

万家集利债券型发起式证券投资基金

2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 27 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。
本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家集利债券发起式	
基金主代码	018741	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 6 月 29 日	
报告期末基金份额总额	615,643,653.79 份	
投资目标	在严格控制风险并保持良好流动性的基础上，力争为投资者提供长期稳定的投资回报。	
投资策略	1、资产配置策略；2、利率预期策略；3、期限结构配置策略；4、属类配置策略；5、债券品种选择策略；6、股票投资策略；7、公开发行的证券公司短期公司债券投资策略；8、可转换债券和可交换债券投资策略；9、国债期货交易策略；10、信用衍生品投资策略。	
业绩比较基准	中债新综合指数（全价）收益率×90%+沪深 300 指数收益率×5%+恒生指数收益率×5%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金可投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	万家集利债券发起式 A	万家集利债券发起式 C
下属分级基金的交易代码	018741	018742

报告期末下属分级基金的份额总额	230,792,455.53 份	384,851,198.26 份
-----------------	------------------	------------------

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日）	
	万家集利债券发起式 A	万家集利债券发起式 C
1. 本期已实现收益	122,160.14	-266,476.68
2. 本期利润	-3,739,288.85	-5,384,640.76
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0154	-0.0158
4. 期末基金资产净值	247,521,058.46	407,419,658.56
5. 期末基金份额净值	1.0725	1.0586

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家集利债券发起式 A

阶段	净值增长率①	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	-1.45%	0.20%	0.21%	0.09%	-1.66%	0.11%
过去六个月	0.37%	0.21%	0.97%	0.11%	-0.60%	0.10%
过去一年	1.61%	0.20%	0.72%	0.11%	0.89%	0.09%
过去三年	9.55%	0.19%	8.29%	0.11%	1.26%	0.08%
自基金合同生效起至今	7.25%	0.19%	7.80%	0.11%	-0.55%	0.08%

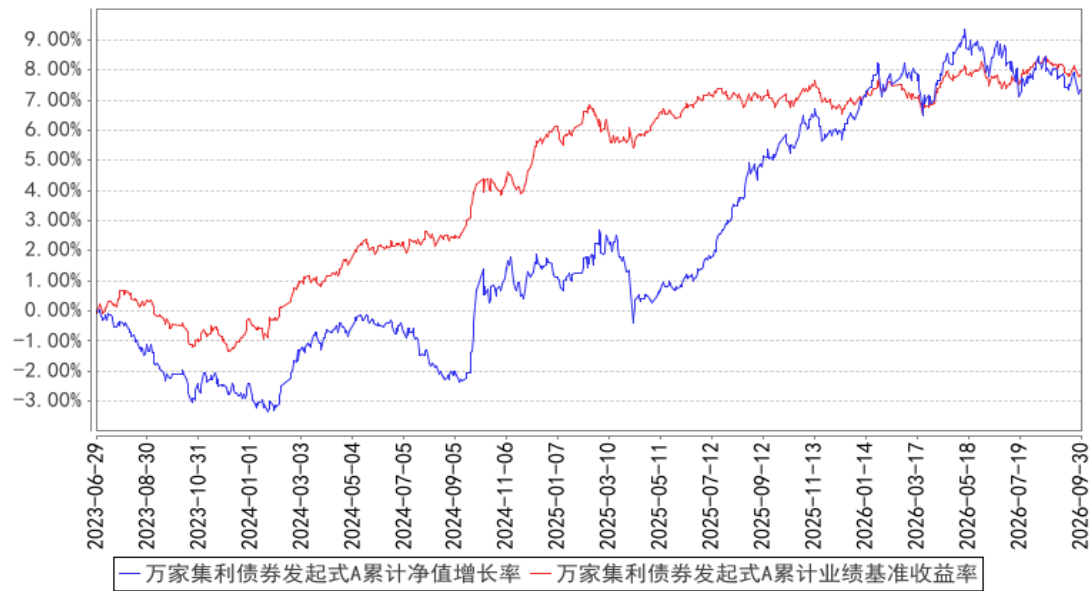
万家集利债券发起式 C

阶段	净值增长率①	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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

				④		
过去三个月	-1.56%	0.20%	0.21%	0.09%	-1.77%	0.11%
过去六个月	0.17%	0.21%	0.97%	0.11%	-0.80%	0.10%
过去一年	1.19%	0.20%	0.72%	0.11%	0.47%	0.09%
过去三年	8.24%	0.19%	8.29%	0.11%	-0.05%	0.08%
自基金合同生效起至今	5.86%	0.19%	7.80%	0.11%	-1.94%	0.08%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

万家集利债券发起式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



万家集利债券发起式C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2023 年 6 月 29 日成立，根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨若愚	万家元利债券型证券投资基金、万家民瑞祥和6个月持有期债券型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家集利债券型发起式证券投资基金的基金经	2023年6月29日	—	8.5年	国籍：中国；学历：复旦大学金融专业硕士，2021年10月入职万家基金管理有限公司，现任固定收益部基金经理，历任固定收益部可转债研究员、基金经理助理，曾任融通基金管理有限公司固定收益部研究员等职。

	理。				
段博卿	万家 1-3 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家 CFETS0-3 年期政策性金融债指数证券投资基金、万家元利债券型证券投资基金、万家玖盛纯债 9 个月定期开放债券型证券投资基金、万家鑫怡债券型证券投资基金、万家鑫耀纯债债券型证券投资基金、万家陆家嘴金融城金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家集利债券型发起式证券投资基金的基金经理。	2025 年 6 月 4 日	-	10 年	国籍：中国；学历：美国杜克大学经济学专业硕士，2021 年 4 月入职万家基金管理有限公司，现任固定收益部基金经理，历任债券投资部基金经理等职。曾任渣打银行(中国)有限公司金融市场部管培生，泰康资产管理有限公司集中交易室固定收益交易经理，平安银行股份有限公司资产管理事业部组合投资经理，长信基金管理有限公司现金理财部基金经理助理、基金经理等职。

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律、法规和监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋取最大利益，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，管理人制定了《公平交易管理办法》和《异常交易监控及报告管理办法》等规章制度，涵盖了研究、授权、投资决策和交易执行等投资管理活动的各个环节，确保公平对待不同投资组合，防范导致不公平交易以及利益输送的异常交易发生。

管理人制订了明确的投资授权制度，并建立了统一的投资管理平台，确保不同投资组合获得公平的投资决策机会。实行集中交易制度，对于交易所公开竞价交易，执行交易系统内的公平交易程序；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，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 2 次，均为指数和量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度国内经济呈现结构分化格局，外需延续韧性，内需修复节奏依旧偏弱。宏观政策继续

保持连续性，货币政策坚持适度宽松取向，市场整体流动性维持充裕状态。权益市场方面，三季度整体呈现宽幅震荡格局，市场波动有所放大，成长板块在经历二季度上涨后出现阶段性回调，板块内部分化加剧，业绩兑现成为行情演绎的核心主线。债券市场方面，货币政策保持流动性充裕，收益率曲线整体低位震荡，短端资金面维持宽松，长端受基本面预期、供给节奏交替影响呈现区间波动。转债市场整体估值仍处于相对高位，估值压缩压力有所显现，成交活跃度有所回落，板块内部分化进一步加大，高价偏股品种波动放大，具备债底保护、基本面扎实的个券表现相对抗跌，收益更多来源于自下而上精选标的。

操作方面，本基金三季度严格恪守风险预算约束，根据市场环境变化动态调整大类资产配置。权益仓位上，结合市场波动适度做了仓位的动态调节，整体维持中性偏积极水平；持仓结构上，继续坚守业绩确定性逻辑，均衡行业配置，分散组合波动风险。债券仓位上，继续保持中性久期策略，以高等级品种作为底仓获取稳定票息，结合资金面、利率波段灵活开展交易操作，控制利率波动带来的回撤。转债层面，适当降低高溢价高价偏股券的配置，重点布局转股溢价率合理、正股基本面稳健的个券，规避高估值带来的双重回撤风险。整体组合以控制回撤为前提，力争股票、债券、转债多资产协同，为持有人持续创造稳健的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家集利债券发起式 A 的基金份额净值为 1.0725 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.45%，同期业绩比较基准收益率为 0.21%；截至本报告期末万家集利债券发起式 C 的基金份额净值为 1.0586 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.56%，同期业绩比较基准收益率为 0.21%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	103,759,497.30	12.53
	其中：股票	103,759,497.30	12.53
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	713,283,148.58	86.15
	其中：债券	713,283,148.58	86.15

	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	10,700,955.32	1.29
8	其他资产	204,298.00	0.02
9	合计	827,947,899.20	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 10,197,410.70 元，占净值比例 1.56%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	428,493.00	0.07
B	采矿业	8,986,975.00	1.37
C	制造业	54,322,542.55	8.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,569,518.51	0.55
E	建筑业	475,569.00	0.07
F	批发和零售业	787,400.00	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	4,864,321.44	0.74
H	住宿和餐饮业	35,232.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,756,914.00	0.88
J	金融业	10,192,853.10	1.56
K	房地产业	583,704.00	0.09
L	租赁和商务服务业	1,479,706.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	1,015,332.00	0.16
N	水利、环境和公共设施管理业	454,942.00	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	475,470.00	0.07
Q	卫生和社会工作	87,666.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	45,448.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	93,562,086.60	14.29

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
材料	323,100.71	0.05

可选消费品	1,785,316.16	0.27
必需消费品	102,598.36	0.02
能源	431,922.61	0.07
金融	2,860,718.99	0.44
医疗保健	1,112,653.96	0.17
工业	736,290.87	0.11
信息技术	451,044.77	0.07
通信服务	1,883,330.56	0.29
公用事业	-	-
房地产	510,433.71	0.08
合计	10,197,410.70	1.56

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600938	中国海油	42,700	1,427,034.00	0.22
1	00883	中国海洋石油	21,000	431,922.61	0.07
2	688256	寒武纪	1,600	1,614,416.00	0.25
3	601319	中国人保	118,100	942,438.00	0.14
3	01339	中国人民保险集团	124,000	597,151.29	0.09
4	300750	宁德时代	5,000	1,455,550.00	0.22
5	00700	腾讯控股	3,800	1,405,920.28	0.21
6	09988	阿里巴巴-W	14,600	1,336,010.55	0.20
7	002648	卫星化学	47,800	1,267,178.00	0.19
8	600900	长江电力	42,900	1,224,366.00	0.19
9	300308	中际旭创	1,500	1,212,660.00	0.19
10	000807	云铝股份	43,400	1,137,080.00	0.17

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	130,585,570.55	19.94
2	央行票据	-	-
3	金融债券	569,822,101.37	87.00
	其中：政策性金融债	80,941,164.39	12.36
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	12,875,476.66	1.97
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	713,283,148.58	108.91

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	232380089	23 中信银行二级资本债 01A	600,000	63,617,789.59	9.71
2	232380015	23 工行二级资本债 01A	600,000	62,775,409.32	9.58
3	092280139	22 交行二级资本债 02A	600,000	62,613,090.41	9.56
4	232580050	25 中行二级资本债 02BC	500,000	51,731,441.10	7.90
5	232480033	24 建行二级资本债 02A	500,000	51,095,863.01	7.80

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金按照风险管理原则、以套期保值为目的，参与国债期货交易。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。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					14,815.73
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金基于谨慎原则，主要投资流动性好、交易活跃的国债期货合约，以降低投资组合的整体风险为目的，力争提升组合收益的同时，将回撤保持在可控范围内。

本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，中信银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局和中国人民银行的处罚，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，宁波银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行宁波市分行的处罚，上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行和国家外汇管理局上海市分局的处罚，交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局和中国人民银行的处罚，中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局和中国人民银行的处罚，中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局和中国人民银行的处罚，本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	91,703.85
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	40,581.95
4	应收利息	—
5	应收申购款	72,012.20
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	204,298.00

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	111015	东亚转债	309,880.74	0.05
2	110099	福能转债	307,986.80	0.05
3	127110	广核转债	307,200.70	0.05
4	113056	重银转债	307,063.53	0.05
5	113681	镇洋转债	305,724.04	0.05
6	127078	优彩转债	305,680.03	0.05
7	110084	贵燃转债	304,880.77	0.05
8	113631	皖天转债	297,597.19	0.05
9	113640	苏利转债	297,459.61	0.05
10	127082	亚科转债	297,153.70	0.05
11	111017	蓝天转债	296,223.43	0.05
12	127103	东南转债	292,382.82	0.04
13	127095	广泰转债	290,779.61	0.04
14	111002	特纸转债	289,742.15	0.04
15	123235	亿田转债	261,507.55	0.04
16	123247	万凯转债	204,152.14	0.03
17	123183	海顺转债	194,867.36	0.03
18	123133	佩蒂转债	193,099.63	0.03
19	113054	绿动转债	192,748.99	0.03
20	127105	龙星转债	191,710.81	0.03
21	113636	甬金转债	191,482.40	0.03
22	127099	盛航转债	191,117.75	0.03
23	113665	汇通转债	189,924.14	0.03
24	110087	天业转债	189,607.14	0.03
25	127054	双箭转债	189,287.50	0.03
26	127060	湘佳转债	189,044.70	0.03
27	113649	丰山转债	188,982.42	0.03
28	110100	龙建转债	188,738.48	0.03
29	127049	希望转 2	188,490.34	0.03
30	127059	永东转 2	188,417.26	0.03
31	113052	兴业转债	187,881.16	0.03
32	123178	花园转债	187,006.55	0.03
33	113062	常银转债	186,389.52	0.03
34	123150	九强转债	185,836.34	0.03
35	110093	神马转债	185,637.90	0.03
36	123155	中陆转债	185,513.40	0.03
37	123149	通裕转债	184,833.15	0.03
38	127064	杭氧转债	184,460.37	0.03
39	110097	天润转债	181,794.98	0.03
40	127084	柳工转 2	181,572.41	0.03
41	113695	华辰转债	181,145.99	0.03

42	110098	南药转债	181,104.96	0.03
43	113661	福 22 转债	180,444.66	0.03
44	127056	中特转债	180,296.69	0.03
45	113058	友发转债	180,070.01	0.03
46	113691	和邦转债	170,485.32	0.03
47	127053	豪美转债	128,325.62	0.02
48	123243	严牌转债	128,007.72	0.02
49	111009	盛泰转债	119,263.67	0.02
50	123224	宇邦转债	118,469.75	0.02
51	118024	冠宇转债	118,035.50	0.02
52	113648	巨星转债	117,815.47	0.02
53	113673	岱美转债	116,847.95	0.02
54	118051	皓元转债	113,273.88	0.02
55	127092	运机转债	112,969.46	0.02
56	118030	睿创转债	104,892.18	0.02
57	123241	欧通转债	96,666.14	0.01
58	123213	天源转债	94,241.41	0.01
59	118044	赛特转债	77,246.42	0.01
60	123194	百洋转债	75,343.90	0.01
61	123172	漱玉转债	75,070.95	0.01
62	113659	莱克转债	73,990.14	0.01
63	113070	渝水转债	73,543.40	0.01
64	123199	山河转债	73,291.01	0.01
65	113680	丽岛转债	73,192.34	0.01
66	123225	翔丰转债	73,140.15	0.01
67	127102	浙建转债	73,003.71	0.01
68	127108	太能转债	72,800.37	0.01
69	113643	风语转债	72,291.90	0.01
70	110095	双良转债	72,036.82	0.01
71	113067	燃 23 转债	71,440.68	0.01
72	118031	天 23 转债	71,428.66	0.01
73	127046	百润转债	70,979.68	0.01
74	123222	博俊转债	69,522.81	0.01
75	127050	麒麟转债	68,937.78	0.01

5.10.5 报告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。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家集利债券发起式 A	万家集利债券发起式 C
报告期期初基金份额总额	304,427,769.17	283,403,711.09
报告期期间基金总申购份额	67,937,044.69	285,703,454.51
减:报告期期间基金总赎回份额	141,572,358.33	184,255,967.34
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	230,792,455.53	384,851,198.26

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	万家集利债券发起式 A	万家集利债券发起式 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	24,837,333.86	5,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	24,837,333.86	5,000,000.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	-	-

注：申购份额包括红利再投、转换入份额、因份额拆分而增加的份额；赎回份额包括转换出份额、因份额合并而减少的份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	赎回	2026-09-23	-24,837,333.86	-26,777,129.63	0.00
2	赎回	2026-09-23	-5,000,000.00	-5,321,000.00	0.00
合计			-29,837,333.86	-32,098,129.63	

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

本基金成立后有 10,000,000.00 份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为 2023 年 6 月 29 日（合同生效日）起 3 年。截至本报告期期末，最低持有期限届满，发起资金持有份额为 0.00 份。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§10 备查文件目录

10.1 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、《万家集利债券型发起式证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家集利债券型发起式证券投资基金托管协议》。
- 4、万家集利债券型发起式证券投资基金 2026 年第 3 季度报告原文。
- 5、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。
- 7、本报告期内在中国证监会指定媒介公开披露的基金净值、更新招募说明书及其他临时公告。

10.2 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。

10.3 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 10 月 27 日