万家社会责任18个月定期开放混合型证券投资基金(LOF)
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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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、收益分配情况、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

§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 6

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

§3 主要财务指标和基金净值表现 8

3.1 主要会计数据和财务指标 8

3.2 基金净值表现 8

§4 管理人报告 11

4.1 基金管理人及基金经理情况 11

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 13

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 13

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 14

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 15

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 15

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

§5 托管人报告 17

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 17

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 17

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 17

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 18

6.1 资产负债表 18

6.2 利润表 19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表 20

6.4 报表附注.....21
§7 投资组合报告.....42
7.1 期末基金资产组合情况.....42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....42
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.....43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....47
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.....47
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.....47
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.....47
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.....47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....47
7.12 市场中性策略执行情况.....48
7.13 投资组合报告附注.....48
§8 基金份额持有人信息.....49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....49
8.2 期末上市基金前十名持有人.....49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....49
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的情况.....50
§9 开放式基金份额变动.....51
§10 重大事件揭示.....52
10.1 基金份额持有人大会决议.....52
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.....52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....52
10.4 基金投资策略的改变.....52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....52
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.....52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....52
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....54

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

§12 备查文件目录 55

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	万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金(LOF)	
基金简称	万家社会责任 18 个月定期开放混合	
基金主代码	161912	
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）	
基金合同生效日	2019 年 3 月 21 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	551,438,198.79 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2019 年 6 月 14 日	
下属分级基金的基金简称：	万家社会责任 A	万家社会责任 C
下属分级基金场内简称:	社会责任	
下属分级基金的交易代码：	161912	161913
报告期末下属分级基金的份额总额	535,904,729.00 份	15,533,469.79 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制投资组合风险的前提下，谋求实现基金财产的长期稳健增值。
投资策略	本基金以“自下而上”精选证券的策略为主，并适度动态配置大类资产。通过定性与定量分析相结合的方法，精选出具备持续竞争优势且价值被低估的企业进行重点投资。本基金根据对宏观经济环境、经济增长前景及证券市场发展状况的综合分析，结合对股票市场整体估值水平、上市公司利润增长情况，债券市场整体收益率曲线变化等综合指标的分析，形成对各大类资产收益风险水平的前瞻性预测，以此确定股票、固定收益证券和现金等大类资产及中国证监会允许基金投资的其他金融工具在给定区间内的动态配置。开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资者安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种。未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，在履行适当程序后相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80% +上证国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

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	中国农业银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	兰剑	贺倩
	联系电话	021-38909626	010-66060069
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008880800	95599
传真		021-38909627	010-68121816
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）	北京市东城区建国门内大街 69 号
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）	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200122	100031
法定代表人		方一天	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.wjasset.com
基金中期报告备置地点	中国（上海）自由贸易实验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）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

基金级别	万家社会责任 A	万家社会责任 C
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)	报告期(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	181,826,307.40	5,203,789.48
本期利润	161,727,960.55	4,619,979.09
加权平均基金份额本期利润	0.3018	0.2974
本期加权平均净值利润率	20.33%	20.09%
本期基金份额净值增长率	23.20%	22.89%
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	199,273,098.83	5,697,023.45
期末可供分配基金份额利润	0.3718	0.3668
期末基金资产净值	858,942,974.46	24,802,800.46
期末基金份额净值	1.6028	1.5967
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	66.23%	65.17%

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(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

万家社会责任 A

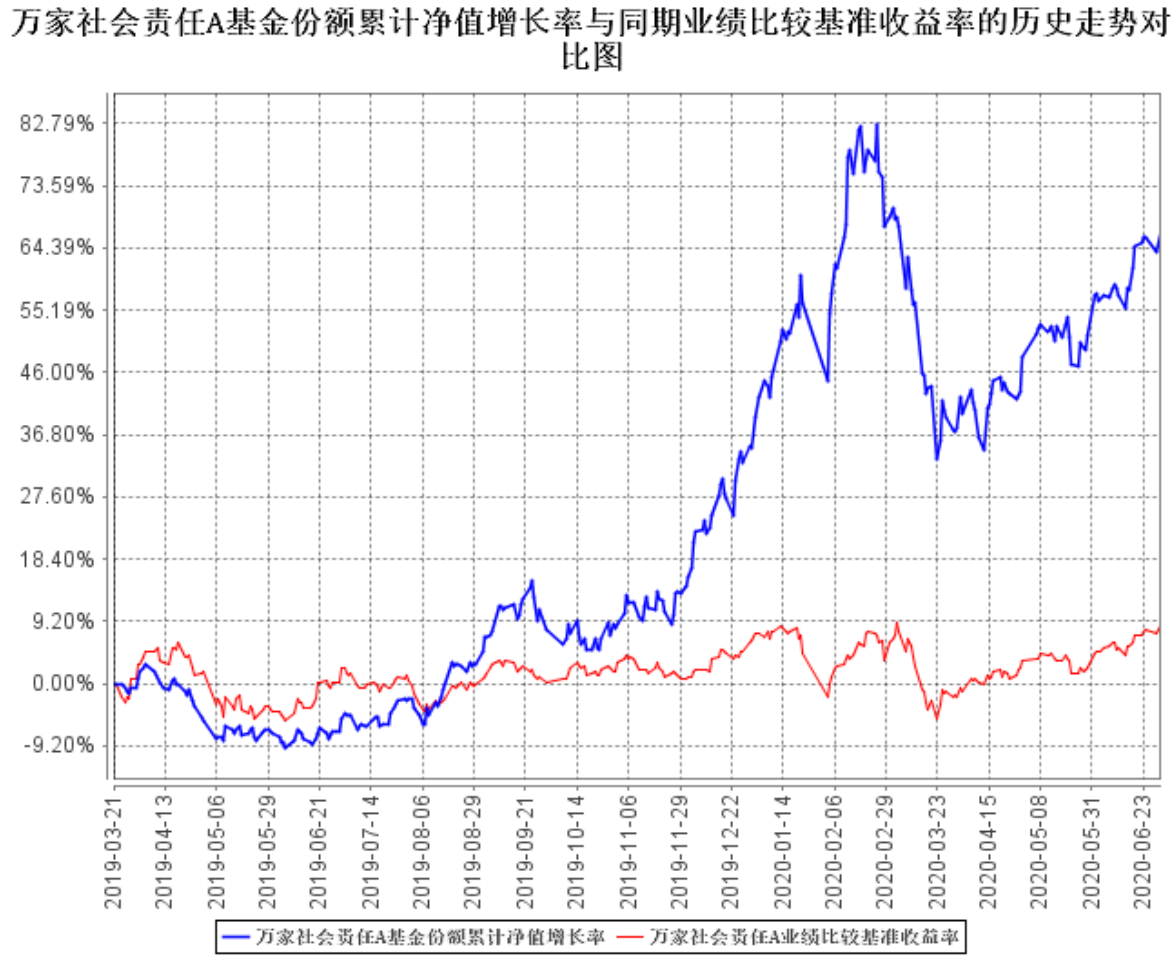
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	9.72%	1.26%	6.08%	0.72%	3.64%	0.54%
过去三个月	21.10%	1.51%	10.42%	0.72%	10.68%	0.79%
过去六个月	23.20%	2.30%	2.13%	1.21%	21.07%	1.09%
过去一年	78.93%	1.88%	8.44%	0.97%	70.49%	0.91%
自基金合同	66.23%	1.72%	8.57%	1.04%	57.66%	0.68%

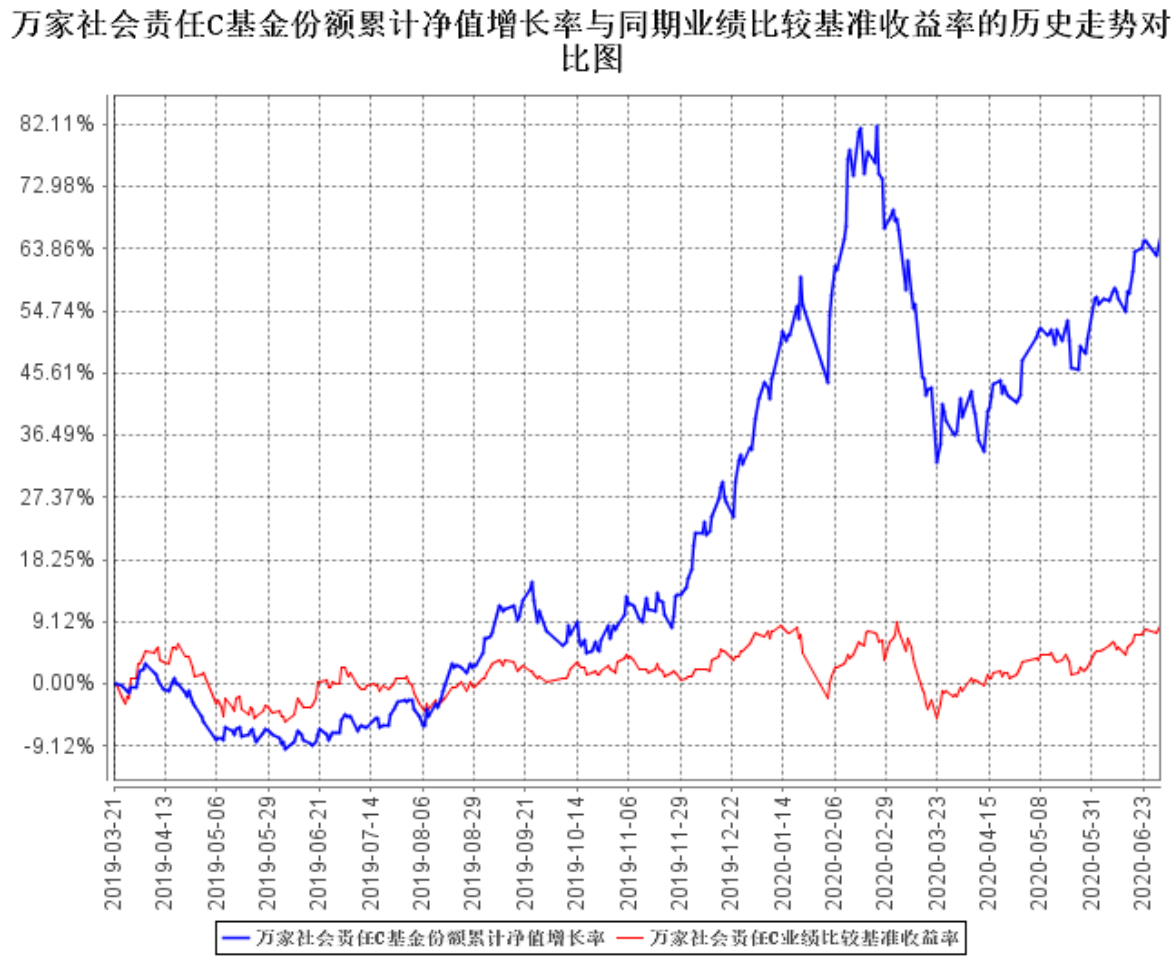
生效起至今						

万家社会责任 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	9.67%	1.26%	6.08%	0.72%	3.59%	0.54%
过去三个月	20.94%	1.51%	10.42%	0.72%	10.52%	0.79%
过去六个月	22.89%	2.30%	2.13%	1.21%	20.76%	1.09%
过去一年	78.04%	1.88%	8.44%	0.97%	69.60%	0.91%
自基金合同生效起至今	65.17%	1.71%	8.57%	1.04%	56.60%	0.67%

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：本基金合同生效日期为 2019 年 03 月 21 日，本基金建仓期为基金合同生效后 6 个月。截至报告期末各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§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）自由贸易实验区浦电路 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 三年持有期混合型发起式基金中基金(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	2019 年 3 月 21 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。				

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《证券业从业人员资格管理办法》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》,公司制定了《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。

公司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,执行交易系统中的公平交易程序;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,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 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。

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良好的赚钱效应，提高投资者对于 A 股市场的认同度。

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价值蓝筹。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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家社会责任 A 基金份额净值为 1.6028 元，本报告期基金份额净值增长率为

23.20%；截至本报告期末万家社会责任C基金份额净值为1.5967元，本报告期基金份额净值增长率为22.89%；同期业绩比较基准收益率为2.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

本基金在报告期内未实施利润分配。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—万家基金管理有限公司 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，万家基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，万家基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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：万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金(LOF)

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
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	23,342,612.99	6,582,826.68
结算备付金		1,109,629.53	1,418,395.54
存出保证金		560,270.06	379,135.34
交易性金融资产	6.4.7.2	860,692,687.05	706,243,386.60
其中：股票投资		860,692,687.05	706,243,386.60
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	4,838,231.89
应收利息	6.4.7.5	6,236.46	11,818.91
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		885,711,436.09	719,473,794.96
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2020 年 6 月 30 日**	**上年度末 2019 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,047,991.18	874,030.31
应付托管费		174,665.21	145,671.71
应付销售服务费		9,806.14	8,172.54
应付交易费用	6.4.7.7	471,314.14	853,085.12
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	261,884.50	195,000.00
负债合计		1,965,661.17	2,075,959.68
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	551,438,198.79	551,438,198.79
未分配利润	6.4.7.10	332,307,576.13	165,959,636.49
所有者权益合计		883,745,774.92	717,397,835.28
负债和所有者权益总计		885,711,436.09	719,473,794.96

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，万家社会责任 A 基金份额净值 1.6028 元，基金份额总额 535,904,729.00 份；万家社会责任 C 基金份额净值 1.5967 元，基金份额总额 15,533,469.79 份。万家社会责任 18 个月定期开放混合份额总额合计为 551,438,198.79 份。

6.2 利润表

会计主体：万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金(LOF)

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 3 月 21 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		176,880,849.23	-35,810,083.82
1.利息收入		355,715.55	658,917.36
其中：存款利息收入	6.4.7.11	355,715.55	630,475.08
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		-	28,442.28
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		197,207,290.92	-1,383,041.23
其中：股票投资收益	6.4.7.12	192,157,834.24	-2,602,984.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
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	5,049,456.68	1,219,943.17
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-20,682,157.24	-35,085,959.95
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	-	-
减：二、费用		10,532,909.59	3,322,988.37
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	6,103,251.66	2,181,449.14
2．托管费	6.4.10.2.2	1,017,208.62	363,574.87
3．销售服务费	6.4.10.2.3	57,166.45	20,449.67
4．交易费用	6.4.7.19	3,221,094.15	694,035.08
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	134,188.71	63,479.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		166,347,939.64	-39,133,072.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		166,347,939.64	-39,133,072.19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金(LOF)

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）	551,438,198.79	165,959,636.49	717,397,835.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	166,347,939.64	166,347,939.64
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	551,438,198.79	332,307,576.13	883,745,774.92
项目	**上年度可比期间 2019 年 3 月 21 日(基金合同生效日)至 2019 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）	550,561,697.77	-	550,561,697.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-39,133,072.19	-39,133,072.19
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	550,561,697.77	-39,133,072.19	511,428,625.58

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

方一天　　陈广益　　陈广益

基金管理人负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金（LOF）（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”）证监许可【2018】2172 号文《关于准予万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金（LOF）注册的批复》的核准，由万家基金管理有限公司作为管理人于 2019 年 2 月 18 日至 2018 年 3 月 15 日向社会公开募集，募集期结束经立信

会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具信会师报字[2018]第 ZA30152 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 2019 年 3 月 21 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 550,272,385.47 元，在募集期间产生的活期存款利息为 289,312.30 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 550,561,697.77 元，折合 550,561,697.77 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金主要投资具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（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）、股指期货、国债期货、股票期权以及债券（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）、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债等）、权证、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等金融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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80% +上证国债指数收益率×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》及其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 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。

6.4.4.1 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。

6.4.5 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。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 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	23,342,612.99
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：	23,342,612.99

6.4.6.2 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		733,571,457.37	860,692,687.05	127,121,229.68
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		733,571,457.37	860,692,687.05	127,121,229.68

6.4.6.3 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。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无返售金融资产余额。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.6.5 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	-
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	499.30
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	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	5,737.16
合计	6,236.46

6.4.6.6 其他资产

本基金本期末无其他资产。

6.4.6.7 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	471,314.14
银行间市场应付交易费用	-
合计	471,314.14

6.4.6.8 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	-
应付证券出借违约金	-

预提费用	261,884.50
合计	261,884.50

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

万家社会责任 A		
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	535,904,729.00	535,904,729.00
本期申购	-	-
本期赎回(以"-"号填列)	-	-
- 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	535,904,729.00	535,904,729.00

金额单位：人民币元

万家社会责任 C		
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	15,533,469.79	15,533,469.79
本期申购	-	-
本期赎回(以"-"号填列)	-	-
- 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	15,533,469.79	15,533,469.79

注:申购含红利再投、转换入份额,赎回含转换出份额。

6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

万家社会责任 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	17,446,791.43	143,863,493.48	161,310,284.91
本期利润	181,826,307.40	-20,098,346.85	161,727,960.55

本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	199,273,098.83	123,765,146.63	323,038,245.46

单位：人民币元

万家社会责任 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	493,233.97	4,156,117.61	4,649,351.58
本期利润	5,203,789.48	-583,810.39	4,619,979.09
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,697,023.45	3,572,307.22	9,269,330.67

6.4.6.11 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	336,584.47
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	15,139.34
其他	3,991.74
合计	355,715.55

6.4.6.12 股票投资收益

6.4.6.12.1 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	1,056,168,716.25
减：卖出股票成本总额	864,010,882.01
买卖股票差价收入	192,157,834.24

6.4.6.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.6.13.1 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。

6.4.6.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.6.15 衍生工具收益

本基金本报告期末无衍生工具收益。

6.4.6.16 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	5,049,456.68
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	5,049,456.68

6.4.6.17 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	-20,682,157.24
——股票投资	-20,682,157.24
——债券投资	-
——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	-20,682,157.24

6.4.6.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.6.19 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	3,221,094.15
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	3,221,094.15

6.4.6.20 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	22,376.90
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
上市年费	29,835.26
帐户维护费	10,500.00
银行费用	11,804.21
其他	-
合计	134,188.71

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 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3月21日(基金合同生效日) 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	1,155,805,429.89	55.38%	-	-

6.4.9.1.2 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。

6.4.9.1.3 债券回购交易

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回购交易。

6.4.9.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.9.1.5 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	期末应付佣金余额	占期末应付佣金

		量的比例		总额的比例
中泰证券	1,076,400.77	55.38%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019年3月21日(基金合同生效日)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
-	-	-	-	-

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 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 3 月 21 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,103,251.66	2,181,449.14
其中：支付销售机构的客户维护费	2,922,684.16	1,071,833.13

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提，其中基金管理人应将净管理费收入（税后）的 5%用于公益事业。管理费的计算方法如下：

H=E×1.50%÷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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.9.2.2 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 3 月 21 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,017,208.62	363,574.87

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×0.25%÷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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.9.2.3 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家社会责任 A	万家社会责任 C	合计
中泰证券	-	29,456.09	29,456.09
合计	-	29,456.09	29,456.09
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019 年 3 月 21 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家社会责任 A	万家社会责任 C	合计
中泰证券	-	10,563.84	10,563.84
合计	-	10,563.84	10,563.84

注：基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。本基金销售服务年费率为 0.50%,计算方法如下:

H=E×0.50%÷当年天数

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金托管人根据基金管理人指令于次月前 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人,由基金管理人支付给各代销机构,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

6.4.9.3 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。

6.4.9.4 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

6.4.9.4.1 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。

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.9.5.2 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。

6.4.9.6 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 3 月 21 日(基金合同生效日)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
农业银行	23,342,612.99	336,584.47	198,814,032.59	622,572.35

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公司,2020 年 1 月 1 日至 6 月 30 日获得的利息收入为人民币 15,139.34 元(2019 年 3 月 21 日（基金合同生效日）至 6 月 30 日获得的利息收入为人民币 7,541.36 元),2020 年 6 月 30 日结算备付金余额为人民币 1,109,629.53 元(2019 年 6 月 30 日结算备付金余额为人民币 842,513.48 元)。

6.4.9.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.9.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期没有需作说明的其他关联交易事项。

6.4.10 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.11 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 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

6.4.11.1.1 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
300840	酷特智能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股发行	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	圣蓝股份	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 2 日	新股发行	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 3 日	新股发行	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 1 日	新股发行	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
300847	中船汉光	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 9 日	新股发行	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
688528	秦川物联	2020 年 6 月 19 日	2020 年 7 月 1 日	新股发行	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688207	国盾量子	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 9 日	新股发行	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688377	迪威尔	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 8 日	新股发行	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	新股发行	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688600	皖仪科技	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 3 日	新股发行	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-
688318	财富趋势	2020 年 4 月 17 日	2020 年 10 月 27 日	新股流通受限	107.41	237.93	4,356	467,877.96	1,036,423.08	-
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	-
688222	成都先导	2020 年 4 月 3 日	2020 年 10 月 16 日	新股流通受限	20.52	43.70	9,201	188,804.52	402,083.70	-
688312	燕麦科技	2020 年 5 月 29 日	2020 年 12 月 8 日	新股流通受限	19.68	41.77	7,390	145,435.20	308,680.30	-

6.4.11.2 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暂时停牌等流通受限股票。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 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证券款余额。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 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。

6.4.11.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 信用风险

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

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

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。

6.4.12.3 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。

6.4.12.3.1 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，并建全了逆回购交易质押品管理制度。

本基金所持有的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 6.4.11“期末（2020 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。

6.4.12.4 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。

6.4.12.4.1 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。

6.4.12.4.1.1 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	23,342,612.99	-	-	-	-	-	23,342,612.99
结算备付金	1,109,629.53	-	-	-	-	-	1,109,629.53

存出保证金	560,270.06	-	-	-	-	-	560,270.06
交易性金融资产	-	-	-	-	-	860,692,687.05	860,692,687.05
应收利息	-	-	-	-	-	6,236.46	6,236.46
资产总计	25,012,512.58	-	-	-	-	860,698,923.51	885,711,436.09
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,047,991.18	1,047,991.18
应付托管费	-	-	-	-	-	174,665.21	174,665.21
应付销售服务费	-	-	-	-	-	9,806.14	9,806.14
应付交易费用	-	-	-	-	-	471,314.14	471,314.14
其他负债	-	-	-	-	-	261,884.50	261,884.50
负债总计	-	-	-	-	-	1,965,661.17	1,965,661.17
利率敏感度缺口	25,012,512.58	-	-	-	-	858,733,262.34	883,745,774.92
上年度末 2019 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							
银行存款	6,582,826.68	-	-	-	-	-	6,582,826.68
结算备付金	1,418,395.54	-	-	-	-	-	1,418,395.54
存出保证金	379,135.34	-	-	-	-	-	379,135.34
交易性金融资产	-	-	-	-	-	706,243,386.60	706,243,386.60
应收证券清算款	-	-	-	-	-	4,838,231.89	4,838,231.89
应收利息	-	-	-	-	-	11,818.91	11,818.91
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	8,380,357.56	-	-	-	-	711,093,437.40	719,473,794.96
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	874,030.31	874,030.31
应付托管费	-	-	-	-	-	145,671.71	145,671.71
应付销售服务费	-	-	-	-	-	8,172.54	8,172.54
应付交易费用	-	-	-	-	-	853,085.12	853,085.12
其他负债	-	-	-	-	-	195,000.00	195,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	2,075,959.68	2,075,959.68
利率敏感度缺口	8,380,357.56	-	-	-	-	709,017,477.72	717,397,835.28

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。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，银行存款、结算备付金以及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。

6.4.12.4.2 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。

6.4.12.4.2.1 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	860,692,687.05	97.39	706,243,386.60	98.45
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
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	860,692,687.05	97.39	706,243,386.60	98.45

6.4.12.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	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	-11,553,770.55	-8,727,131.42
	2.股票基准指数上升 100 个基点	11,553,770.55	8,727,131.42

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。本基金为本报告期内合同生效的基金,无上年度末对比数据。

6.4.13 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	860,692,687.05	97.18
	其中：股票	860,692,687.05	97.18
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	24,452,242.52	2.76
8	其他各项资产	566,506.52	0.06
9	合计	885,711,436.09	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	32,500,800.00	3.68
B	采矿业	-	-
C	制造业	606,140,978.91	68.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	9,540,630.00	1.08
F	批发和零售业	-	-
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	13,103,153.72	1.48
J	金融业	34,997,415.00	3.96
K	房地产业	118,550,459.40	13.41
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	402,083.70	0.05

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	45,444,400.00	5.14
S	综合	-	-
	合计	860,692,687.05	97.39

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	002460	赣锋锂业	1,480,185	79,293,510.45	8.97
2	002594	比亚迪	971,400	69,746,520.00	7.89
3	603986	兆易创新	259,473	61,212,275.43	6.93
4	300750	宁德时代	300,000	52,308,000.00	5.92
5	300413	芒果超媒	697,000	45,444,400.00	5.14
6	002074	国轩高科	1,450,137	38,921,677.08	4.40
7	603659	璞泰来	351,004	36,160,432.08	4.09
8	600600	青岛啤酒	471,900	36,100,350.00	4.08
9	000636	风华高科	1,194,800	34,876,212.00	3.95
10	000333	美的集团	578,000	34,558,620.00	3.91
11	600383	金地集团	2,456,102	33,648,597.40	3.81
12	000998	隆平高科	1,952,000	32,500,800.00	3.68
13	000651	格力电器	559,300	31,639,601.00	3.58
14	600048	保利地产	2,077,800	30,709,884.00	3.47
15	688388	嘉元科技	498,738	28,103,886.30	3.18
16	000671	阳 光 城	4,316,200	27,364,708.00	3.10
17	000961	中南建设	3,014,300	26,827,270.00	3.04
18	688006	杭可科技	509,950	22,917,153.00	2.59
19	601211	国泰君安	1,018,700	17,582,762.00	1.99
20	600030	中信证券	722,300	17,414,653.00	1.97
21	000596	古井贡酒	114,900	17,262,576.00	1.95
22	600703	三安光电	630,060	15,751,500.00	1.78
23	300223	北京君正	152,359	15,379,117.46	1.74

24	002709	天赐材料	382,900	12,938,191.00	1.46
25	688030	山石网科	211,268	9,976,074.96	1.13
26	601186	中国铁建	1,138,500	9,540,630.00	1.08
27	300618	寒锐钴业	114,700	7,113,694.00	0.80
28	002497	雅化集团	576,980	5,325,525.40	0.60
29	688396	华润微	62,457	2,713,132.08	0.31
30	002185	华天科技	110,800	1,499,124.00	0.17
31	688023	安恒信息	4,186	1,288,869.40	0.15
32	688318	财富趋势	4,356	1,036,423.08	0.12
33	688505	复旦张江	22,688	772,072.64	0.09
34	688051	佳华科技	4,053	487,454.31	0.06
35	688222	成都先导	9,201	402,083.70	0.05
36	688312	燕麦科技	7,390	308,680.30	0.03
37	002555	三七互娱	6,458	302,234.40	0.03
38	603799	华友钴业	7,600	295,336.00	0.03
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	0.01
46	002371	北方华创	283	48,367.53	0.01
47	300837	浙矿股份	737	33,187.11	0.00
48	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
49	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.00
50	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
51	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
52	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
53	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
54	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
55	300843	圣蓝股份	751	7,517.51	0.00
56	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
57	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	65,659,930.60	9.15
2	600703	三安光电	58,299,348.68	8.13
3	300223	北京君正	50,098,100.37	6.98
4	000636	风华高科	43,882,887.31	6.12
5	002074	国轩高科	37,986,348.07	5.30
6	300568	星源材质	37,634,779.90	5.25
7	300207	欣旺达	37,532,824.05	5.23
8	002497	雅化集团	37,083,437.68	5.17
9	300073	当升科技	36,923,724.42	5.15
10	300450	先导智能	35,343,440.88	4.93
11	603659	璞泰来	35,254,493.80	4.91
12	000998	隆平高科	34,581,703.21	4.82
13	688388	嘉元科技	33,643,239.65	4.69
14	002185	华天科技	33,263,878.86	4.64
15	000671	阳 光 城	32,463,745.58	4.53
16	000651	格力电器	30,853,972.32	4.30
17	300413	芒果超媒	30,012,994.14	4.18
18	600048	保利地产	29,186,644.09	4.07
19	000333	美的集团	29,060,987.80	4.05
20	300618	寒锐钴业	27,971,395.00	3.90
21	600600	青岛啤酒	26,243,144.32	3.66
22	000961	中南建设	23,994,140.96	3.34
23	688006	杭可科技	23,904,487.66	3.33
24	600383	金地集团	22,750,001.31	3.17
25	688030	山石网科	19,414,061.32	2.71
26	601211	国泰君安	17,688,530.72	2.47
27	600030	中信证券	17,688,189.00	2.47
28	600584	长电科技	17,257,484.60	2.41
29	603799	华友钴业	15,797,726.83	2.20
30	000596	古井贡酒	15,766,454.00	2.20
31	601186	中国铁建	15,449,659.53	2.15
32	300010	立思辰	15,369,286.92	2.14

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	87,922,928.11	12.26
2	600703	三安光电	76,292,837.77	10.63
3	300618	寒锐钴业	75,901,922.28	10.58
4	002371	北方华创	73,990,847.97	10.31
5	300450	先导智能	48,492,449.99	6.76
6	603986	兆易创新	44,001,684.85	6.13
7	688012	中微公司	43,468,249.18	6.06
8	300033	同花顺	42,898,583.94	5.98
9	002384	东山精密	35,790,077.09	4.99
10	002624	完美世界	34,745,589.52	4.84
11	300073	当升科技	34,567,652.60	4.82
12	002497	雅化集团	33,977,927.80	4.74
13	002241	歌尔股份	33,299,599.18	4.64
14	300136	信维通信	33,236,713.58	4.63
15	300059	东方财富	28,438,697.56	3.96
16	002185	华天科技	28,322,427.78	3.95
17	300568	星源材质	27,278,791.61	3.80
18	300223	北京君正	27,253,240.00	3.80
19	600030	中信证券	26,635,693.00	3.71
20	601211	国泰君安	25,218,763.38	3.52
21	688023	安恒信息	25,201,419.05	3.51
22	300207	欣旺达	24,326,509.37	3.39
23	600837	海通证券	21,476,867.00	2.99
24	300010	立思辰	15,777,102.00	2.20
25	002460	赣锋锂业	15,326,794.00	2.14
26	600584	长电科技	15,018,392.02	2.09

注：卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，“卖出金额”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。

7.4.3 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	1,039,142,339.70
卖出股票收入（成交）总额	1,056,168,716.25

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。卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，“卖出金额”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。

7.5 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 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

本基金本报告期末未持有股指期货持仓。

7.10.2 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，并行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货约之间的定价关系、 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，以套期保值未主要目的，运用国债期货对基金投资组合进行管理，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 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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 市场中性策略执行情况

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	560,270.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,236.46
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	566,506.52

7.13.4 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处于转股期的可转换债券。

7.13.5 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的情况。

7.13.6 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
万家社会责任A	16,974	31,572.09	20,634,462.81	3.85%	515,270,266.19	96.15%
万家社会责任C	527	29,475.27	0.00	0.00%	15,533,469.79	100.00%
合计	17,414	31,666.37	20,634,462.81	3.74%	530,803,735.98	96.26%

8.2 期末上市基金前十名持有人

万家社会责任 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	兴全基金－映山红兴享回报 90 天人民币理财－兴全－华兴银行 2 号 FOF 单一资产管理	8,318,264.00	7.27%
2	孙晓菲	3,051,059.00	2.67%
3	吴迅	2,829,364.00	2.47%
4	张继荣	2,433,937.00	2.13%
5	奚洪涛	2,054,865.00	1.80%
6	钱中明	1,771,219.00	1.55%
7	路丕思	1,500,204.00	1.31%
8	高丰宝	1,355,627.00	1.19%
9	何国瑛	1,216,059.00	1.06%
10	高溢冰	1,161,389.00	1.02%

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	万家社会责任 A	521,894.28	0.0974%
	万家社会	-	-

	责任 C		
	合计	521,894.28	0.0946%

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的情况

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	万家社会责任 A	10~50
	万家社会责任 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	万家社会责任 A	0
	万家社会责任 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家社会责任 A	万家社会责任 C
基金合同生效日（2019 年 3 月 21 日）基金份额总额	535,068,059.77	15,493,638.00
本报告期期初基金份额总额	535,904,729.00	15,533,469.79
本报告期基金总申购份额	-	-
减:本报告期基金总赎回份额	-	-
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	535,904,729.00	15,533,469.79

§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

本基金自基金合同生效日起聘请立信会计师事务所提供审计服务。

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

本报告期内管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或者处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	2	1,155,805,429.89	55.38%	1,076,400.77	55.38%	-
广发证券	1	625,949,790.66	29.99%	582,947.57	29.99%	-
华福证券	2	223,685,131.18	10.72%	208,318.61	10.72%	-
新时代证券	1	81,596,247.41	3.91%	75,991.08	3.91%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

中信建投	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-

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服务;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。

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、基金专用交易席位的变更情况:

无

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

§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

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§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社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金（LOF）发行及募集的文件

2、《万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金（LOF）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媒介上公开披露的基金净值、季度报告、更新招募说明书及其他临时公告

5、万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金（LOF）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、《万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金（LOF）托管协议》

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

2020 年 8 月 28 日