

# 万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 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：2021 年 8 月 30 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 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.....	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>45</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	52
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.....	52
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.....	52
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.....	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
7.12 投资组合报告附注.....	52
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
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.....	54
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>55</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>56</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>58</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.....	58
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>59</b>

12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

## § 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	388,055,804.96 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	1、资产配置策略；2、股票投资策略：（1）品质生活主题相关行业的界定；（2）个股选择策略；（3）存托凭证策略；（3、债券投资策略：（1）利率预期策略；（2）久期控制策略；（3）类属配置策略；（4）个券选择策略；（5）套利策略；（6）中小企业私募债券投资策略；（7）可转换债券投资策略；4、股指期货投资策略；5、股票期权、权证投资策略；6、参与融资业务的投资策略；7、资产支持证券等品种投资策略；8、其他金融衍生产品投资策略。
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	秦一楠
	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	北京市东城区建国门内大街 69

	区浦电路 360 号 8 层(名义楼层 9 层)	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	谷澍

## 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(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	268,740,044.52
本期利润	51,415,226.05
加权平均基金份额本期利润	0.1150
本期加权平均净值利润率	5.12%
本期基金份额净值增长率	3.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	523,303,741.95
期末可供分配基金份额利润	1.3485
期末基金资产净值	911,359,546.91
期末基金份额净值	2.3485
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	224.33%

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

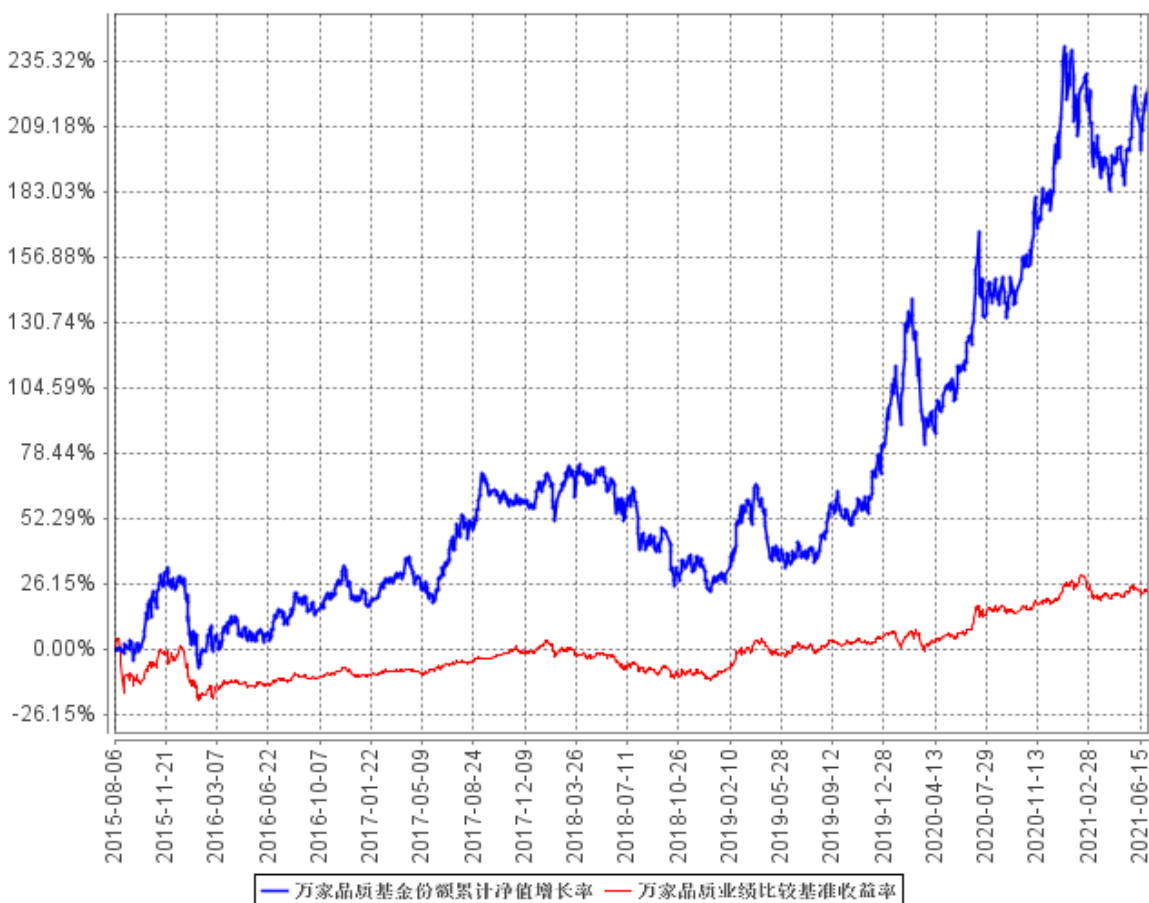
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.54%	1.43%	-0.94%	0.41%	2.48%	1.02%
过去三个月	11.30%	1.24%	2.23%	0.49%	9.07%	0.75%
过去六个月	3.88%	1.60%	1.21%	0.66%	2.67%	0.94%
过去一年	44.41%	1.63%	13.98%	0.67%	30.43%	0.96%
过去三年	102.27%	1.64%	31.90%	0.68%	70.37%	0.96%
自基金合同生效起至今	224.33%	1.61%	23.65%	0.83%	200.68%	0.78%



### 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。目前管理九十一只开放式基金,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、万家双利债券型证券投资基金、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、万家鑫安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、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、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 1-3 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家瑞隆混合型证券投资基金、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、万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家玖盛纯债 9 个月定期开放债券型证券投资基金、万家天添宝货币市场基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、万家家瑞债券型证券投资基金、万家臻选混合型证券投资基金、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金、万家成长优选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、万家潜力价值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、万家智造优势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)、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、万家平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (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、万家民安增利 12 个月定期开放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、万家养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、万家鑫动力月月购一年滚动持有混合型证券投资基金、万家科创板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家创业板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家周期优势企业混合型证券投资基金、万家健康产业混合型证券投资基金、万家互联互通中国优势量化策略混合型证券投资基金、万家战略发展产业混合型证券投资基金、万家创业板指数增强型证券投资基金、万家陆家嘴金融城金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家内需增长一年持有期混合型证券投资基金、万家互联互通核心资产量化策略混合型证券投资基金、万家民瑞祥明 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家瑞泽回报一年持有期混合型证券投资基金、万家惠裕回报 6 个月持有期混合型证券投资基金。

#### 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、万家品质生活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	2015 年 8 月 6 日	-	11 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

	型证券投资基金、 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。			资研究部总监、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。

#### 4.2 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,原则上按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;对于银行间交易,按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询

价并完成交易。为保证公平交易原则的实现,通过制度规范、流程审批、系统风控参数设置等进行事前控制,通过对投资交易系统的实时监控进行事中控制,通过对异常交易的监控和分析实现事后控制。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 1 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

1 季度上证指数先是震荡冲高到 3731 点,然后震荡回落,4 月下旬以来,随着风险的释放和财报的集中披露,市场信心有所恢复,部分股票在一季报业绩带动下形成了较大幅度的上涨,上证最高 3629 点,尤其是创业板指 6 月也重新站上 3400 点,创下年内新高,7 月底市场出现了较快的调整。预计 8-9 月美联储提出 Taper,四季度开始实行,从美联储过去三次 QE 退出的历史复盘看,在美联储暗示或者宣布 QE 缩减计划的时候,受未来流动性收紧的预期,我们预计短期市场波动会加大,尤其是沪深港通开通后,外资对 A 股的影响明显增强,如果 taper 的过程造成人民币汇率明显波动或阶段性贬值,则可能通过北上资金影响 A 股,加剧 A 股波动,但市场暂时没有系统性风险,建议关注结构性机会,行业配置上,我们建议配置估值仍有一定安全边际,且行业供需格局较好的板块。

目前产品持仓 90%左右,未来短中期的主要配置方向稳定在农业、新能源汽车、地产等。在产品一季报里,我们旗帜鲜明地看好新能源汽车,当时的表述是:新能源汽车短期不在市场风格上,但新能源汽车是未来几年最具有确定性成长性的方向之一,2021 年是新能源汽车爆发的元年。二季度新能源汽车板块进入爆发,产品净值也取得了不错的收益,我们维持继续看好的观点,宏观层面看,全球碳中和的大背景下,各国都在加码新能源车的推广应用。微观层面看,从 20 年下半年起,以特斯拉、比亚迪、新势力、五菱等为代表的车企推出大量优质车型,新能源车在占领消费者心智方面出现了大幅的提升。优质的车型供给在 21 年仍在持续加速,如特斯拉 model Y、比亚迪 DMI 超级混动、大众 ID 系列等。销量层面,市场不断调高全年新能源车销量,全年有望超

过 270 万辆。

其次，我们近期加仓了种业板块，长期看好种子行业，目前行业景气度提升、市场格局快速优化、转基因带来增量空间等逻辑正在逐步兑现。

#### 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 2.3485 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.88%，业绩比较基准收益率为 1.21%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们近期加仓了种业板块，长期看好种子行业，目前行业景气度提升、市场格局快速优化、转基因带来增量空间等逻辑正在逐步兑现。短期看，国家政策对种子行业的支持力度也较超预期，后续也会带来行业实质性变化，打开种子行业盈利空间。最新支持扶持种业的政策不断出台，频率和力度都较超预期，有望为行业带来质变。

#### 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。估值委员会由总经理、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》、《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》。

#### 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《中华人民共和国证券投资基金法》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 2021 年 1 月 1 日至 2021 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《中华人民共和国证券投资基金法》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：万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	56,419,084.60	97,561,060.67
结算备付金		269,574.72	964,939.57
存出保证金		268,889.61	344,257.06
交易性金融资产	6.4.7.2	857,030,053.52	1,328,983,233.03
其中：股票投资		857,030,053.52	1,328,983,233.03
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		4,538,561.31	14,164,136.37
应收利息	6.4.7.5	12,188.79	22,796.19
应收股利		-	-
应收申购款		2,479,561.60	3,453,064.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		921,017,914.15	1,445,493,487.67
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 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		8,096,439.00	12,235,600.70
应付管理人报酬		1,102,514.87	1,682,158.86
应付托管费		183,752.48	280,359.79
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	171,711.54	473,343.04
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	103,949.35	301,892.64
负债合计		9,658,367.24	14,973,355.03
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	388,055,804.96	632,779,845.13
未分配利润	6.4.7.10	523,303,741.95	797,740,287.51
所有者权益合计		911,359,546.91	1,430,520,132.64
负债和所有者权益总计		921,017,914.15	1,445,493,487.67

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.3485，基金份额总额 388,055,804.96 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		62,252,940.50	369,890,681.63
1.利息收入		321,498.49	798,689.44
其中：存款利息收入	6.4.7.11	321,498.49	798,689.44
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		277,260,211.13	437,952,376.02
其中：股票投资收益	6.4.7.12	272,807,356.85	422,330,093.36
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
股利收益	6.4.7.16	4,452,854.28	11,048,127.32
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-217,324,818.47	-76,180,320.21
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	1,996,049.35	7,319,936.38
<b>减：二、费用</b>		10,837,714.45	18,070,602.56
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,466,190.04	10,504,415.61
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,244,365.01	1,750,736.01

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,014,666.43	5,681,422.35
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
7. 其他费用	6.4.7.20	112,492.97	117,561.63
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		51,415,226.05	351,820,079.07
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		51,415,226.05	351,820,079.07

### 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	632,779,845.13	797,740,287.51	1,430,520,132.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	51,415,226.05	51,415,226.05
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）	-244,724,040.17	-325,851,771.61	-570,575,811.78
其中：1.基金申购款	204,519,106.96	266,793,798.31	471,312,905.27
2.基金赎回款	-449,243,147.13	-592,645,569.92	-1,041,888,717.05
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）	388,055,804.96	523,303,741.95	911,359,546.91
项目	上年度可比期间 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

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
尹超  
 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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 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

##### (一) 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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》的规定，基金通过深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

##### (二) 增值税

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、地方政府债券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，自 2018 年 1 月 1 日起，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。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。

### (三) 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。

### (四) 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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》的规定，对基金通过深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

#### 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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	56,419,084.60
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：	56,419,084.60

##### 6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	692,789,915.48	857,030,053.52	164,240,138.04
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	692,789,915.48	857,030,053.52	164,240,138.04

#### 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

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

##### 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 2021年6月30日
应收活期存款利息	11,871.84
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	98.10
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	13.55
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	205.30
合计	12,188.79

#### 6.4.6.6 其他资产

本报告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
----	-----

	2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	171,711.54
银行间市场应付交易费用	-
合计	171,711.54

#### 6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	14,689.20
应付证券出借违约金	-
预提费用	89,260.15
合计	103,949.35

#### 6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	632,779,845.13	632,779,845.13
本期申购	204,519,106.96	204,519,106.96
本期赎回(以“-”号填列)	-449,243,147.13	-449,243,147.13
- 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	388,055,804.96	388,055,804.96

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	550,356,208.28	247,384,079.23	797,740,287.51
本期利润	268,740,044.52	-217,324,818.47	51,415,226.05
本期基金份额交易产生的变动数	-288,268,262.20	-37,583,509.41	-325,851,771.61
其中：基金申购款	248,779,313.63	18,014,484.68	266,793,798.31

基金赎回款	-537,047,575.83	-55,597,994.09	-592,645,569.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	530,827,990.60	-7,524,248.65	523,303,741.95

#### 6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	313,997.39
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	4,303.55
其他	3,197.55
合计	321,498.49

#### 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	861,372,377.60
减：卖出股票成本总额	588,565,020.75
买卖股票差价收入	272,807,356.85

#### 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**

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 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,452,854.28
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	4,452,854.28

**6.4.6.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-217,324,818.47
——股票投资	-217,324,818.47
——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	-217,324,818.47

**6.4.6.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	1,766,503.52
转换费	229,545.83
合计	1,996,049.35

### 6.4.6.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,014,666.43
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	2,014,666.43

### 6.4.6.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	630.00
银行汇划费用	4,602.82
债券帐户维护费	18,000.00
合计	112,492.97

## 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	468,727,892.56	39.55%	159,159,988.26	4.47%

##### 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 2021年1月1日至2021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	436,527.10	42.97%	81,943.05	47.72%
关联方名称	上年度可比期间 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%
------	------------	-------	------------	--------

## 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 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,466,190.04	10,504,415.61
其中：支付销售机构的客户维护费	1,966,003.60	2,183,798.08

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 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,244,365.01	1,750,736.01

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中泰证券股份有限公司	6,469,161.10	1.6671%	6,469,161.10	1.0223%

### 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 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	56,419,084.60	313,997.39	119,529,230.22	746,009.74

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，2021年1月1日至6月30日获得的利息收入为人民币4,303.55元，2021年6月30日结算备付金余额为人民币269,574.72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

本基金本报告期及上年度可比期间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（2021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
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	新股流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	新股流通受限	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	

688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
688819	天能股份	2021年1月18日	2021年7月19日	新股流通受限	41.79	43.69	19,868	830,283.72	868,032.92	-
688680	海优新材	2021年1月22日	2021年7月22日	新股流通受限	69.94	243.61	2,795	195,482.30	680,889.95	-
688425	铁建重工	2021年6月11日	2021年12月22日	新股流通受限	2.87	4.75	101,655	291,749.85	482,861.25	-
688677	海泰新光	2021年2月26日	2021年8月26日	新股流通受限	35.76	103.23	1,768	63,223.68	182,510.64	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股流通受限	47.33	251.96	647	30,622.51	163,018.12	-
688669	聚石化学	2021年1月25日	2021年7月26日	新股流通受限	36.65	32.39	2,681	98,258.65	86,837.59	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股流通受限	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
688359	三孚新科	2021年5月14日	2021年11月22日	新股流通受限	11.03	26.35	2,213	24,409.39	58,312.55	-
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	新股流通受限	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-
688685	迈信林	2021年4月30日	2021年11月15日	新股流通受限	9.02	19.50	2,612	23,560.24	50,934.00	-

			日							
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股流通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月22日	新股流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300941	创识科技	2021年2月2日	2021年8月9日	新股流通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	新股流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新股流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
301013	利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	新股流通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-

300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021年3月3日	2021年9月13日	新股流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	新股流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新股流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	新股流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021年2月24日	2021年9月3日	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新股流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特	2021年	2021	新股流	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-

	新材	4月21日	年11月1日	通受限							
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81		-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80		-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月12日	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80		-
300930	屹通新材	2021年1月13日	2021年7月21日	新股流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56		-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95		-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05		-
301004	嘉益	2021年6月18日	2021年12月27日	新股流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28		-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54		-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70		-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76		-
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新股流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67		-

301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	创业板股票流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	新股流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月21日	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	创业板股票流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

#### **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 2021 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 2021 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。

#### **6.4.12 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。

##### **6.4.12.2 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。

### 6.4.12.3 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。

#### 6.4.12.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

#### 6.4.12.3.2 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 6.4.12 “期末(2021 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 2021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	56,419,084.60	-	-	-	-	-	56,419,084.60
结算备付金	269,574.72	-	-	-	-	-	269,574.72
存出保证金	268,889.61	-	-	-	-	-	268,889.61
交易性金融资产	-	-	-	-	-	857,030,053.52	857,030,053.52
应收证券清算款	-	-	-	-	-	4,538,561.31	4,538,561.31
应收利息	-	-	-	-	-	12,188.79	12,188.79
应收申购款	624.00	-	-	-	-	2,478,937.60	2,479,561.60
资产总计	56,958,172.93	-	-	-	-	864,059,741.22	921,017,914.15
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	8,096,439.00	8,096,439.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,102,514.87	1,102,514.87
应付托管费	-	-	-	-	-	183,752.48	183,752.48
应付交易费用	-	-	-	-	-	171,711.54	171,711.54
其他负债	-	-	-	-	-	103,949.35	103,949.35
负债总计	-	-	-	-	-	9,658,367.24	9,658,367.24
利率敏感度缺口	56,958,172.93	-	-	-	-	854,401,373.98	911,359,546.91
上年度末 2020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	97,561,060.67	-	-	-	-	-	97,561,060.67
结算备付金	964,939.57	-	-	-	-	-	964,939.57
存出保证金	344,257.06	-	-	-	-	-	344,257.06
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-1,328,983,233.03	1,328,983,233.03
应收证券清算款	-	-	-	-	-	14,164,136.37	14,164,136.37
应收利息	-	-	-	-	-	22,796.19	22,796.19
应收申购款	994.04	-	-	-	-	3,452,070.74	3,453,064.78
资产总计	98,871,251.34	-	-	-	-	-1,346,622,236.33	1,445,493,487.67
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	12,235,600.70	12,235,600.70
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,682,158.86	1,682,158.86
应付托管费	-	-	-	-	-	280,359.79	280,359.79
应付交易费用	-	-	-	-	-	473,343.04	473,343.04
其他负债	-	-	-	-	-	301,892.64	301,892.64
负债总计	-	-	-	-	-	14,973,355.03	14,973,355.03
利率敏感度缺口	98,871,251.34	-	-	-	-	-1,331,648,881.30	1,430,520,132.64

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。

#### 6.4.12.4.1.2 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。

#### 6.4.12.4.2 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。

#### 6.4.12.4.3 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。

### 6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	857,030,053.52	94.04	1,328,983,233.03	92.90
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	857,030,053.52	94.04	1,328,983,233.03	92.90

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。

### 6.4.12.4.3.2 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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1. 股票基准指数下降 100 个基点	-8,403,293.03	-16,871,119.23
2. 股票基准指数上升 100 个基点	8,403,293.03	16,871,119.23	

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。

#### **6.4.13 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	857,030,053.52	93.05
	其中：股票	857,030,053.52	93.05
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	56,688,659.32	6.16
8	其他各项资产	7,299,201.31	0.79
9	合计	921,017,914.15	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	149,515,262.64	16.41
B	采矿业	-	-
C	制造业	507,341,780.97	55.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	85,374.49	0.01
E	建筑业	25,555.67	0.00
F	批发和零售业	283,369.70	0.03
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	18,272,614.62	2.00
J	金融业	67,222,333.27	7.38
K	房地产业	113,210,201.58	12.42
L	租赁和商务服务业	65,464.36	0.01
M	科学研究和技术服务业	809,126.69	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	198,969.53	0.02
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	857,030,053.52	94.04

### 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	603986	兆易创新	452,218	84,971,762.20	9.32
2	002460	赣锋锂业	671,085	81,261,682.65	8.92
3	002074	国轩高科	1,394,800	60,757,488.00	6.67
4	000998	隆平高科	3,447,200	55,293,088.00	6.07
5	688005	容百科技	414,535	50,241,642.00	5.51
6	002299	圣农发展	2,075,222	49,556,301.36	5.44
7	002041	登海种业	2,955,300	44,654,583.00	4.90
8	002497	雅化集团	1,875,000	42,712,500.00	4.69
9	600418	江淮汽车	3,260,900	40,532,987.00	4.45
10	000002	万科A	1,685,300	40,126,993.00	4.40
11	600048	保利地产	3,255,427	39,195,341.08	4.30
12	600036	招商银行	713,099	38,642,834.81	4.24
13	688006	杭可科技	444,166	37,754,110.00	4.14
14	688388	嘉元科技	410,606	37,348,721.76	4.10
15	600383	金地集团	3,105,600	31,801,344.00	3.49
16	601166	兴业银行	1,382,800	28,416,540.00	3.12
17	603799	华友钴业	230,466	26,319,217.20	2.89
18	000333	美的集团	351,300	25,072,281.00	2.75
19	688099	晶晨股份	161,344	18,102,796.80	1.99
20	600893	航发动力	198,600	10,563,534.00	1.16
21	000671	阳光城	399,313	2,076,427.60	0.23
22	688819	天能股份	19,868	868,032.92	0.10
23	002594	比亚迪	3,200	803,200.00	0.09
24	688538	和辉光电	207,086	788,997.66	0.09
25	688680	海优新材	2,795	680,889.95	0.07

26	688131	皓元医药	1,955	676,801.45	0.07
27	688425	铁建重工	101,655	482,861.25	0.05
28	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.04
29	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.04
30	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.04
31	688269	凯立新材	1,941	270,808.32	0.03
32	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.03
33	688613	奥精医疗	2,617	237,597.43	0.03
34	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.02
35	688677	海泰新光	1,768	182,510.64	0.02
36	300614	百川畅银	3,283	176,700.30	0.02
37	688345	博力威	2,332	171,518.60	0.02
38	301013	利和兴	4,704	168,966.51	0.02
39	300997	欢乐家	9,279	168,775.16	0.02
40	300957	贝泰妮	647	163,018.12	0.02
41	688700	东威科技	3,049	162,755.62	0.02
42	301002	崧盛股份	2,001	159,001.62	0.02
43	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.02
44	301006	迈拓股份	5,051	154,055.50	0.02
45	688625	呈和科技	2,672	142,764.96	0.02
46	688216	气派科技	2,000	133,400.00	0.01
47	688621	阳光诺和	1,485	131,868.00	0.01
48	600906	财达证券	7,597	128,237.36	0.01
49	688319	欧林生物	3,412	127,642.92	0.01
50	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.01
51	688201	信安世纪	2,129	111,240.25	0.01
52	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
53	688113	联测科技	1,415	93,107.00	0.01
54	301004	嘉益股份	3,115	90,654.98	0.01
55	688669	聚石化学	2,681	86,837.59	0.01
56	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
57	300979	华利集团	925	80,937.50	0.01
58	688117	圣诺生物	1,672	80,924.80	0.01
59	301011	华立科技	1,750	79,474.50	0.01
60	688577	浙海德曼	1,503	77,675.04	0.01
61	301007	德迈仕	3,022	60,305.15	0.01
62	300998	宁波方正	2,003	60,075.24	0.01
63	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.01
64	688359	三孚新科	2,213	58,312.55	0.01

65	300995	奇德新材	1,909	57,368.52	0.01
66	301012	扬电科技	1,691	56,994.16	0.01
67	300992	泰福泵业	1,998	55,828.42	0.01
68	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.01
69	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
70	688685	迈信林	2,612	50,934.00	0.01
71	301010	晶雪节能	2,172	50,480.96	0.01
72	300910	瑞丰新材	474	49,556.70	0.01
73	601156	东航物流	2,090	49,470.30	0.01
74	688597	煜邦电力	3,907	49,306.34	0.01
75	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
76	300894	火星号	628	42,704.00	0.00
77	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
78	688517	金冠电气	2,892	41,095.32	0.00
79	688067	爱威科技	1,259	39,520.01	0.00
80	605339	南侨食品	864	37,307.52	0.00
81	688367	工大高科	1,717	37,035.69	0.00
82	600032	浙江新能	3,045	37,027.20	0.00
83	605090	九丰能源	1,090	35,326.90	0.00
84	688681	科汇股份	1,899	34,903.62	0.00
85	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
86	003040	楚天龙	1,101	33,470.40	0.00
87	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
88	603324	盛剑环境	732	26,630.16	0.00
89	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
90	300911	亿田智能	309	21,407.52	0.00
91	001206	依依股份	321	20,389.92	0.00
92	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
93	603511	爱慕股份	553	18,249.00	0.00
94	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
95	300908	仲景食品	285	16,983.15	0.00
96	300913	兆龙互连	630	16,506.00	0.00
97	605196	华通线缆	1,172	16,079.84	0.00
98	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.00
99	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
100	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
101	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
102	605016	百龙创园	445	14,222.20	0.00
103	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00



104	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
105	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
106	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
107	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
108	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
109	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
110	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
111	002371	北方华创	41	11,372.58	0.00
112	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
113	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
114	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
115	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
116	605189	富春染织	423	10,190.07	0.00
117	300917	特发服务	365	10,095.90	0.00
118	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
119	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
120	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
121	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
122	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
123	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
124	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
125	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
126	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
127	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
128	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
129	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
130	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
131	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
132	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
133	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
134	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
135	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
136	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
137	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
138	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
139	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
140	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
141	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
142	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00

143	605337	李子园	88	5,236.00	0.00
144	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
145	003020	立方制药	74	3,788.80	0.00
146	605077	华康股份	57	2,600.34	0.00
147	300872	天阳科技	71	2,577.30	0.00
148	300136	信维通信	65	2,007.20	0.00
149	600585	海螺水泥	46	1,888.30	0.00
150	605376	博迁新材	22	1,625.36	0.00
151	605060	联德股份	83	1,309.74	0.00
152	003036	泰坦股份	76	1,171.16	0.00
153	605299	舒华体育	38	817.38	0.00
154	605183	确成股份	41	717.50	0.00
155	300223	北京君正	5	504.60	0.00
156	003035	南网能源	46	457.24	0.00
157	605133	嵘泰股份	18	390.24	0.00
158	003025	思进智能	7	212.45	0.00
159	605303	园林股份	10	184.30	0.00
160	300920	润阳科技	3	101.04	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	002497	雅化集团	48,440,957.23	3.39
2	000998	隆平高科	40,412,800.00	2.83
3	600418	江淮汽车	40,066,117.85	2.80
4	600036	招商银行	38,356,220.32	2.68
5	601166	兴业银行	35,950,642.14	2.51
6	002385	大北农	33,595,885.00	2.35
7	002041	登海种业	25,598,423.83	1.79
8	603799	华友钴业	20,849,305.50	1.46
9	688099	晶晨股份	17,939,422.93	1.25
10	603986	兆易创新	15,469,152.57	1.08
11	300750	宁德时代	6,965,034.00	0.49
12	688819	天能股份	830,283.72	0.06

13	688538	和辉光电	548,777.90	0.04
14	300979	华利集团	307,152.12	0.02
15	300957	贝泰妮	306,177.77	0.02
16	688425	铁建重工	291,749.85	0.02
17	300981	中红医疗	291,685.77	0.02
18	688660	电气风电	278,734.72	0.02
19	688083	中望软件	276,468.50	0.02
20	688317	之江生物	248,082.80	0.02

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	002594	比亚迪	129,387,277.49	9.04
2	300750	宁德时代	88,667,811.79	6.20
3	002460	赣锋锂业	64,536,211.93	4.51
4	002497	雅化集团	55,456,680.85	3.88
5	000807	云铝股份	49,707,125.07	3.47
6	000333	美的集团	45,284,651.89	3.17
7	600030	中信证券	45,054,744.87	3.15
8	600893	航发动力	38,113,679.75	2.66
9	000933	神火股份	37,509,550.22	2.62
10	601689	拓普集团	34,393,699.49	2.40
11	688388	嘉元科技	28,526,643.91	1.99
12	002385	大北农	24,186,688.10	1.69
13	601377	兴业证券	23,938,226.30	1.67
14	000166	申万宏源	22,824,480.00	1.60
15	000671	阳光城	20,136,859.60	1.41
16	601211	国泰君安	19,693,833.15	1.38
17	603986	兆易创新	17,860,302.19	1.25
18	002074	国轩高科	15,404,371.00	1.08
19	603799	华友钴业	13,650,522.00	0.95
20	688006	杭可科技	13,026,093.24	0.91

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	333,936,659.71
卖出股票收入（成交）总额	861,372,377.60

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 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。

### 7.12.2 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

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。

### 7.12.3 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	268,889.61
2	应收证券清算款	4,538,561.31
3	应收股利	-
4	应收利息	12,188.79
5	应收申购款	2,479,561.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,299,201.31

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 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
100,727	3,852.55	129,499,557.78	33.37%	258,556,247.18	66.63%

### 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	134,006.67	0.0345%

### 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	632,779,845.13
本报告期基金总申购份额	204,519,106.96
减：本报告期基金总赎回份额	449,243,147.13
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	388,055,804.96

## § 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：

2021 年 3 月 16 日，公司聘任陈广益先生担任公司总经理。

基金托管人：

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

### 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

报告期期为基金进行审计的会计师事务所未发生变更。

### 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	
中泰证券	2	468,727,892.56	39.55%	436,527.10	42.97%	-
华安证券	2	439,044,471.64	37.05%	321,079.40	31.61%	-
方正证券	2	249,438,118.67	21.05%	232,302.52	22.87%	-
广发证券	1	27,805,856.10	2.35%	25,894.49	2.55%	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-



安信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	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

本基金本报告期内未发生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 2021 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

2021 年 8 月 30 日