

万家稳健增利债券型证券投资基金

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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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	万家稳健增利债券
基金主代码	519186
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 8 月 12 日
报告期末基金份额总额	844,761,365.61 份
投资目标	严格控制投资风险的基础上，追求稳定的当期收益和基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金管理人在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上，采取积极主动地投资管理策略，通过定性与定量分析，对利率变化趋势、债券收益率曲线移动方向、信用利差等影响债券价格的因素进行评估，对不同投资品种运用不同的投资策略，并充分利用市场的非有效性，把握各类套利的机会。在风险可控的前提下，实现基金收益的最大化。 1、利率预期策略；2、期限结构配置策略；3、属类配置策略；4、债券品种选择策略；5、可转换债券投资策略；6、股票等权益类资产投资策略；7、信用债券投资的风险管理；8、中小企业私募债券投资策略。
业绩比较基准	中债-新综合全价（总值）指数收益率*85%+中证可转换债券指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%
风险收益特征	本基金是债券型证券投资基金，属于具有中低风险收益特征的基金品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。
基金管理人	万家基金管理有限公司

基金托管人	中国银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	万家稳健增利债券 A	万家稳健增利债券 C	万家稳健增利债券 D
下属分级基金的交易代码	519186	519187	024152
报告期末下属分级基金的份额总额	613,658,139.72 份	8,041,978.85 份	223,061,247.04 份

注：自 2026 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准由“中国债券总指数”调整为“中债-新综合全价（总值）指数收益率*85%+中证可转换债券指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%”。

§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）		
	万家稳健增利债券 A	万家稳健增利债券 C	万家稳健增利债券 D
1. 本期已实现收益	463,273.93	-2,504.20	15,930.65
2. 本期利润	846,532.54	2,156.08	227,476.74
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0012	0.0002	0.0012
4. 期末基金资产净值	650,663,226.15	8,472,157.12	239,180,513.43
5. 期末基金份额净值	1.0603	1.0535	1.0723

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

万家稳健增利债券 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	0.12%	0.08%	0.11%	0.04%	0.01%	0.04%
过去六个月	0.88%	0.09%	0.60%	0.05%	0.28%	0.04%
过去一年	2.82%	0.10%	0.60%	0.06%	2.22%	0.04%
过去三年	4.16%	0.11%	4.60%	0.09%	-0.44%	0.02%
过去五年	9.20%	0.14%	6.49%	0.09%	2.71%	0.05%

过去七年	19.16%	0.13%	8.83%	0.10%	10.33%	0.03%
过去十年	28.45%	0.12%	8.04%	0.10%	20.41%	0.02%
自基金合同 生效起至今	111.59%	0.19%	16.43%	0.10%	95.16%	0.09%

万家稳健增利债券 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
过去三个月	0.05%	0.08%	0.11%	0.04%	-0.06%	0.04%
过去六个月	0.74%	0.09%	0.60%	0.05%	0.14%	0.04%
过去一年	2.52%	0.10%	0.60%	0.06%	1.92%	0.04%
过去三年	3.14%	0.11%	4.60%	0.09%	-1.46%	0.02%
过去五年	7.26%	0.14%	6.49%	0.09%	0.77%	0.05%
过去七年	16.11%	0.13%	8.83%	0.10%	7.28%	0.03%
过去十年	23.69%	0.12%	8.04%	0.10%	15.65%	0.02%
自基金合同 生效起至今	98.39%	0.19%	16.43%	0.10%	81.96%	0.09%

万家稳健增利债券 D

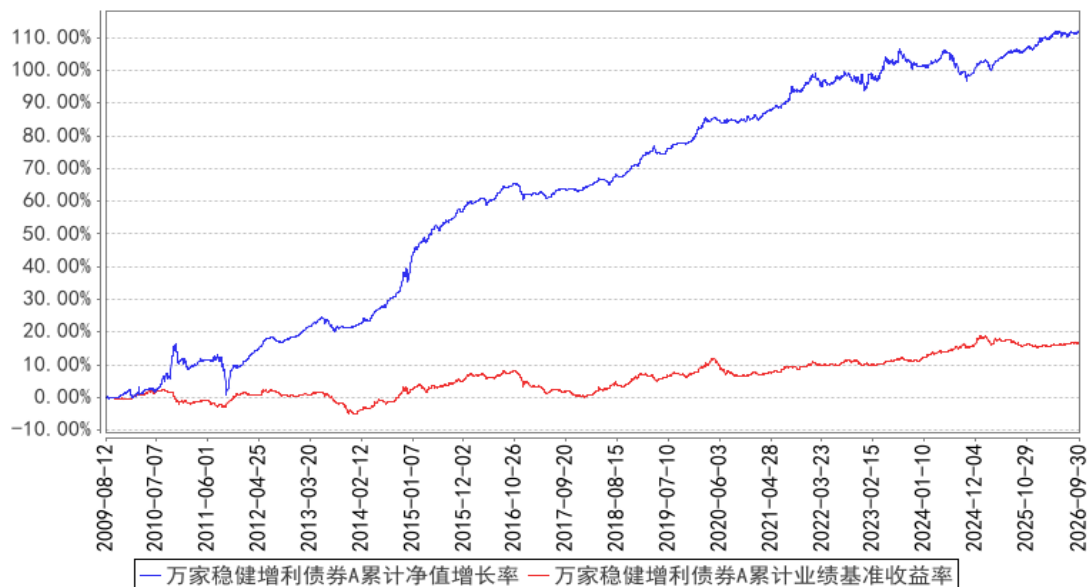
阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个月	0.13%	0.08%	0.11%	0.04%	0.02%	0.04%
过去六个月	0.89%	0.09%	0.60%	0.05%	0.29%	0.04%
过去一年	2.82%	0.10%	0.60%	0.06%	2.22%	0.04%
自基金合同 生效起至今	5.50%	0.11%	-0.87%	0.07%	6.37%	0.04%

注：万家稳健增利债券 D 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。

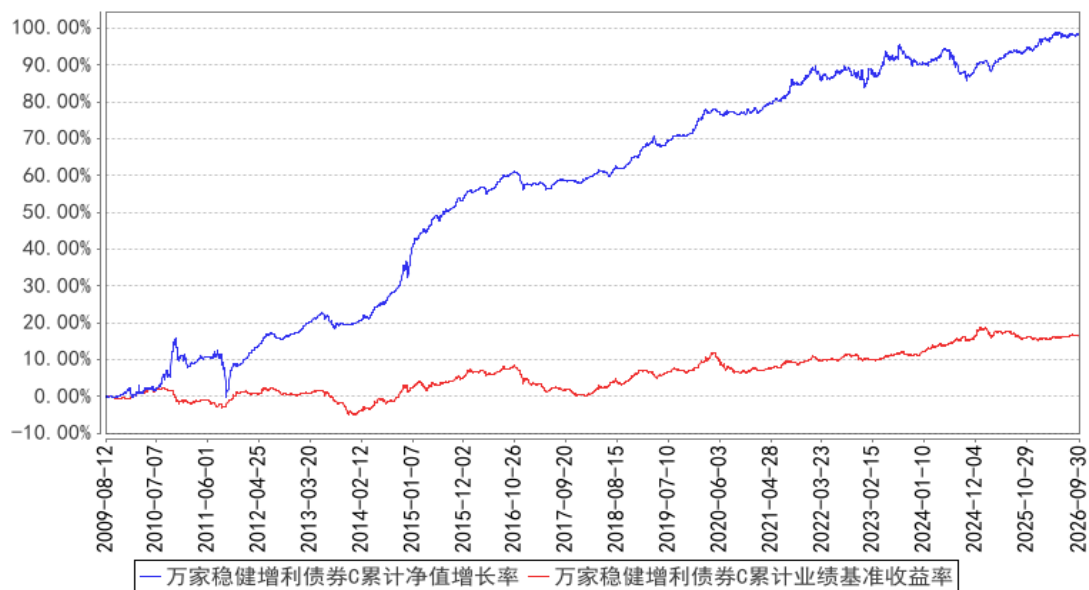
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益

率变动的比较

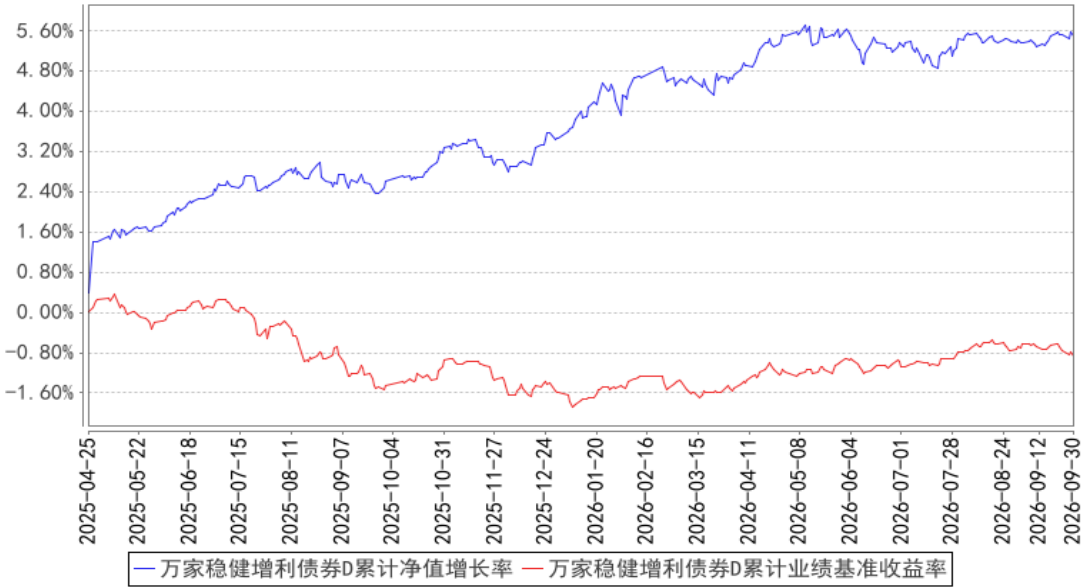
万家稳健增利债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



万家稳健增利债券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



万家稳健增利债券D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 2009 年 8 月 12 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 2025 年 4 月 24 日起增设 D 类份额，2025 年 4 月 25 日起确认有 D 类基金份额登记在册。

3、自 2026 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准由“中国债券总指数”调整为“中债-新综合全价（总值）指数收益率*85%+中证可转换债券指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%”。

§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		
徐青	万家CFETS0-3年期山东省国有企业信用债精选指数发起式证券投资基金、万家深证 AAA 科技创新公司债交	2024 年 8 月 21 日	—	15 年	国籍：中国；学历：清华大学材料科学与工程专业硕士，2022 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。曾任华泰证券股份有限公司研究所债券研究员，国联安基金管理有限公司债券组合管理部债券研究员、基金经理助理，兴业基金管理有限公司固定收益投资部基金经理等职。

	易型开放式指数证券投资基金、万家稳丰 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、万家鑫明债券型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家鼎鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。				
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	2025 年 4 月 1 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。				
石东	固定收益部部门总经理助理（主持工作）；万家悦兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家稳安 60 天持有期债券型证券投资基金、万家稳康 30 天持有期债券型证券投资基金、万家稳航 90 天持有期债券型证券投资基金、万家裕利债券型证券投资基金、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家鑫橙纯债债券型证券投资基金、万家鑫融纯债债券型证券投	2025 年 4 月 1 日	-	3.5 年	国籍：中国；学历：香港城市大学金融学专业硕士，2023 年 7 月入职万家基金管理有限公司，现任固定收益部总经理助理、基金经理，历任债券投资部总监助理、基金经理。曾任中国农业银行股份有限公司深圳市分行金融市场部证券与基金部同业业务岗，江苏银行股份有限公司资金营运中心投资发行团队债券投资岗、组合投资部总经理助理等职。

	资基金、 万家锦利 债券型发 起式证券 投资基金 的基金经 理。				
--	--	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

管理人制订了明确的投资授权制度,并建立了统一的投资管理平台,确保不同投资组合获得公平的投资决策机会。实行集中交易制度,对于交易所公开竞价交易,执行交易系统内的公平交易程序;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，经济修复动能放缓，内需不足、投资偏弱的压力仍在，实体融资需求疲软，信用扩张不畅，资产荒逻辑延续。债市出现牛平走势，短端受政策利率约束，下行空间有限，而长端则受到基本面偏弱和资产荒逻辑驱动而逐月下行，期限利差明显压缩。7 月，中上旬债市延续窄幅震荡态势，下旬隔夜逆回购工具启用，“存款降息”预期升温，宽松信号推动收益率明显下行。8 月中上旬在资产荒及摊余债基发行建仓的背景下，长债延续偏强走势，10Y 国债收益率下破 1.7% 关口。8 月下半月 MLF 缩量续作、政策刺激预期升温叠加季节性止盈是利率小幅回调的主要触发因素。9 月，10Y 国债收益率窄幅震荡，超长端成为全月最强品种。央行超额续作 MLF、隔夜逆回购规模上限升至万亿，货币宽松预期进一步发酵，交易盘拉长久期，超长债收益率向下突破。月末政策组合拳落地，债市止盈盘增加，10y 国债收益率收于 1.675%。展望四季度，组合拳落地后，对基本面的拉动或仍有限，在资金宽松、资产荒逻辑延续的支撑下，债市中期仍积极看多，后续需关注政府债供给加速，以及机构止盈需求的扰动，预计债市维持震荡偏强格局。

本季度权益市场大幅波动，经历“高位放量-缩量去杠杆-事件催化反弹-落地修复”轮动。7 月上旬成交一度超 3.3 万亿元，随后受海外科技去杠杆、韩国强平、国内科技拥挤交易影响，权益市场大幅回撤，科技普跌，红利走强，整体成交量缩至 2.4 万亿附近；8 月随英伟达业绩、地缘缓和与流动性预期修复，权益市场在科技带动下有所修复，海外链涨幅相对更大；9 月初期震荡，但加息落地后再度回归做多。指数层面，双创与半导体、光通信弹性最大，但在美债收益率上行与筹码拥挤时回撤最深；上证依靠银行、非银、红利与资源品维稳。轮动方面，医药在创新药出海、mRNA 肿瘤疫苗、AI 制药带动下成为科技回撤期的防御与中期配置方向；资源黄金、有色、煤炭、油运受央行购金、地缘与涨价共振，但 9 月停火后弹性下降；机器人受 T 链订单、宇树上市、Optimus 量产指引催化，强度弱于 AI 硬件；金融、地产、公用事业承担低位再平衡功能。

转债市场方面，三季度中证转债指数单边下跌 7%，同期正股加权指数上涨接近 1%，转债市场估值主动压缩，基本回吐今年以来相对正股的超涨。截至报告期末，转债市场中位数价格回到年初水平，但整体转股溢价率、隐含波动率显示估值仍在历史高位，高于年初，仍有一定的回落空间；除价格与估值之外，市场结构的变化亦值得关注，5 月以来转债市场稳定在 4700 亿元、300 余只的体量，但其中临期与新发转债只数合计占比超过 40%，随着临期转债剩余期限继续缩短、新发转债进入转股期，估值均面临收缩压力。基于上述，若权益市场无法复刻过去 1 年多的主升

浪行情，转债或将进入估值缓慢消化的阶段，难言系统性机会，仍需寻找结构性的交易机会。

报告期内，组合转债仓位略有下降，持仓延续双低、低价思路，在 8-9 月承受了低价转债的杀跌。到目前，考虑到低价进一步大幅下杀的空间相对有限，而高价尤其新券仍面临一定估值压缩风险，组合将延续前期操作，在低价与双低板块内寻找具备收益风险不对称性的标的进行配置，弹性个券仍以交易思路应对，力争获取更为稳健的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家稳健增利债券 A 的基金份额净值为 1.0603 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.12%，同期业绩比较基准收益率为 0.11%；截至本报告期末万家稳健增利债券 C 的基金份额净值为 1.0535 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.05%，同期业绩比较基准收益率为 0.11%；截至本报告期末万家稳健增利债券 D 的基金份额净值为 1.0723 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.13%，同期业绩比较基准收益率为 0.11%。

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	—	—
	其中：股票	—	—
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	1,023,519,629.19	98.55
	其中：债券	1,023,519,629.19	98.55
	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	15,037,433.24	1.45
8	其他资产	17,325.05	0.00
9	合计	1,038,574,387.48	100.00

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

本基金本报告期末未持有境内股票。

5.2.2 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。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	92,643,393.44	10.31
2	央行票据	—	—
3	金融债券	530,531,331.49	59.06
	其中：政策性金融债	231,431,978.08	25.76
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	327,541,178.33	36.46
7	可转债（可交换债）	72,803,725.93	8.10
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	1,023,519,629.19	113.94

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	250215	25 国开 15	1,300,000	129,928,054.79	14.46
2	2600004	26 超长特别国债 04	900,000	92,643,393.44	10.31
3	232680001	26 工行二级资本债 01BC	500,000	50,966,369.86	5.67
4	232680004	26 交行二级资本债 01BC	500,000	50,848,947.95	5.66
5	260205	26 国开 05	300,000	30,749,819.18	3.42

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10 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，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，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚，广发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和国家外汇管理局广东省分局的处罚，本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

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	10,235.54
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	7,089.51
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	17,325.05

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	127049	希望转 2	2,265,675.54	0.25
2	111015	东亚转债	1,665,110.26	0.19
3	110099	福能转债	1,651,271.93	0.18
4	127110	广核转债	1,649,462.95	0.18
5	113056	重银转债	1,643,103.24	0.18
6	110084	贵燃转债	1,636,796.34	0.18
7	127078	优彩转债	1,632,853.62	0.18
8	113681	镇洋转债	1,632,347.98	0.18
9	113640	苏利转债	1,598,366.66	0.18
10	113631	皖天转债	1,596,799.00	0.18
11	127082	亚科转债	1,594,294.19	0.18
12	111017	蓝天转债	1,591,724.20	0.18
13	127103	东南转债	1,565,960.23	0.17
14	127095	广泰转债	1,555,396.57	0.17
15	111002	特纸转债	1,554,192.89	0.17
16	123107	温氏转债	1,409,301.13	0.16
17	123235	亿田转债	1,401,971.04	0.16
18	127045	牧原转债	1,331,786.96	0.15
19	123247	万凯转债	1,092,393.01	0.12
20	123183	海顺转债	1,031,119.35	0.11
21	123133	佩蒂转债	1,025,601.99	0.11
22	113054	绿动转债	1,025,129.96	0.11
23	127105	龙星转债	1,019,435.17	0.11
24	113636	甬金转债	1,013,045.40	0.11
25	127099	盛航转债	1,012,265.03	0.11
26	113052	兴业转债	1,009,578.31	0.11
27	127054	双箭转债	1,007,925.80	0.11
28	110087	天业转债	1,006,837.93	0.11
29	123178	花园转债	1,006,206.86	0.11
30	110100	龙建转债	1,005,440.16	0.11
31	113649	丰山转债	1,004,926.77	0.11
32	123150	九强转债	1,004,307.02	0.11
33	113665	汇通转债	1,002,998.07	0.11

34	113062	常银转债	1,001,685.15	0.11
35	127059	永东转 2	1,001,123.71	0.11
36	127060	湘佳转债	999,589.32	0.11
37	123149	通裕转债	993,478.20	0.11
38	110093	神马转债	988,901.27	0.11
39	123155	中陆转债	982,204.51	0.11
40	127084	柳工转 2	979,146.04	0.11
41	110098	南药转债	976,391.97	0.11
42	127064	杭氧转债	976,158.87	0.11
43	110097	天润转债	974,199.06	0.11
44	113695	华辰转债	972,244.47	0.11
45	113058	友发转债	968,827.35	0.11
46	127056	中特转债	968,035.95	0.11
47	113661	福 22 转债	951,201.12	0.11
48	113691	和邦转债	919,546.82	0.10
49	127053	豪美转债	694,220.55	0.08
50	123243	严牌转债	692,747.67	0.08
51	111009	盛泰转债	632,458.87	0.07
52	113673	岱美转债	630,978.90	0.07
53	123224	宇邦转债	630,043.65	0.07
54	118024	冠宇转债	627,515.24	0.07
55	113648	巨星转债	626,461.13	0.07
56	118051	皓元转债	608,101.87	0.07
57	127092	运机转债	607,592.52	0.07
58	118030	睿创转债	574,146.67	0.06
59	123213	天源转债	508,407.58	0.06
60	123241	欧通转债	505,638.29	0.06
61	118044	赛特转债	414,608.33	0.05
62	123172	漱玉转债	399,061.38	0.04
63	123194	百洋转债	395,897.93	0.04
64	113659	莱克转债	392,017.93	0.04
65	123199	山河转债	389,963.51	0.04
66	113680	丽岛转债	389,003.73	0.04
67	127102	浙建转债	388,954.21	0.04
68	113070	渝水转债	388,554.28	0.04
69	123225	翔丰转债	387,780.77	0.04
70	127108	太能转债	387,055.29	0.04
71	113643	风语转债	382,312.91	0.04
72	110095	双良转债	381,570.04	0.04
73	118031	天 23 转债	380,562.53	0.04
74	113067	燃 23 转债	379,374.65	0.04
75	127046	百润转债	379,374.18	0.04

76	127050	麒麟转债	367,271.98	0.04
77	123222	博俊转债	365,689.97	0.04

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

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	万家稳健增利债券 A	万家稳健增利债券 C	万家稳健增利债券 D
报告期期初基金份额总额	727,198,225.95	10,465,292.45	268,368,980.34
报告期期间基金总申购份额	810,371.41	656,830.02	80,255,029.54
减：报告期期间基金总赎回份额	114,350,457.64	3,080,143.62	125,562,762.84
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	613,658,139.72	8,041,978.85	223,061,247.04

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申赎及买卖本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申赎及买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20260701-20260930	288,752,118.52	-	-	288,752,118.52	34.18
	2	20260701-20260930	287,637,453.22	-	94,481,481.48	193,155,971.74	22.87
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。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《万家稳健增利债券型证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家稳健增利债券型证券投资基金托管协议》。
- 4、万家稳健增利债券型证券投资基金 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。

9.2 存放地点

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

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司

2026 年 10 月 27 日