

# 万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金

## 2020 年中期报告

2020 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：2020 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 27 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 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	45
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	48
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>49</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>54</b>
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.....	54
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>55</b>

12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	万家新兴蓝筹
基金主代码	519196
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 1 月 26 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	1,293,741,879.69 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金投资于中国经济中具有代表性和竞争力的蓝筹公司。在有效控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳定增值，力争使基金份额持有人分享中国经济持续成长的成果。
投资策略	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，采取积极主动地的投资管理策略，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、信用利差等影响固定收益投资品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。在信用风险可控的前提下，寻求组合流动性与收益的最佳配比，力求持续取得达到或超过业绩比较基准的收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*50% + 中证全债指数收益率*50%
风险收益特征	本基金是混合型基金，风险高于货币市场基金和债券型基金但低于股票型基金，属于中高风险、中高预期收益的证券投资基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		万家基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	李申
	联系电话	021-38909626	021-60637102
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4008880800	021-60637111
传真		021-38909627	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验	北京市西城区金融大街 25 号

	区浦电路 360 号 8 层(名义楼层 9 层)	
办公地址	中国(上海)自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层(名义楼层 9 层)	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200122	100033
法定代表人	方一天	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.wjasset.com">http://www.wjasset.com</a>
基金中期报告备置地点	中国(上海)自由贸易试验区浦电路 8 层(名义楼层 9 层)

## 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(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	304,484,411.34
本期利润	386,563,301.95
加权平均基金份额本期利润	0.2405
本期加权平均净值利润率	19.32%
本期基金份额净值增长率	25.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	91,746,660.37
期末可供分配基金份额利润	0.0709
期末基金资产净值	1,791,143,093.43
期末基金份额净值	1.3845
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	105.37%

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。

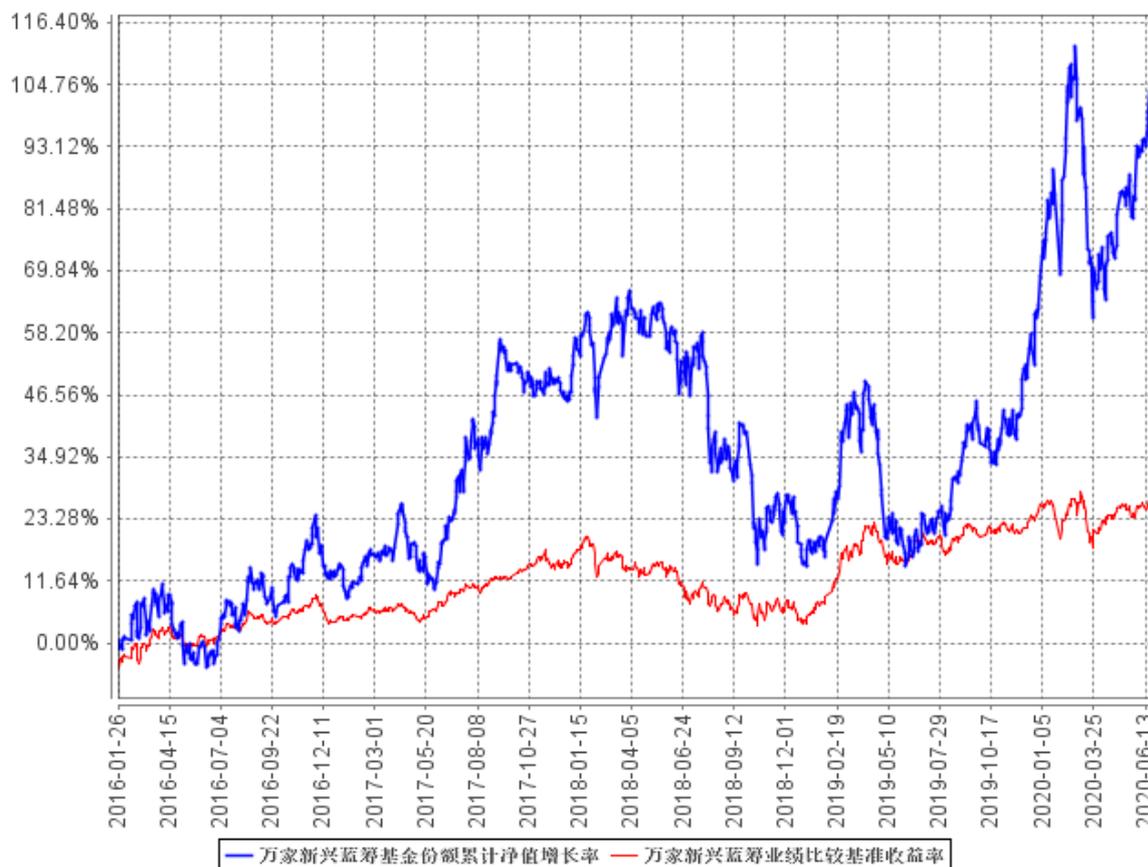
#### 3.2 基金净值表现

##### 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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	10.45%	1.20%	3.34%	0.44%	7.11%	0.76%
过去三个月	22.83%	1.43%	6.14%	0.45%	16.69%	0.98%
过去六个月	25.73%	2.13%	2.46%	0.74%	23.27%	1.39%
过去一年	73.24%	1.75%	7.64%	0.60%	65.60%	1.15%
过去三年	66.37%	1.61%	16.99%	0.62%	49.38%	0.99%
自基金合同生效起至今	105.37%	1.53%	28.09%	0.59%	77.28%	0.94%

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

万家新兴蓝筹基金份额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 2016 年 1 月 26 日成立，根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44号文批准设立。公司现股东为中泰证券股份有限公司、新疆国际实业股份有限公司和齐河众鑫投资有限公司,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),办公地点:上海市浦东新区浦电路360号9楼,注册资本3亿元人民币。目前管理七十八只开放式基金,分别为万家180指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选混合型证券投资基金(LOF)、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金(LOF)、万家添利债券型证券投资基金(LOF)、万家新机遇价值驱动灵活配置混合型证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家上证50交易型开放式指数证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞和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、万家颐和灵活配置混合型证券投资基金、万家恒瑞18个月定期开放债券型证券投资基金、万家3-5年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家鑫璟纯债债券型证券投资基金、万家鑫安纯债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、万家家享中短债债券型证券投资基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞隆混合型证券投资基金、万家1-3年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家现金增利货币市场基金、万家消费成长股票型证券投资基金、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家玖盛纯债9个月定期开放债券型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家天添宝货币市场基金、万家家瑞债券型证券投资基金、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金、万家潜力价值灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金、万家经济新动能混合型证券投资基金、万

家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家臻选混合型证券投资基金、万家成长优选灵活配置混合型证券投资基金、万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家新机遇龙头企业灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型证券投资基金、万家智造优势混合型证券投资基金、万家稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、万家人工智能混合型证券投资基金、万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金 (LOF)、万家平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、万家民安增利 12 个月定期开放债券型证券投资基金、万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫盛纯债债券型证券投资基金、万家汽车新趋势混合型证券投资基金、万家惠享 39 个月定期开放债券型证券投资基金、万家科技创新混合型证券投资基金、万家自主创新混合型证券投资基金、万家民丰回报一年持有期混合型证券投资基金、万家可转债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、万家价值优势一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫动力月月购一年滚动持有混合型证券投资基金、万家养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF)。

#### 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		
莫海波	万家和谐增长混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资	2016 年 1 月 26 日	-	10 年	美国圣约翰大学 MBA。 2010 年 3 月至 2011 年 2 月在财富证券有限责任公司任分析师、投资经理助理, 2011 年 2 月至 2015 年 3 月在中银国际证券有限责任公司任投资经理; 2015 年 3 月进入万家基金管理有限公司, 从事投资研究工作, 自 2015 年 5 月起担任基金经理职务, 现任公司总经理助理、投资研究部总监、基金经理。”

	资基金、 万家臻选 混合型证 券投资基 金、万家 社会责任 18 个月 定期开放 混合型证 券投资基 金(LOF)、 万家价值 优势一年 持有期混 合型证券 投资基金 的基金经 理。				
--	--	--	--	--	--

#### 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

本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《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》,公司制定了《万家基金管理有限公司公平交易管理办法》,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,严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送,确保公平对待不同投资组合。

在投资决策上:(1)公司对不同类别的投资组合分别设定独立的投资部门,公募基金经理和特定客户资产管理投资经理不得互相兼任。(2)公司投资管理实行分层次决策,投资决策委员会下设的公募基金投资决策小组和专户投资决策小组分别根据公募基金和专户投资组合的规模、风格特征等因素合理确定各投资组合经理的投资权限,投资组合经理在授权范围内自主决策,超过投资权限的操作需经过严格的逐级审批程序。(3)公司接受的外部研究报告、研究员撰写的研究报告等均

通过统一的投研管理平台发布, 确保各投资组合经理在获得投资信息、投资建议和实施决策方面享有公平的机会。

在交易执行上: (1) 公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离, 实行集中交易制度; (2) 对于交易公开竞价交易, 所有指令必须通过系统下达, 公司执行交易系统内的公平交易程序; (3) 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, 各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量, 公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配; (4) 对于银行间交易, 交易部按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。

在行为监控上, 公司定期对不同投资组合的同向交易价差、反向交易, 场外交易对手议价的價格公允性及其他异常交易情况进行监控及分析, 基金经理对异常交易情况进行合理性解释并留存记录, 并定期编制公平交易分析报告, 由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

#### 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表交易量超过了该证券当日成交量的 5% 的交易共有 6 次, 为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, 有关基金经理按规定履行了审批程序。

#### 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

2020 年二季度, 全球受到新型肺炎疫情的影响持续发酵, 尤其是美国新增确诊病例数还在增长, 不断创出新高, 全球经济上受疫情冲击, 各主要国家纷纷采取了非常规货币宽松政策, 以抵御自身经济衰退的风险。美国针对华为做出了一些限制, 又将越来越多的中国企业列入了“实体清单”名单, 中国政府颁布“国安法”, 美国联合 G7 制裁中国, 中印边境也再生事端。海外经济, 尤其是美国、印度、俄罗斯等对全球经济有着重大影响力的国家和地区, 目前仍然受困于严重的疫情影响, 9 月开始, 美国将进入为期三个月的总统大选期, 这也会对全球经济形成一定的冲击。从二季度国内经济情况来看, 国内经济受到疫情的影响相对较小, 适当的逆周期调节政策可以在较大的程度上缓解疫情带来的压力。但是海外经济的不确定性, 使得国内出口承压, 就业和消费市场也都受到了一定程度的影响。

2020 年上半年 A 股呈现一个宽幅震荡格局。指数方面, 创业板指大涨 35.6%, 沪深 300 微涨 1.64%, 上证综指和上证 50 分别收跌 2.15% 和 3.95%, 市场风格方面成长优于蓝筹。本产品保持了偏左侧和稳健的投资风格, 上半年减持了消费电子和半导体, 增加了低估值的地产板块, 目前结

构上主要配置在新能源汽车、低估值及高分红的地产。

权益市场在过去两年多的时间里，连续受到了 2018 年国内去杠杆政策影响、2018-2019 年中美贸易关税影响、2020 年新冠疫情影响，上证指数大部分时间都被压制在 3000 点下方。我们认为，上证综指的表现，已经很大程度上反应了中国经济所面临的内部外部压力，但我们也看到的过去一年，国内的流动性在改善、政策也在积极引导资金进入股票市场，并已经在消费和科技领域逐渐形成了比较好的赚钱效应，提高投资者对于 A 股市场的认同度。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.3845 元；本报告期基金份额净值增长率为 25.73%，业绩比较基准收益率为 2.46%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

往后看，经济复苏仍然是大方向，但疫情对消费的抑制将继续存在，意味着消费增速的大幅回升，存在难度，相应的，GDP 里面占比很大的消费服务业也难以恢复正常，下半年 GDP 增速向 5%以上增速回归难度较大。如果疫情显著缓解或者疫苗出来，经济预期的想象空间将打开。

具体看好行业上，最看好新能源，其次是地产、电子等。目前对新能源汽车板块观点不变，继续乐观。基本面层面国内排产开始逐步恢复，海外政策进一步升温。地产当前也相对看好，基本面有边际改善（销售、利润率、限价等），地产长期价值被低估，股息率高，安全边际高，这个位置可以加强配置。消费电子板块看，智能手机市场越来越成为一个存量市场，我们更多看好可穿戴设备快速渗透的机会和 5G 带来的产业链中结构性的机会。我们还看好面板等相对成熟的电子产业在经过多年的产能过剩之后的海外产能退出带来的供给格局改善的投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了估值委员会,定期评价现行估值政策和程序,在发生了影响估值政策和程序有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。估值委员会由督察长、基金运营部负责人、合规稽核部负责人、权益投资部负责人、固定收益部负责人等组成。估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关从业资格,精通各自领域的理论知识,熟悉政策法规,并具有丰富的实践经验。

##### 2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不介入基金日常估值业务。

##### 3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

##### 4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中债金融估值中心有限公司签署了《中债信息产品服务协议》，本基金管理人与中证指数有限公司签署了《中证债券估值数据服务协议》。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。本基金本报告期内未进行利润分配。

#### **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，本基金没有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况。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本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,本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核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：万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	173,031,057.40	47,200,328.21
结算备付金		10,349,137.75	11,815,461.88
存出保证金		1,158,143.80	354,716.48
交易性金融资产	6.4.7.2	1,631,050,293.02	1,599,633,351.41
其中：股票投资		1,631,050,293.02	1,529,621,351.41
基金投资		-	-
债券投资		-	70,012,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	4,589,626.64
应收利息	6.4.7.5	44,628.91	646,284.03
应收股利		-	-
应收申购款		3,213,808.63	1,762,957.36
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,818,847,069.51	1,666,002,726.01
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		24,031,347.33	25,932,763.02
应付管理人报酬		2,159,513.83	2,022,398.91
应付托管费		359,918.94	337,066.46
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	792,663.96	374,469.78
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	360,532.02	314,900.45
负债合计		27,703,976.08	28,981,598.62
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,293,741,879.69	1,486,542,932.84
未分配利润	6.4.7.10	497,401,213.74	150,478,194.55
所有者权益合计		1,791,143,093.43	1,637,021,127.39
负债和所有者权益总计		1,818,847,069.51	1,666,002,726.01

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3845 元，基金份额总额 1,293,741,879.69 份。

## 6.2 利润表

会计主体：万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		412,097,142.60	191,580,270.09
1.利息收入		1,446,467.16	805,788.32
其中：存款利息收入	6.4.7.11	888,708.65	784,275.49
债券利息收入		557,758.51	21,512.83
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		321,693,237.88	-73,868,316.86
其中：股票投资收益	6.4.7.12	307,454,493.51	-81,820,702.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	366,030.00	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
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	13,872,714.37	7,952,385.16
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	82,079,112.26	261,764,540.15
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	6,878,325.30	2,878,258.48
<b>减：二、费用</b>		25,533,840.65	22,374,979.80

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	14,924,638.31	15,551,138.12
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,487,439.61	2,591,856.38
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	8,011,093.04	4,106,714.83
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	110,669.69	125,270.47
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		386,563,301.95	169,205,290.29
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		386,563,301.95	169,205,290.29

注：其他利息收入为期货利息收入。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,486,542,932.84	150,478,194.55	1,637,021,127.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	386,563,301.95	386,563,301.95
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-192,801,053.15	-39,640,282.76	-232,441,335.91
其中：1.基金申购款	1,639,556,457.78	429,264,604.80	2,068,821,062.58
2.基金赎回款	-1,832,357,510.93	-468,904,887.56	-2,301,262,398.49
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,293,741,879.69	497,401,213.74	1,791,143,093.43



司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行、上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率\*50%+中证全债指数收益率\*50%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则-基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、证监会公告[2010]5 号关于发布《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>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本半年度报告所采取的会计政策、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 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

##### 1、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。

## 2、增值税

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，继续免征营业税；

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，管理人接受投资者委托或信托对受托资产提供的管理服务以及管理人发生的其他增值税应税行为，按照现行规定缴纳增值税，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。本通知自 2018 年 1 月 1 日起施行，对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

## 3、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。

#### 4、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。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	173,031,057.40
定期存款	-
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	-
合计：	173,031,057.40

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,329,702,148.27	1,631,050,293.02	301,348,144.75
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	1,329,702,148.27	1,631,050,293.02	301,348,144.75

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

### 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

本报告期末本基金未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	27,657.30
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-

应收结算备付金利息	15,849.46
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	601.05
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	521.10
合计	44,628.91

注：其他为应收清算备付金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	792,663.96
银行间市场应付交易费用	-
合计	792,663.96

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	51,024.42
应付证券出借违约金	-
预提费用	309,507.60
合计	360,532.02

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,486,542,932.84	1,486,542,932.84

本期申购	1,639,556,457.78	1,639,556,457.78
本期赎回(以“-”号填列)	-1,832,357,510.93	-1,832,357,510.93
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,293,741,879.69	1,293,741,879.69

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-157,657,936.29	308,136,130.84	150,478,194.55
本期利润	304,484,189.69	82,079,112.26	386,563,301.95
本期基金份额交易产生的变动数	-55,079,593.03	15,439,310.27	-39,640,282.76
其中：基金申购款	-53,159,934.53	482,424,539.33	429,264,604.80
基金赎回款	-1,919,658.50	-466,985,229.06	-468,904,887.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	91,746,660.37	405,654,553.37	497,401,213.74

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	751,292.03
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	128,314.40
其他	9,102.22
合计	888,708.65

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,720,417,229.43
减：卖出股票成本总额	2,412,962,735.92
买卖股票差价收入	307,454,493.51

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	366,030.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	366,030.00

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	71,187,000.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	69,633,970.00
减：应收利息总额	1,187,000.00
买卖债券差价收入	366,030.00

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金报告期内未持有资产支持证券。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金报告期内未投资贵金属。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金报告期内未投资衍生工具。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	13,872,714.37
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	13,872,714.37

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	82,079,112.26
——股票投资	82,457,142.26
——债券投资	-378,030.00
——资产支持证券投资	-
——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	82,079,112.26

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	6,754,978.60
转换费	123,346.70
合计	6,878,325.30

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	8,011,093.04
银行间市场交易费用	-

交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	8,011,093.04

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费用	12,162.09
债券帐户维护费	9,000.00
其他	-
合计	110,669.69

#### 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

截至本财务报表批准日,本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内,与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司	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”)	基金管理人股东、基金销售机构

## 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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	1,219,354,811.62	23.71%	173,044,529.40	6.94%

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方席位进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期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 2020年1月1日至2020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	1,135,586.62	23.71%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	161,156.97	6.94%	-	0.00%

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	14,924,638.31	15,551,138.12
其中：支付销售机构的客户维护费	3,166,400.66	2,831,630.63

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提, 按月支付。由托管人根据与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, 管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等, 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 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,487,439.61	2,591,856.38

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提, 按月支付。由托管人根据与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, 管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等, 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

本基金本报告期末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无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。

#### 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无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。

#### 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	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2016 年 1 月 26 日）持有的基金份额	0	-
报告期初持有的基金份额	8,325,682.32	8,325,682.32
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	8,325,682.32	-
报告期末持有的基金份额	0.00	8,325,682.32
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	0.4575%

##### 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

##### 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		上年度可比期间	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		2019 年 1 月 1 日至 2019 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	173,031,057.40	751,292.03	79,728,575.29	744,080.22

注：本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2020 年 1 月 1 日至 6 月 30 日获得的利息为人民币 33,284.43 元（2019 年 1 月 1 日至 6 月 30 日获得的利息为 16,174.08 元），2020 年 6 月 30 日结算备付金余额为人民币 10,349,137.75 元（2019 年 6 月 30 日结算备付金余额为 0.00 元）。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

报告期内及上年度可比期间, 本基金无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2020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	可流通日	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
688377	迪威尔	2020年6月29日	2020年7月8日	新股流通受限	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688277	天智航	2020年6月24日	2020年7月7日	新股流通受限	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688027	国盾量子	2020年6月30日	2020年7月9日	新股流通受限	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688528	秦川物联	2020年6月19日	2020年7月1日	新股流通受限	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688600	皖仪科技	2020年6月23日	2020年7月3日	新股流通受限	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-
688051	佳华科技	2020年3月12日	2020年9月21日	新股流通受限	50.81	120.27	4,053	205,932.93	487,454.31	-
688026	洁特生物	2020年1月15日	2020年7月22日	新股流通受限	16.49	83.32	4,433	73,100.17	369,357.56	-
688189	南新制药	2020年3月18日	2020年9月28日	新股流通受限	34.94	50.21	6,833	238,745.02	343,084.93	-
688157	松井股份	2020年5月29日	2020年12月9日	新股流通受限	34.48	86.64	3,402	117,300.96	294,749.28	-
688228	开普云	2020年3月19日	2020年9月	新股流通受限	59.26	73.20	2,718	161,068.68	198,957.60	-

		日	28 日							
300847	中船汉光	2020 年 06 月 29 日	2020 年 7 月 9 日	新股流通受限	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	
300845	捷安高科	2020 年 6 月 24 日	2020 年 07 月 03 日	新股流通受限	17.63	17.63	470	8,286.1	8,286.1	
300843	胜蓝股份	2020 年 06 月 23 日	2020 年 07 月 02 日	新股流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	
300840	酷特智能	2020 年 06 月 30 日	2020 年 07 月 08 日	新股流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.9	7,038.9	
300846	首都在线	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 01 日	新股流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有因暂时停牌而于期末持有的流通受限的证券。

#### 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

本基金本报告期末无银行间债券正回购,因此没有在债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所债券正回购,因此没有在债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了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。

#### 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,建立了三道防线:以各岗位目标责任制为基础,形成第一道防线;通过相关部门、相关岗位之间相互监督制衡,形成第二道防线;由监察稽核部门、督察长对各岗位、各部门、各机构、各项业务实施监督反馈,形成第三道防线。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金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。本基金投资于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的证券,不得超过该证券的 10%。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行,申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外,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;基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估,以控制相应的信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

短期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	30,048,000.00
合计	-	30,048,000.00

注:本基金本报告期末未持有债券。

**6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资**

长期信用评级	本期末 2020 年 06 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	39,964,000.00
合计	-	39,964,000.00

注：本基金本报告期末未持有债券。

**6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**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。

本基金所持大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,本期末本基金的资产均能及时变现。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**

本基金主要投资于股票市场。公司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。本基金运作期间公司对组合短期变现能力、流动性受限资产比例等流动性指标进行持续的监测和评估,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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2020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							
银行存款	173,031,057.40	-	-	-	-	-	173,031,057.40
结算备付金	10,349,137.75	-	-	-	-	-	10,349,137.75
存出保证金	1,158,143.80	-	-	-	-	-	1,158,143.80
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,631,050,293.02	1,631,050,293.02
应收利息	-	-	-	-	-	44,628.91	44,628.91
应收申购款	3,188.31	-	-	-	-	3,210,620.32	3,213,808.63
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	184,541,527.26	-	-	-	-	1,634,305,542.25	1,818,847,069.51
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	24,031,347.33	24,031,347.33
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,159,513.83	2,159,513.83
应付托管费	-	-	-	-	-	359,918.94	359,918.94
应付交易费用	-	-	-	-	-	792,663.96	792,663.96
其他负债	-	-	-	-	-	360,532.02	360,532.02
负债总计	-	-	-	-	-	27,703,976.08	27,703,976.08
利率敏感度缺口	184,541,527.26	-	-	-	-	1,606,601,566.17	1,791,143,093.43
上年度末 2019年12月	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

31 日							
资产							
银行存款	47,200,328.21	-	-	-	-	-	47,200,328.21
结算备付金	11,815,461.88	-	-	-	-	-	11,815,461.88
存出保证金	354,716.48	-	-	-	-	-	354,716.48
交易性金融资产	39,964,000.00	-30,048,000.00	-	-	-1,529,621,351.41	-	1,599,633,351.41
应收证券清算款	-	-	-	-	-	4,589,626.64	4,589,626.64
应收利息	-	-	-	-	-	646,284.03	646,284.03
应收申购款	-	-	-	-	-	1,762,957.36	1,762,957.36
资产总计	99,334,506.57	-30,048,000.00	-	-	-1,536,620,219.44	-	1,666,002,726.01
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	25,932,763.02	25,932,763.02
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,022,398.91	2,022,398.91
应付托管费	-	-	-	-	-	337,066.46	337,066.46
应付交易费用	-	-	-	-	-	374,469.78	374,469.78
其他负债	-	-	-	-	-	314,900.45	314,900.45
负债总计	-	-	-	-	-	28,981,598.62	28,981,598.62
利率敏感度缺口	99,334,506.57	-30,048,000.00	-	-	-	-1,507,638,620.82	1,637,021,127.39

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 若市场利率发生变动而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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	-	62,098.33
2. 市场利率上升 25 个基点	-	-61,891.18	

注：该表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

#### 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

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场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。本基金均投资于证券交易所上市的股票,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 2020年6月30日		上年度末 2019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	1,631,050,293.02	91.06	1,529,621,351.41	93.44
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	70,012,000.00	4.28
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	1,631,050,293.02	91.06	1,599,633,351.41	97.72

注:股票投资占基金资产的 0%-95%,投资于新兴蓝筹主题的证券不低于非现金基金资产的 80%。

其中,基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;于资产负债表日,本基金面临的整体市场价格风险列示如表中数据。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 若股票基准指数发生变动而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(2020年6月30日)	上年度末(2019年12月31日)
	1. 股票基准指数下降 100 个基点	-20,874,611.71	-18,557,269.81
2. 股票基准指数上升 100 个基点	20,874,611.71	18,557,269.81	

注：本基金管理人运用资本-资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。表中为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### **6.4.14 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	1,631,050,293.02	89.67
	其中：股票	1,631,050,293.02	89.67
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	183,380,195.15	10.08
8	其他各项资产	4,416,581.34	0.24
9	合计	1,818,847,069.51	100.00

### 7.2 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	33,002,522.00	1.84
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,109,585,518.00	61.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	12,020,272.00	0.67
F	批发和零售业	85,816,151.42	4.79
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	698,509.48	0.04
J	金融业	-	-
K	房地产业	225,956,991.00	12.62
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	141,153,315.80	7.88
S	综合	22,804,247.00	1.27
	合计	1,631,050,293.02	91.06

### 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	占基金资产净值比例（%）
1	002594	比亚迪	2,295,550	164,820,490.00	9.20
2	603986	兆易创新	658,131	155,259,684.21	8.67
3	002460	赣锋锂业	2,892,072	154,928,297.04	8.65
4	300750	宁德时代	836,544	145,859,811.84	8.14
5	300413	芒果超媒	2,164,914	141,152,392.80	7.88
6	000333	美的集团	1,936,400	115,777,356.00	6.46
7	002074	国轩高科	3,522,379	94,540,652.36	5.28
8	600048	保利地产	5,629,646	83,206,167.88	4.65
9	688388	嘉元科技	1,168,785	65,861,034.75	3.68
10	000002	万科A	2,460,208	64,309,837.12	3.59
11	000651	格力电器	1,080,620	61,130,673.40	3.41
12	600600	青岛啤酒	791,200	60,526,800.00	3.38
13	603883	老百姓	584,507	58,474,080.28	3.26
14	000671	阳光城	7,774,900	49,292,866.00	2.75
15	688006	杭可科技	925,820	41,606,350.80	2.32
16	002299	圣农发展	1,138,018	33,002,522.00	1.84
17	600383	金地集团	2,127,600	29,148,120.00	1.63
18	002024	苏宁易购	3,117,682	27,342,071.14	1.53
19	600703	三安光电	997,100	24,927,500.00	1.39
20	000009	中国宝安	2,679,700	22,804,247.00	1.27
21	601186	中国铁建	1,434,400	12,020,272.00	0.67
22	002497	雅化集团	1,267,807	11,701,858.61	0.65
23	688396	华润微	81,911	3,558,213.84	0.20
24	688169	石头科技	5,382	2,028,475.80	0.11
25	000636	风华高科	65,600	1,914,864.00	0.11

26	688505	复旦张江	22,688	772,072.64	0.04
27	603799	华友钴业	19,500	757,770.00	0.04
28	688166	博瑞医药	8,041	497,657.49	0.03
29	688051	佳华科技	4,053	487,454.31	0.03
30	688026	洁特生物	4,433	369,357.56	0.02
31	688189	南新制药	6,833	343,084.93	0.02
32	688157	松井股份	3,402	294,749.28	0.02
33	688089	嘉必优	5,546	287,781.94	0.02
34	688101	三达膜	13,483	286,513.75	0.02
35	002185	华天科技	19,270	260,723.10	0.01
36	688300	联瑞新材	3,164	217,619.92	0.01
37	688228	开普云	2,718	198,957.60	0.01
38	002371	北方华创	866	148,008.06	0.01
39	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.01
40	603392	万泰生物	785	129,525.00	0.01
41	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.01
42	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.01
43	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.01
44	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.01
45	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.00
46	300837	浙矿股份	737	33,187.11	0.00
47	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
48	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.00
49	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
50	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
51	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
52	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
53	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
54	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
55	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
56	002810	山东赫达	202	6,819.52	0.00
57	002241	歌尔股份	200	5,872.00	0.00
58	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00
59	300364	中文在线	130	923.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002594	比亚迪	174,982,489.36	10.69
2	600703	三安光电	168,003,100.95	10.26
3	300450	先导智能	149,501,838.77	9.13
4	300750	宁德时代	147,995,659.00	9.04
5	300073	当升科技	136,127,745.57	8.32
6	002074	国轩高科	102,243,801.95	6.25
7	000333	美的集团	97,755,353.59	5.97
8	002185	华天科技	94,686,177.01	5.78
9	002497	雅化集团	94,491,934.90	5.77
10	300223	北京君正	93,556,573.50	5.72
11	002146	荣盛发展	83,412,522.09	5.10
12	688388	嘉元科技	79,518,217.03	4.86
13	000002	万科A	77,537,693.98	4.74
14	600884	杉杉股份	77,330,786.30	4.72
15	600383	金地集团	65,206,056.33	3.98
16	300618	寒锐钴业	64,446,706.21	3.94
17	002714	牧原股份	63,575,899.68	3.88
18	000671	阳光城	60,124,417.11	3.67
19	000651	格力电器	58,567,791.03	3.58
20	300413	芒果超媒	51,658,838.30	3.16
21	002624	完美世界	48,119,812.74	2.94
22	688006	杭可科技	45,688,769.19	2.79
23	603799	华友钴业	44,147,231.82	2.70
24	300207	欣旺达	44,029,144.86	2.69
25	002460	赣锋锂业	42,285,413.07	2.58
26	300136	信维通信	41,927,930.88	2.56
27	600048	保利地产	40,411,542.92	2.47
28	600600	青岛啤酒	39,860,424.00	2.43
29	000636	风华高科	35,306,843.00	2.16

注：买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，“买入金额”按买卖成交金额(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	603799	华友钴业	229,910,606.96	14.04
2	002371	北方华创	218,003,621.44	13.32
3	600703	三安光电	210,526,324.94	12.86
4	300618	寒锐钴业	182,848,481.08	11.17
5	300450	先导智能	151,467,222.95	9.25
6	300073	当升科技	122,442,471.66	7.48
7	002384	东山精密	113,891,691.07	6.96
8	603986	兆易创新	100,456,430.42	6.14
9	002497	雅化集团	96,164,187.68	5.87
10	300136	信维通信	94,358,850.13	5.76
11	002624	完美世界	92,162,466.63	5.63
12	002185	华天科技	86,860,127.01	5.31
13	002460	赣锋锂业	82,808,783.23	5.06
14	002714	牧原股份	81,174,077.38	4.96
15	002241	歌尔股份	80,098,702.46	4.89
16	002146	荣盛发展	79,867,527.12	4.88
17	300223	北京君正	75,992,704.01	4.64
18	600884	杉杉股份	74,013,705.80	4.52
19	300059	东方财富	51,506,269.59	3.15
20	300568	星源材质	50,057,585.62	3.06
21	600383	金地集团	37,422,623.33	2.29
22	600030	中信证券	36,636,759.00	2.24
23	300113	顺网科技	35,952,052.00	2.20
24	300033	同花顺	34,679,337.49	2.12

### 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	2,431,934,535.27
卖出股票收入（成交）总额	2,720,417,229.43

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金报告期末未持有债券投资。

### 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

本基金报告期末未持有债券投资。

**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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金报告期末未持有股指期货。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

在股指期货投资上，本基金以避险保值和有效管理为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中，将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约，通过研究现货和期货市场的发展趋势，运用定价模型对其进行合理估值，谨慎利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，及时调整投资组合仓位，以降低组合风险、提高组合的运作效率。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**7.11.1 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末无国债期货投资。

**7.12 投资组合报告附注****7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明**

基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	1,158,143.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	44,628.91
5	应收申购款	3,213,808.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,416,581.34

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

## § 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

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
37,471	34,526.48	752,977,973.34	58.20%	540,763,906.35	41.80%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	3,425,962.21	0.2648%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年1月26日）基金份额总额	249,064,678.74
本报告期期初基金份额总额	1,486,542,932.84
本报告期基金总申购份额	1,639,556,457.78
减：本报告期基金总赎回份额	1,832,357,510.93
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1,293,741,879.69

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

公司高级管理人员：

2020 年 1 月 16 日起，沈芳女士不再担任公司副总经理职务。

基金托管人：

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国盛证券	1	1,263,730,887.83	24.58%	1,176,913.51	24.58%	-
中泰证券	2	1,219,354,811.62	23.71%	1,135,586.62	23.71%	-
国信证券	1	973,436,029.03	18.93%	906,561.43	18.93%	-
天风证券	2	580,565,228.17	11.29%	540,681.84	11.29%	-
华创证券	2	406,959,050.75	7.91%	379,001.42	7.91%	-
信达证券	2	264,905,652.52	5.15%	246,706.57	5.15%	-
东兴证券	1	204,846,507.94	3.98%	190,773.77	3.98%	-

国泰君安	1	158,365,837.02	3.08%	147,486.09	3.08%	-
国金证券	1	23,450,487.57	0.46%	21,838.86	0.46%	-
兴业证券	2	22,885,616.88	0.45%	21,313.46	0.45%	-
光大证券	1	18,719,035.76	0.36%	17,433.63	0.36%	-
安信证券	2	4,959,970.00	0.10%	4,619.63	0.10%	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
中银国际	3	-	-	-	-	-

注:1、基金专用交易席位的选择标准如下:

- (1) 经营行为稳健规范,内控制度健全,在业内有良好的声誉;
- (2) 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要;
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于:有较好的研究能力和行业分析能力,能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息;能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告,具有开发量化投资组合模型的能力;能积极为公司投资业务的开展,投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

3、报告期内基金租用证券公司交易单元的变更情况：

新增东北证券交易单元 1 个、恒泰证券交易单元 1 个、华泰证券交易单元 2 个、天风证券交易单元 2 个、华创证券交易单元 2 个、光大证券交易单元 1 个。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

恒泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

## § 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	20200427 - 20200630	50,874,033.37	264,477,885.18	0.00	315,351,918.55	24.38%
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p>							

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金发行及募集的文件。
- 2、《万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 4、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金净值及其他临时公告。
- 5、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金 2020 年中期报告原文。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。
- 7、《万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。

### 12.2 存放地点

基金管理人的办公场所，并登载于基金管理人网站：[www.wjasset.com](http://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

2020 年 8 月 28 日