52
67	000977	浪潮信息	10,900	554,592.00	0.50
68	603486	科沃斯	9,500	553,185.00	0.50
69	002661	克明食品	55,000	550,550.00	0.50
70	300940	南极光	21,340	538,835.00	0.49
71	000423	东阿阿胶	10,000	523,000.00	0.48
72	600219	南山铝业	134,200	513,986.00	0.47
73	603893	瑞芯微	3,300	501,138.00	0.46
74	600866	星湖科技	71,600	494,756.00	0.45
75	002246	北化股份	32,400	473,688.00	0.43
76	605507	国邦医药	22,500	444,825.00	0.40
77	688636	智明达	13,056	441,162.24	0.40
78	600012	皖通高速	24,800	421,104.00	0.38
79	600728	佳都科技	75,400	410,930.00	0.37
80	600482	中国动力	17,700	408,339.00	0.37
81	603566	普莱柯	29,400	400,134.00	0.36
82	301031	中熔电气	4,980	396,657.00	0.36
83	601077	渝农商行	54,800	391,272.00	0.36
84	002223	鱼跃医疗	10,700	380,920.00	0.35
85	688668	鼎通科技	6,053	378,070.38	0.34

86	301230	泓博医药	10,800	371,736.00	0.34
87	300573	兴齐眼药	7,100	367,709.00	0.33
88	688286	敏芯股份	5,200	367,588.00	0.33
89	300896	爱美客	2,100	367,101.00	0.33
90	603881	数据港	13,760	351,568.00	0.32
91	601126	四方股份	21,500	349,805.00	0.32
92	301248	杰创智能	13,800	343,344.00	0.31
93	000061	农产品	52,100	332,919.00	0.30
94	300648	星云股份	9,500	328,320.00	0.30
95	600476	湘邮科技	17,100	322,848.00	0.29
96	603596	伯特利	6,100	321,409.00	0.29
97	600176	中国巨石	28,000	319,200.00	0.29
98	002905	金逸影视	34,200	317,376.00	0.29
99	601066	中信建投	13,100	315,055.00	0.29
100	000513	丽珠集团	8,500	306,340.00	0.28
101	000651	格力电器	6,800	305,456.00	0.28
102	000783	长江证券	43,600	302,148.00	0.27
103	300685	艾德生物	14,000	301,420.00	0.27
104	603617	君禾股份	42,000	301,140.00	0.27
105	688258	卓易信息	6,200	300,266.00	0.27
106	000333	美的集团	4,100	296,020.00	0.27
107	300299	富春股份	37,500	288,000.00	0.26
108	301183	东田微	5,500	281,765.00	0.26
109	603659	璞泰来	14,800	277,944.00	0.25
110	000603	盛达资源	18,400	273,976.00	0.25
111	600062	华润双鹤	14,500	270,570.00	0.25
112	002442	龙星科技	42,400	270,512.00	0.25
113	688202	美迪西	7,500	269,475.00	0.25
114	600750	江中药业	12,300	268,509.00	0.24
115	603868	飞科电器	7,400	265,438.00	0.24
116	600673	东阳光	22,700	264,001.00	0.24
117	600216	浙江医药	16,700	246,993.00	0.22
118	603818	曲美家居	48,000	246,720.00	0.22
119	300708	聚灿光电	20,200	242,400.00	0.22
120	300662	科锐国际	8,100	240,651.00	0.22
121	688280	精进电动	32,900	239,183.00	0.22
122	002001	新 和 成	11,200	238,224.00	0.22
123	603129	春风动力	1,100	238,150.00	0.22
124	002244	滨江集团	24,300	236,925.00	0.22
125	300251	光线传媒	11,300	229,051.00	0.21
126	000878	云南铜业	17,800	226,416.00	0.21
127	688048	长光华芯	3,900	225,186.00	0.20
128	688302	海创药业	4,800	224,640.00	0.20

129	600988	赤峰黄金	8,900	221,432.00	0.20
130	603983	丸美生物	5,200	219,076.00	0.20
131	601777	千里科技	25,800	219,042.00	0.20
132	688401	路维光电	6,300	218,610.00	0.20
133	600563	法拉电子	2,000	218,180.00	0.20
134	688365	光云科技	14,300	217,646.00	0.20
135	300637	扬帆新材	17,600	212,080.00	0.19
136	300499	高澜股份	11,800	210,040.00	0.19
137	301080	百普赛斯	2,900	207,437.00	0.19
138	601963	重庆银行	18,900	205,254.00	0.19
139	601128	常熟银行	26,660	196,484.20	0.18
140	300369	绿盟科技	25,200	195,804.00	0.18
141	003037	三和管桩	27,200	195,296.00	0.18
142	000039	中集集团	24,600	193,356.00	0.18
143	688192	迪哲医药	3,200	191,360.00	0.17
144	002362	汉王科技	8,500	190,570.00	0.17
145	688661	和林微纳	4,754	189,066.58	0.17
146	603267	鸿远电子	3,700	185,999.00	0.17
147	300274	阳光电源	2,700	182,979.00	0.17
148	002985	北摩高科	6,000	181,500.00	0.17
149	600584	长电科技	5,300	178,557.00	0.16
150	003006	百亚股份	6,500	177,970.00	0.16
151	002755	奥赛康	11,100	177,378.00	0.16
152	600285	羚锐制药	7,700	174,559.00	0.16
153	688213	思特威	1,700	173,774.00	0.16
154	603466	风语筑	17,100	172,539.00	0.16
155	688655	迅捷兴	8,100	171,639.00	0.16
156	600153	建发股份	16,400	170,068.00	0.15
157	300990	同飞股份	3,400	169,660.00	0.15
158	301291	明阳电气	4,100	168,715.00	0.15
159	688173	希荻微	12,300	168,018.00	0.15
160	300647	超频三	25,800	166,926.00	0.15
161	600758	辽宁能源	44,500	166,430.00	0.15
162	000915	华特达因	4,700	166,145.00	0.15
163	603585	苏利股份	8,900	164,561.00	0.15
164	688208	道通科技	5,303	162,271.80	0.15
165	605599	菜百股份	9,900	161,865.00	0.15
166	688313	仕佳光子	4,200	159,810.00	0.15
167	300980	祥源新材	6,800	159,256.00	0.14
168	600989	宝丰能源	9,700	156,558.00	0.14
169	301396	宏景科技	2,500	155,275.00	0.14
170	688519	南亚新材	3,429	153,619.20	0.14
171	688360	德马科技	8,100	150,255.00	0.14

172	002761	浙江建投	16,800	149,016.00	0.14
173	002206	海利得	29,000	148,190.00	0.13
174	688116	天奈科技	3,200	146,464.00	0.13
175	002909	集泰股份	23,400	146,016.00	0.13
176	601216	君正集团	25,900	142,968.00	0.13
177	603089	正裕工业	10,900	142,463.00	0.13
178	600535	天士力	9,100	142,415.00	0.13
179	688288	鸿泉物联	4,900	142,149.00	0.13
180	600031	三一重工	7,900	141,805.00	0.13
181	300320	海达股份	14,200	141,148.00	0.13
182	300655	晶瑞电材	14,100	141,141.00	0.13
183	300081	恒信东方	19,900	140,892.00	0.13
184	600410	华胜天成	14,600	140,014.00	0.13
185	688580	伟思医疗	3,000	139,470.00	0.13
186	688536	思瑞浦	1,000	138,720.00	0.13
187	300184	力源信息	14,100	138,462.00	0.13
188	601298	青岛港	15,900	138,171.00	0.13
189	300491	通合科技	7,200	137,520.00	0.13
190	300484	蓝海华腾	6,100	136,457.00	0.12
191	002345	潮宏基	9,300	136,059.00	0.12
192	301119	正强股份	3,800	134,368.00	0.12
193	601311	骆驼股份	14,800	133,644.00	0.12
194	688557	兰剑智能	4,400	131,692.00	0.12
195	600619	海立股份	11,500	131,215.00	0.12
196	301220	亚香股份	2,920	131,108.00	0.12
197	300746	汉嘉设计	8,300	130,061.00	0.12
198	688369	致远互联	4,900	129,311.00	0.12
199	603199	九华旅游	3,500	126,840.00	0.12
200	000573	粤宏远 A	31,000	124,620.00	0.11
201	002850	科达利	1,100	124,487.00	0.11
202	688181	八亿时空	4,000	124,480.00	0.11
203	300245	天玑科技	6,400	123,968.00	0.11
204	688680	海优新材	2,800	123,760.00	0.11
205	301226	祥明智能	4,500	123,210.00	0.11
206	600628	新世界	16,800	122,976.00	0.11
207	688059	华锐精密	2,600	121,576.00	0.11
208	002747	埃斯顿	5,900	119,416.00	0.11
209	600732	爱旭股份	9,100	119,210.00	0.11
210	603499	翔港科技	7,220	119,057.80	0.11
211	603103	横店影视	7,400	118,770.00	0.11
212	002029	七匹狼	17,300	116,602.00	0.11
213	300956	英力股份	7,100	115,162.00	0.10
214	000957	中通客车	10,400	113,672.00	0.10

215	300534	陇神戎发	11,700	113,022.00	0.10
216	688381	帝奥微	5,100	110,466.00	0.10
217	600731	湖南海利	15,100	110,079.00	0.10
218	600064	南京高科	14,100	108,711.00	0.10
219	600710	苏美达	11,200	107,632.00	0.10
220	002915	中欣氟材	6,000	107,280.00	0.10
221	300690	双一科技	4,400	106,524.00	0.10
222	301018	申菱环境	2,800	106,232.00	0.10
223	688261	东微半导	2,536	104,610.00	0.10
224	688095	福昕软件	1,500	101,865.00	0.09
225	300942	易瑞生物	10,600	101,548.00	0.09
226	688393	安必平	3,500	100,590.00	0.09
227	002398	垒知集团	20,300	100,282.00	0.09
228	301270	汉仪股份	2,100	100,086.00	0.09
229	688041	海光信息	700	98,903.00	0.09
230	300048	合康新能	16,700	98,029.00	0.09
231	301239	普瑞眼科	2,500	98,000.00	0.09
232	300150	世纪瑞尔	19,200	96,384.00	0.09
233	688025	杰普特	1,326	94,809.00	0.09
234	688071	华依科技	2,600	94,770.00	0.09
235	688270	臻镭科技	2,000	93,120.00	0.08
236	300627	华测导航	2,660	93,100.00	0.08
237	301212	联盛化学	3,500	92,645.00	0.08
238	600268	国电南自	11,700	91,494.00	0.08
239	603278	大业股份	10,000	91,000.00	0.08
240	002709	天赐材料	5,000	90,600.00	0.08
241	002938	鹏鼎控股	2,800	89,684.00	0.08
242	688508	芯朋微	1,600	89,312.00	0.08
243	300641	正丹股份	3,900	88,881.00	0.08
244	603978	深圳新星	4,800	86,592.00	0.08
245	300705	九典制药	5,500	85,635.00	0.08
246	603086	先达股份	8,700	85,260.00	0.08
247	688351	微电生理	4,300	84,710.00	0.08
248	000807	云铝股份	5,300	84,694.00	0.08
249	300470	中密控股	2,300	84,571.00	0.08
250	300077	国民技术	3,300	84,480.00	0.08
251	301367	瑞迈特	1,000	84,100.00	0.08
252	002926	华西证券	9,400	84,036.00	0.08
253	002169	智光电气	12,800	82,816.00	0.08
254	000962	东方钽业	5,000	82,050.00	0.07
255	000757	浩物股份	18,100	81,993.00	0.07
256	301061	匠心家居	1,050	81,417.00	0.07
257	002668	TCL 智家	8,300	81,091.00	0.07

258	688029	南微医学	1,200	81,060.00	0.07
259	002463	沪电股份	1,900	80,902.00	0.07
260	605118	力鼎光电	3,200	79,456.00	0.07
261	002245	蔚蓝锂芯	6,100	78,263.00	0.07
262	603118	共进股份	6,900	77,763.00	0.07
263	603766	隆鑫通用	6,000	76,560.00	0.07
264	688039	当虹科技	2,300	75,486.00	0.07
265	688518	联赢激光	3,700	75,443.00	0.07
266	601005	重庆钢铁	59,000	74,930.00	0.07
267	603816	顾家家居	2,900	74,008.00	0.07
268	000062	深圳华强	2,700	72,522.00	0.07
269	600458	时代新材	5,100	69,972.00	0.06
270	603713	密尔克卫	1,300	69,316.00	0.06
271	603698	航天工程	3,900	68,718.00	0.06
272	002428	云南锗业	3,400	67,660.00	0.06
273	000803	山高环能	10,900	67,144.00	0.06
274	605068	明新旭腾	3,700	66,489.00	0.06
275	002402	和而泰	2,800	64,876.00	0.06
276	688252	天德钰	2,589	63,119.82	0.06
277	300496	中科创达	1,100	62,942.00	0.06
278	002769	普路通	6,500	62,920.00	0.06
279	600351	亚宝药业	10,300	62,521.00	0.06
280	300272	开能健康	9,100	59,787.00	0.05
281	600460	士兰微	2,400	59,568.00	0.05
282	688179	阿拉丁	4,680	59,529.60	0.05
283	605277	新亚电子	3,300	59,268.00	0.05
284	300656	民德电子	2,200	58,806.00	0.05
285	688611	杭州柯林	1,800	58,734.00	0.05
286	300019	硅宝科技	2,900	57,246.00	0.05
287	688716	中研股份	1,600	56,960.00	0.05
288	000099	中信海直	2,600	56,628.00	0.05
289	688097	博众精工	2,000	55,820.00	0.05
290	000659	珠海中富	18,700	55,352.00	0.05
291	688103	国力股份	900	54,756.00	0.05
292	300249	依米康	4,000	54,560.00	0.05
293	002913	奥士康	1,800	52,938.00	0.05
294	688114	华大智造	800	51,864.00	0.05
295	002688	金河生物	8,200	50,922.00	0.05
296	002117	东港股份	4,300	50,912.00	0.05
297	600397	安源煤业	7,700	48,279.00	0.04
298	603739	蔚蓝生物	3,600	47,952.00	0.04
299	002346	柘中股份	3,400	46,240.00	0.04
300	001267	汇绿生态	4,900	45,962.00	0.04

301	002560	通达股份	5,800	45,820.00	0.04
302	000551	创元科技	3,500	44,975.00	0.04
303	600662	外服控股	8,800	44,968.00	0.04
304	301259	艾布鲁	900	43,992.00	0.04
305	603193	润本股份	1,400	43,974.00	0.04
306	688205	德科立	700	43,883.00	0.04
307	605296	神农集团	1,400	43,036.00	0.04
308	688486	龙迅股份	632	42,268.16	0.04
309	000791	甘肃能源	6,600	42,108.00	0.04
310	300604	长川科技	900	40,419.00	0.04
311	688629	华丰科技	700	40,040.00	0.04
312	300770	新媒股份	1,000	39,990.00	0.04
313	002138	顺络电子	1,400	39,368.00	0.04
314	300236	上海新阳	1,000	38,800.00	0.04
315	002384	东山精密	1,000	37,770.00	0.03
316	300043	星辉娱乐	7,800	37,752.00	0.03
317	301004	嘉益股份	560	37,088.80	0.03
318	600276	恒瑞医药	700	36,330.00	0.03
319	605080	浙江自然	1,300	36,140.00	0.03
320	688228	开普云	600	35,628.00	0.03
321	301076	新瀚新材	1,000	34,780.00	0.03
322	301101	明月镜片	700	34,265.00	0.03
323	300149	睿智医药	3,200	33,920.00	0.03
324	002286	保龄宝	2,900	32,857.00	0.03
325	301511	德福科技	1,560	32,292.00	0.03
326	300759	康龙化成	1,300	31,902.00	0.03
327	688128	中国电研	1,300	31,850.00	0.03
328	688049	炬芯科技	520	31,460.00	0.03
329	001207	联科科技	1,200	29,448.00	0.03
330	002249	大洋电机	4,300	28,294.00	0.03
331	000677	恒天海龙	4,900	27,685.00	0.03
332	000534	万泽股份	1,700	25,364.00	0.02
333	002003	伟星股份	2,300	25,093.00	0.02
334	688093	世华科技	800	24,840.00	0.02
335	688160	步科股份	283	24,253.10	0.02
336	600577	精达股份	3,200	23,808.00	0.02
337	002953	日丰股份	2,200	22,836.00	0.02
338	300666	江丰电子	300	22,230.00	0.02
339	002956	西麦食品	900	21,123.00	0.02
340	603229	奥翔药业	2,400	20,928.00	0.02
341	688155	先惠技术	400	20,648.00	0.02
342	000819	岳阳兴长	1,300	20,345.00	0.02
343	000031	大悦城	7,500	19,875.00	0.02

344	002782	可立克	1,500	19,470.00	0.02
345	301082	久盛电气	1,000	19,190.00	0.02
346	600780	通宝能源	3,100	18,383.00	0.02
347	300972	万辰集团	100	18,024.00	0.02
348	301033	迈普医学	300	18,018.00	0.02
349	301489	思泉新材	300	17,247.00	0.02
350	301169	零点有数	400	16,592.00	0.02
351	688583	思看科技	200	15,936.00	0.01
352	688220	翱捷科技	200	15,660.00	0.01
353	301458	钧崴电子	456	15,554.16	0.01
354	600986	浙文互联	1,900	15,523.00	0.01
355	688001	华兴源创	601	15,187.27	0.01
356	301602	超研股份	611	15,152.80	0.01
357	688168	安博通	200	14,174.00	0.01
358	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.01
359	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.01
360	688277	天智航	1,000	13,900.00	0.01
361	688050	爱博医疗	200	13,770.00	0.01
362	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.01
363	002563	森马服饰	2,500	13,150.00	0.01
364	688545	兴福电子	485	13,070.75	0.01
365	688135	利扬芯片	600	12,426.00	0.01
366	688331	荣昌生物	200	12,100.00	0.01
367	002527	新时达	800	11,672.00	0.01
368	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.01
369	300480	光力科技	700	11,130.00	0.01
370	000686	东北证券	1,400	10,682.00	0.01
371	301479	弘景光电	136	10,590.32	0.01
372	300473	德尔股份	300	9,765.00	0.01
373	300510	金冠股份	2,100	9,618.00	0.01
374	002396	星网锐捷	400	8,980.00	0.01
375	301275	汉朔科技	156	8,765.64	0.01
376	603072	天和磁材	159	8,657.55	0.01
377	301379	天山电子	320	8,614.40	0.01
378	603678	火炬电子	200	7,606.00	0.01
379	688100	威胜信息	200	7,410.00	0.01
380	001382	新亚电缆	344	6,952.24	0.01
381	688191	智洋创新	288	6,848.64	0.01
382	301501	恒鑫生活	148	6,692.56	0.01
383	002278	神开股份	700	6,251.00	0.01
384	002546	新联电子	1,100	6,039.00	0.01
385	301665	泰禾股份	264	5,910.96	0.01
386	301658	首航新能	248	5,699.04	0.01

387	002658	雪迪龙	700	5,481.00	0.00
388	300288	朗玛信息	300	4,533.00	0.00
389	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
390	605286	同力日升	100	3,962.00	0.00
391	301363	美好医疗	200	3,528.00	0.00
392	603966	法兰泰克	300	2,784.00	0.00
393	603271	永杰新材	77	2,701.16	0.00
394	603210	泰鸿万立	163	2,544.43	0.00
395	603386	骏亚科技	200	2,530.00	0.00
396	300684	中石科技	100	2,388.00	0.00
397	002739	万达电影	200	2,286.00	0.00
398	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
399	603120	肯特催化	61	2,039.23	0.00
400	603409	汇通控股	59	1,965.88	0.00
401	603257	中国瑞林	45	1,686.15	0.00
402	600817	宇通重工	100	1,184.00	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	4,312,441.00	2.70
2	600066	宇通客车	3,689,235.00	2.31
3	688235	百济神州	3,505,734.81	2.19
4	300308	中际旭创	3,425,557.00	2.14
5	600519	贵州茅台	3,190,864.00	1.99
6	300888	稳健医疗	3,188,356.00	1.99
7	688256	寒武纪	3,119,116.91	1.95
8	001207	联科科技	3,083,628.00	1.93
9	002273	水晶光电	2,987,265.00	1.87
10	300750	宁德时代	2,973,452.00	1.86
11	301291	明阳电气	2,958,452.00	1.85
12	601877	正泰电器	2,952,869.00	1.85
13	000651	格力电器	2,778,743.00	1.74
14	300476	胜宏科技	2,746,197.00	1.72
15	605117	德业股份	2,711,237.00	1.69
16	603236	移远通信	2,691,370.00	1.68
17	000404	长虹华意	2,664,972.00	1.67
18	300033	同花顺	2,548,218.00	1.59
19	300442	润泽科技	2,478,264.00	1.55
20	002676	顺威股份	2,460,052.00	1.54

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	000333	美的集团	4,048,553.00	2.53
2	300570	太辰光	3,946,018.00	2.47
3	600066	宇通客车	3,751,285.00	2.35
4	002594	比亚迪	3,682,827.00	2.30
5	000651	格力电器	3,620,444.00	2.26
6	688041	海光信息	3,514,327.86	2.20
7	605499	东鹏饮料	3,478,816.00	2.17
8	002273	水晶光电	3,442,311.00	2.15
9	001207	联科科技	3,431,681.00	2.15
10	605117	德业股份	3,425,713.76	2.14
11	688256	寒武纪	3,359,601.13	2.10
12	300476	胜宏科技	3,227,507.00	2.02
13	600519	贵州茅台	3,172,268.00	1.98
14	601225	陕西煤业	3,136,509.00	1.96
15	688568	中科星图	3,077,165.76	1.92
16	601877	正泰电器	3,016,945.00	1.89
17	300308	中际旭创	2,994,163.00	1.87
18	000404	长虹华意	2,932,634.00	1.83
19	300750	宁德时代	2,925,644.00	1.83
20	002456	欧菲光	2,882,799.00	1.80

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	542,399,330.92
卖出股票收入（成交）总额	595,795,565.57

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

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

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

本基金可基于谨慎原则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。

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。

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	53,015.80
2	应收清算款	14,489.05
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,028.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	69,533.83

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 (%)
万家量化 睿选 A	4,908	16,126.54	47,561,728.19	60.09	31,587,331.06	39.91
万家量化 睿选 C	424	25,984.94	585,394.41	5.31	10,432,219.62	94.69
合计	5,303	17,002.96	48,147,122.60	53.40	42,019,550.68	46.60

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	万家量化睿选 A	1,740,035.61	2.1984
	万家量化睿选 C	58,381.85	0.5299
	合计	1,798,417.46	1.9945

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、	万家量化睿选 A	>100

基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	万家量化睿选 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	万家量化睿选 A	10~50
	万家量化睿选 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家量化睿选 A	万家量化睿选 C
基金合同生效日 (2017 年 8 月 4 日) 基金份额总额	937,449,452.68	—
本报告期期初基金份额总额	122,742,521.47	14,585,677.13
本报告期基金总申购份额	18,203,561.86	1,225,594.96
减：本报告期基金总赎回份额	61,797,024.08	4,793,658.06
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	79,149,059.25	11,017,614.03

§ 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：

报告期内本基金管理人无重大人事变动。

基金托管人：

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省

分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

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，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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(%)	
中信证券	4	527,060,459.44	46.33	235,017.92	46.33	-
东北证券	1	191,595,019.79	16.84	85,442.99	16.84	-
东方财富证券	2	135,349,635.29	11.90	60,385.90	11.90	-
长江证券	1	105,516,405.06	9.28	47,051.95	9.28	-
华创证券	2	82,267,864.90	7.23	36,689.01	7.23	-
浙商证券	1	75,501,313.64	6.64	33,673.75	6.64	-
民生证券	1	20,262,148.98	1.78	9,034.83	1.78	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-

东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
高盛证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通 证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源 西部证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中银国际 证券	3	-	-	-	-	-

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，本基金减少东北证券交易单元 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

本基金本报告期内未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

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	万家量化睿选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旗下基金年度报告提示性公告	指定媒介	2025 年 3 月 29 日
4	万家量化睿选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
5	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
6	万家量化睿选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

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	20250101-202	54,069,54	-	54,069,54	-	-

		50310	6.25		6.25		
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、《万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。
- 4、万家量化睿选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