

万家瑞盈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：宁波银行股份有限公司

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。

基金托管人宁波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、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,投资者在做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

| | |
|--|-----------|
| §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合规守信情况的说明..... | 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..... | 13 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 14 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 14 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 15 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明..... | 15 |
| §5 托管人报告 | 16 |
| 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 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 17 |
| 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 |
| §7 投资组合报告..... | 49 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 49 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 49 |
| 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..... | 50 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 52 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 54 |
| 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..... | 54 |
| 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..... | 55 |
| 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..... | 55 |
| 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..... | 55 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 55 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 55 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 55 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 57 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 57 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 57 |
| 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..... | 57 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 58 |
| §10 重大事件揭示..... | 59 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 59 |
| 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..... | 59 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 59 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 59 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 59 |
| 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..... | 59 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 59 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 61 |
| 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..... | 61 |
| §12 备查文件目录..... | 62 |

| | |
|------------------|----|
| 12.1 备查文件目录..... | 62 |
| 12.2 存放地点..... | 62 |
| 12.3 查阅方式..... | 62 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-------------------|------------------|
| 基金名称 | 万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 万家瑞盈 | |
| 基金主代码 | 003734 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016 年 11 月 11 日 | |
| 基金管理人 | 万家基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 宁波银行股份有限公司 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 报告期末基金份额总额 | 509,386,970.02 份 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 万家瑞盈 A | 万家瑞盈 C |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 303,932,029.04 份 | 205,454,940.98 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金通过灵活运用资产配置策略及多种股票市场、债券市场投资策略，充分挖掘潜在的投资机会，追求基金资产长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 1、资产配置策略；2、股票投资策略（（1）定性方面、（2）定量方面）；3、权证投资策略；4、普通债券投资策略；5、中小企业私募债券债券投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、证券公司短期公司债券投资策略；8、股指期货投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50% |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金，风险高于货币市场基金和债券型基金但低于股票型基金，属于中高风险、中高预期收益的证券投资基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|--------------------------------------|----------------------|
| 名称 | | 万家基金管理有限公司 | 宁波银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 兰剑 | 朱广科 |
| | 联系电话 | 021-38909626 | 0574-87050338 |
| | 电子邮箱 | lanj@wjasset.com | custody-audit@nbc.cn |
| 客户服务电话 | | 4008880800 | 0574-83895886 |
| 传真 | | 021-38909627 | 0574-89103213 |
| 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） | 中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 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） | 中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号 |
| 邮政编码 | | 200122 | 315100 |

| | | |
|-------|-----|-----|
| 法定代表人 | 方一天 | 陆华裕 |
|-------|-----|-----|

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《证券时报》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.wjasset.com |
| 基金中期报告备置地点 | 中国(上海)自由贸易试验区浦电路 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 | 万家基金管理有限公司 | 中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层） |

§ 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 | 万家瑞盈 A | 万家瑞盈 C |
|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| 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) | 报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日) |
| 本期已实现收益 | 4,565,920.45 | 3,258,952.23 |
| 本期利润 | -2,211,275.58 | -1,059,245.64 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0083 | -0.0056 |
| 本期加权平均净值利润率 | -0.70% | -0.48% |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.28% | 0.27% |
| 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 | 55,528,314.63 | 37,195,609.79 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1827 | 0.1810 |
| 期末基金资产净值 | 359,460,343.67 | 242,650,550.77 |
| 期末基金份额净值 | 1.1827 | 1.1810 |
| 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 | 18.27% | 18.10% |

注：(1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益; (2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字; (3) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家瑞盈 A

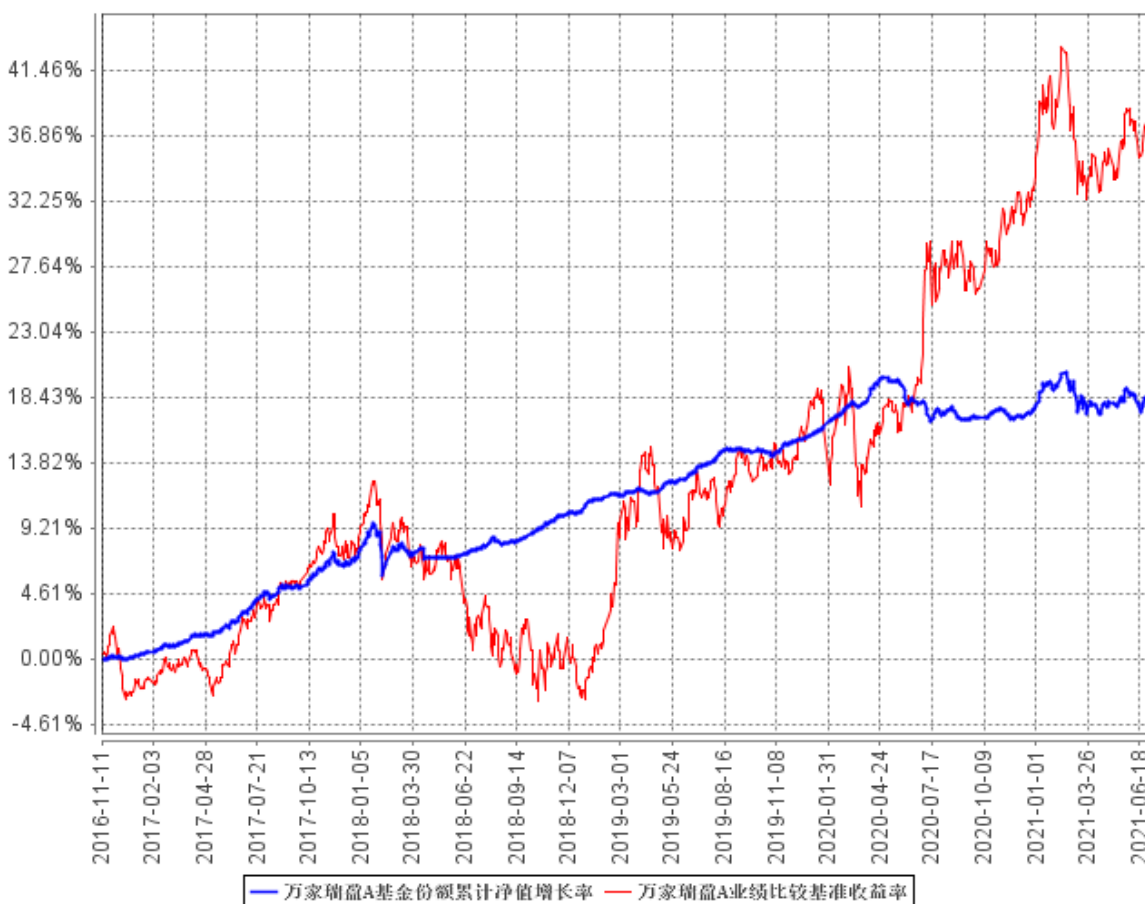
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去一个月 | -0.49% | 0.18% | -0.91% | 0.41% | 0.42% | -0.23% |
| 过去三个月 | 0.27% | 0.18% | 2.46% | 0.49% | -2.19% | -0.31% |
| 过去六个月 | 0.28% | 0.23% | 1.53% | 0.66% | -1.25% | -0.43% |
| 过去一年 | 0.15% | 0.17% | 14.21% | 0.66% | -14.06% | -0.49% |
| 过去三年 | 9.96% | 0.11% | 33.38% | 0.68% | -23.42% | -0.57% |
| 自基金合同生效起至今 | 18.27% | 0.12% | 37.38% | 0.60% | -19.11% | -0.48% |

万家瑞盈 C

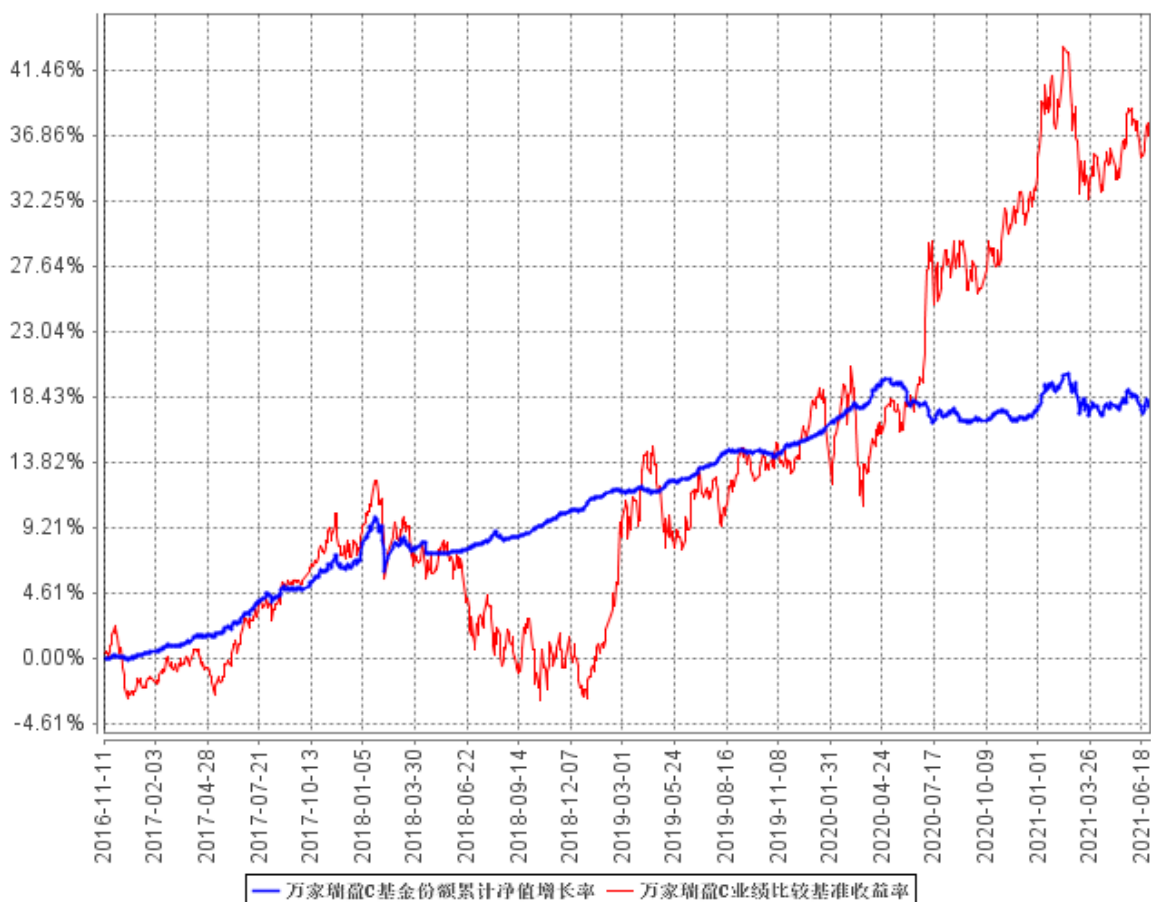
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去一个月 | -0.50% | 0.18% | -0.91% | 0.41% | 0.41% | -0.23% |
| 过去三个月 | 0.26% | 0.18% | 2.46% | 0.49% | -2.20% | -0.31% |
| 过去六个月 | 0.27% | 0.23% | 1.53% | 0.66% | -1.26% | -0.43% |
| 过去一年 | 0.14% | 0.17% | 14.21% | 0.66% | -14.07% | -0.49% |
| 过去三年 | 9.49% | 0.11% | 33.38% | 0.68% | -23.89% | -0.57% |
| 自基金合同生效起至今 | 18.10% | 0.12% | 37.38% | 0.60% | -19.28% | -0.48% |

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

万家瑞盈A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



万家瑞盈C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2016 年 11 月 11 日成立，根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44号文批准设立。公司现股东为中泰证券股份有限公司、新疆国际实业股份有限公司和齐河众鑫投资有限公司,住所:中国(上海)自由贸易试验区浦电路360号8楼(名义楼层9层),办公地点:上海市浦东新区浦电路360号9楼,注册资本3亿元人民币。目前管理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基金中基金 (FOF)、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基金中基金 (FOF)、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基金中基金 (FOF)、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基金中基金 (FOF)、万家互联互通核心资产量化策略混合型基金中基金 (FOF)、万家民瑞祥明 6 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、万家瑞泽回报一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、万家惠裕回报 6 个月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 | | |
| 谷丹青 | 万家瑞盈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、万家鑫盛纯债债券型证券投资基金的基金经理 | 2020 年 11 月 24 日 | - | 7.5 年 | 2010 年 5 月至 2011 年 5 月在上海新世纪资信评估投资服务有限公司担任评级部分析师；于 2012 年 2 月至 2014 年 4 月在上海资信有限公司担任评级部分析师；于 2016 年 7 月进入万家基金管理有限公司，先后担任固定收益部债券研究员、固定收益部基金经理助理等职务，现任固 |

| | | | | | |
|-----|---|----------------|----------------|---|-----------|
| | | | | | 定收益部基金经理。 |
| 侯慧娣 | - | 2018年12月 8日 | 2021年5月 15日 | - | 因个人原因离职 |

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,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

2021年一季度整体而言经济延续平稳复苏,而债券市场处于小幅震荡状态。至二季度,全球

疫情长尾特征拉长了经济复苏和政策退出的窗口，国内经济尚在顶部区域震荡，但多种数据显示边际走弱较为确定。5月发布的一季度《中国货币政策执行报告》认为通胀仍是输入性、结构性、暂时性的，二季度资金面超预期宽松，债市出现持续走强，10年期国债收益率下行11BP至3.08%，10年期国开收益率下行6BP至3.49%。权益市场方面，在经历一季度的调整后，总体而言成长风格行业表现较强，而价值风格表现较弱。

上半年本基金在债券配置上仍以信用债重短久期、高评级高资质风格为主，并通过长端利率债参与利率债下行机会。权益方面，本基金在上半年持仓股票以低估值蓝筹为主，二季度表现较弱。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家瑞盈 A 基金份额净值为 1.1827 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.28%；截至本报告期末万家瑞盈 C 基金份额净值为 1.1810 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.27%；同期业绩比较基准收益率为 1.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

向后看，经济复苏不均衡的局面预计仍难充分缓解，而出口随着海外疫情缓解预计走弱。通胀风险目前来看仍主要系供给造成，对货币政策影响有限。7月中央政治局会议要求“积极的财政提升政策效能”，不过我们预计房地产和基建投资仍然受到政策和隐性债务调控限制。

中长期看仍看好债券市场，不过由于前期利率下行较多，短期受政府债券供给等因素影响可能有调整压力。权益市场方面，目前部分景气度较高的行业估值较高，行业整体安全边际较小，投资机会可能以挖掘个股为主。预计本基金在股票配置上仍以价值蓝筹风格为主。

本基金将持续积极关注市场机会，保持稳健风格，力争为持有人获取较好的投资回报。

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金没有出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情况。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人在万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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：万家瑞盈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 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 692,455.54 | 233,046.36 |
| 结算备付金 | | 447,497.48 | 232,510.46 |
| 存出保证金 | | 103,444.89 | 14,307.35 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 582,009,759.03 | 183,821,146.50 |
| 其中：股票投资 | | 122,277,742.53 | 19,436,365.00 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 459,732,016.50 | 164,384,781.50 |
| 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 | 14,400,125.00 | 5,500,000.00 |
| 应收证券清算款 | | 3,242,470.59 | 502,889.86 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 5,305,113.38 | 1,697,090.84 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 66,617.97 | 45,090.00 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 606,267,483.88 | 192,046,081.37 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 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 | | 3,420,556.45 | - |
| 应付赎回款 | | 36,984.79 | 256,520.52 |
| 应付管理人报酬 | | 300,161.56 | 69,758.15 |
| 应付托管费 | | 60,032.31 | 13,951.62 |
| 应付销售服务费 | | 2,047.68 | 886.80 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 105,340.07 | 26,903.71 |
| 应交税费 | | 29,643.72 | 7,023.00 |

| | | | |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 201,822.86 | 320,000.00 |
| 负债合计 | | 4,156,589.44 | 695,043.80 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 509,386,970.02 | 162,391,613.35 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 92,723,924.42 | 28,959,424.22 |
| 所有者权益合计 | | 602,110,894.44 | 191,351,037.57 |
| 负债和所有者权益总计 | | 606,267,483.88 | 192,046,081.37 |

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1820 元，基金份额总额合计为 509,386,970.02 份。万家瑞盈 A 基金份额净值 1.1827 元，基金份额总额 303,932,029.04 份；万家瑞盈 C 基金份额净值 1.1810 元，基金份额总额 205,454,940.98 份。

6.2 利润表

会计主体：万家瑞盈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 |
|-----------------------|------------|--|---|
| 一、收入 | | -843,200.75 | 19,997,427.51 |
| 1.利息收入 | | 6,310,025.46 | 13,884,570.94 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 28,071.11 | 44,578.89 |
| 债券利息收入 | | 5,730,547.14 | 13,828,638.07 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 551,407.21 | 11,353.98 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 3,874,182.08 | 8,275,885.20 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 2,891,062.28 | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -64,144.36 | 8,275,885.20 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.3 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 1,047,264.16 | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | -11,095,393.90 | -2,596,873.89 |
| 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 | 67,985.61 | 433,845.26 |
| 减：二、费用 | | 2,427,320.47 | 4,362,228.28 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 1,601,181.25 | 1,590,263.80 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 320,236.21 | 318,052.79 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 10,962.80 | 25,058.25 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 372,210.12 | 19,042.66 |
| 5. 利息支出 | | 6,678.47 | 2,261,474.32 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 6,678.47 | 2,261,474.32 |
| 6. 税金及附加 | | 16,078.76 | 40,228.86 |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.20 | 99,972.86 | 108,107.60 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -3,270,521.22 | 15,635,199.23 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -3,270,521.22 | 15,635,199.23 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家瑞盈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） | 162,391,613.35 | 28,959,424.22 | 191,351,037.57 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -3,270,521.22 | -3,270,521.22 |
| 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） | 346,995,356.67 | 67,035,021.42 | 414,030,378.09 |
| 其中：1.基金申购款 | 422,375,934.11 | 80,883,988.05 | 503,259,922.16 |
| 2.基金赎回款 | -75,380,577.44 | -13,848,966.63 | -89,229,544.07 |
| 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) | 509,386,970.02 | 92,723,924.42 | 602,110,894.44 |
| 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) | 919,770,992.10 | 143,260,665.54 | 1,063,031,657.64 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 15,635,199.23 | 15,635,199.23 |
| 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) | -696,817,893.18 | -118,885,202.02 | -815,703,095.20 |
| 其中: 1.基金申购款 | 367,112,057.91 | 64,308,449.16 | 431,420,507.07 |
| 2.基金赎回款 | -1,063,929,951.09 | -183,193,651.18 | -1,247,123,602.27 |
| 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) | 222,953,098.92 | 40,010,662.75 | 262,963,761.67 |

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:

| | | |
|------------|------------|-----------|
| <u>方一天</u> | <u>陈广益</u> | <u>尹超</u> |
| 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

万家瑞盈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(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1959号文《关于准予万家瑞盈灵活配置混合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2016年11月9日至2016年11月10日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明

(2016)验字 60778298_B15 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 2016 年 11 月 11 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 620,025,575.38 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 620,025,575.38 元,折合 620,025,575.38 份基金份额。本基金的基金管理机构为万家基金管理有限公司,注册登记机构为万家基金管理有限公司,基金托管人为宁波银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的

股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券、可交换债券、中小企业私募债券、中期票据、证券公司短期公司债券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、货币市场工具等)、权证、股指期货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)。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*50%+中证全债指数收益率*50%。

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(2020 年修订)》、《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。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

(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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 692,455.54 |
| 定期存款 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 692,455.54 |

6.4.7.2 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 | 133,230,205.85 | 122,277,742.53 | -10,952,463.32 | |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | 98,570,028.96 | 98,449,016.50 | -121,012.46 |
| | 银行间市场 | 360,570,778.79 | 361,283,000.00 | 712,221.21 |
| | 合计 | 459,140,807.75 | 459,732,016.50 | 591,208.75 |
| 资产支持证券 | - | - | - | |
| 基金 | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | |
| 合计 | 592,371,013.60 | 582,009,759.03 | -10,361,254.57 | |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期内无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | |
|-------|------------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 4,400,000.00 | - |
| 银行间市场 | 10,000,125.00 | - |
| 合计 | 14,400,125.00 | - |

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息 | 491.93 |
| 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 | 201.40 |
| 应收债券利息 | 5,300,114.89 |
| 应收资产支持证券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | 4,258.56 |
| 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 | 46.60 |
| 合计 | 5,305,113.38 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 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 | 97,276.65 |
| 银行间市场应付交易费用 | 8,063.42 |

| | |
|----|------------|
| 合计 | 105,340.07 |
|----|------------|

6.4.7.8 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 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 预提费用 | 201,822.86 |
| 合计 | 201,822.86 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 万家瑞盈 A | | |
|---------------|----------------------------|----------------|
| 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 | 57,680,441.37 | 57,680,441.37 |
| 本期申购 | 260,123,323.68 | 260,123,323.68 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -13,871,736.01 | -13,871,736.01 |
| - 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 | 303,932,029.04 | 303,932,029.04 |

金额单位：人民币元

| 万家瑞盈 C | | |
|---------------|----------------------------|----------------|
| 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 | 104,711,171.98 | 104,711,171.98 |
| 本期申购 | 162,252,610.43 | 162,252,610.43 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -61,508,841.43 | -61,508,841.43 |
| - 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 | 205,454,940.98 | 205,454,940.98 |

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 万家瑞盈 A | | | |
|----------------|---------------|----------------|---------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 11,869,082.58 | -1,522,569.69 | 10,346,512.89 |
| 本期利润 | 4,565,920.45 | -6,777,196.03 | -2,211,275.58 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 51,063,171.12 | -3,670,093.80 | 47,393,077.32 |
| 其中：基金申购款 | 53,951,838.53 | -3,983,481.26 | 49,968,357.27 |
| 基金赎回款 | -2,888,667.41 | 313,387.46 | -2,575,279.95 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 67,498,174.15 | -11,969,859.52 | 55,528,314.63 |

单位：人民币元

| 万家瑞盈 C | | | |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 21,383,334.35 | -2,770,423.02 | 18,612,911.33 |
| 本期利润 | 3,258,952.23 | -4,318,197.87 | -1,059,245.64 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 20,652,811.85 | -1,010,867.75 | 19,641,944.10 |
| 其中：基金申购款 | 33,576,883.00 | -2,661,252.22 | 30,915,630.78 |
| 基金赎回款 | -12,924,071.15 | 1,650,384.47 | -11,273,686.68 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 45,295,098.43 | -8,099,488.64 | 37,195,609.79 |

6.4.7.11 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 | 14,159.68 |
| 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 | 5,890.06 |
| 其他 | 8,021.37 |
| 合计 | 28,071.11 |

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------|----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| 卖出股票成交总额 | 87,622,785.77 |
| 减：卖出股票成本总额 | 84,731,723.49 |
| 买卖股票差价收入 | 2,891,062.28 |

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------------------------|----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | -64,144.36 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | -64,144.36 |

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------------------|----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 197,641,265.55 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 195,012,875.81 |
| 减：应收利息总额 | 2,692,534.10 |
| 买卖债券差价收入 | -64,144.36 |

6.4.7.13.3 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。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期末无衍生工具收益。

6.4.7.16 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 | 1,047,264.16 |
| 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 | 1,047,264.16 |

6.4.7.17 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 | -11,095,393.90 |
| ——股票投资 | -11,804,543.72 |
| ——债券投资 | 709,149.82 |
| ——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 | -11,095,393.90 |

6.4.7.18 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 | 11,095.61 |
| 转换费收入 003734 | 56,890.00 |
| 转换费收入 003735 | - |

| | |
|----|-----------|
| 合计 | 67,985.61 |
|----|-----------|

6.4.7.19 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 | 364,297.62 |
| 银行间市场交易费用 | 7,912.50 |
| 交易基金产生的费用 | - |
| 其中：申购费 | - |
| 赎回费 | - |
| 合计 | 372,210.12 |

6.4.7.20 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 | 22,315.49 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 帐户维护费 | 18,150.00 |
| 其他 | - |
| 合计 | 99,972.86 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------|----------------|
| 万家基金管理有限公司 | 基金管理人、基金销售机构 |
| 宁波银行股份有限公司 | 基金托管人 |
| 中泰证券股份有限公司（“中泰证券”） | 基金管理人股东、基金销售机构 |

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 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 | 128,874,441.75 | 45.77% | - | - |

注：本基金上年可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

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 | 占当期债券 成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券 成交总额的比例 |
| 中泰证券 | 48,077,283.51 | 82.26% | 157,468,708.32 | 95.15% |

6.4.10.1.3 债券回购交易

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 | |
|-------|----------------------------|--------------------|---------------------------------|--------------------|
| | 回购成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 | 回购成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 |
| 中泰证券 | 313,500,000.00 | 79.42% | - | - |

注：本基金上年度可比期间未通过关联方席位进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 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 | 94,245.42 | 39.86% | 34,198.62 | 35.16% |

注：本基金上年度可比期间未产生关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 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 | 1,601,181.25 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 128,320.61 | 923,942.59 |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.60% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.2.2 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 | 320,236.21 |

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.12%的年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times 0.12\% / \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.2.3 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | | |
|----------------|--|----------|----------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 万家瑞盈 A | 万家瑞盈 C | 合计 |
| 万家基金管理有限公司 | - | 6,019.25 | 6,019.25 |
| 中泰证券股份有限公司 | - | 121.59 | 121.59 |
| 合计 | - | 6,140.84 | 6,140.84 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 万家瑞盈 A | 万家瑞盈 C | 合计 |
| 万家基金管理有限公司 | - | 16.38 | 16.38 |
| 中泰证券股份有限公司 | - | 1,503.63 | 1,503.63 |
| 合计 | - | 1,520.01 | 1,520.01 |

注:本基金 A 类基金份额不收取销售服务费, C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%, 销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.01%年费率计提。

计算方法如下:

$$H=E \times 0.01\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中划出,由登记机构代收,登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期和未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

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。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 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 |
| 宁波银行股份有限公司 | 692,455.54 | 14,159.68 | 5,721,800.76 | 33,237.68 |

注：本基金的银行存款由基金托管人宁波银行股份有限公司保管，活期存款按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金在报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|-----------------|------------------|---------|-------|--------|--------------|-----------|-----------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 688087 | 英科再生 | 2021 年 6 月 30 日 | 2021 年 7 月 9 日 | 新股未上市 | 21.96 | 21.96 | 2,469 | 54,219.24 | 54,219.24 | |
| 605162 | 新中港 | 2021 年 6 月 29 日 | 2021 年 7 月 7 日 | 新股未上市 | 6.07 | 6.07 | 1,377 | 8,358.39 | 8,358.39 | |
| 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 | |
| 605287 | 德才股份 | 2021 年 6 月 28 日 | 2021 年 7 月 6 日 | 新股未上市 | 31.56 | 31.56 | 349 | 11,014.44 | 11,014.44 | |
| 688226 | 威腾电气 | 2021 年 6 月 28 日 | 2021 年 7 月 7 日 | 新股未上市 | 6.42 | 6.42 | 2,693 | 17,289.06 | 17,289.06 | |
| 688499 | 利元亨 | 2021 年 6 月 23 日 | 2021 年 7 月 1 日 | 新股未上市 | 38.85 | 38.85 | 2,149 | 83,488.65 | 83,488.65 | |
| 301016 | 雷尔伟 | 2021 年 6 月 23 日 | 2021 年 12 月 30 日 | 创业板流通受限 | 13.75 | 32.98 | 275 | 3,781.25 | 9,069.50 | |
| 301015 | 百洋医药 | 2021 年 6 月 22 日 | 2021 年 12 月 30 日 | 创业板流通受限 | 7.64 | 38.83 | 462 | 3,529.68 | 17,939.46 | |
| 301013 | 利和兴 | 2021 年 6 月 21 日 | 2021 年 12 月 29 日 | 创业板流通受限 | 8.72 | 27.11 | 471 | 4,107.12 | 12,768.81 | |
| 301004 | 嘉益股份 | 2021 年 6 月 18 日 | 2021 年 12 月 | 创业板流通受 | 7.81 | 21.94 | 312 | 2,436.72 | 6,845.28 | |

| | | | | | | | | | | |
|--------|----------|-----------------------|---------------------------|-----------------|-------|-------|-------|-----------|------------|---|
| | | 日 | 月 27 日 | 限 | | | | | | |
| 301012 | 扬电 科技 | 2021 年 6 月 15 日 | 2021 年 12 月 22 日 | 创业板 流通受 限 | 8.05 | 24.26 | 170 | 1,368.50 | 4,124.20 | - |
| 688517 | 金冠 电气 | 2021 年 6 月 10 日 | 2021 年 12 月 20 日 | 科创板 流通受 限 | 7.71 | 11.88 | 2,892 | 22,297.32 | 34,356.96 | - |
| 301011 | 华立 科技 | 2021 年 6 月 9 日 | 2021 年 12 月 17 日 | 创业板 流通受 限 | 14.20 | 33.84 | 175 | 2,485.00 | 5,922.00 | - |
| 301010 | 晶雪 节能 | 2021 年 6 月 9 日 | 2021 年 12 月 20 日 | 创业板 流通受 限 | 7.83 | 17.61 | 218 | 1,706.94 | 3,838.98 | - |
| 301007 | 德迈 仕 | 2021 年 6 月 4 日 | 2021 年 12 月 16 日 | 创业板 流通受 限 | 5.29 | 14.44 | 303 | 1,602.87 | 4,375.32 | - |
| 301006 | 迈拓 股份 | 2021 年 5 月 31 日 | 2021 年 12 月 7 日 | 创业板 流通受 限 | 14.42 | 24.89 | 5,051 | 72,835.42 | 125,719.39 | - |
| 301002 | 崧盛 股份 | 2021 年 5 月 27 日 | 2021 年 12 月 7 日 | 创业板 流通受 限 | 18.71 | 57.62 | 201 | 3,760.71 | 11,581.62 | - |
| 300997 | 欢乐 家 | 2021 年 5 月 26 日 | 2021 年 12 月 2 日 | 创业板 流通受 限 | 4.94 | 13.05 | 928 | 4,584.32 | 12,110.40 | - |
| 300998 | 宁波 方正 | 2021 年 5 月 25 日 | 2021 年 12 月 2 日 | 创业板 流通受 限 | 6.02 | 21.32 | 201 | 1,210.02 | 4,285.32 | - |
| 300614 | 百川 畅银 | 2021 年 5 月 18 日 | 2021 年 11 月 25 日 | 创业板 流通受 限 | 9.19 | 40.38 | 329 | 3,023.51 | 13,285.02 | - |
| 300992 | 泰福 泵业 | 2021 年 5 月 17 日 | 2021 年 11 月 25 日 | 创业板 流通受 限 | 9.36 | 20.32 | 200 | 1,872.00 | 4,064.00 | - |
| 300995 | 奇德 | 2021 年 | 2021 | 创业板 | 14.72 | 23.32 | 191 | 2,811.52 | 4,454.12 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-------------|---------|-------|-------|-------|-----------|------------|---|
| | 新材 | 5月17日 | 年11月26日 | 流通受限 | | | | | | |
| 688613 | 奥精医疗 | 2021年5月13日 | 2021年11月22日 | 科创板流通受限 | 16.43 | 63.50 | 2,617 | 42,997.31 | 166,179.50 | - |
| 300991 | 创益通 | 2021年5月12日 | 2021年11月22日 | 创业板流通受限 | 13.06 | 26.51 | 254 | 3,317.24 | 6,733.54 | - |
| 688097 | 博众精工 | 2021年4月29日 | 2021年11月12日 | 科创板流通受限 | 11.27 | 28.01 | 3,983 | 44,888.41 | 111,563.83 | - |
| 300987 | 川网传媒 | 2021年4月28日 | 2021年11月11日 | 创业板流通受限 | 6.79 | 26.81 | 301 | 2,043.79 | 8,069.81 | - |
| 688395 | 正弦电气 | 2021年4月21日 | 2021年10月29日 | 科创板流通受限 | 15.95 | 22.37 | 1,627 | 25,950.65 | 36,395.99 | - |
| 300985 | 致远新能 | 2021年4月21日 | 2021年10月29日 | 创业板流通受限 | 24.90 | 24.81 | 295 | 7,345.50 | 7,318.95 | - |
| 300986 | 志特新材 | 2021年4月21日 | 2021年11月1日 | 创业板流通受限 | 14.79 | 30.57 | 264 | 3,904.56 | 8,070.48 | - |
| 300981 | 中红医疗 | 2021年4月19日 | 2021年10月27日 | 创业板流通受限 | 48.59 | 90.39 | 442 | 21,476.78 | 39,952.38 | - |
| 300982 | 苏文电能 | 2021年4月19日 | 2021年10月27日 | 创业板流通受限 | 15.83 | 45.29 | 317 | 5,018.11 | 14,356.93 | - |
| 300979 | 华利集团 | 2021年4月15日 | 2021年10月26日 | 创业板流通受限 | 33.22 | 87.50 | 735 | 24,416.70 | 64,312.50 | - |
| 300978 | 东箭科技 | 2021年4月15日 | 2021年10月 | 创业板流通受限 | 8.42 | 13.60 | 593 | 4,993.06 | 8,064.80 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|----------|-----------------------|---------------------------|-----------------|-------|--------|-------|-----------|-----------|---|
| | | 日 | 月 26 日 | 限 | | | | | | |
| 300975 | 商络 电子 | 2021 年 4 月 14 日 | 2021 年 10 月 21 日 | 创业板 流通受 限 | 5.48 | 13.03 | 492 | 2,696.16 | 6,410.76 | - |
| 688639 | 华恒 生物 | 2021 年 4 月 14 日 | 2021 年 10 月 22 日 | 科创板 流通受 限 | 23.16 | 42.28 | 2,302 | 53,314.32 | 97,328.56 | - |
| 300973 | 立高 食品 | 2021 年 4 月 8 日 | 2021 年 10 月 15 日 | 创业板 流通受 限 | 28.28 | 115.71 | 360 | 10,180.80 | 41,655.60 | - |
| 300972 | 万辰 生物 | 2021 年 4 月 8 日 | 2021 年 10 月 19 日 | 创业板 流通受 限 | 7.19 | 12.65 | 430 | 3,091.70 | 5,439.50 | - |
| 300971 | 博亚 精工 | 2021 年 4 月 7 日 | 2021 年 10 月 15 日 | 创业板 流通受 限 | 18.24 | 28.29 | 245 | 4,468.80 | 6,931.05 | - |
| 300968 | 格林 精密 | 2021 年 4 月 6 日 | 2021 年 10 月 15 日 | 创业板 流通受 限 | 6.87 | 12.07 | 1,162 | 7,982.94 | 14,025.34 | - |
| 300967 | 晓鸣 股份 | 2021 年 4 月 2 日 | 2021 年 10 月 13 日 | 创业板 流通受 限 | 4.54 | 11.54 | 507 | 2,301.78 | 5,850.78 | - |
| 300966 | 共同 药业 | 2021 年 3 月 31 日 | 2021 年 10 月 11 日 | 创业板 流通受 限 | 8.24 | 31.54 | 286 | 2,356.64 | 9,020.44 | - |
| 300963 | 中洲 特材 | 2021 年 3 月 30 日 | 2021 年 10 月 11 日 | 创业板 流通受 限 | 12.13 | 22.49 | 283 | 3,432.79 | 6,364.67 | - |
| 688109 | 品茗 股份 | 2021 年 3 月 22 日 | 2021 年 9 月 30 日 | 科创板 流通受 限 | 50.05 | 72.10 | 1,301 | 65,115.05 | 93,802.10 | - |
| 301020 | 密封 科技 | 2021 年 6 月 28 日 | 2022 年 1 月 6 日 | 创业板 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 | 创业板 流通受 限 | 9.46 | 9.46 | 290 | 2,743.40 | 2,743.40 |
|--------|------|-----------------------|----------------------|-----------------|------|------|-----|----------|----------|

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金期末无银行间市场正回购余额，因此无银行间正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，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证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1 | 30,186,000.00 | - |
| A-1 以下 | 10,005,000.00 | - |
| 未评级 | 167,948,250.00 | 46,886,466.00 |
| 合计 | 208,139,250.00 | 46,886,466.00 |

注：未评级债券包括超短期融资券、同业存单、政策性金融债和国债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | 217,015,000.00 | 103,183,750.00 |
| AAA 以下 | 10,010,000.00 | 9,994,000.00 |
| 未评级 | 24,567,766.50 | 4,320,565.50 |
| 合计 | 251,592,766.50 | 117,498,315.50 |

注：未评级债券包括政策性金融债。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。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部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金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。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险, 包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本 期 末 202 1 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 | 692,455.54 | - | - | - | - | - | 692,455.54 |

| | | | | | | | |
|----------|---------------|----------------|----------------|----------------|--------------|----------------|----------------|
| 结算备付金 | 447,497.48 | - | - | - | - | - | 447,497.48 |
| 存出保证金 | 103,444.89 | - | - | - | - | - | 103,444.89 |
| 交易性金融资产 | 37,191,330.00 | 113,783,436.50 | 178,352,250.00 | 120,469,000.00 | 9,936,000.00 | 122,277,742.53 | 582,009,759.03 |
| 买入返售金融资产 | 14,400,125.00 | - | - | - | - | - | 14,400,125.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 3,242,470.59 | 3,242,470.59 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 5,305,113.38 | 5,305,113.38 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 66,617.97 | 66,617.97 |
| 资产总计 | 52,834,852.91 | 113,783,436.50 | 178,352,250.00 | 120,469,000.00 | 9,936,000.00 | 130,891,944.47 | 606,267,483.88 |

| | | | | | | | |
|---------|---|---|---|---|---|--------------|--------------|
| 计 | | | | | | | |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 3,420,556.45 | 3,420,556.45 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 36,984.79 | 36,984.79 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 300,161.56 | 300,161.56 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 60,032.31 | 60,032.31 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 2,047.68 | 2,047.68 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 105,340.07 | 105,340.07 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 29,643.72 | 29,643.72 |

| | | | | | | | |
|---|---------------|----------------|----------------|----------------|--------------|----------------|----------------|
| 其他 负债 | - | - | - | - | - | 201,822.86 | 201,822.86 |
| 负债 总计 | - | - | - | - | - | 4,156,589.44 | 4,156,589.44 |
| 利率 敏感 度缺 口 | 52,834,852.91 | 113,783,436.50 | 178,352,250.00 | 120,469,000.00 | 9,936,000.00 | 126,735,355.03 | 602,110,894.44 |
| 上 年 度 末 202 0 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 | 233,046.36 | - | - | - | - | - | 233,046.36 |
| 结 算 备 付 金 | 232,510.46 | - | - | - | - | - | 232,510.46 |
| 存 出 保 证 金 | 14,307.35 | - | - | - | - | - | 14,307.35 |
| 交 易 性 | - | 10,039,986.00 | 108,964,295.50 | 45,380,500.00 | - | 19,436,365.00 | 183,821,146.50 |

| | | | | | | | |
|----------|--------------|---------------|----------------|---------------|---|---------------|----------------|
| 金融资产 | | | | | | | |
| 买入返售金融资产 | 5,500,000.00 | - | - | - | - | - | 5,500,000.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 502,889.86 | 502,889.86 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 1,697,090.84 | 1,697,090.84 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 45,090.00 | 45,090.00 |
| 资产总计 | 5,979,864.17 | 10,039,986.00 | 108,964,295.50 | 45,380,500.00 | - | 21,681,435.70 | 192,046,081.37 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 256,520.52 | 256,520.52 |
| 应付管理人 | - | - | - | - | - | 69,758.15 | 69,758.15 |

| | | | | | | | |
|---------|--------------|---------------|----------------|---------------|---|----------------|----------------|
| 报酬 | | | | | | | |
| 应付托管费 | | - | - | - | - | 13,951.62 | 13,951.62 |
| 应付销售服务费 | | - | - | - | - | 886.80 | 886.80 |
| 应付交易费用 | | - | - | - | - | 26,903.71 | 26,903.71 |
| 应交税费 | | - | - | - | - | 7,023.00 | 7,023.00 |
| 其他负债 | | - | - | - | - | 320,000.00 | 320,000.00 |
| 负债总计 | | - | - | - | - | 695,043.80 | 695,043.80 |
| 利率敏感度缺口 | 5,979,864.17 | 10,039,986.00 | 108,964,295.50 | 45,380,500.00 | | -20,986,391.90 | 191,351,037.57 |

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | |
|----|----------------------|
| 假设 | 若市场利率发生变动而其他市场变量保持不变 |
|----|----------------------|

| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元） | |
|------------------|------------------|---------------------------------|-------------------|
| | | 本期末（2021年6月30日） | 上年度末（2020年12月31日） |
| | 1. 市场利率下降 25 个基点 | 1,126,001.13 | 351,302.16 |
| 2. 市场利率上升 25 个基点 | -1,114,886.75 | -349,423.03 | |

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 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 | 122,277,742.53 | 20.31 | 19,436,365.00 | 10.16 |
| 交易性金融资产-基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-债券投资 | 459,732,016.50 | 76.35 | 164,384,781.50 | 85.91 |
| 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 | 582,009,759.03 | 96.66 | 183,821,146.50 | 96.06 |

注：股票投资占基金资产的 0%-95%。其中，基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净

值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

6.4.13.4.3.2 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（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 | -931,996.38 | -184,808.64 |
| 2. 股票基准指数上升 100 个基点 | 931,996.38 | 184,808.64 | |

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

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 122,277,742.53 | 20.17 |
| | 其中：股票 | 122,277,742.53 | 20.17 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 459,732,016.50 | 75.83 |
| | 其中：债券 | 459,732,016.50 | 75.83 |
| | 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 | 14,400,125.00 | 2.38 |
| | 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 | 1,139,953.02 | 0.19 |
| 8 | 其他各项资产 | 8,717,646.83 | 1.44 |
| 9 | 合计 | 606,267,483.88 | 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 | 11,290.28 | 0.00 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 39,251,541.84 | 6.52 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,998,620.39 | 1.00 |
| E | 建筑业 | 25,371.37 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 24,350.22 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 5,957,100.00 | 0.99 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 114,102.31 | 0.02 |
| J | 金融业 | 55,378,581.10 | 9.20 |
| K | 房地产业 | 15,503,500.00 | 2.57 |
| 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 | 13,285.02 | 0.00 |
| 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 | 122,277,742.53 | 20.31 |

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 | 000001 | 平安银行 | 630,000 | 14,250,600.00 | 2.37 |
| 2 | 000002 | 万科A | 550,000 | 13,095,500.00 | 2.17 |
| 3 | 600030 | 中信证券 | 240,000 | 5,985,600.00 | 0.99 |
| 3 | 600900 | 长江电力 | 290,000 | 5,985,600.00 | 0.99 |
| 4 | 601166 | 兴业银行 | 250,000 | 5,137,500.00 | 0.85 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 90,000 | 4,877,100.00 | 0.81 |
| 6 | 000166 | 申万宏源 | 1,000,000 | 4,680,000.00 | 0.78 |
| 7 | 600887 | 伊利股份 | 110,000 | 4,051,300.00 | 0.67 |
| 8 | 000651 | 格力电器 | 70,000 | 3,647,000.00 | 0.61 |
| 9 | 601601 | 中国太保 | 120,000 | 3,476,400.00 | 0.58 |
| 10 | 601398 | 工商银行 | 650,000 | 3,360,500.00 | 0.56 |
| 11 | 300059 | 东方财富 | 100,000 | 3,279,000.00 | 0.54 |
| 12 | 000157 | 中联重科 | 350,000 | 3,234,000.00 | 0.54 |
| 13 | 002946 | 新乳业 | 200,000 | 3,030,000.00 | 0.50 |
| 14 | 601939 | 建设银行 | 450,000 | 2,992,500.00 | 0.50 |
| 15 | 000739 | 普洛药业 | 100,000 | 2,940,000.00 | 0.49 |
| 15 | 002966 | 苏州银行 | 400,000 | 2,940,000.00 | 0.49 |
| 16 | 600031 | 三一重工 | 100,000 | 2,907,000.00 | 0.48 |
| 17 | 000333 | 美的集团 | 40,000 | 2,854,800.00 | 0.47 |
| 18 | 600048 | 保利地产 | 200,000 | 2,408,000.00 | 0.40 |
| 19 | 600018 | 上港集团 | 500,000 | 2,385,000.00 | 0.40 |
| 20 | 600104 | 上汽集团 | 100,000 | 2,197,000.00 | 0.36 |
| 21 | 600309 | 万华化学 | 20,000 | 2,176,400.00 | 0.36 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 22 | 000338 | 潍柴动力 | 120,000 | 2,144,400.00 | 0.36 |
| 23 | 002311 | 海大集团 | 22,500 | 1,836,000.00 | 0.30 |
| 24 | 000951 | 中国重汽 | 64,900 | 1,756,194.00 | 0.29 |
| 25 | 600377 | 宁沪高速 | 150,000 | 1,464,000.00 | 0.24 |
| 26 | 600660 | 福耀玻璃 | 25,000 | 1,396,250.00 | 0.23 |
| 27 | 601628 | 中国人寿 | 40,000 | 1,355,600.00 | 0.23 |
| 28 | 601012 | 隆基股份 | 15,000 | 1,332,600.00 | 0.22 |
| 29 | 601688 | 华泰证券 | 75,000 | 1,185,000.00 | 0.20 |
| 30 | 601006 | 大秦铁路 | 150,000 | 987,000.00 | 0.16 |
| 31 | 601318 | 中国平安 | 14,500 | 932,060.00 | 0.15 |
| 32 | 600276 | 恒瑞医药 | 12,000 | 815,640.00 | 0.14 |
| 33 | 600004 | 白云机场 | 70,000 | 782,600.00 | 0.13 |
| 34 | 002493 | 荣盛石化 | 40,000 | 690,800.00 | 0.11 |
| 35 | 600585 | 海螺水泥 | 15,000 | 615,750.00 | 0.10 |
| 36 | 601128 | 常熟银行 | 95,000 | 589,000.00 | 0.10 |
| 37 | 600690 | 海尔智家 | 20,000 | 518,200.00 | 0.09 |
| 38 | 002352 | 顺丰控股 | 5,000 | 338,500.00 | 0.06 |
| 39 | 601288 | 农业银行 | 100,000 | 303,000.00 | 0.05 |
| 40 | 688613 | 奥精医疗 | 2,617 | 166,179.50 | 0.03 |
| 41 | 301006 | 迈拓股份 | 5,051 | 125,719.39 | 0.02 |
| 42 | 688097 | 博众精工 | 3,983 | 111,563.83 | 0.02 |
| 43 | 688639 | 华恒生物 | 2,302 | 97,328.56 | 0.02 |
| 44 | 688109 | 品茗股份 | 1,301 | 93,802.10 | 0.02 |
| 45 | 688499 | 利元亨 | 2,149 | 83,488.65 | 0.01 |
| 46 | 300979 | 华利集团 | 735 | 64,312.50 | 0.01 |
| 47 | 688087 | 英科再生 | 2,469 | 54,219.24 | 0.01 |
| 48 | 301020 | 密封科技 | 4,210 | 44,794.40 | 0.01 |
| 49 | 300973 | 立高食品 | 360 | 41,655.60 | 0.01 |
| 50 | 300981 | 中红医疗 | 442 | 39,952.38 | 0.01 |
| 51 | 688395 | 正弦电气 | 1,627 | 36,395.99 | 0.01 |
| 52 | 601528 | 瑞丰银行 | 2,230 | 34,721.10 | 0.01 |
| 53 | 688517 | 金冠电气 | 2,892 | 34,356.96 | 0.01 |
| 54 | 301021 | 英诺激光 | 2,899 | 27,424.54 | 0.00 |
| 55 | 301015 | 百洋医药 | 462 | 17,939.46 | 0.00 |
| 56 | 688226 | 威腾电气 | 2,693 | 17,289.06 | 0.00 |
| 57 | 300982 | 苏文电能 | 317 | 14,356.93 | 0.00 |
| 58 | 300968 | 格林精密 | 1,162 | 14,025.34 | 0.00 |
| 59 | 001208 | 华菱线缆 | 1,754 | 13,558.42 | 0.00 |
| 60 | 300614 | 百川畅银 | 329 | 13,285.02 | 0.00 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 61 | 301013 | 利和兴 | 471 | 12,768.81 | 0.00 |
| 62 | 603171 | 税友股份 | 637 | 12,230.40 | 0.00 |
| 63 | 300997 | 欢乐家 | 928 | 12,110.40 | 0.00 |
| 64 | 301002 | 崧盛股份 | 201 | 11,581.62 | 0.00 |
| 65 | 605287 | 德才股份 | 349 | 11,014.44 | 0.00 |
| 66 | 301016 | 雷尔伟 | 275 | 9,069.50 | 0.00 |
| 67 | 300966 | 共同药业 | 286 | 9,020.44 | 0.00 |
| 68 | 605162 | 新中港 | 1,377 | 8,358.39 | 0.00 |
| 69 | 300986 | 志特新材 | 264 | 8,070.48 | 0.00 |
| 70 | 300987 | 川网传媒 | 301 | 8,069.81 | 0.00 |
| 71 | 300978 | 东箭科技 | 593 | 8,064.80 | 0.00 |
| 72 | 300985 | 致远新能 | 295 | 7,318.95 | 0.00 |
| 73 | 300971 | 博亚精工 | 245 | 6,931.05 | 0.00 |
| 74 | 301004 | 嘉益股份 | 312 | 6,845.28 | 0.00 |
| 75 | 300991 | 创益通 | 254 | 6,733.54 | 0.00 |
| 76 | 300975 | 商络电子 | 492 | 6,410.76 | 0.00 |
| 77 | 300963 | 中洲特材 | 283 | 6,364.67 | 0.00 |
| 78 | 301011 | 华立科技 | 175 | 5,922.00 | 0.00 |
| 79 | 300967 | 晓鸣股份 | 507 | 5,850.78 | 0.00 |
| 80 | 300972 | 万辰生物 | 430 | 5,439.50 | 0.00 |
| 81 | 605011 | 杭州热电 | 525 | 4,662.00 | 0.00 |
| 82 | 300995 | 奇德新材 | 191 | 4,454.12 | 0.00 |
| 83 | 301007 | 德迈仕 | 303 | 4,375.32 | 0.00 |
| 84 | 300998 | 宁波方正 | 201 | 4,285.32 | 0.00 |
| 85 | 301012 | 扬电科技 | 170 | 4,124.20 | 0.00 |
| 86 | 300992 | 泰福泵业 | 200 | 4,064.00 | 0.00 |
| 87 | 301010 | 晶雪节能 | 218 | 3,838.98 | 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 | 000002 | 万科A | 17,296,808.44 | 9.04 |
| 2 | 000001 | 平安银行 | 16,360,476.00 | 8.55 |
| 3 | 000089 | 深圳机场 | 8,283,598.00 | 4.33 |
| 4 | 000157 | 中联重科 | 7,488,407.00 | 3.91 |
| 5 | 600900 | 长江电力 | 6,154,199.90 | 3.22 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 6 | 600036 | 招商银行 | 6,021,728.88 | 3.15 |
| 7 | 601166 | 兴业银行 | 5,959,944.00 | 3.11 |
| 8 | 002352 | 顺丰控股 | 5,527,825.55 | 2.89 |
| 9 | 300059 | 东方财富 | 5,397,085.63 | 2.82 |
| 10 | 600048 | 保利地产 | 5,381,003.00 | 2.81 |
| 11 | 600030 | 中信证券 | 4,705,965.00 | 2.46 |
| 12 | 600009 | 上海机场 | 4,656,776.72 | 2.43 |
| 13 | 000166 | 申万宏源 | 4,632,000.00 | 2.42 |
| 14 | 601601 | 中国太保 | 4,474,259.00 | 2.34 |
| 15 | 000338 | 潍柴动力 | 4,278,196.00 | 2.24 |
| 16 | 000651 | 格力电器 | 4,237,666.00 | 2.21 |
| 17 | 000656 | 金科股份 | 4,169,858.00 | 2.18 |
| 18 | 600018 | 上港集团 | 4,148,360.00 | 2.17 |
| 19 | 600887 | 伊利股份 | 4,042,689.00 | 2.11 |
| 20 | 000333 | 美的集团 | 3,723,267.58 | 1.95 |

注：本基金本报告期内无累计买入价值超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细。

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 | 000089 | 深圳机场 | 8,006,058.00 | 4.18 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 5,247,319.00 | 2.74 |
| 3 | 600009 | 上海机场 | 4,435,997.60 | 2.32 |
| 4 | 000656 | 金科股份 | 3,669,623.00 | 1.92 |
| 5 | 002352 | 顺丰控股 | 3,527,953.00 | 1.84 |
| 6 | 000425 | 徐工机械 | 3,116,247.00 | 1.63 |
| 7 | 600048 | 保利地产 | 2,855,606.00 | 1.49 |
| 8 | 000157 | 中联重科 | 2,592,669.00 | 1.35 |
| 9 | 000401 | 冀东水泥 | 2,476,712.00 | 1.29 |
| 10 | 600585 | 海螺水泥 | 2,270,093.00 | 1.19 |
| 11 | 600660 | 福耀玻璃 | 2,192,623.00 | 1.15 |
| 12 | 300059 | 东方财富 | 2,123,138.00 | 1.11 |
| 13 | 600690 | 海尔智家 | 2,039,113.00 | 1.07 |
| 14 | 600018 | 上港集团 | 1,992,684.00 | 1.04 |
| 15 | 600031 | 三一重工 | 1,711,625.00 | 0.89 |
| 16 | 600346 | 恒力石化 | 1,701,475.99 | 0.89 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 17 | 000671 | 阳光城 | 1,679,285.00 | 0.88 |
| 18 | 000001 | 平安银行 | 1,556,249.60 | 0.81 |
| 19 | 601012 | 隆基股份 | 1,398,353.00 | 0.73 |
| 20 | 600276 | 恒瑞医药 | 1,382,200.00 | 0.72 |

注：本基金本报告期内无累计卖出价值超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细。

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 | 199,377,644.74 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 87,622,785.77 |

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 7,523,250.00 | 1.25 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 54,694,766.50 | 9.08 |
| | 其中：政策性金融债 | 34,573,766.50 | 5.74 |
| 4 | 企业债券 | 76,294,000.00 | 12.67 |
| 5 | 企业短期融资券 | 180,605,000.00 | 30.00 |
| 6 | 中期票据 | 140,615,000.00 | 23.35 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 459,732,016.50 | 76.35 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 175690 | 21 东债 01 | 200,000 | 20,152,000.00 | 3.35 |
| 2 | 102000043 | 20 申迪 MTN001 | 200,000 | 20,130,000.00 | 3.34 |
| 3 | 042100064 | 21 深能源 CP001 | 200,000 | 20,120,000.00 | 3.34 |
| 4 | 012100661 | 21 三一 SCP006 | 200,000 | 20,060,000.00 | 3.33 |
| 5 | 102100964 | 21 三峡新能 MTN002(碳中和债) | 200,000 | 20,056,000.00 | 3.33 |

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**

报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的，在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 103,444.89 |
| 2 | 应收证券清算款 | 3,242,470.59 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 5,305,113.38 |

| | | |
|---|-------|--------------|
| 5 | 应收申购款 | 66,617.97 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 8,717,646.83 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末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

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

7.12.6 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 |
| 万家瑞盈 A | 214 | 1,420,243.13 | 302,692,376.12 | 99.59% | 1,239,652.92 | 0.41% |
| 万家瑞盈 C | 4,126 | 49,795.19 | 159,932,252.78 | 77.84% | 45,522,688.20 | 22.16% |
| 合计 | 4,322 | 117,859.09 | 462,624,628.90 | 90.82% | 46,762,341.12 | 9.18% |

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 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 | 万家瑞盈 A | 1,269.68 | 0.0004% |
| | 万家瑞盈 C | 4,950.50 | 0.0024% |
| | 合计 | 6,220.18 | 0.0012% |

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 | 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金 | 万家瑞盈 A | 0~10 |
| | 万家瑞盈 C | 0~10 |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 万家瑞盈 A | 0 |
| | 万家瑞盈 C | 0~10 |
| | 合计 | 0~10 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 万家瑞盈 A | 万家瑞盈 C |
|---------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日（2016 年 11 月 11 日）基金份额总额 | 2,686.50 | 620,022,888.88 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 57,680,441.37 | 104,711,171.98 |
| 本报告期基金总申购份额 | 260,123,323.68 | 162,252,610.43 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 13,871,736.01 | 61,508,841.43 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 303,932,029.04 | 205,454,940.98 |

§ 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：

2021 年 5 月 15 日，侯慧娣因个人原因离职，不再担任本基金的基金经理。

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：

报告期内无涉及基金托管人的重大人事变动。

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 | |
| 川财证券 | 1 | 152,709,975.11 | 54.23% | 142,219.01 | 60.14% | - |
| 中泰证券 | 1 | 128,874,441.75 | 45.77% | 94,245.42 | 39.86% | - |

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

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|---------------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 川财证券 | 10,367,798.70 | 17.74% | 81,229,000.00 | 20.58% | - | - |
| 中泰证券 | 48,077,283.51 | 82.26% | 313,500,000.00 | 79.42% | - | - |

§ 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 | 20210101 - 20210112 | 42,653,983.96 | - | - | 42,653,983.96 | 8.37% |
| | 2 | 20210204 - 20210204 | - | 83,820,620.28 | - | 83,820,620.28 | 16.46% |
| 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、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《万家瑞盈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媒介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、万家瑞盈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、《万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。

12.2 存放地点

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

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