

# 万家品质生活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、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，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、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 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.....	14
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.....	14
<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>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 市场中性策略执行情况.....	44
7.13 投资组合报告附注.....	44
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
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.....	45
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>46</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>49</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.....	49

<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>50</b>
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	50
12.3 查阅方式.....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	万家品质
基金主代码	519195
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 8 月 6 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	777,633,020.10 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于中国经济社会发展过程中所涌现出的能够直接或间接满足居民生活品质提升需求的上市公司，在严格控制投资风险的基础上，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	随着中国社会经济的发展、居民收入水平的提升和城镇化进程的推进，居民的各方面需求将逐步释放，尤其是对于生活品质的要求会逐步提高，由此带来对相关产品和服务的需求增加，并推动提供此类产品和服务的上市公司的快速成长。本基金将重点把握居民生活品质提升、消费结构升级的趋势，运用“自上而下”和“自下而上”相结合的方法优选行业和精选股票，并构建基金的投资组合。一方面，本基金通过“自上而下”的深入分析，在综合国内外宏观经济发展趋势、国家相关政策的基础上，优化大类资产配置、甄选受益行业；另一方面，通过“自下而上”的深入研究，精选具有核心竞争力、成长性突出且价值低估的上市公司，依靠这些公司的出色成长能力来抵御经济和行业的不确定性和各种压力，力争获得超越市场平均水平的长期回报。
业绩比较基准	50%*沪深 300 指数收益率+50%*上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中高预期风险、中高预期收益的证券投资基金，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金但低于股票型基金。

### 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	《中国证券报》
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

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	428,000,399.28
本期利润	351,820,079.07
加权平均基金份额本期利润	0.3775
本期加权平均净值利润率	25.15%
本期基金份额净值增长率	22.80%
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	458,081,834.97
期末可供分配基金份额利润	0.5891
期末基金资产净值	1,264,679,966.99
期末基金份额净值	1.6263
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	124.59%

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、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。

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

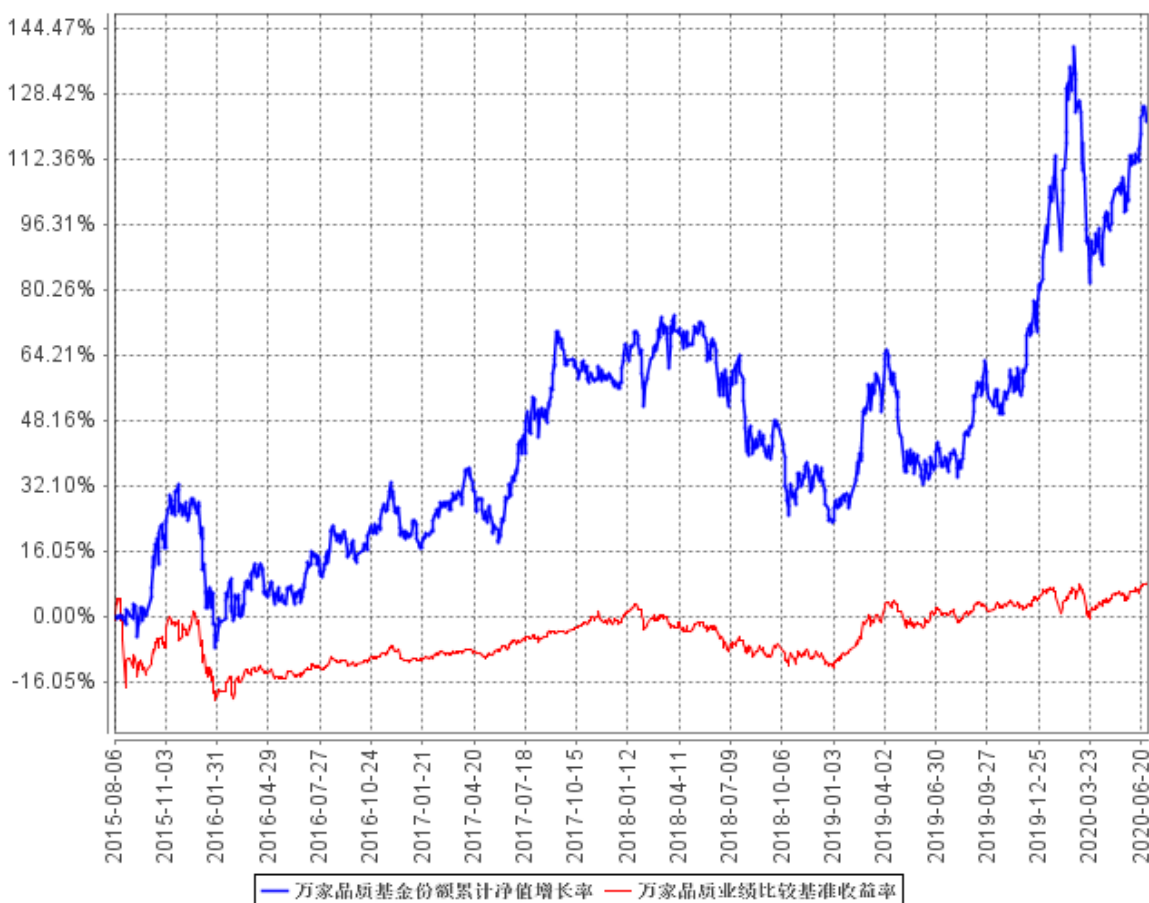
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	9.29%	1.14%	3.72%	0.45%	5.57%	0.69%
过去三个月	18.42%	1.27%	6.67%	0.45%	11.75%	0.82%
过去六个月	22.80%	2.10%	2.64%	0.75%	20.16%	1.35%
过去一年	63.97%	1.74%	7.54%	0.60%	56.43%	1.14%
过去三年	67.42%	1.55%	15.33%	0.63%	52.09%	0.92%
自基金合同生效起至今	124.59%	1.60%	8.49%	0.86%	116.10%	0.74%



### 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

万家品质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：本基金成立于 2015 年 8 月 6 日，建仓期为 6 个月，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。本基金已于 2016 年 3 月 8 日召开基金持有人大会，对本基金的名称、基金投资范围等事项进行相应修改。根据基金份额持有人大会决议，原“万家品质生活股票型证券投资基金”更名为“万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金”。基金管理人已将修改后的《万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金托管协议》和《万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》报中国证监会进行变更注册，修订和更新后的文件于 2016 年 3 月 8 日生效。报告期末各项资产配置比例符合基金合同要求。

## § 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	2015 年 8 月 6 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合规守信情况的说明

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

#### 4.3 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，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和国家和地区,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

截至本报告期末本基金份额净值为 1.6263 元;本报告期基金份额净值增长率为 22.80%,业

绩比较基准收益率为 2.64%。

#### 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

基金合同规定“本基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 10%”。本基金本报告期内未进行利润分配，符合法律法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未发生连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或基金资产净值低

于 5000 万的情况。

## § 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

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《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万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金半年度报告中的财务指标、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，未发现有关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：万家品质生活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	119,529,230.22	104,531,452.40
结算备付金		2,603,938.35	11,190,494.29
存出保证金		1,003,064.17	632,901.90
交易性金融资产	6.4.7.2	1,157,036,211.58	1,262,174,073.25
其中：股票投资		1,157,036,211.58	1,262,174,073.25
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		-	4,350,779.62
应收利息	6.4.7.5	18,936.05	44,534.54
应收股利		-	-
应收申购款		7,366,292.31	1,175,802.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,287,557,672.68	1,384,100,038.35
<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		19,962,765.83	8,033,176.60
应付管理人报酬		1,614,098.84	2,388,293.59
应付托管费		269,016.49	398,048.95
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	803,170.00	1,584,966.32
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	228,654.53	291,652.09
负债合计		22,877,705.69	12,696,137.55
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	777,633,020.10	1,035,560,427.21
未分配利润	6.4.7.10	487,046,946.89	335,843,473.59
所有者权益合计		1,264,679,966.99	1,371,403,900.80
负债和所有者权益总计		1,287,557,672.68	1,384,100,038.35

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.6263 元，基金份额总额 777,633,020.10 份。

## 6.2 利润表

会计主体：万家品质生活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>		369,890,681.63	559,591,225.27
1.利息收入		798,689.44	1,590,501.40
其中：存款利息收入	6.4.7.11	798,689.44	1,537,285.02
债券利息收入		-	53,216.38
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）		437,952,376.02	16,856,363.01
其中：股票投资收益	6.4.7.12	422,330,093.36	-16,750,930.98
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	6.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	4,574,155.34	15,714,377.48
股利收益	6.4.7.16	11,048,127.32	17,892,916.51
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-76,180,320.21	537,629,156.81
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	7,319,936.38	3,515,204.05
<b>减：二、费用</b>		18,070,602.56	39,602,785.94
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,504,415.61	27,956,728.13
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,750,736.01	4,659,454.72

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	5,681,422.35	6,815,558.78
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		16,466.96	54,013.17
7. 其他费用	6.4.7.20	117,561.63	117,031.14
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		351,820,079.07	519,988,439.33
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		351,820,079.07	519,988,439.33

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家品质生活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）	1,035,560,427.21	335,843,473.59	1,371,403,900.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	351,820,079.07	351,820,079.07
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）	-257,927,407.11	-200,616,605.77	-458,544,012.88
其中：1.基金申购款	1,185,380,579.85	606,266,408.06	1,791,646,987.91
2.基金赎回款	-1,443,307,986.96	-806,883,013.83	-2,250,191,000.79
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）	777,633,020.10	487,046,946.89	1,264,679,966.99
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 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)	4,328,614,439.99	-448,491,681.91	3,880,122,758.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	520,042,452.50	520,042,452.50
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)	-1,247,118,289.20	-96,662,244.08	-1,343,780,533.28
其中: 1.基金申购款	991,415,492.74	54,395,266.22	1,045,810,758.96
2.基金赎回款	-2,238,533,781.94	-151,057,510.30	-2,389,591,292.24
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)	3,081,496,150.79	-25,111,473.49	3,056,384,677.30

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

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

万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会证监许可[2014]474号文《关于核准万家品质生活股票型证券投资基金募集的批复》的批准,由万家基金管理有限公司作为基金管理人于2015年7月13日至2015年7月31日止向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验资并出具安永华明(2015)验字第60778298\_B24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2015年8月6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339,018,446.05元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币82,154.91元,以上实收基金(本息)合计为人民币339,100,600.96元,折合339,100,600.96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。

本基金已于 2016 年 3 月 8 日召开基金持有人大会，对本基金的名称、基金投资范围等事项进行相应修改。根据基金份额持有人大会决议，原“万家品质生活股票型证券投资基金”更名为“万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金”。基金管理人已将修改后的《万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金托管协议》和《万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》报中国证监会进行变更注册，修订和更新后的文件于 2016 年 3 月 8 日生效。

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（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、地方政府债、可转换债券、可分离债券、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券等）、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款及协议存款）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（但须符合中国证监会相关规定）。通过投资于中国经济社会发展过程中所涌现出的能够直接或间接满足居民生活品质提升需求的上市公司，在严格控制投资风险的基础上，谋求基金资产的长期稳定增值。本基金业绩比较基准为：50%\*沪深 300 指数收益率+50%\*上证国债指数收益率。

#### 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

本半年度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	119,529,230.22
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：	119,529,230.22

##### 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	1,014,167,345.34	1,157,036,211.58	142,868,866.24
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	1,014,167,345.34	1,157,036,211.58	142,868,866.24

##### 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。

##### 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

本基金本报告期末买入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	17,252.49
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	1,149.40
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	0.21
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	533.95
合计	18,936.05

#### 6.4.6.6 其他资产

本报告期期末本基金未持有其他资产。

#### 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	803,170.00
银行间市场应付交易费用	-
合计	803,170.00

#### 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	39,146.93
应付证券出借违约金	-

预提费用	189,507.60
合计	228,654.53

#### 6.4.6.9 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	1,035,560,427.21	1,035,560,427.21
本期申购	1,185,380,579.85	1,185,380,579.85
本期赎回(以“-”号填列)	-1,443,307,986.96	-1,443,307,986.96
- 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	777,633,020.10	777,633,020.10

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	153,566,733.48	182,276,740.11	335,843,473.59
本期利润	428,000,399.28	-76,180,320.21	351,820,079.07
本期基金份额交易产生的变动数	-123,485,297.79	-77,131,307.98	-200,616,605.77
其中：基金申购款	442,091,422.32	164,174,985.74	606,266,408.06
基金赎回款	-565,576,720.11	-241,306,293.72	-806,883,013.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	458,081,834.97	28,965,111.92	487,046,946.89

#### 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
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	20,688.19

其他	31,991.51
合计	798,689.44

#### 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	2,009,742,965.76
减：卖出股票成本总额	1,587,412,872.40
买卖股票差价收入	422,330,093.36

#### 6.4.6.13 债券投资收益

##### 6.4.6.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.6.13.2 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

##### 6.4.6.15.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2020年1月1日至2020年6月30日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	4,574,155.34

#### 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	11,048,127.32
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	11,048,127.32

#### 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	-76,180,320.21
——股票投资	-76,180,320.21
——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	-76,180,320.21

#### 6.4.6.18 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	5,364,501.35
转换费	1,955,435.03
合计	7,319,936.38

#### 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	5,681,422.35
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	5,681,422.35

#### 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	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
其他	626.00
银行汇划费用	9,428.03
债券帐户维护费	18,000.00
合计	117,561.63

#### 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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.9 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	159,159,988.26	4.47%	208,489,640.59	5.28%

#### 6.4.9.1.2 债券交易

本报告期及上年度可比期间,本基金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

本报告期及上年度可比期间,本基金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

本报告期及上年度可比期间,本基金未通过关联方席位进行权证交易。

#### 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	148,226.08	4.47%	114,163.57	14.21%
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	194,166.65	5.28%	61,239.04	3.76%

### 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	10,504,415.61	27,956,728.13
其中：支付销售机构的客户维护费	2,183,798.08	961,168.11

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。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，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、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

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
当期发生的基金应支付的托管费	1,750,736.01	4,659,454.72

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，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、公休日等，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
中国农业银行	119,529,230.22	746,009.74	235,888,127.13	1,259,114.01

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日获得的利息收入为人民币20,688.19元（2019年1月1日至6月30日为人民币18,114.90元），2020年6月30日结算备付金余额为人民币2,603,938.35元（2019年6月30日为人民币1,962,080.17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	-
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	2021年1月25日	新股流通受限	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
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	-
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	-
688027	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	-
688599	天合	2020年	2021	新股	8.16	13.91	102,459	836,065.44	1,425,204.69	-

	光能	6 月 2 日	年 1 月 4 日	流通 受限						
--	----	------------	-----------------	----------	--	--	--	--	--	--

#### 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, 本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 6.4.11.4 风险管理政策和组织架构

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。

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。

#### 6.4.11.5 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。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。（2019 年 12 月 31 日：同）

#### **6.4.11.6 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。

本基金所持有的证券均在证券交易所上市，因此本报告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可回购交易债券投资的公允价值。

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人员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。

##### **6.4.11.6.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金资产的流动性风险进行管理，基金管理人建立了健全的流动性风险管理的内部控制体系，在申购赎回确认、投资交易、估值和信息披露等运作过程中专业审慎、勤勉尽责地管控基金的流动性风险，维护投资者的合法权益，公平对待投资者。本基金开放期间管理人对组合持仓集中度、短期变现能力、流动性受限资产比例、现金类资产比例等流动性指标进行持续的监测和分析，通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，对交易对手进行必要的尽职调查和准入，加强逆回购的流动性风险和交易对手风险的管理，并健全了逆回购交易质押品管理制度。

本基金所持有的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。

#### **6.4.11.7 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。

##### **6.4.11.7.1 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。

#### 6.4.11.7.1.1 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	119,529,230.22	-	-	-	-	-	119,529,230.22
结算备付金	2,603,938.35	-	-	-	-	-	2,603,938.35
存出保证金	1,003,064.17	-	-	-	-	-	1,003,064.17
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,157,036,211.58	1,157,036,211.58
应收利息	-	-	-	-	-	18,936.05	18,936.05
应收申购款	1,550.00	-	-	-	-	7,364,742.31	7,366,292.31
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	123,137,782.74	-	-	-	-	1,164,419,889.94	1,287,557,672.68
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	19,962,765.83	19,962,765.83
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,614,098.84	1,614,098.84
应付托管费	-	-	-	-	-	269,016.49	269,016.49
应付交易费用	-	-	-	-	-	803,170.00	803,170.00
其他负债	-	-	-	-	-	228,654.53	228,654.53
负债总计	-	-	-	-	-	22,877,705.69	22,877,705.69
利率敏感度缺口	123,137,782.74	-	-	-	-	-1,141,542,184.25	1,264,679,966.99
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	104,531,452.40	-	-	-	-	-	104,531,452.40
结算备付金	11,190,494.29	-	-	-	-	-	11,190,494.29
存出保证金	632,901.90	-	-	-	-	-	632,901.90
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,262,174,073.25	1,262,174,073.25
应收证券清算	-	-	-	-	-	4,350,779.62	4,350,779.62

款							
应收利息	-	-	-	-	-	44,534.54	44,534.54
应收申购款	1,030.00	-	-	-	-	1,174,772.35	1,175,802.35
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	116,355,878.59	-	-	-	-	1,267,744,159.76	1,384,100,038.35
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	8,033,176.60	8,033,176.60
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,388,293.59	2,388,293.59
应付托管费	-	-	-	-	-	398,048.95	398,048.95
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,584,966.32	1,584,966.32
其他负债	-	-	-	-	-	291,652.09	291,652.09
负债总计	-	-	-	-	-	12,696,137.55	12,696,137.55
利率敏感度缺口	116,355,878.59	-	-	-	-	-1,255,048,022.21	1,371,403,900.80

注：该表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早进行了分类。

#### 6.4.11.7.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金未持有交易性债券投资，银行存款和结算备付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。

#### 6.4.11.7.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.11.7.3 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。

本基金主要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。

##### 6.4.11.7.3.1 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	公允价值	占基金资

		资产净 值比例 (%)		产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,157,036,211.58	91.49	1,262,174,073.25	92.04
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	1,157,036,211.58	91.49	1,262,174,073.25	92.04

注：本基金投资组合中股票资产占基金资产的 0%-95%，投资于能直接或间接满足居民生活品质提升需求的公司发行的证券不低于非现金资产的 80%；其余资产投资于债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、债券回购、银行存款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。其中，权证投资占基金资产净值的 0%-3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约所需缴纳的交易保证金后现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。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。

#### 6.4.11.7.3.2 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	-14,934,451.29	-15,057,085.24
2. 股票基准指数上升 100 个基点	14,934,451.29	15,057,085.24	

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。

#### 6.4.12 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	1,157,036,211.58	89.86
	其中：股票	1,157,036,211.58	89.86
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	122,133,168.57	9.49
8	其他各项资产	8,388,292.53	0.65
9	合计	1,287,557,672.68	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	62,136,038.00	4.91
B	采矿业	-	-
C	制造业	787,421,612.45	62.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,455,997.62	2.09
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	12,097.57	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	201,694,026.82	15.95
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	79,303,672.80	6.27
S	综合	-	-
	合计	1,157,036,211.58	91.49

### 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	1,497,050	107,488,190.00	8.50
2	002460	赣锋锂业	1,847,335	98,961,735.95	7.83
3	300413	芒果超媒	1,216,314	79,303,672.80	6.27
4	300750	宁德时代	437,482	76,279,361.52	6.03
5	603986	兆易创新	300,632	70,922,095.12	5.61
6	002299	圣农发展	2,142,622	62,136,038.00	4.91
7	002074	国轩高科	2,276,800	61,109,312.00	4.83
8	600048	保利地产	3,899,227	57,630,575.06	4.56
9	000636	风华高科	1,881,200	54,912,228.00	4.34
10	000333	美的集团	883,300	52,812,507.00	4.18
11	000002	万科A	1,990,600	52,034,284.00	4.11
12	000651	格力电器	918,000	51,931,260.00	4.11
13	688388	嘉元科技	838,380	47,242,713.00	3.74
14	002497	雅化集团	4,182,600	38,605,398.00	3.05
15	001979	招商蛇口	2,147,900	35,311,476.00	2.79
16	600383	金地集团	2,332,400	31,953,880.00	2.53
17	688006	杭可科技	611,518	27,481,618.92	2.17
18	600600	青岛啤酒	327,000	25,015,500.00	1.98
19	000671	阳光城	3,905,964	24,763,811.76	1.96
20	600703	三安光电	984,300	24,607,500.00	1.95
21	002024	苏宁易购	2,788,506	24,455,197.62	1.93
22	300223	北京君正	240,705	24,296,762.70	1.92
23	000596	古井贡酒	135,097	20,296,973.28	1.60
24	002461	珠江啤酒	229,700	2,301,594.00	0.18
25	603883	老百姓	20,000	2,000,800.00	0.16



26	688599	天合光能	102,459	1,425,204.69	0.11
27	688505	复旦张江	22,688	772,072.64	0.06
28	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.01
29	603392	万泰生物	785	129,525.00	0.01
30	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.01
31	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.01
32	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.01
33	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.01
34	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.01
35	002371	北方华创	341	58,280.31	0.00
36	300837	浙矿股份	737	33,187.11	0.00
37	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
38	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.00
39	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
40	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
41	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
42	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
43	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
44	300843	圣蓝股份	751	7,517.51	0.00
45	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
46	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00
47	300136	信维通信	65	3,446.30	0.00
58	600585	海螺水泥	46	2,433.86	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	123,455,719.30	9.00
2	002497	雅化集团	113,456,656.74	8.27
3	600703	三安光电	94,078,344.61	6.86
4	300750	宁德时代	91,590,085.67	6.68
5	300450	先导智能	90,539,759.94	6.60
6	300073	当升科技	87,651,619.74	6.39
7	002074	国轩高科	71,353,735.58	5.20
8	300413	芒果超媒	70,411,017.78	5.13

9	002405	四维图新	66,380,664.81	4.84
10	000002	万科A	62,812,854.26	4.58
11	600048	保利地产	60,006,774.28	4.38
12	688388	嘉元科技	59,845,495.90	4.36
13	300223	北京君正	57,849,772.63	4.22
14	000651	格力电器	50,796,309.45	3.70
15	000636	风华高科	49,735,568.72	3.63
16	000333	美的集团	43,418,180.40	3.17
17	001979	招商蛇口	42,088,112.87	3.07
18	002602	世纪华通	41,901,851.92	3.06
19	300618	寒锐钴业	35,113,124.96	2.56
20	600383	金地集团	32,034,051.81	2.34
21	688006	杭可科技	30,822,046.95	2.25
22	000671	阳光城	30,088,071.69	2.19
23	603799	华友钴业	29,539,727.95	2.15

注：“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	002371	北方华创	197,021,723.11	14.37
2	603799	华友钴业	185,804,203.13	13.55
3	300618	寒锐钴业	159,957,754.79	11.66
4	603986	兆易创新	150,261,223.27	10.96
5	002460	赣锋锂业	111,776,157.82	8.15
6	002241	歌尔股份	110,494,994.65	8.06
7	002384	东山精密	109,561,262.31	7.99
8	600703	三安光电	92,909,314.79	6.77
9	002497	雅化集团	85,260,973.30	6.22
10	300450	先导智能	84,759,915.14	6.18
11	300136	信维通信	79,830,443.45	5.82
12	300073	当升科技	79,230,984.69	5.78
13	002405	四维图新	62,253,757.00	4.54
14	300369	绿盟科技	59,512,236.66	4.34
15	300059	东方财富	49,702,462.64	3.62
16	600030	中信证券	44,397,612.00	3.24

17	002602	世纪华通	43,220,606.02	3.15
18	603883	老百姓	43,146,712.80	3.15
19	600606	绿地控股	33,755,516.40	2.46
20	300413	芒果超媒	31,733,702.01	2.31
21	300223	北京君正	30,393,510.59	2.22
22	002594	比亚迪	28,793,854.85	2.10

注：“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	1,558,455,330.94
卖出股票收入（成交）总额	2,009,742,965.76

注：本项买入金额均按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用

本项卖出金额均按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

### 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

本报告期末本基金未持有债券。

### 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

本报告期末本基金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投资。

### 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

本报告期末本基金未持有权证。

### 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。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据有关法律法规和政策的规定,在严格控制风险的前提下,本着谨慎原则,以套期保值为主要目的,参与股指期货的投资。

### 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合约。

## 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

本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	1,003,064.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	18,936.05
5	应收申购款	7,366,292.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,388,292.53

### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金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

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 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

份额单位：份

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
104,971	7,408.07	410,519,481.94	52.79%	367,113,538.16	47.21%

### 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	146,086.68	0.0188%

### 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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2015 年 8 月 6 日 ）基金份额总额	339,100,600.96
本报告期期初基金份额总额	1,035,560,427.21
本报告期基金总申购份额	1,185,380,579.85
减：本报告期基金总赎回份额	1,443,307,986.96
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	777,633,020.10

## § 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

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任何稽查或处罚。

### 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	
安信证券	1	901,445,958.61	25.33%	839,517.68	25.33%	-
中信建投	2	559,345,997.58	15.71%	520,919.08	15.71%	-
广发证券	1	552,656,312.37	15.53%	514,690.10	15.53%	-
方正证券	2	483,278,173.48	13.58%	450,078.66	13.58%	-
华福证券	2	375,513,861.65	10.55%	349,717.55	10.55%	-
天风证券	1	248,936,694.34	6.99%	231,833.92	6.99%	-
华泰证券	2	171,261,806.55	4.81%	159,496.00	4.81%	-

中泰证券	2	159,159,988.26	4.47%	148,226.08	4.47%	-
新时代证券	1	107,814,861.45	3.03%	100,408.19	3.03%	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，本公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

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、报告期内基金租用证券公司交易单元的变更情况：

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

本基金报告期内未通过租用证券交易单元进行其它证券投资。



## § 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

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	20200101 - 20200304	287,837,425.71	0.00	287,837,425.71	0.00	0.00%
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品质生活灵活配置混合型证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《万家品质生活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、万家品质生活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、《万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

### 12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，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