

万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	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	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	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
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	67

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	67
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	67
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	67
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
7.12 投资组合报告附注	68
§ 8 基金份额持有人信息	69
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
8.2 盈利投资者数量占比	69
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	69
§ 9 开放式基金份额变动	70
§ 10 重大事件揭示	70
10.1 基金份额持有人大会决议	70
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	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
10.4 基金投资策略的改变	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	71
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	71
10.8 其他重大事件	73
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	74
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	74
§ 12 备查文件目录	74
12.1 备查文件目录	74
12.2 存放地点	74
12.3 查阅方式	74

§ 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	2,722,813,616.82 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	1,022,640,704.33 份	1,700,172,912.49 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	陈广益	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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.wjasset.com
基金中期报告置备地点	基金管理人办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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(2026 年 1 月 1 日-2026 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	158,660,774.83	199,983,280.27
本期利润	502,164,563.29	569,371,478.87
加权平均基金份额 本期利润	1.0050	1.1098
本期加权平均净 值利润率	46.45%	50.39%
本期基金份额净 值增长率	48.96%	48.54%
3.1.2 期末数 和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	1,161,506,897.18	1,854,190,447.37
期末可供分配基 金份额利润	1.1358	1.0906
期末基金资产净 值	2,583,552,687.44	4,197,919,116.63
期末基金份额净 值	2.5264	2.4691

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	152.64%	66.85%

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
过去三个月	37.86%	1.78%	16.69%	1.48%	21.17%	0.30%
过去六个月	48.96%	1.62%	18.95%	1.49%	30.01%	0.13%
过去一年	106.81%	1.41%	46.90%	1.28%	59.91%	0.13%
过去三年	83.40%	1.46%	46.22%	1.34%	37.18%	0.12%
过去五年	79.06%	1.36%	31.26%	1.23%	47.80%	0.13%
过去七年	151.63%	1.38%	76.09%	1.23%	75.54%	0.15%
自基金合同生效起至今	152.64%	1.36%	60.16%	1.15%	92.48%	0.21%

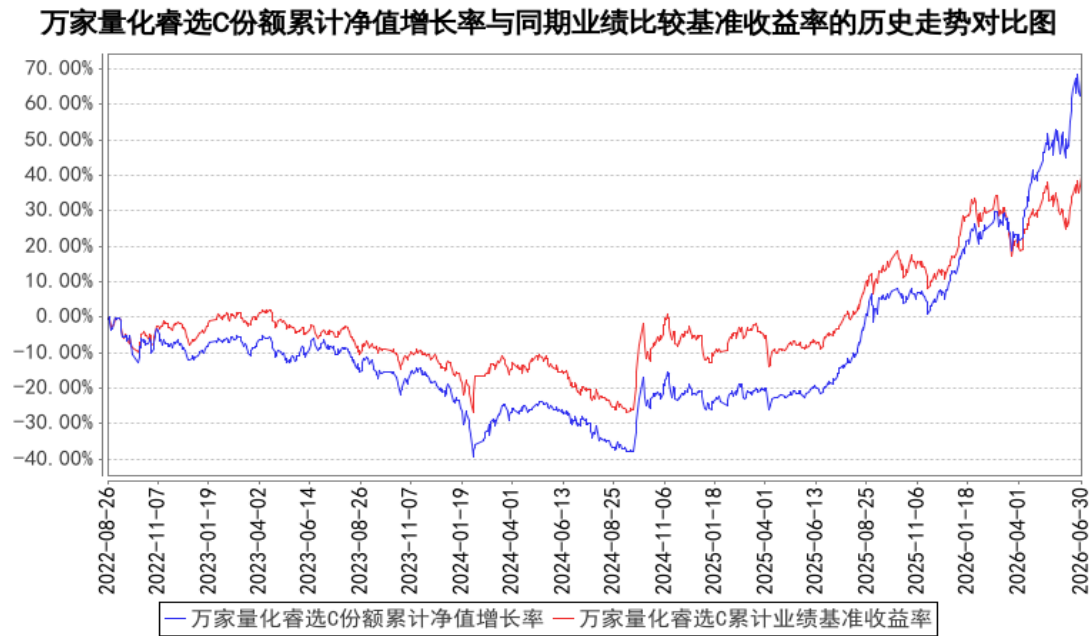
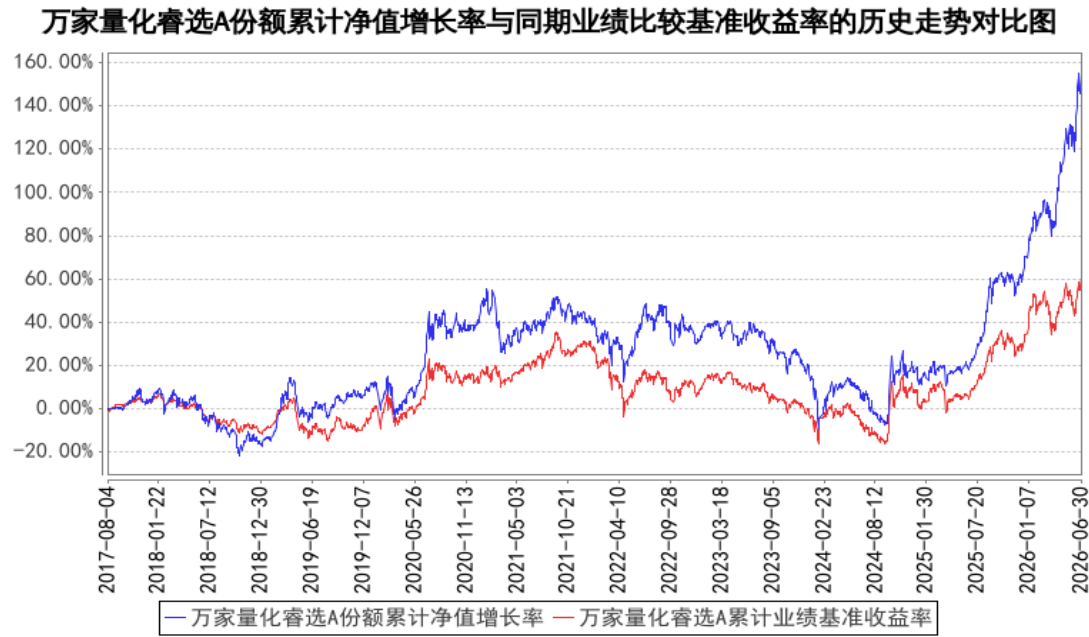
万家量化睿选 C

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
过去三个月	37.66%	1.78%	16.69%	1.48%	20.97%	0.30%
过去六个月	48.54%	1.62%	18.95%	1.49%	29.59%	0.13%
过去一年	105.59%	1.41%	46.90%	1.28%	58.69%	0.13%
过去三年	80.13%	1.46%	46.22%	1.34%	33.91%	0.12%

自基金合同 生效起至今	66.85%	1.37%	39.75%	1.24%	27.10%	0.13%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

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



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 2026 年 6 月 30 日，公司共管理 208 只开放式基金，其中包括 59 只股票型基金、80 只混合型基金、48 只债券型基金、5 只货币市场基金、4 只 QDII 基金、12 只基金中基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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	2019 年 8 月 21 日	-	19.5 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。

基金、万家元贞量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 4 次，为量化投资组合或不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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 2.5264 元，本报告期基金份额净值增长率为 48.96%，同期业绩比较基准收益率为 18.95%；截至本报告期末万家量化睿选 C 的基金份额净值为 2.4691 元，本报告期基金份额净值增长率为 48.54%，同期业绩比较基准收益率为 18.95%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年上半年，A 股市场呈现“科技领涨、指数震荡抬升”的结构分化格局。人工智能产业革命、国产替代加速与全球科技周期共振向上，三重驱动之下，资金深度抱团 AI 相关板块，科技成长走出独立行情；而传统价值板块则持续承压，资金流出与价格下跌并行，市场分化显著。

展望后市，7 月以来 AI 板块杠杆资金快速出清，市场经历大幅调整后估值已回归合理区间，A 股有望逐步企稳回升。从政策层面看，近期决策层对资本市场积极表态，稳定信号明确，维稳资金正有序入场，托底力度增强；从基本面看，二季度 PPI 中枢较一季度显著抬升，价格端改善正向企业盈利传导，上市公司盈利有望进一步上行，为市场走强提供有力支撑；从政策定调看，7 月政治局会议基调积极，强调高度重视经济运行中的困难挑战，要求及时谋划增量政策，加大逆周期调节与扩内需力度，财政与货币表述均较 4 月更为积极——财政端加快支出与债券资金使用进度，推进“两重”“两新”落地，货币端要求适时调整政策工具，降准降息预期升温，且股市表述从“稳信心”升级为“提升韧性信心”，政策呵护力度进一步加码。总体而言，市场调整已较为充分，叠加政策托底与基本面改善的双重支撑，A 股有望企稳回升。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在履行托管职责中，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：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,047,658,109.24	62,273,008.85
结算备付金		18,364,389.81	1,856,596.10
存出保证金		874,954.42	94,407.14
交易性金融资产	6.4.7.2	5,934,947,015.76	328,973,471.93
其中：股票投资		5,934,947,015.76	328,973,471.93
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		-	123,865.91
应收股利		-	-
应收申购款		103,189,639.06	15,635,814.15
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		7,105,034,108.29	408,957,164.08
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		187,860,303.30	0.04
应付赎回款		123,335,910.18	41,357,616.37
应付管理人报酬		5,627,986.04	531,985.77
应付托管费		937,997.70	88,664.31
应付销售服务费		1,581,858.22	43,797.61
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	4,218,248.78	789,483.70
负债合计		323,562,304.22	42,811,547.80
净 资 产：			
实收基金	6.4.7.7	2,722,813,616.82	216,730,493.87
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	4,058,658,187.25	149,415,122.41
净资产合计		6,781,471,804.07	366,145,616.28
负债和净资产总计		7,105,034,108.29	408,957,164.08

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 2,722,813,616.82 份，其中万家量化睿选 A 基金份额净值 2.5264 元，基金份额总额 1,022,640,704.33 份；万家量化睿选 C 基金份额净值 2.4691 元，基金份额总额 1,700,172,912.49 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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,089,830,636.94	6,988,286.87
1. 利息收入		668,387.00	20,435.11
其中：存款利息收入	6.4.7.10	668,387.00	20,435.11
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）		361,632,279.12	4,063,811.17
其中：股票投资收益	6.4.7.11	343,354,264.61	2,689,744.27
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	18,278,014.51	1,374,066.90
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	712,891,987.06	2,740,075.82
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	14,637,983.76	163,964.77
减：二、营业总支出		18,294,594.78	995,326.07
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	12,804,795.40	770,259.64
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,134,132.64	128,376.58
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,262,532.98	43,202.67
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	93, 133. 76	53, 487. 18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1, 071, 536, 042. 16	5, 992, 960. 80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1, 071, 536, 042. 16	5, 992, 960. 80
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1, 071, 536, 042. 16	5, 992, 960. 80

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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	216, 730, 493. 87	-	149, 415, 122. 41	366, 145, 616. 28
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	216, 730, 493. 87	-	149, 415, 122. 41	366, 145, 616. 28
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2, 506, 083, 122. 95	-	3, 909, 243, 064. 84	6, 415, 326, 187. 79
（一）、综合收益总额	-	-	1, 071, 536, 042. 16	1, 071, 536, 042. 16
（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）	2, 506, 083, 122. 95	-	2, 837, 707, 022. 68	5, 343, 790, 145. 63
其中：1. 基金申购款	4, 378, 404, 529. 37	-	5, 095, 665, 948. 46	9, 474, 070, 477. 83
2. 基金赎回款	-1, 872, 321, 406. 42	-	-2, 257, 958, 925. 78	-4, 130, 280, 332. 20

（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	2,722,813,616.82	-	4,058,658,187.25	6,781,471,804.07
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈广益

基金管理人负责人

莫海波

主管会计工作负责人

尹超

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

万家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》、《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》及其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本中期报告所采用的会计政策、会计估计与上年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

（一）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）

交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》的规定，基金通过深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税；

根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（二）增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

根据 2026 年 1 月 1 日起施行的《中华人民共和国增值税法》的规定，取得存款利息收入不征收增值税；

根据 2026 年 1 月 1 日起施行的《中华人民共和国增值税法实施条例》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；

根据财政部、国家税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；金融同业往来利息收入免征增值税；资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为可以选择适用简易计税方法，按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税；

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%和 2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（三）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运

用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(四) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》的规定，对基金通过深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	1,047,658,109.24
等于：本金	1,047,551,123.19
加：应计利息	106,986.05
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	1,047,658,109.24

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		5,205,700,164.09	-	5,934,947,015.76	729,246,851.67
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		5,205,700,164.09	-	5,934,947,015.76	729,246,851.67

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	24,215.74
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,999,649.28
其中：交易所市场	3,999,649.28
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	194,383.76
合计	4,218,248.78

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	174,157,912.68	174,157,912.68
本期申购	1,941,699,681.33	1,941,699,681.33
本期赎回（以“-”号填列）	-1,093,216,889.68	-1,093,216,889.68
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	1,022,640,704.33	1,022,640,704.33

万家量化睿选 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	42,572,581.19	42,572,581.19
本期申购	2,436,704,848.04	2,436,704,848.04

本期赎回（以“-”号填列）	-779,104,516.74	-779,104,516.74
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	1,700,172,912.49	1,700,172,912.49

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	145,859,594.91	-24,641,125.04	121,218,469.87
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	145,859,594.91	-24,641,125.04	121,218,469.87
本期利润	158,660,774.83	343,503,788.46	502,164,563.29
本期基金份额交易产生的变动数	856,986,527.44	80,542,422.51	937,528,949.95
其中：基金申购款	1,970,458,771.64	284,920,456.06	2,255,379,227.70
基金赎回款	-1,113,472,244.20	-204,378,033.55	-1,317,850,277.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,161,506,897.18	399,405,085.93	1,560,911,983.11

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	34,241,321.92	-6,044,669.38	28,196,652.54
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	34,241,321.92	-6,044,669.38	28,196,652.54
本期利润	199,983,280.27	369,388,198.60	569,371,478.87
本期基金份额交易产生的变动数	1,619,965,845.18	280,212,227.55	1,900,178,072.73
其中：基金申购款	2,391,699,006.30	448,587,714.46	2,840,286,720.76
基金赎回款	-771,733,161.12	-168,375,486.91	-940,108,648.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,854,190,447.37	643,555,756.77	2,497,746,204.14

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	657,720.84
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	9,982.50
其他	683.66
合计	668,387.00

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	343,354,264.61
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	343,354,264.61

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,804,295,614.40
减：卖出股票成本总额	2,454,363,409.66
减：交易费用	6,577,940.13
买卖股票差价收入	343,354,264.61

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
----	----

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	18,278,014.51
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	18,278,014.51

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	712,891,987.06
股票投资	712,891,987.06
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	712,891,987.06

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	14,613,603.15
基金转换费收入	24,380.61
合计	14,637,983.76

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	150.00
账户维护费	18,600.00

合计	93,133.76
----	-----------

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司（“万家基金”）	基金管理人、基金销售机构
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
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
万家财富基金销售（天津）有限公司（“万家财富”）	基金管理人的子公司、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例（%）
中泰证券	271,488,797.77	2.68	-	-

注：

本基金上年度可比期间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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
中泰证券	121,059.26	2.68	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
-	-	-	-	-

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	12,804,795.40	770,259.64
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,029,020.57	195,886.72
应支付基金管理人的净管理费	8,775,774.83	574,372.92

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,134,132.64	128,376.58

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		
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家量化睿选 A	万家量化睿选 C	合计
建设银行	-	403,430.48	403,430.48
万家财富	-	6.07	6.07
万家基金	-	1,444,566.50	1,444,566.50
中泰证券	-	1,813.79	1,813.79
合计	-	1,849,816.84	1,849,816.84
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	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

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	-	-
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	-	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-
项目	上年度可比期间 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%	-

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	1,047,658,109.24	657,720.84	8,931,185.88	18,590.84

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（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股流通受	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-

				限						
001237	惠康科技	2026年5月15日	6个月	新股流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能源	2026年6月24日	6个月	新股流通受限	10.11	10.11	58,873	595,206.03	595,206.03	-
001248	华润新能源	2026年6月24日	1个月内(含)	新股未上市	10.11	10.11	25,231	255,085.41	255,085.41	-
001257	盛龙股份	2026年3月24日	6个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026年4月14日	6个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026年5月11日	6个月	新股流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001399	惠科股份	2026年6月16日	6个月	新股流通受限	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
301513	尚水	2026年4	6个月	新股	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-

	智能	月 10 日		流通受限						
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	86	4,988.00	9,645.76	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-

				受限						
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	252	2,817.36	4,432.68	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-

603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,008	17,660.16	36,207.36	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	9 个月	新股流通受限	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	72	6,636.96	33,346.80	-
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	9 个月	新股流通受限	114.28	676.94	1,722	196,790.16	1,165,690.68	-
688797	臻宝	2026 年 6 月	6 个月	新股	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-

	科技	月 16 日		流通受限						
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股流通受限	104.66	768.89	1,265	132,394.90	972,645.85	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	101	5,650.95	5,767.10	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	727	6,884.69	50,991.78	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通	19.68	141.49	1,277	25,131.36	180,682.73	-

				受 限						
--	--	--	--	--------	--	--	--	--	--	--

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
688260	昀冢 科技	2026 年 6 月 26 日	异常 波动 停牌	145.02	2026 年 7 月 1 日	132.00	40,500	2,188,905.98	5,873,310.00	-
688072	拓荆 科技	2026 年 6 月 29 日	重大 事项 停牌	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	6,200	3,439,264.10	5,453,086.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理融入各业务层面，建立了四道防线：以各岗位目标责任制为基础，形成第一道防线；合规风控部门通过完善的风险控制制度和手段对各一线部门的风险管理工作进行指导、管理和监督，形成第二道防线；独立的监察稽核部门对公司内部控制制度的总体执行情况和有效性进行监督、检查、评估和反馈，形成第三道防线；董事会及其风险管理委员会听取公司管理层对公司整体运营情况的报告，并提出指导性意见，形成第四道防线。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。(2025 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（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券”，本报告期内本基金未出现因投资品种变现困难或投资集中而无法以合理价格及时变现基金资产以支付赎回款的情况。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,047,658,109.24	-	-	-	-	-	1,047,658,109.24
结算备付金	18,364,389.81	-	-	-	-	-	18,364,389.81
存出保证金	874,954.42	-	-	-	-	-	874,954.42
交易性金融资产	-	-	-	-	-	5,934,947,015.76	5,934,947,015.76
应收申购款	15.75	-	-	-	-	103,189,623.31	103,189,639.06
资产总计	1,066,897,469.22	-	-	-	-	6,038,136,639.07	7,105,034,108.29
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	123,335,910.18	123,335,910.18
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,627,986.04	5,627,986.04
应付托管费	-	-	-	-	-	937,997.70	937,997.70
应付清算款	-	-	-	-	-	187,860,303.30	187,860,303.30
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,581,858.22	1,581,858.22

其他负债	-	-	-	-	-	4,218,248.78	4,218,248.78
负债总计	-	-	-	-	-	323,562,304.22	323,562,304.22
利率敏感度缺口	1,066,897,469.22	-	-	-	-	5,714,574,334.85	6,781,471,804.07
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	62,273,008.85	-	-	-	-	-	62,273,008.85
结算备付金	1,856,596.10	-	-	-	-	-	1,856,596.10
存出保证金	94,407.14	-	-	-	-	-	94,407.14
交易性金融资产	-	-	-	-	-	328,973,471.93	328,973,471.93
应收申购款	1,000.05	-	-	-	-	15,634,814.10	15,635,814.15
应收清算款	-	-	-	-	-	123,865.91	123,865.91
资产总计	64,225,012.14	-	-	-	-	344,732,151.94	408,957,164.08
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	41,357,616.37	41,357,616.37
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	531,985.77	531,985.77
应付托管费	-	-	-	-	-	88,664.31	88,664.31
应付清算款	-	-	-	-	-	0.04	0.04
应付销售服务费	-	-	-	-	-	43,797.61	43,797.61
其他负债	-	-	-	-	-	789,483.70	789,483.70
负债总计	-	-	-	-	-	42,811,547.80	42,811,547.80
利率敏感度缺口	64,225,012.14	-	-	-	-	301,920,604.14	366,145,616.28

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 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2025 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（2025 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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	5,934,947,015.76	87.52	328,973,471.93	89.85
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	5,934,947,015.76	87.52	328,973,471.93	89.85

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除股票基准指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	股票基准指数上升 100 个基点	94,808,045.84	4,775,472.71
	股票基准指数下降	-94,808,045.84	-4,775,472.71

	100 个基点		
--	---------	--	--

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	5,918,503,230.14	327,489,139.00
第二层次	12,176,687.44	-
第三层次	4,267,098.18	1,484,332.93
合计	5,934,947,015.76	328,973,471.93

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	5,934,947,015.76	83.53
	其中：股票	5,934,947,015.76	83.53
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	1,066,022,499.05	15.00
8	其他各项资产	104,064,593.48	1.46
9	合计	7,105,034,108.29	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	3,538,535.70	0.05
B	采矿业	138,192,806.82	2.04
C	制造业	4,543,801,077.76	67.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,766,299.44	0.09
E	建筑业	63,309,344.18	0.93
F	批发和零售业	209,139,477.60	3.08
G	交通运输、仓储和邮政业	53,284,893.46	0.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	381,272,997.91	5.62
J	金融业	376,428,975.18	5.55
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	11,829,846.00	0.17
M	科学研究和技术服务业	106,258,722.71	1.57
N	水利、环境和公共设施管理业	41,947,584.00	0.62
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	142,875.00	0.00
S	综合	33,580.00	0.00
	合计	5,934,947,015.76	87.52

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	688498	源杰科技	48,495	91,461,570.00	1.35
2	300308	中际旭创	64,500	81,915,000.00	1.21
3	688627	精智达	107,831	77,099,165.00	1.14
4	688630	芯碁微装	137,700	75,651,003.00	1.12
5	300223	君正股份	302,200	75,217,580.00	1.11
6	002384	东山精密	285,801	74,979,892.35	1.11
7	600105	永鼎股份	1,108,800	74,821,824.00	1.10
8	300475	香农芯创	234,611	70,383,300.00	1.04
9	300502	新易盛	115,636	70,191,052.00	1.04
10	300394	天孚通信	229,121	69,350,344.28	1.02
11	688525	佰维存储	137,764	68,155,983.72	1.01
12	300442	润泽科技	802,798	66,688,429.86	0.98
13	688766	普冉股份	84,000	64,394,400.00	0.95
14	300476	胜宏科技	176,100	61,006,323.00	0.90
15	002297	博云新材	1,990,200	57,695,898.00	0.85
16	688002	睿创微纳	365,600	56,554,664.00	0.83
17	002281	光迅科技	218,300	56,090,002.00	0.83
18	002080	中材科技	615,880	55,429,200.00	0.82
19	600176	中国巨石	760,000	55,388,800.00	0.82
20	002460	赣锋锂业	845,400	55,289,160.00	0.82
21	002466	天齐锂业	895,157	54,891,027.24	0.81
22	688025	杰普特	115,600	54,332,000.00	0.80
23	002916	深南电路	118,207	54,126,985.30	0.80
24	301191	菲菱科思	444,753	50,501,703.15	0.74
25	300236	上海新阳	383,100	50,377,650.00	0.74
26	300857	协创数据	143,640	48,823,236.00	0.72
27	300548	长芯博创	170,952	47,524,656.00	0.70
28	300490	华自科技	3,400,300	44,985,969.00	0.66
29	601077	渝农商行	7,310,460	44,666,910.60	0.66
30	600183	生益科技	254,900	44,199,660.00	0.65
31	002948	青岛银行	8,632,200	43,851,576.00	0.65
32	688503	聚和材料	324,400	43,047,880.00	0.63

33	002463	沪电股份	281,500	43,013,200.00	0.63
34	002353	杰瑞股份	280,000	42,700,000.00	0.63
35	300842	帝科股份	477,998	42,623,081.66	0.63
36	601869	长飞光纤	77,200	42,143,480.00	0.62
37	002415	海康威视	1,222,900	41,823,180.00	0.62
38	002240	盛新锂能	918,400	41,171,872.00	0.61
39	600015	华夏银行	6,415,500	40,995,045.00	0.60
40	300604	长川科技	118,900	40,594,838.00	0.60
41	688390	固德威	366,700	39,790,617.00	0.59
42	600549	厦门钨业	466,699	39,762,754.80	0.59
43	603083	剑桥科技	155,100	39,530,337.00	0.58
44	688313	仕佳光子	213,800	39,478,170.00	0.58
45	300620	光库科技	104,200	39,408,440.00	0.58
46	600487	亨通光电	360,300	39,395,202.00	0.58
47	603126	中材节能	6,151,756	38,756,062.80	0.57
48	301308	江波龙	54,715	38,508,417.00	0.57
49	688787	海天瑞声	286,100	38,466,145.00	0.57
50	688521	芯原股份	103,500	38,412,990.00	0.57
51	002837	英维克	469,740	37,372,514.40	0.55
52	301377	鼎泰高科	67,000	36,910,300.00	0.54
53	300073	当升科技	763,000	36,654,520.00	0.54
54	001309	德明利	38,508	36,309,193.20	0.54
55	688045	必易微	435,542	35,183,082.76	0.52
56	603799	华友钴业	710,250	34,276,665.00	0.51
57	600502	安徽建工	7,524,020	32,729,487.00	0.48
58	002414	高德红外	2,460,733	32,629,319.58	0.48
59	600489	中金黄金	1,775,900	32,054,995.00	0.47
60	688416	恒烁股份	226,080	31,651,200.00	0.47
61	688167	炬光科技	88,430	31,322,790.30	0.46
62	301219	腾远钴业	571,028	31,292,334.40	0.46
63	601872	招商轮船	1,751,000	30,765,070.00	0.45
64	688001	华兴源创	358,001	30,680,685.70	0.45
65	000630	铜陵有色	4,743,800	30,170,568.00	0.44
66	000657	中钨高新	313,400	29,998,648.00	0.44
67	002558	巨人网络	1,079,700	29,756,532.00	0.44
68	601963	重庆银行	2,844,200	28,669,536.00	0.42
69	603986	兆易创新	35,100	28,606,500.00	0.42
70	300153	科泰电源	1,264,234	28,596,973.08	0.42
71	688668	鼎通科技	74,393	27,770,906.90	0.41
72	300480	光力科技	642,000	27,400,560.00	0.40
73	002142	宁波银行	916,100	27,199,009.00	0.40
74	300408	三环集团	160,900	26,854,210.00	0.40
75	605599	菜百股份	1,955,600	26,791,720.00	0.40

76	600919	江苏银行	2,472,900	26,657,862.00	0.39
77	301215	中汽股份	5,131,689	26,633,465.91	0.39
78	688388	嘉元科技	602,090	26,491,960.00	0.39
79	603268	松发股份	189,400	26,379,632.00	0.39
80	300042	朗科科技	337,200	25,684,524.00	0.38
81	600323	瀚蓝环境	916,000	25,153,360.00	0.37
82	301235	华康洁净	335,318	25,152,203.18	0.37
83	688170	德龙激光	258,700	24,837,787.00	0.37
84	688257	新锐股份	237,180	24,168,642.00	0.36
85	300429	强力新材	1,355,900	24,026,548.00	0.35
86	601009	南京银行	2,420,300	23,936,767.00	0.35
87	605399	晨光新材	1,617,100	23,755,199.00	0.35
88	002491	通鼎互联	728,800	23,613,120.00	0.35
89	603256	宏和科技	87,900	23,322,507.00	0.34
90	600875	东方电气	809,800	23,297,946.00	0.34
91	002805	丰元股份	814,020	23,272,831.80	0.34
92	688700	东威科技	256,600	22,940,040.00	0.34
93	002396	星网锐捷	1,164,170	22,317,138.90	0.33
94	688456	有研粉材	159,500	22,266,200.00	0.33
95	300184	力源信息	1,266,600	22,228,830.00	0.33
96	301099	雅创电子	230,132	21,977,606.00	0.32
97	002758	浙农股份	2,747,637	21,706,332.30	0.32
98	002560	通达股份	2,834,275	21,087,006.00	0.31
99	300975	商络电子	404,390	20,927,182.50	0.31
100	300856	科思股份	1,953,800	20,827,508.00	0.31
101	688559	海目星	247,500	20,770,200.00	0.31
102	688531	日联科技	115,296	20,504,240.64	0.30
103	600926	杭州银行	1,404,836	20,299,880.20	0.30
104	688039	当虹科技	538,900	20,111,748.00	0.30
105	688182	灿勤科技	465,700	20,057,699.00	0.30
106	603345	安井食品	248,600	19,935,234.00	0.29
107	601187	厦门银行	2,918,200	19,931,306.00	0.29
108	600971	恒源煤电	2,878,200	19,859,580.00	0.29
109	688372	伟测科技	103,100	19,176,600.00	0.28
110	000988	华工科技	102,065	18,842,219.65	0.28
111	000001	平安银行	1,872,500	18,818,625.00	0.28
112	301246	宏源药业	698,600	18,792,340.00	0.28
113	301165	锐捷网络	230,732	18,562,389.40	0.27
114	601225	陕西煤业	903,400	18,384,190.00	0.27
115	300882	万胜智能	1,095,217	18,158,697.86	0.27
116	600026	中远海能	1,009,800	18,115,812.00	0.27
117	301217	铜冠铜箔	108,500	17,910,095.00	0.26
118	601998	中信银行	2,550,672	17,676,156.96	0.26

119	300619	金银河	555,160	17,271,027.60	0.25
120	301086	鸿富瀚	80,960	16,943,308.80	0.25
121	603588	高能环境	867,400	16,654,080.00	0.25
122	301487	盟固利	860,800	16,484,320.00	0.24
123	600710	苏美达	1,669,100	15,956,596.00	0.24
124	688556	高测股份	1,199,400	15,928,032.00	0.23
125	603039	泛微网络	438,477	15,815,865.39	0.23
126	002008	大族激光	104,700	15,716,517.00	0.23
127	688179	阿拉丁	566,100	15,686,631.00	0.23
128	300438	鹏辉能源	187,200	15,509,520.00	0.23
129	688308	欧科亿	82,800	15,053,868.00	0.22
130	688320	禾川科技	362,400	15,021,480.00	0.22
131	603124	江南新材	80,139	14,984,390.22	0.22
132	603045	福达合金	206,900	14,770,591.00	0.22
133	301150	中一科技	229,239	14,467,273.29	0.21
134	600522	中天科技	229,600	13,932,128.00	0.21
135	300731	科创新源	237,840	13,880,342.40	0.20
136	002518	科士达	255,000	13,665,450.00	0.20
137	002709	天赐材料	264,597	13,608,223.71	0.20
138	601600	中国铝业	1,651,800	13,577,796.00	0.20
139	300395	菲利华	100,700	13,466,611.00	0.20
140	603185	弘元绿能	803,000	13,402,070.00	0.20
141	603444	吉比特	37,300	13,369,066.00	0.20
142	688610	埃科光电	50,300	13,249,020.00	0.20
143	002028	思源电气	75,800	13,113,400.00	0.19
144	601138	工业富联	180,400	13,015,860.00	0.19
145	301589	诺瓦星云	86,900	12,946,362.00	0.19
146	002839	张家港行	3,263,680	12,728,352.00	0.19
147	000426	兴业银锡	364,900	12,027,104.00	0.18
148	300491	通合科技	306,300	11,697,597.00	0.17
149	688220	翱捷科技	93,803	11,661,588.96	0.17
150	300496	中科创达	183,797	11,356,816.63	0.17
151	002448	中原内配	922,500	11,346,750.00	0.17
152	301200	大族数控	31,200	11,252,280.00	0.17
153	688400	凌云光	166,300	11,009,060.00	0.16
154	601398	工商银行	1,499,600	10,602,172.00	0.16
155	600801	华新建材	676,600	10,554,960.00	0.16
156	603061	金海通	21,000	10,546,620.00	0.16
157	002379	宏桥控股	710,188	10,489,476.76	0.15
158	300567	精测电子	32,600	10,353,760.00	0.15
159	601100	恒立液压	95,000	10,218,200.00	0.15
160	688256	寒武纪	6,400	10,211,520.00	0.15
161	301511	德福科技	69,381	9,980,456.85	0.15

162	301085	亚康股份	164,100	9,946,101.00	0.15
163	603019	中科曙光	91,500	9,811,545.00	0.14
164	688012	中微公司	20,764	9,727,934.00	0.14
165	688392	骄成超声	42,600	9,677,868.00	0.14
166	300811	铂科新材	100,680	9,553,525.20	0.14
167	688059	华锐精密	47,600	9,506,196.00	0.14
168	301517	陕西华达	190,940	9,476,352.20	0.14
169	688052	纳芯微	32,600	9,398,906.00	0.14
170	688183	生益电子	70,900	9,387,160.00	0.14
171	688328	深科达	97,000	9,282,900.00	0.14
172	002582	好想你	1,091,800	9,225,710.00	0.14
173	600535	天士力	688,300	9,106,209.00	0.13
174	300750	宁德时代	23,100	9,078,531.00	0.13
175	688063	派能科技	168,200	8,960,014.00	0.13
176	600601	方正科技	646,600	8,948,944.00	0.13
177	001389	广合科技	37,400	8,873,150.00	0.13
178	688027	国盾量子	17,600	8,870,576.00	0.13
179	000829	天音控股	1,137,216	8,870,284.80	0.13
180	603093	南华期货	485,800	8,817,270.00	0.13
181	002237	恒邦股份	599,705	8,809,666.45	0.13
182	688519	南亚新材	22,900	8,702,916.00	0.13
183	301205	联特科技	25,300	8,452,730.00	0.12
184	688048	长光华芯	16,800	8,433,600.00	0.12
185	000933	神火股份	395,700	8,388,840.00	0.12
186	003031	中瓷电子	45,500	8,203,650.00	0.12
187	002557	洽洽食品	456,300	8,195,148.00	0.12
188	601208	东材科技	115,600	8,183,324.00	0.12
189	603993	洛阳钼业	451,200	7,918,560.00	0.12
190	688261	东微半导	75,000	7,869,750.00	0.12
191	688347	华虹宏力	22,523	7,574,484.90	0.11
192	300756	金马游乐	229,127	7,572,647.35	0.11
193	688322	奥比中光	58,000	7,571,900.00	0.11
194	688378	奥来德	121,800	7,551,600.00	0.11
195	000776	广发证券	317,800	7,436,520.00	0.11
196	688337	普源精电	98,700	7,395,591.00	0.11
197	000603	盛达资源	319,200	7,373,520.00	0.11
198	300418	昆仑万维	182,500	7,365,700.00	0.11
199	688258	卓易信息	61,300	7,266,502.00	0.11
200	688017	绿的谐波	17,130	7,157,941.80	0.11
201	600123	兰花科创	1,328,900	7,096,326.00	0.10
202	688676	金盘科技	83,398	7,058,806.72	0.10
203	688097	博众精工	110,100	6,941,805.00	0.10
204	601899	紫金矿业	274,600	6,903,444.00	0.10

205	600711	盛屯矿业	627,800	6,886,966.00	0.10
206	002738	中矿资源	112,200	6,618,678.00	0.10
207	300769	德方纳米	99,100	6,590,150.00	0.10
208	002345	潮宏基	716,500	6,570,305.00	0.10
209	688147	微导纳米	40,500	6,556,140.00	0.10
210	000811	冰轮环境	116,100	6,527,142.00	0.10
211	688031	星环科技	56,500	6,507,670.00	0.10
212	301251	威尔高	119,960	6,391,468.80	0.09
213	600546	山煤国际	579,400	6,332,842.00	0.09
214	600775	南京熊猫	639,900	6,117,444.00	0.09
215	300579	数字认证	291,900	6,042,330.00	0.09
216	688536	思瑞浦	16,400	5,971,076.00	0.09
217	002056	横店东磁	195,600	5,961,888.00	0.09
218	688699	明微电子	72,100	5,908,595.00	0.09
219	688260	昀冢科技	40,500	5,873,310.00	0.09
220	688779	五矿新能	716,500	5,810,815.00	0.09
221	603308	应流股份	95,400	5,762,160.00	0.08
222	301169	零点有数	80,100	5,659,866.00	0.08
223	603067	振华股份	121,200	5,610,348.00	0.08
224	300570	太辰光	22,600	5,575,646.00	0.08
225	688127	蓝特光学	56,800	5,543,680.00	0.08
226	688072	拓荆科技	6,200	5,453,086.00	0.08
227	002115	三维通信	528,600	5,444,580.00	0.08
228	301338	凯格精机	32,703	5,326,991.67	0.08
229	601918	新集能源	615,400	5,286,286.00	0.08
230	301607	富特科技	101,020	5,278,295.00	0.08
231	300724	捷佳伟创	74,200	5,238,520.00	0.08
232	300389	艾比森	403,200	5,169,024.00	0.08
233	688418	震有科技	106,600	5,125,328.00	0.08
234	601128	常熟银行	870,631	5,067,072.42	0.07
235	688535	华海诚科	26,308	4,919,596.00	0.07
236	688577	浙海德曼	107,180	4,912,059.40	0.07
237	688332	中科蓝讯	30,552	4,811,940.00	0.07
238	688720	艾森股份	47,280	4,775,280.00	0.07
239	002897	意华股份	53,800	4,733,324.00	0.07
240	688202	美迪西	57,500	4,640,825.00	0.07
241	002863	今飞凯达	1,085,900	4,604,216.00	0.07
242	605118	力鼎光电	131,400	4,584,546.00	0.07
243	301526	国际复材	96,300	4,494,321.00	0.07
244	688158	优刻得	121,700	4,473,692.00	0.07
245	688301	奕瑞科技	35,220	4,367,280.00	0.06
246	002222	福晶科技	46,500	4,291,020.00	0.06
247	603115	海星股份	34,900	4,274,203.00	0.06

248	301326	捷邦科技	30,600	4,264,722.00	0.06
249	600961	株冶集团	130,900	4,239,851.00	0.06
250	688387	信科移动	212,000	4,206,080.00	0.06
251	688365	光云科技	265,200	4,182,204.00	0.06
252	002154	报喜鸟	1,170,700	4,167,692.00	0.06
253	605117	德业股份	36,440	3,869,199.20	0.06
254	688411	海博思创	13,000	3,785,600.00	0.06
255	002975	博杰股份	26,440	3,754,480.00	0.06
256	688307	中润光学	46,840	3,744,858.00	0.06
257	688361	中科飞测	8,702	3,741,860.00	0.06
258	000977	浪潮信息	53,400	3,738,000.00	0.06
259	688499	利元亨	69,100	3,631,205.00	0.05
260	600410	华胜天成	229,300	3,629,819.00	0.05
261	301369	联动科技	14,721	3,606,645.00	0.05
262	601168	西部矿业	132,700	3,601,478.00	0.05
263	002458	益生股份	455,410	3,538,535.70	0.05
264	301095	广立微	29,600	3,494,280.00	0.05
265	600498	烽火通信	44,100	3,245,760.00	0.05
266	603556	海兴电力	146,500	3,223,000.00	0.05
267	688176	亚虹医药	322,545	3,199,646.40	0.05
268	603663	三祥新材	33,200	3,197,160.00	0.05
269	002851	麦格米特	18,600	3,109,548.00	0.05
270	300802	矩子科技	131,700	3,052,806.00	0.05
271	301182	凯旺科技	28,600	2,953,522.00	0.04
272	300762	上海瀚讯	64,400	2,939,860.00	0.04
273	603936	博敏电子	109,800	2,932,758.00	0.04
274	603527	众源新材	243,200	2,898,944.00	0.04
275	688778	厦钨新能	52,500	2,856,000.00	0.04
276	688095	福昕软件	48,025	2,854,125.75	0.04
277	688143	长盈通	16,200	2,849,256.00	0.04
278	002284	亚太股份	299,866	2,845,728.34	0.04
279	300870	欧陆通	8,080	2,793,175.20	0.04
280	000807	云铝股份	126,100	2,791,854.00	0.04
281	300593	新雷能	92,600	2,783,556.00	0.04
282	688041	海光信息	7,400	2,740,220.00	0.04
283	300432	富临精工	135,800	2,728,222.00	0.04
284	688311	盟升电子	103,900	2,721,141.00	0.04
285	301018	申菱环境	23,500	2,716,835.00	0.04
286	002511	中顺洁柔	399,100	2,654,015.00	0.04
287	603901	永创智能	242,300	2,633,801.00	0.04
288	002850	科达利	13,900	2,631,270.00	0.04
289	688150	莱特光电	37,600	2,580,112.00	0.04
290	300693	盛弘股份	52,600	2,564,250.00	0.04

291	603516	淳中科技	18,800	2,530,668.00	0.04
292	688356	键凯科技	32,800	2,528,224.00	0.04
293	688205	德科立	12,000	2,498,280.00	0.04
294	688733	壹石通	59,700	2,468,595.00	0.04
295	002271	东方雨虹	207,600	2,464,212.00	0.04
296	601211	国泰海通	134,500	2,447,900.00	0.04
297	300745	欣锐科技	57,600	2,431,872.00	0.04
298	688225	亚信安全	195,800	2,431,836.00	0.04
299	601665	齐鲁银行	419,200	2,418,784.00	0.04
300	688239	航宇科技	39,500	2,363,285.00	0.03
301	000510	新金路	94,500	2,347,380.00	0.03
302	002997	瑞鹄模具	84,999	2,342,572.44	0.03
303	002792	通宇通讯	65,800	2,340,506.00	0.03
304	000938	紫光股份	79,400	2,291,484.00	0.03
305	600036	招商银行	64,400	2,286,200.00	0.03
306	605060	联德股份	40,000	2,269,600.00	0.03
307	688321	微芯生物	85,700	2,256,481.00	0.03
308	688330	宏力达	66,523	2,250,473.09	0.03
309	300252	金信诺	129,600	2,235,600.00	0.03
310	300191	潜能恒信	79,100	2,187,115.00	0.03
311	002912	中新赛克	118,100	2,177,764.00	0.03
312	300751	迈为股份	7,700	2,174,942.00	0.03
313	301358	湖南裕能	28,400	2,154,708.00	0.03
314	600742	富维股份	294,500	2,132,180.00	0.03
315	301396	宏景科技	6,340	2,102,344.00	0.03
316	600795	国电电力	435,300	2,032,851.00	0.03
317	688148	芳源股份	235,900	2,024,022.00	0.03
318	002768	国恩股份	38,796	2,019,719.76	0.03
319	300953	震裕科技	14,760	1,973,412.00	0.03
320	600206	有研新材	29,500	1,964,700.00	0.03
321	688428	诺诚健华	67,500	1,921,725.00	0.03
322	002849	威星智能	112,900	1,910,268.00	0.03
323	601156	东航物流	117,800	1,898,936.00	0.03
324	688636	智明达	51,256	1,857,004.88	0.03
325	002446	盛路通信	172,015	1,847,441.10	0.03
326	601126	四方股份	29,200	1,845,440.00	0.03
327	688208	道通科技	73,200	1,843,908.00	0.03
328	000708	中信特钢	145,400	1,834,948.00	0.03
329	002012	凯恩股份	283,600	1,817,876.00	0.03
330	603929	亚翔集成	6,600	1,795,332.00	0.03
331	600233	圆通速递	109,200	1,719,900.00	0.03
332	601166	兴业银行	101,800	1,685,808.00	0.02
333	688171	纬德信息	37,700	1,657,292.00	0.02

334	300933	中辰股份	271,500	1,650,720.00	0.02
335	688292	浩瀚深度	87,800	1,633,080.00	0.02
336	688120	华海清科	5,040	1,623,787.20	0.02
337	603228	景旺电子	22,300	1,614,743.00	0.02
338	688512	慧智微	100,557	1,605,895.29	0.02
339	600885	宏发股份	46,500	1,603,785.00	0.02
340	300830	金现代	200,100	1,588,794.00	0.02
341	601229	上海银行	182,200	1,581,496.00	0.02
342	600908	无锡银行	309,700	1,573,276.00	0.02
343	601117	中国化学	212,400	1,561,140.00	0.02
344	002669	康达新材	90,900	1,553,481.00	0.02
345	688283	坤恒顺维	46,900	1,552,859.00	0.02
346	000962	东方钨业	17,100	1,549,260.00	0.02
347	301489	思泉新材	9,156	1,506,894.48	0.02
348	601390	中国中铁	357,900	1,492,443.00	0.02
349	000960	锡业股份	34,500	1,472,805.00	0.02
350	002039	黔源电力	77,600	1,460,432.00	0.02
351	688711	宏微科技	32,100	1,458,945.00	0.02
352	600864	哈投股份	279,800	1,452,162.00	0.02
353	301189	奥尼电子	24,220	1,427,284.60	0.02
354	300672	国科微	4,700	1,386,500.00	0.02
355	300322	硕贝德	54,200	1,365,840.00	0.02
356	600262	北方股份	67,275	1,331,372.25	0.02
357	688795	摩尔线程	1,922	1,308,988.68	0.02
358	601577	长沙银行	149,600	1,303,016.00	0.02
359	688386	泛亚微透	14,400	1,293,696.00	0.02
360	688551	科威尔	18,280	1,284,535.60	0.02
361	002169	智光电气	86,300	1,263,432.00	0.02
362	603119	浙江荣泰	18,999	1,260,393.66	0.02
363	002156	通富微电	16,400	1,244,268.00	0.02
364	601360	三六零	142,200	1,235,718.00	0.02
365	301128	强瑞技术	7,760	1,209,784.00	0.02
366	603150	万朗磁塑	16,900	1,196,520.00	0.02
367	301626	苏州天脉	3,100	1,190,276.00	0.02
368	688312	燕麦科技	14,064	1,181,235.36	0.02
369	002497	雅化集团	57,800	1,177,386.00	0.02
370	601375	中原证券	293,400	1,170,666.00	0.02
371	603659	璞泰来	39,700	1,148,521.00	0.02
372	300531	优博讯	75,500	1,143,825.00	0.02
373	688375	国博电子	10,886	1,135,409.80	0.02
374	002532	天山铝业	104,900	1,125,577.00	0.02
375	688449	联芸科技	12,800	1,104,768.00	0.02
376	300474	景嘉微	17,700	1,070,496.00	0.02

377	002335	科华数据	25,100	1,065,495.00	0.02
378	300450	先导智能	26,100	1,062,792.00	0.02
379	300895	铜牛信息	20,300	1,056,412.00	0.02
380	003016	欣贺股份	171,200	1,049,456.00	0.02
381	601601	中国太保	36,200	1,032,424.00	0.02
382	002484	江海股份	9,400	987,000.00	0.01
383	605376	博迁新材	3,600	976,680.00	0.01
384	688802	沐曦股份	1,265	972,645.85	0.01
385	300499	高澜股份	24,900	963,630.00	0.01
386	300399	天利科技	50,500	963,540.00	0.01
387	300720	海川智能	10,000	962,000.00	0.01
388	002074	国轩高科	34,800	957,348.00	0.01
389	688062	迈威生物	33,300	940,725.00	0.01
390	600761	安徽合力	57,500	940,700.00	0.01
391	688231	隆达股份	24,710	907,598.30	0.01
392	002475	立讯精密	12,800	901,120.00	0.01
393	300369	绿盟科技	165,100	898,144.00	0.01
394	000338	潍柴动力	32,700	891,075.00	0.01
395	301176	逸豪新材	13,100	890,800.00	0.01
396	600330	天通股份	28,800	888,192.00	0.01
397	603703	盛洋科技	79,100	878,010.00	0.01
398	600195	中牧股份	147,900	872,610.00	0.01
399	000408	藏格矿业	12,500	866,500.00	0.01
400	600497	驰宏锌锗	70,900	858,599.00	0.01
401	600988	赤峰黄金	32,600	858,032.00	0.01
402	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.01
403	688652	京仪装备	4,200	840,714.00	0.01
404	600352	浙江龙盛	68,100	824,691.00	0.01
405	002624	完美世界	65,400	812,268.00	0.01
406	688153	唯捷创芯	25,100	806,212.00	0.01
407	300818	耐普矿机	42,430	801,927.00	0.01
408	688088	虹软科技	22,500	799,875.00	0.01
409	002246	北化股份	41,800	785,840.00	0.01
410	301193	家联科技	42,200	782,388.00	0.01
411	300602	飞荣达	15,200	778,240.00	0.01
412	688023	安恒信息	21,098	774,718.56	0.01
413	300748	金力永磁	24,900	768,165.00	0.01
414	605196	华通线缆	29,000	756,900.00	0.01
415	301600	慧翰股份	8,100	740,340.00	0.01
416	603236	移远通信	14,300	731,731.00	0.01
417	603688	石英股份	8,800	726,968.00	0.01
418	002483	润邦股份	146,087	721,669.78	0.01
419	300697	电工合金	44,900	680,235.00	0.01

420	300759	康龙化成	23,100	668,283.00	0.01
421	300278	华昌达	171,900	666,972.00	0.01
422	300416	苏试试验	31,600	644,008.00	0.01
423	000688	国城矿业	18,600	636,678.00	0.01
424	603313	梦百合	107,000	633,440.00	0.01
425	601877	正泰电器	25,000	626,750.00	0.01
426	300684	中石科技	10,200	622,200.00	0.01
427	301196	唯科科技	4,820	604,524.40	0.01
428	301005	超捷股份	5,360	597,961.60	0.01
429	300007	汉威科技	15,600	595,920.00	0.01
430	603699	纽威股份	11,500	578,450.00	0.01
431	000063	中兴通讯	15,900	575,421.00	0.01
432	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.01
433	300045	华力创通	32,500	560,300.00	0.01
434	002746	仙坛股份	109,040	556,104.00	0.01
435	002812	恩捷股份	8,300	555,353.00	0.01
436	601825	沪农商行	73,900	553,511.00	0.01
437	600031	三一重工	31,900	551,232.00	0.01
438	603979	金诚信	9,300	548,979.00	0.01
439	600098	广州发展	92,700	547,857.00	0.01
440	300662	科锐国际	31,900	541,662.00	0.01
441	605389	长龄液压	5,630	540,480.00	0.01
442	601658	邮储银行	106,100	523,073.00	0.01
443	300691	联合光电	32,800	518,568.00	0.01
444	301002	崧盛股份	13,300	513,380.00	0.01
445	002911	佛燃能源	51,200	485,888.00	0.01
446	688037	芯源微	1,100	482,955.00	0.01
447	300726	宏达电子	5,600	473,592.00	0.01
448	603316	诚邦股份	22,900	471,511.00	0.01
449	300563	神宇股份	16,400	465,596.00	0.01
450	688678	福立旺	19,120	462,130.40	0.01
451	300304	云意电气	25,700	458,745.00	0.01
452	603486	科沃斯	8,500	431,375.00	0.01
453	688125	安达智能	2,600	425,100.00	0.01
454	300790	宇瞳光学	16,260	424,548.60	0.01
455	603118	共进股份	34,300	415,373.00	0.01
456	300772	运达股份	33,100	407,130.00	0.01
457	002961	瑞达期货	20,600	403,348.00	0.01
458	001267	汇绿生态	7,500	401,250.00	0.01
459	300213	佳讯飞鸿	66,000	399,960.00	0.01
460	301468	博盈特焊	9,570	399,164.70	0.01
461	688291	金橙子	6,800	397,664.00	0.01
462	603889	新澳股份	77,340	395,207.40	0.01

463	601018	宁波港	124,900	393,435.00	0.01
464	300747	锐科激光	7,400	392,866.00	0.01
465	688206	概伦电子	8,708	386,373.96	0.01
466	300353	东土科技	18,200	378,196.00	0.01
467	301029	怡合达	13,900	375,439.00	0.01
468	301382	蜂助手	8,100	372,600.00	0.01
469	603626	科森科技	19,700	364,450.00	0.01
470	600879	航天电子	17,100	364,059.00	0.01
471	688199	久日新材	10,500	362,565.00	0.01
472	002943	宇晶股份	8,130	359,589.90	0.01
473	300711	广哈通信	21,900	359,160.00	0.01
474	688333	铂力特	3,500	358,400.00	0.01
475	300557	理工光科	10,350	356,350.50	0.01
476	000547	航天发展	18,600	356,190.00	0.01
477	002534	西子洁能	19,200	356,160.00	0.01
478	600928	西安银行	107,600	351,852.00	0.01
479	688507	索辰科技	1,300	350,584.00	0.01
480	002378	章源钨业	10,000	334,800.00	0.00
481	300072	海新能科	95,700	325,380.00	0.00
482	000969	安泰科技	13,100	321,474.00	0.00
483	002478	常宝股份	51,000	315,180.00	0.00
484	603052	可川科技	3,800	307,762.00	0.00
485	002405	四维图新	46,200	298,914.00	0.00
486	603728	鸣志电器	4,900	298,508.00	0.00
487	688080	映翰通	6,900	298,425.00	0.00
488	688077	大地熊	10,900	288,741.00	0.00
489	301153	中科江南	17,700	288,333.00	0.00
490	002824	和胜股份	8,300	287,014.00	0.00
491	301321	翰博高新	6,500	286,975.00	0.00
492	300735	光弘科技	12,600	286,524.00	0.00
493	002151	北斗星通	9,000	285,750.00	0.00
494	601717	中创智领	19,900	276,809.00	0.00
495	002465	海格通信	21,600	275,832.00	0.00
496	688103	国力电子	3,700	275,317.00	0.00
497	688433	华曙高科	3,200	273,920.00	0.00
498	605358	立昂微	3,500	271,600.00	0.00
499	000899	赣能股份	28,000	270,480.00	0.00
500	600595	中孚实业	48,100	270,322.00	0.00
501	001287	中电港	8,600	267,890.00	0.00
502	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.00
503	300634	彩讯股份	13,200	258,324.00	0.00
504	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.00
505	688049	炬芯科技	5,500	258,005.00	0.00

506	002787	华源控股	7,800	251,160.00	0.00
507	002324	普利特	20,300	245,021.00	0.00
508	300810	中科海讯	9,500	241,110.00	0.00
509	688353	华盛锂电	1,995	231,559.65	0.00
510	300955	嘉亨家化	6,400	230,976.00	0.00
511	688591	泰凌微	6,700	230,346.00	0.00
512	301117	佳缘科技	9,720	226,962.00	0.00
513	002602	世纪华通	15,600	219,960.00	0.00
514	000555	神州信息	21,100	217,330.00	0.00
515	600282	南钢股份	47,100	216,189.00	0.00
516	688195	腾景科技	1,120	215,689.60	0.00
517	688682	霍莱沃	5,500	213,950.00	0.00
518	301110	青木科技	5,600	212,016.00	0.00
519	603565	中谷物流	21,200	207,972.00	0.00
520	300101	振芯科技	12,700	205,359.00	0.00
521	002636	金安国纪	1,700	203,949.00	0.00
522	600166	福田汽车	69,500	202,245.00	0.00
523	603496	恒为科技	8,800	202,224.00	0.00
524	601336	新华保险	3,300	196,878.00	0.00
525	688702	盛科通信	500	194,995.00	0.00
526	002111	威海广泰	20,700	186,300.00	0.00
527	688135	利扬芯片	4,400	185,152.00	0.00
528	600057	厦门象屿	33,900	183,738.00	0.00
529	601000	唐山港	43,900	182,185.00	0.00
530	002202	金风科技	7,600	181,640.00	0.00
531	688488	艾迪药业	14,100	181,185.00	0.00
532	688820	盛合晶微	1,277	180,682.73	0.00
533	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.00
534	600177	雅戈尔	23,700	178,461.00	0.00
535	600392	盛和资源	5,400	160,758.00	0.00
536	300299	富春股份	31,000	151,900.00	0.00
537	600219	南山铝业	37,700	150,423.00	0.00
538	688020	方邦股份	600	149,760.00	0.00
539	688545	兴福电子	1,100	146,366.00	0.00
540	688309	恒誉科技	2,400	146,112.00	0.00
541	601058	赛轮轮胎	12,500	144,125.00	0.00
542	000719	中原传媒	12,500	142,875.00	0.00
543	002603	以岭药业	9,400	141,000.00	0.00
544	688480	赛恩斯	1,600	140,144.00	0.00
545	301232	飞沃科技	900	138,555.00	0.00
546	002706	良信股份	12,600	137,466.00	0.00
547	300409	道氏技术	6,800	135,524.00	0.00
548	601666	平煤股份	18,000	128,700.00	0.00

549	300206	理邦仪器	10,500	128,415.00	0.00
550	301120	新特电气	7,700	128,051.00	0.00
551	688275	万润新能	1,000	127,550.00	0.00
552	603031	安孚科技	2,300	122,475.00	0.00
553	603876	鼎胜新材	4,700	122,247.00	0.00
554	600803	新奥股份	7,500	118,500.00	0.00
555	300852	四会富仕	1,700	117,708.00	0.00
556	688653	康希通信	6,700	116,446.00	0.00
557	688173	希荻微	6,000	114,840.00	0.00
558	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
559	688091	上海谊众	2,600	104,520.00	0.00
560	300520	科大国创	3,800	102,372.00	0.00
561	605208	永茂泰	6,200	98,890.00	0.00
562	300678	中科信息	4,400	98,560.00	0.00
563	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
564	002203	海亮股份	4,200	95,970.00	0.00
565	601328	交通银行	14,700	94,521.00	0.00
566	688207	格灵深瞳	4,700	94,470.00	0.00
567	301291	明阳电气	2,600	93,574.00	0.00
568	300207	欣旺达	4,900	93,051.00	0.00
569	301282	金禄电子	3,120	92,008.80	0.00
570	603678	火炬电子	1,100	91,300.00	0.00
571	688349	三一重能	5,990	90,928.20	0.00
572	301201	诚达药业	2,500	90,900.00	0.00
573	600970	中材国际	12,600	89,838.00	0.00
574	002612	朗姿股份	7,900	88,559.00	0.00
575	688539	高华科技	2,700	86,076.00	0.00
576	002587	奥拓电子	11,000	85,910.00	0.00
577	603085	天成自控	7,100	77,177.00	0.00
578	301316	慧博云通	1,900	74,822.00	0.00
579	300606	金太阳	1,700	72,352.00	0.00
580	601898	中煤能源	5,900	71,862.00	0.00
581	301389	隆扬电子	800	69,432.00	0.00
582	300835	龙磁科技	300	68,847.00	0.00
583	300541	先进数通	6,800	65,620.00	0.00
584	301172	君逸数码	2,500	64,875.00	0.00
585	300328	宜安科技	4,500	63,180.00	0.00
586	688335	复洁科技	2,600	62,504.00	0.00
587	603267	鸿远电子	800	61,984.00	0.00
588	300494	盛天网络	7,100	59,853.00	0.00
589	000925	众合科技	6,300	58,842.00	0.00
590	603063	禾望电气	1,100	58,179.00	0.00
591	688691	灿芯股份	500	57,965.00	0.00

592	603859	能科科技	1,200	57,576.00	0.00
593	600380	健康元	5,900	55,578.00	0.00
594	300446	航天智造	3,100	52,173.00	0.00
595	688818	电科蓝天	727	50,991.78	0.00
596	300341	麦克奥迪	3,800	50,350.00	0.00
597	603712	七一二	3,900	50,271.00	0.00
598	002004	华邦健康	12,400	48,732.00	0.00
599	301026	浩通科技	2,360	47,719.20	0.00
600	002258	利尔化学	3,600	45,756.00	0.00
601	300224	正海磁材	3,400	45,322.00	0.00
602	605277	新亚电子	2,160	41,169.60	0.00
603	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
604	300257	开山股份	1,400	40,152.00	0.00
605	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
606	601179	中国西电	2,600	38,792.00	0.00
607	002811	郑中设计	3,300	36,927.00	0.00
608	300473	德尔股份	1,200	36,480.00	0.00
609	688712	北芯生命	1,008	36,207.36	0.00
610	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
611	301319	唯特偶	215	35,975.95	0.00
612	600673	东阳光	1,000	33,580.00	0.00
613	688785	恒运昌	72	33,346.80	0.00
614	300698	万马科技	1,200	32,640.00	0.00
615	600704	物产中大	6,300	29,736.00	0.00
616	301031	中熔电气	244	29,145.80	0.00
617	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
618	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
619	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
620	002735	王子新材	1,200	19,476.00	0.00
621	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
622	001369	双欣材料	1,297	17,535.44	0.00
623	601669	中国电建	3,700	17,390.00	0.00
624	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
625	603017	中衡设计	1,600	15,920.00	0.00
626	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
627	688607	康众医疗	300	15,300.00	0.00
628	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
629	688084	晶品特装	300	15,084.00	0.00
630	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
631	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
632	000565	渝三峡 A	2,300	13,064.00	0.00
633	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
634	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00

635	301680	固德电材	86	9,645.76	0.00
636	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
637	688816	易思维	101	5,767.10	0.00
638	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
639	601112	振石股份	252	4,432.68	0.00
640	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
641	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
642	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
643	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
644	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	300394	天孚通信	77,246,749.86	21.10
2	688498	源杰科技	77,109,799.23	21.06
3	300308	中际旭创	76,723,985.00	20.95
4	300502	新易盛	76,122,857.00	20.79
5	300475	香农芯创	75,282,339.21	20.56
6	002384	东山精密	75,103,971.29	20.51
7	300548	长芯博创	72,521,308.16	19.81
8	300442	润泽科技	68,656,249.28	18.75
9	688525	佰维存储	64,449,779.35	17.60
10	002460	赣锋锂业	63,142,138.00	17.25
11	300476	胜宏科技	62,115,084.66	16.96
12	600105	永鼎股份	62,067,505.60	16.95
13	002353	杰瑞股份	61,992,973.00	16.93
14	001309	德明利	59,497,004.74	16.25
15	002466	天齐锂业	59,063,263.74	16.13
16	002281	光迅科技	58,233,518.00	15.90
17	300490	华自科技	55,167,172.00	15.07
18	300223	君正股份	52,574,751.00	14.36
19	688002	睿创微纳	52,549,225.89	14.35
20	601077	渝农商行	51,292,852.20	14.01
21	002463	沪电股份	51,112,114.31	13.96
22	002080	中材科技	50,939,212.16	13.91
23	600183	生益科技	49,355,609.00	13.48
24	002240	盛新锂能	49,331,916.54	13.47
25	002948	青岛银行	49,122,066.00	13.42
26	600015	华夏银行	48,786,725.00	13.32
27	301191	菲菱科思	48,651,724.16	13.29
28	688170	德龙激光	48,143,054.67	13.15
29	688313	仕佳光子	47,144,099.82	12.88

30	688627	精智达	46,994,064.30	12.83
31	603126	中材节能	46,669,487.64	12.75
32	603083	剑桥科技	46,338,420.00	12.66
33	688630	芯碁微装	46,224,440.60	12.62
34	688766	普冉股份	45,179,363.99	12.34
35	601963	重庆银行	45,092,388.00	12.32
36	688416	恒烁股份	43,126,161.80	11.78
37	002414	高德红外	42,627,061.74	11.64
38	688390	固德威	42,605,125.52	11.64
39	688787	海天瑞声	42,346,007.73	11.57
40	301377	鼎泰高科	42,328,249.16	11.56
41	300236	上海新阳	42,319,314.52	11.56
42	300842	帝科股份	41,417,300.40	11.31
43	688045	必易微	41,347,650.65	11.29
44	300073	当升科技	40,978,406.00	11.19
45	603799	华友钴业	40,722,711.80	11.12
46	605599	菜百股份	40,666,028.00	11.11
47	600502	安徽建工	40,195,359.40	10.98
48	002415	海康威视	40,057,289.00	10.94
49	600176	中国巨石	40,047,663.00	10.94
50	688001	华兴源创	39,947,550.11	10.91
51	600489	中金黄金	39,763,410.00	10.86
52	002837	英维克	39,717,695.70	10.85
53	688025	杰普特	39,491,012.40	10.79
54	002916	深南电路	39,306,154.72	10.74
55	002297	博云新材	38,778,100.00	10.59
56	002028	思源电气	38,689,134.00	10.57
57	600487	亨通光电	36,041,707.00	9.84
58	688167	炬光科技	35,906,236.59	9.81
59	301308	江波龙	35,440,583.45	9.68
60	002008	大族激光	35,154,041.00	9.60
61	600919	江苏银行	35,099,865.00	9.59
62	300857	协创数据	33,918,556.40	9.26
63	601869	长飞光纤	33,070,131.00	9.03
64	688503	聚和材料	32,874,017.18	8.98
65	300153	科泰电源	32,776,949.64	8.95
66	301219	腾远钴业	32,288,292.80	8.82
67	300604	长川科技	32,270,070.00	8.81
68	600549	厦门钨业	32,155,049.14	8.78
69	000630	铜陵有色	31,743,337.00	8.67
70	300408	三环集团	31,229,444.20	8.53
71	300438	鹏辉能源	31,192,362.00	8.52
72	688388	嘉元科技	31,108,265.77	8.50

73	301215	中汽股份	31,092,607.31	8.49
74	301366	一博科技	30,888,759.60	8.44
75	601998	中信银行	30,864,380.96	8.43
76	601872	招商轮船	30,745,208.10	8.40
77	601600	中国铝业	30,624,551.00	8.36
78	300620	光库科技	30,219,102.82	8.25
79	600323	瀚蓝环境	29,441,441.00	8.04
80	002758	浙农股份	29,421,298.99	8.04
81	688521	芯原股份	29,320,796.28	8.01
82	002142	宁波银行	29,235,199.00	7.98
83	601009	南京银行	29,120,961.00	7.95
84	600875	东方电气	28,646,876.00	7.82
85	000001	平安银行	28,161,973.00	7.69
86	601138	工业富联	28,096,545.00	7.67
87	300042	朗科科技	27,632,353.00	7.55
88	603268	松发股份	27,575,695.00	7.53
89	600546	山煤国际	27,524,801.00	7.52
90	002558	巨人网络	26,978,587.00	7.37
91	300480	光力科技	26,376,158.00	7.20
92	603444	吉比特	26,201,823.00	7.16
93	301235	华康洁净	26,056,276.90	7.12
94	300389	艾比森	25,443,573.00	6.95
95	600926	杭州银行	25,240,141.36	6.89
96	002396	星网锐捷	25,160,955.10	6.87
97	603185	弘元绿能	25,083,218.02	6.85
98	300975	商络电子	24,481,580.00	6.69
99	688456	有研粉材	24,018,050.61	6.56
100	002839	张家港行	23,962,291.80	6.54
101	601860	紫金银行	23,953,880.00	6.54
102	300619	金银河	23,905,343.00	6.53
103	002560	通达股份	23,727,310.20	6.48
104	600971	恒源煤电	23,690,433.00	6.47
105	688039	当虹科技	23,444,617.94	6.40
106	000829	天音控股	23,404,460.00	6.39
107	600601	方正科技	23,084,704.00	6.30
108	300491	通合科技	22,993,448.00	6.28
109	688668	鼎通科技	22,913,920.78	6.26
110	603186	华正新材	22,225,593.00	6.07
111	605399	晨光新材	22,061,335.00	6.03
112	300856	科思股份	21,856,512.00	5.97
113	603986	兆易创新	21,757,831.00	5.94
114	300429	强力新材	21,623,410.00	5.91
115	601225	陕西煤业	21,548,226.00	5.89

116	300184	力源信息	21,484,926.00	5.87
117	000988	华工科技	21,356,886.32	5.83
118	601187	厦门银行	21,294,712.00	5.82
119	603345	安井食品	21,116,787.00	5.77
120	603256	宏和科技	21,086,308.84	5.76
121	600026	中远海能	20,869,210.00	5.70
122	300882	万胜智能	20,859,193.58	5.70
123	301246	宏源药业	20,706,445.00	5.66
124	000657	中钨高新	20,403,527.00	5.57
125	688183	生益电子	20,160,392.13	5.51
126	600801	华新建材	19,619,468.00	5.36
127	002491	通鼎互联	19,491,767.00	5.32
128	600710	苏美达	19,467,739.00	5.32
129	301487	盟固利	19,391,375.00	5.30
130	600535	天士力	19,333,550.00	5.28
131	688031	星环科技	19,249,610.79	5.26
132	600123	兰花科创	19,154,247.00	5.23
133	688556	高测股份	19,143,303.96	5.23
134	002557	洽洽食品	19,076,472.00	5.21
135	688531	日联科技	18,939,428.05	5.17
136	000426	兴业银锡	18,793,768.00	5.13
137	300750	宁德时代	18,776,534.00	5.13
138	002805	丰元股份	18,631,432.80	5.09
139	688182	灿勤科技	18,414,819.86	5.03
140	301099	雅创电子	18,379,905.38	5.02
141	601918	新集能源	18,037,896.00	4.93
142	603039	泛微网络	17,528,669.18	4.79
143	002709	天赐材料	17,396,617.99	4.75
144	002379	宏桥控股	17,139,329.48	4.68
145	301165	锐捷网络	17,027,066.60	4.65
146	688559	海目星	16,913,946.88	4.62
147	688700	东威科技	16,706,078.47	4.56
148	688372	伟测科技	16,319,804.44	4.46
149	688257	新锐股份	16,085,837.24	4.39
150	688308	欧科亿	15,945,448.90	4.35
151	688322	奥比中光	15,921,311.08	4.35
152	688320	禾川科技	15,761,550.26	4.30
153	688148	芳源股份	15,702,246.59	4.29
154	300756	金马游乐	15,639,882.65	4.27
155	301517	陕西华达	15,479,036.80	4.23
156	688063	派能科技	15,413,100.58	4.21
157	688400	凌云光	15,184,164.81	4.15
158	002863	今飞凯达	14,958,516.00	4.09

159	301217	铜冠铜箔	14,768,601.00	4.03
160	600711	盛屯矿业	14,729,734.00	4.02
161	688027	国盾量子	14,470,916.20	3.95
162	300731	科创新源	14,423,778.20	3.94
163	301086	鸿富瀚	14,116,018.00	3.86
164	301589	诺瓦星云	14,082,193.00	3.85
165	300724	捷佳伟创	13,972,706.94	3.82
166	603045	福达合金	13,943,573.00	3.81
167	300395	菲利华	13,581,696.00	3.71
168	603588	高能环境	13,297,543.00	3.63
169	603019	中科曙光	13,231,852.00	3.61
170	000776	广发证券	13,186,258.00	3.60
171	603124	江南新材	13,067,361.75	3.57
172	002518	科士达	12,983,870.00	3.55
173	000603	盛达资源	12,841,992.00	3.51
174	002448	中原内配	12,783,972.00	3.49
175	300322	硕贝德	12,548,658.00	3.43
176	600410	华胜天成	12,436,660.00	3.40
177	301326	捷邦科技	12,380,799.00	3.38
178	688012	中微公司	12,294,227.48	3.36
179	300496	中科创达	12,226,218.01	3.34
180	688179	阿拉丁	12,004,837.68	3.28
181	600961	株冶集团	11,793,283.00	3.22
182	600742	富维股份	11,627,952.00	3.18
183	000933	神火股份	11,565,182.00	3.16
184	601398	工商银行	11,345,078.00	3.10
185	301150	中一科技	11,258,905.16	3.07
186	688256	寒武纪	11,186,346.64	3.06
187	601100	恒立液压	11,101,003.00	3.03
188	600522	中天科技	11,036,669.00	3.01
189	002582	好想你	10,990,888.00	3.00
190	301085	亚康股份	10,884,499.00	2.97
191	603236	移远通信	10,876,560.00	2.97
192	601899	紫金矿业	10,834,708.00	2.96
193	300811	铂科新材	10,825,023.00	2.96
194	002012	凯恩股份	10,729,500.00	2.93
195	688301	奕瑞科技	10,568,489.81	2.89
196	301200	大族数控	10,535,663.00	2.88
197	688220	翱捷科技	10,465,001.46	2.86
198	002556	辉隆股份	10,389,747.60	2.84
199	600036	招商银行	9,981,457.00	2.73
200	601020	华钰矿业	9,972,527.00	2.72
201	603093	南华期货	9,899,368.00	2.70

202	688052	纳芯微	9,738,332.07	2.66
203	301205	联特科技	9,674,980.00	2.64
204	688041	海光信息	9,647,381.66	2.63
205	688512	慧智微	9,610,928.86	2.62
206	001389	广合科技	9,427,465.00	2.57
207	300191	潜能恒信	9,414,218.00	2.57
208	600019	宝钢股份	9,347,670.20	2.55
209	688332	中科蓝讯	9,283,975.98	2.54
210	002738	中矿资源	9,100,265.00	2.49
211	688311	盟升电子	9,092,172.50	2.48
212	300418	昆仑万维	9,090,675.00	2.48
213	603228	景旺电子	8,997,456.00	2.46
214	688378	奥来德	8,993,216.18	2.46
215	601208	东材科技	8,786,542.00	2.40
216	688610	埃科光电	8,745,365.55	2.39
217	002345	潮宏基	8,686,358.00	2.37
218	301169	零点有数	8,668,301.00	2.37
219	688676	金盘科技	8,610,383.33	2.35
220	300762	上海瀚讯	8,575,958.00	2.34
221	603993	洛阳钼业	8,498,018.00	2.32
222	603500	祥和实业	8,353,555.06	2.28
223	688258	卓易信息	8,331,167.06	2.28
224	301511	德福科技	8,205,176.42	2.24
225	002237	恒邦股份	8,194,743.00	2.24
226	688072	拓荆科技	8,192,369.06	2.24
227	600775	南京熊猫	8,113,252.00	2.22
228	605117	德业股份	8,069,534.80	2.20
229	688328	深科达	8,035,366.25	2.19
230	688577	浙海德曼	8,015,904.40	2.19
231	688017	绿的谐波	7,979,480.06	2.18
232	688202	美迪西	7,937,431.27	2.17
233	688238	和元生物	7,850,049.77	2.14
234	688261	东微半导	7,827,146.54	2.14
235	002056	横店东磁	7,721,015.00	2.11
236	600795	国电电力	7,569,383.00	2.07
237	002671	龙泉股份	7,545,048.00	2.06
238	600104	上汽集团	7,508,650.00	2.05
239	601166	兴业银行	7,491,737.00	2.05
240	600864	哈投股份	7,458,565.00	2.04
241	003031	中瓷电子	7,428,108.00	2.03
242	688779	五矿新能	7,419,077.15	2.03
243	688048	长光华芯	7,391,358.60	2.02

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	001309	德明利	56,347,529.01	15.39
2	300475	香农芯创	49,353,776.70	13.48
3	688498	源杰科技	48,359,896.55	13.21
4	600183	生益科技	45,446,589.00	12.41
5	301377	鼎泰高科	44,127,799.70	12.05
6	300548	长芯博创	43,690,132.00	11.93
7	688170	德龙激光	42,097,280.21	11.50
8	301366	一博科技	40,790,044.35	11.14
9	688525	佰维存储	36,413,226.93	9.95
10	002008	大族激光	36,045,895.20	9.84
11	688001	华兴源创	32,199,137.81	8.79
12	603186	华正新材	31,232,398.64	8.53
13	603083	剑桥科技	30,203,178.00	8.25
14	300502	新易盛	30,085,989.00	8.22
15	002281	光迅科技	29,969,721.00	8.19
16	002463	沪电股份	28,802,636.00	7.87
17	300308	中际旭创	27,711,672.00	7.57
18	002384	东山精密	27,118,128.00	7.41
19	688416	恒烁股份	25,940,015.67	7.08
20	002353	杰瑞股份	24,250,490.00	6.62
21	300394	天孚通信	23,758,038.80	6.49
22	002028	思源电气	23,630,706.06	6.45
23	601860	紫金银行	23,393,514.00	6.39
24	601138	工业富联	22,091,649.00	6.03
25	300438	鹏辉能源	22,028,001.00	6.02
26	688313	仕佳光子	21,575,833.88	5.89
27	600546	山煤国际	21,037,974.00	5.75
28	600601	方正科技	20,927,634.00	5.72
29	300975	商络电子	20,307,106.00	5.55
30	300491	通合科技	19,189,471.66	5.24
31	601918	新集能源	17,760,937.00	4.85
32	601963	重庆银行	17,602,386.00	4.81
33	688183	生益电子	16,876,254.08	4.61
34	300408	三环集团	15,867,625.80	4.33
35	688388	嘉元科技	15,033,528.21	4.11
36	300389	艾比森	14,427,223.00	3.94
37	688148	芳源股份	13,830,866.98	3.78
38	600487	亨通光电	13,749,148.00	3.76
39	301308	江波龙	13,672,795.00	3.73
40	603444	吉比特	12,642,242.53	3.45
41	603986	兆易创新	12,599,912.00	3.44

42	688167	炬光科技	12,495,267.55	3.41
43	600105	永鼎股份	11,965,460.00	3.27
44	002414	高德红外	11,810,065.00	3.23
45	688322	奥比中光	11,756,278.96	3.21
46	300042	朗科科技	11,753,029.80	3.21
47	300322	硕贝德	11,628,406.00	3.18
48	688766	普冉股份	11,523,026.02	3.15
49	601020	华钰矿业	11,495,557.00	3.14
50	688456	有研粉材	11,411,407.52	3.12
51	002556	辉隆股份	11,121,789.88	3.04
52	300604	长川科技	10,828,271.00	2.96
53	688031	星环科技	10,814,176.95	2.95
54	688045	必易微	10,643,081.24	2.91
55	603236	移远通信	10,625,142.32	2.90
56	600549	厦门钨业	10,597,270.00	2.89
57	603500	祥和实业	10,552,968.91	2.88
58	600919	江苏银行	10,324,323.00	2.82
59	601998	中信银行	10,296,550.00	2.81
60	688301	奕瑞科技	10,244,818.55	2.80
61	000829	天音控股	10,213,017.00	2.79
62	601600	中国铝业	9,735,571.00	2.66
63	603228	景旺电子	9,500,305.00	2.59
64	300191	潜能恒信	9,427,777.00	2.57
65	600535	天士力	9,347,357.00	2.55
66	300750	宁德时代	9,245,635.00	2.53
67	000600	建投能源	9,012,715.00	2.46
68	002839	张家港行	9,008,441.00	2.46
69	688512	慧智微	8,995,917.91	2.46
70	300620	光库科技	8,962,246.00	2.45
71	002012	凯恩股份	8,940,883.00	2.44
72	688308	欧科亿	8,763,890.84	2.39
73	000988	华工科技	8,595,999.00	2.35
74	600019	宝钢股份	8,562,744.48	2.34
75	301235	华康洁净	8,483,795.00	2.32
76	002557	洽洽食品	8,404,869.00	2.30
77	300476	胜宏科技	8,171,045.00	2.23
78	300814	中富电路	8,151,072.00	2.23
79	301217	铜冠铜箔	8,111,570.00	2.22
80	600123	兰花科创	8,047,526.70	2.20
81	002863	今飞凯达	8,044,767.44	2.20
82	300223	君正股份	8,008,693.00	2.19
83	688012	中微公司	7,955,102.34	2.17
84	688332	中科蓝讯	7,899,625.68	2.16

85	300724	捷佳伟创	7,876,580.00	2.15
86	603185	弘元绿能	7,757,933.18	2.12
87	600961	株冶集团	7,693,976.00	2.10
88	600795	国电电力	7,651,603.00	2.09
89	002837	英维克	7,647,572.00	2.09
90	600742	富维股份	7,614,937.00	2.08
91	300684	中石科技	7,519,167.00	2.05
92	600036	招商银行	7,496,187.00	2.05

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	7,347,444,966.43
卖出股票收入（成交）总额	2,804,295,614.40

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约定的备选股票库

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	874,954.42
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	103,189,639.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	104,064,593.48

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	20,963	48,783.13	331,142,621.34	32.38	691,498,082.99	67.62
万家量化 睿选 C	45,122	37,679.47	1,371,989,300.50	80.70	328,183,611.99	19.30
合计	65,355	41,661.90	1,703,131,921.84	62.55	1,019,681,694.98	37.45

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

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	95.65

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管 理人所有从业 人员持有本基 金	万家量化睿选 A	816,884.69	0.0799
	万家量化睿选 C	135,402.58	0.0080
	合计	952,287.27	0.0350

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	万家量化睿选 A	50~100
	万家量化睿选 C	0~10
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	万家量化睿选 A	50~100
	万家量化睿选 C	0

	合计	50~100
--	----	--------

§ 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	174,157,912.68	42,572,581.19
本报告期基金总申购 份额	1,941,699,681.33	2,436,704,848.04
减：本报告期基金总 赎回份额	1,093,216,889.68	779,104,516.74
本报告期基金拆分变 动份额	—	—
本报告期期末基金份 额总额	1,022,640,704.33	1,700,172,912.49

§ 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

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

自 2026 年 4 月 16 日起，陈广益先生担任公司董事长，方一天先生不再担任公司董事长；莫海波先生担任公司总经理，陈广益先生不再担任公司总经理；

自 2026 年 5 月 25 日起，王焱女士担任公司首席信息官，陈广益先生不再担任公司首席信息官。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况未发生改变。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信证券	2	2,311,203,102.38	22.77	1,030,571.59	22.77	-
华泰证券	1	1,657,429,122.44	16.33	739,064.20	16.33	-
东北证券	1	924,312,424.24	9.11	412,160.24	9.11	-
长江证券	1	767,957,026.66	7.57	342,440.24	7.57	-
国泰海通证券	2	725,206,411.41	7.15	323,372.20	7.15	-
天风证券	1	664,913,680.64	6.55	296,486.88	6.55	-
国信证券	1	605,823,296.32	5.97	270,138.74	5.97	-
华创证券	2	553,822,634.70	5.46	246,948.89	5.46	-
国投证券	1	525,527,975.16	5.18	234,333.86	5.18	-
东方财富证券	2	401,830,986.19	3.96	179,173.54	3.96	-

中泰证券	2	271,488,797.77	2.68	121,059.26	2.68	-
华西证券	2	270,247,344.68	2.66	120,496.10	2.66	-
西部证券	2	258,911,969.48	2.55	115,448.40	2.55	-
西南证券	1	208,267,034.21	2.05	92,868.12	2.05	-
兴业证券	3	1,256,979.64	0.01	628.50	0.01	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高盛证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联民生证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
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，本基金新增国联民生证券交易单元 1 个、减少渤海证券交易单元 2 个，减少中信证券交易单元 2 个，减少方正证券交易单元 1 个。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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	万家基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	指定媒介	2026 年 1 月 21 日
2	万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	指定媒介	2026 年 1 月 21 日
3	万家基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	指定媒介	2026 年 3 月 30 日
4	万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金 2025 年年度报告	指定媒介	2026 年 3 月 30 日
5	万家基金管理有限公司关于董事长、高级管理人员变更的公告	指定媒介	2026 年 4 月 17 日
6	万家基金管理有限公司关于旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	指定媒介	2026 年 4 月 21 日
7	万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	指定媒介	2026 年 4 月 21 日
8	万家基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	指定媒介	2026 年 5 月 27 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20260416-20260511	-	295,561,930.16	182,000,000.00	113,561,930.16	4.17
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 2026 年中期报告原文。
- 5、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。
- 7、本报告期内在中国证监会指定媒介公开披露的基金净值、更新招募说明书及其他临时公告。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人网站：www.wjasset.com。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司

2026 年 8 月 29 日