

万家沪深 300 指数增强型证券投资基金 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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	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.....	46
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
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.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	57
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12 投资组合报告附注.....	57
§8 基金份额持有人信息.....	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
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.....	59
§9 开放式基金份额变动.....	61
§10 重大事件揭示.....	62
10.1 基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4 基金投资策略的改变.....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
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.....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
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.....	64
§12 备查文件目录.....	65

12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	万家沪深 300 指数增强	
基金主代码	002670	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 9 月 26 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	
报告期末基金份额总额	472, 221, 837. 16 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	万家沪深 300 指数增强 A	万家沪深 300 指数增强 C
报告期末下属分级基金的份额总额	384, 068, 765. 21 份	88, 153, 071. 95 份

注：2018 年 7 月 9 日, 本基金管理人组织召开本基金基金份额持有人大会, 表决通过了《关于万家瑞旭灵活配置混合型证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》, 万家瑞旭灵活配置混合型证券投资基金更名并转型为“万家沪深 300 指数增强型证券投资基金”。本基金份额持有人大会决议自该日起生效。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金, 采取量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制, 在力求有效跟踪标的指数基础上, 力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0. 5%、年跟踪误差不超过 7. 5% 的基础上, 实现超越目标指数的投资收益, 谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型指数产品, 在标的指数成份股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整, 力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。 1、股票投资策略 ((1) 指数化投资策略、(2) 指数增强策略、(3) 存托凭证投资策略); 2、债券投资策略; 3、中小企业私募债券债券投资策略; 4、资产支持证券投资策略; 5、可转换债券投资策略; 6、证券公司短期公司债券投资策略; 7、衍生产品投资策略 ((1) 权证投资策略、(2) 股指期货投资策略、(3) 国债期货投资策略、(4) 股票期权投资策略、(5) 本基金将关注其他金融衍生产品的推出情况, 谨慎地进行投资); 8、融资及转融通证券出借业务投资策略; 9、其他
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为: 沪深 300 指数收益率*95%+一年期人民币定期存款利率 (税后) *5%。
风险收益特征	本基金为股票型基金, 其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	万家基金管理有限公司	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	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.wjasset.com
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区浦电路 360 号陆家嘴投资大厦 9 楼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	万家沪深 300 指数增强 A	万家沪深 300 指数增强 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	57,391,846.41	19,814,024.42
本期利润	22,089,513.73	7,703,278.00
加权平均基金份额本期利润	0.0550	0.0677
本期加权平均净值利润率	3.57%	3.49%
本期基金份额净值增长率	3.93%	3.72%
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	140,094,156.26	62,944,625.18
期末可供分配基金份额利润	0.3648	0.7140
期末基金资产净值	602,875,514.89	173,953,544.58
期末基金份额净值	1.5697	1.9733
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	74.11%	118.98%

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

万家沪深 300 指数增强 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	0.15%	0.77%	-1.91%	0.76%	2.06%	0.01%
过去三个月	4.96%	0.88%	3.34%	0.93%	1.62%	-0.05%
过去六个月	3.93%	1.23%	0.32%	1.25%	3.61%	-0.02%
过去一年	34.65%	1.26%	24.26%	1.27%	10.39%	-0.01%
过去三年	84.61%	1.29%	49.82%	1.29%	34.79%	0.00%
自基金合同生效起至今	74.11%	1.09%	57.48%	1.06%	16.63%	0.03%

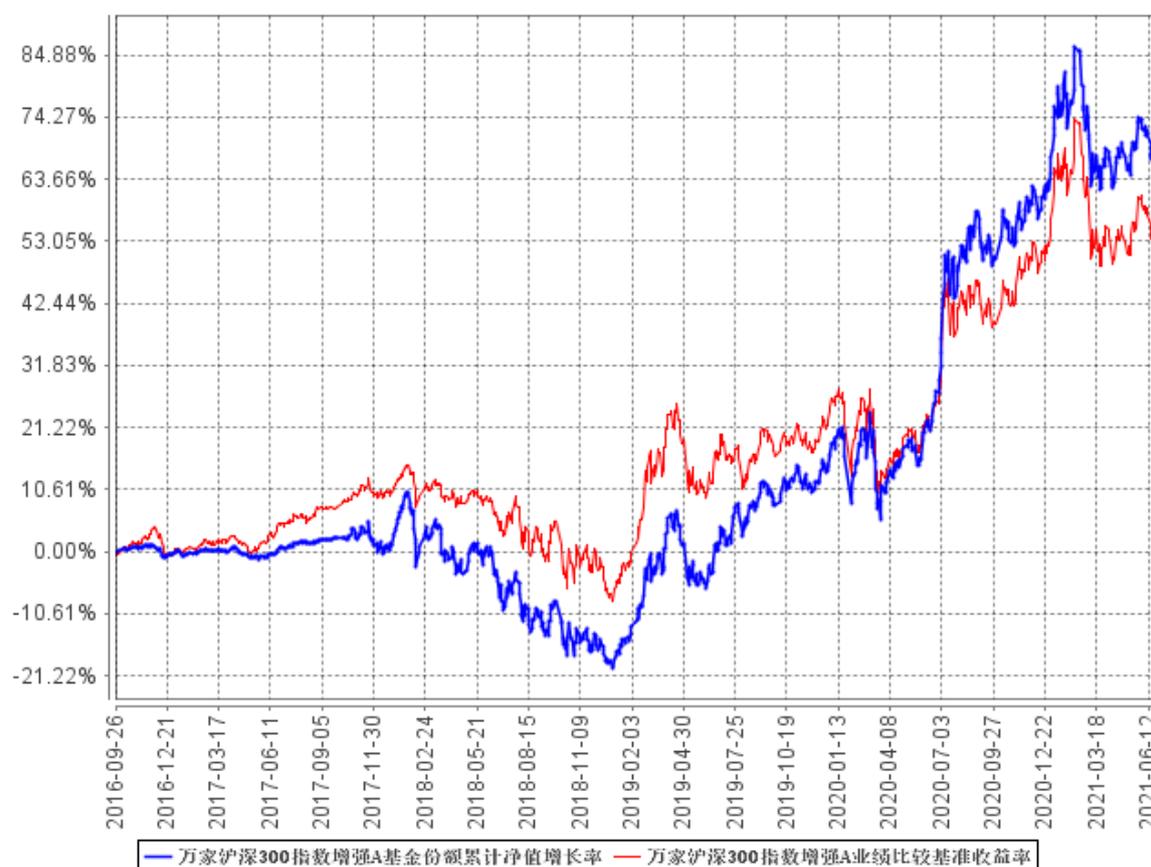
万家沪深 300 指数增强 C

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	0.11%	0.76%	-1.91%	0.76%	2.02%	0.00%
过去三个月	4.86%	0.88%	3.34%	0.93%	1.52%	-0.05%
过去六个月	3.72%	1.23%	0.32%	1.25%	3.40%	-0.02%
过去一年	34.12%	1.26%	24.26%	1.27%	9.86%	-0.01%
过去三年	84.57%	1.29%	49.82%	1.29%	34.75%	0.00%
自基金合同生效起至今	118.98%	1.29%	57.48%	1.06%	61.50%	0.23%

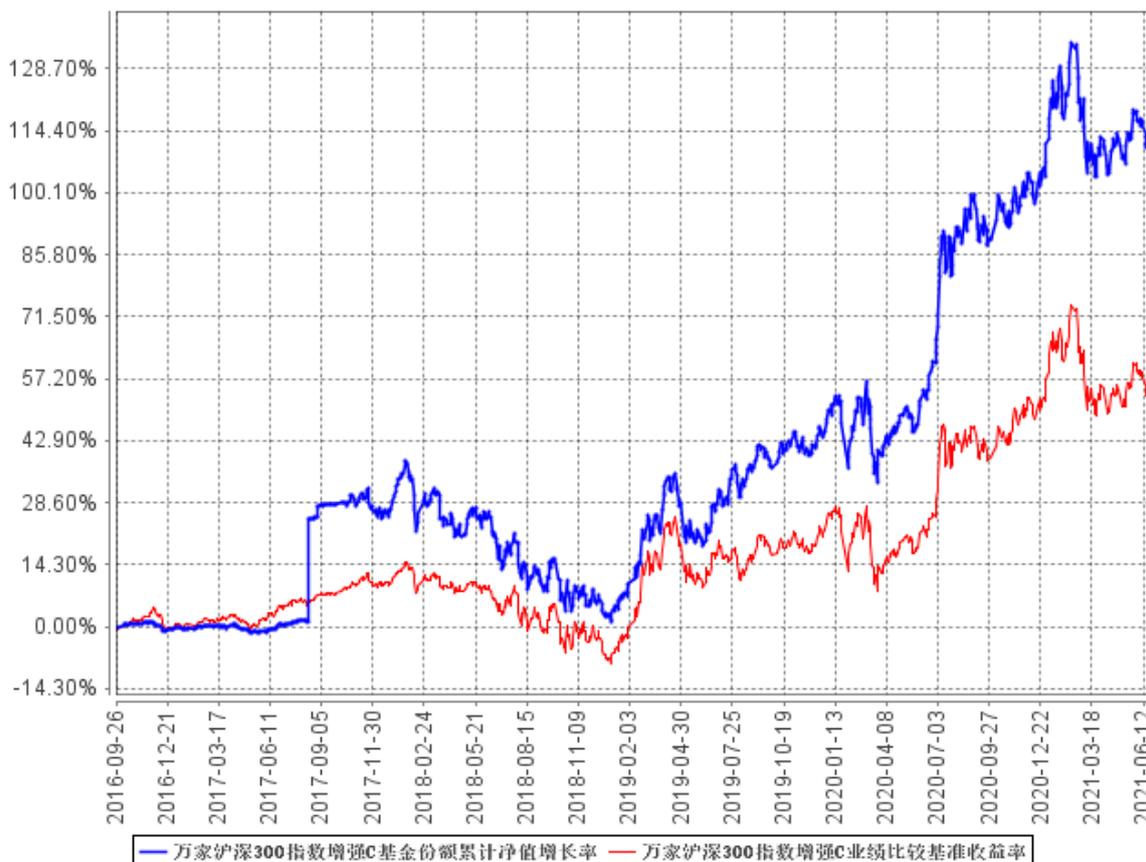
注：本基金的业绩比较基准= 沪深 300 指数收益率*95%+一年期人民币定期存款利率（税后）*5%

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

万家沪深300指数增强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



万家沪深300指数增强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 9 月 26 日成立。根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。2018 年 7 月 9 日，本基金管理人组织召开本基金基金份额持有人大会，表决通过了《关于万家瑞旭灵活配置混合型证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》，万家瑞旭灵活配置混合型证券投资基金更名并转型为“万家沪深 300 指数增强型证券投资基金”。本基金份额持有人大会决议自该日起生效。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发起式基金中基金(FOF)、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、万家科创主题 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 三年持有期混合型发起式基金中基金(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		
乔亮	万家量化睿选灵活配置混合型基金、万家中证 1000 指数增强型发起式基金、万家沪深 300 指数增强型基金、万家互联互通核心资产量化策略混合型证券	2019 年 9 月 6 日	-	14 年	曾任美国巴克莱国际投资管理公司基金经理，加拿大退休基金国际投资管理公司基金经理，南方基金管理有限公司量化投资部基金经理，通联数据股份有限公司联合创始人、首席投资官，上海寻乾资产管理有限公司投资总监、总经理，巨杉（上海）资产管理有限公司量化投资部投

	投资基金、万家创业板指数增强型证券投资基金、万家中证 500 指数增强型基金的基金经理			资总监。2019 年 7 月加入万家基金管理有限公司，担任公司总经理助理。
--	---------------------------------------------	--	--	---------------------------------------

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

本基金为指数增强型股票基金，采取量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，在力求有效跟踪标的指数基础上，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.5%的基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

万家沪深 300 指数增强型证券投资基金在保持相对沪深 300 指数较小跟踪误差情况下，控制行业权重偏离度、个股集中度，通过量化多因子选股的方式选取一篮子股票组合。在行业和风格配置相对于沪深 300 指数相对均衡，无重仓行业或具体风格，在量化选股方面精选行业内质优个股组合，持股较为分散。采用量化风险模型合理控制组合风险，选股方面并取得了较好的超额收益回报。选股组合 80%权重以上为沪深 300 成分股，保证了较小的跟踪误差标准，并在二季度显著跑赢基准指数。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家沪深 300 指数增强 A 基金份额净值为 1.5697 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.93%；截至本报告期末万家沪深 300 指数增强 C 基金份额净值为 1.9733 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.72%；同期业绩比较基准收益率为 0.32%。基金报告期末 A 份额、C 份额日均跟踪偏离度分别为 0.1728%、0.1721%，年跟踪误差分别为 1.9486%、1.9548%。符合基金合同中日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.5%的规定。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观角度，二季度经济具有一定压力，全球经济放缓，预期下半年经济趋于放缓阶段。消费增速下行，对增长贡献提升，居民收入差距扩大，今年上半年有所收敛。投资对地产依赖程度依然较大，全球经贸都在降温且贸易摩擦持续。减税降费继续推进，让利于民激发活力。美国开启宽松周期也增大了我们的货币政策空间。我国法定存款准备金率仍有下调空间，公开市场操作利率也可以下调，同时通过利率走廊，逐渐实现基准利率向市场利率的并轨。下半年的不确定性依然在于贸易摩擦，在全球经济高度一体化的今天，各国经贸是连在一起的，而且经贸关系是重要的“压舱石”，长期尽管有竞争，但短期也需要有合作。所以外部形势基本是确定的，不会太好也不会太差，因此维持下半年处于震荡市的判断。

从指数增强的角度，震荡市是获取估值错杀的重要阶段，也是我们获取超额收益的最佳时机。三季度处于分红集中期，科创板已经开板，这些都是提升市场风险抵御能力的方面。经历过最后的震荡，尘埃落定后市场将回归正常风险偏好，那么估值错杀的个股将会均值回归，而我们获取

超额收益的策略也将会有所表现。

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

根据基金合同规定:“若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资,且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。”

结合法律法规及基金合同的规定,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，本托管人在万家沪深 300 指数增强型证券投资基金（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：万家沪深 300 指数增强型证券投资基金

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	46,572,665.58	51,672,267.34
结算备付金		1,743,508.28	1,851,813.10
存出保证金		286,010.72	330,162.41
交易性金融资产	6.4.7.2	730,986,117.62	834,050,866.09
其中：股票投资		730,986,117.62	834,050,866.09
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		20,671,457.53	218,821.98
应收利息	6.4.7.5	14,492.10	22,261.02
应收股利		-	-
应收申购款		1,000,837.49	851,369.58
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	29,558.40	-
资产总计		801,304,647.72	888,997,561.52
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		-	55,822.70
应付赎回款		22,437,763.80	1,937,057.10
应付管理人报酬		655,445.76	778,393.20
应付托管费		78,653.47	93,407.18
应付销售服务费		67,054.82	91,370.36
应付交易费用	6.4.7.7	884,386.71	914,509.05
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	352,283.69	365,962.09
负债合计		24,475,588.25	4,236,521.68
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	472,221,837.16	551,569,972.71
未分配利润	6.4.7.10	304,607,222.31	333,191,067.13
所有者权益合计		776,829,059.47	884,761,039.84
负债和所有者权益总计		801,304,647.72	888,997,561.52

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.6451 元，基金份额总额合计为 472,221,837.16 份。 万家沪深 300A 基金份额净值 1.5697 元，基金份额总额 384,068,765.21 份； 万家沪深 300C 基金份额净值 1.9733 元，基金份额总额 88,153,071.95 份。

6.2 利润表

会计主体：万家沪深 300 指数增强型证券投资基金

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		38,084,452.95	42,096,907.25
1.利息收入		271,144.34	96,582.99
其中：存款利息收入	6.4.7.11	271,144.34	96,582.99
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）		85,010,129.76	17,665,982.51
其中：股票投资收益	6.4.7.12	79,931,376.26	14,578,741.57
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	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	5,078,753.50	3,087,240.94
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-47,413,079.10	24,189,243.48
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	216,257.95	145,098.27
减：二、费用		8,291,661.22	2,532,495.57
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,184,268.68	1,350,322.08
2. 托管费	6.4.10.2.2	502,112.18	162,038.66
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	439,901.87	64,441.90
4. 交易费用	6.4.7.19	2,973,114.03	773,643.69
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	192,264.46	182,049.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		29,792,791.73	39,564,411.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		29,792,791.73	39,564,411.68

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家沪深 300 指数增强型证券投资基金

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）	551,569,972.71	333,191,067.13	884,761,039.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	29,792,791.73	29,792,791.73
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）	-79,348,135.55	-58,376,636.55	-137,724,772.10
其中：1.基金申购款	100,036,424.37	78,425,842.60	178,462,266.97
2.基金赎回款	-179,384,559.92	-136,802,479.15	-316,187,039.07
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)	472,221,837.16	304,607,222.31	776,829,059.47
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)	219,865,885.96	43,410,380.12	263,276,266.08
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数(本 期利润)	-	39,564,411.68	39,564,411.68
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)	82,840,544.36	19,551,833.65	102,392,378.01
其中：1.基金申购款	153,688,236.76	42,836,763.54	196,525,000.30
2.基金赎回款	-70,847,692.40	-23,284,929.89	-94,132,622.29
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)	302,706,430.32	102,526,625.45	405,233,055.77

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

万家沪深 300 指数增强型证券投资基金（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]1960 号文《关于核准万家瑞旭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 9 月 19 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具(2016) 验字第 60778298_B13 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 9 月 26

日正式生效，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 200,012,714.80 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 0.82 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 200,012,715.62 元，折合 200,012,715.62 份基金份额。2018 年 7 月 9 日，本基金管理人组织召开本基金基金份额持有人大会，表决通过了《关于万家瑞旭灵活配置混合型证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》，万家瑞旭灵活配置混合型证券投资基金更名并转型为“万家沪深 300 指数增强型证券投资基金”。

本基金管理人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。本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股、备选成份股、其他股票（包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中小企业私募债券、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、债券回购、银行存款、同业存单、资产支持证券、金融衍生品（包括权证、股指期货、国债期货、股票期权等）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）。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*95%+一年期人民币定期存款利率（税后）*5%。

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	46,572,665.58
定期存款	-
其他存款	-
合计：	46,572,665.58

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	684,372,533.51	730,986,117.62	46,613,584.11
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	684,372,533.51	730,986,117.62	46,613,584.11

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

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

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	13,579.41
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	783.90
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.09
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	128.70
合计	14,492.10

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	29,558.40
合计	29,558.40

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	884,386.71
银行间市场应付交易费用	-

合计	884,386.71
----	------------

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	460.83
应付证券出借违约金	-
预提费用	351,822.86
合计	352,283.69

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

万家沪深 300 指数增强 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	419,866,094.60	419,866,094.60
本期申购	43,305,083.87	43,305,083.87
本期赎回(以“-”号填列)	-79,102,413.26	-79,102,413.26
- 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	384,068,765.21	384,068,765.21

金额单位：人民币元

万家沪深 300 指数增强 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	131,703,878.11	131,703,878.11
本期申购	56,731,340.50	56,731,340.50
本期赎回(以“-”号填列)	-100,282,146.66	-100,282,146.66
- 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	88,153,071.95	88,153,071.95

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

万家沪深 300 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	94,425,162.09	119,892,301.97	214,317,464.06
本期利润	57,391,846.41	-35,302,332.68	22,089,513.73
本期基金份额交易产生的变动数	-11,722,852.24	-5,877,375.87	-17,600,228.11
其中：基金申购款	13,394,024.83	10,592,522.49	23,986,547.32
基金赎回款	-25,116,877.07	-16,469,898.36	-41,586,775.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	140,094,156.26	78,712,593.42	218,806,749.68

单位：人民币元

万家沪深 300 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	71,362,732.74	47,510,870.33	118,873,603.07
本期利润	19,814,024.42	-12,110,746.42	7,703,278.00
本期基金份额交易产生的变动数	-28,232,131.98	-12,544,276.46	-40,776,408.44
其中：基金申购款	36,421,121.91	18,018,173.37	54,439,295.28
基金赎回款	-64,653,253.89	-30,562,449.83	-95,215,703.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	62,944,625.18	22,855,847.45	85,800,472.63

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	255,439.58
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	12,963.92
其他	2,740.84
合计	271,144.34

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	1,110,372,324.80
减：卖出股票成本总额	1,030,440,948.54
买卖股票差价收入	79,931,376.26

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 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	5,078,753.50
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,078,753.50

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	-47,413,079.10
——股票投资	-47,413,079.10
——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	-47,413,079.10

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	215,999.64
转换费收入 002670	234.41
转换费收入 002671	23.90
合计	216,257.95

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	2,973,114.03
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	2,973,114.03

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	122,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	10,441.60
指数使用费	-
帐户维护费	-
合计	192,264.46

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	基金管理人股东

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		上年度可比期间	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		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	1,422,186,901.95	68.53%	384,002,421.67	66.90%

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方席位进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本报告期间本基金及上年度可比期间均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

本报告期间本基金及上年度可比期间均未通过关联方席位进行权证交易。

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	1,040,055.23	63.10%	585,799.42	66.24%
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	280,814.51	61.34%	188,492.71	65.44%

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	4,184,268.68	1,350,322.08
其中：支付销售机构的客户维护费	299,089.55	47,093.72

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管

理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	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	502,112.18	162,038.66

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 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.3 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		
	万家沪深 300 指数增强 A	万家沪深 300 指数增强 C	合计
万家基金	-	221,136.24	221,136.24
中泰证券	-	118.98	118.98
合计	-	221,255.22	221,255.22
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		
	万家沪深 300 指数增强 A	万家沪深 300 指数增强 C	合计
万家基金	-	40,637.22	40,637.22
中泰证券	-	57.46	57.46
合计	-	40,694.68	40,694.68

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 0.40%，销售服

务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，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，由基金管理人根据相关协议支付给各销售机构。若遇法定节假日、公休假或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

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本报告期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

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	46,572,665.58	255,439.58	22,709,656.70	91,532.15

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未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

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
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	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月12日	创业板流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	创业板流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月21日	创业板流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300930	屹通新材	2021年1月13日	2021年7月21日	创业板流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	创业板流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	创业板流通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	创业板流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-

300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	创业板 流通受 限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	创业板 流通受 限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300941	创识科技	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	创业板 流通受 限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	创业板 流通受 限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	创业板 流通受 限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	创业板 流通受 限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300950	德固特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	创业板 流通受 限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 13 日	创业板 流通受 限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕科技	2021 年 3 月 11 日	2021 年 9 月 22 日	创业板 流通受 限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	创业板 流通受 限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300957	贝泰妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	创业板 流通受 限	47.33	251.96	593	28,066.69	149,412.28	-
300958	建工修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	创业板 流通受 限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	创业板 流通受 限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	创业板 流通受 限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金	2021 年	2021	创业板	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-

	辐照	3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	流通受限						
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
300978	东箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	创业板流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
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	925	30,728.50	80,937.50	-
300981	中红	2021 年	2021	创业板	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-

	医疗	4月19日	2021年10月27日	流通受限						
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	-
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	-
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	-
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	-
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	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	创业板流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
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	-
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	-
301004	嘉益股份	2021年6月18日	2021年12月27日	创业板流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-

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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-

688117	圣诺生物	2021年5月26日	2021年12月3日	科创板流通受限	17.90	35.97	1,672	29,928.80	60,141.84	-
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	-
688316	青云科技	2021年3月5日	2021年9月16日	科创板流通受限	63.70	65.00	1,428	90,963.60	92,820.00	-
688323	瑞华泰	2021年4月21日	2021年10月28日	科创板流通受限	5.97	22.78	4,513	26,942.61	102,806.14	-
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	-
688621	阳光诺和	2021年6月11日	2021年12月21日	科创板流通受限	26.89	63.99	1,485	39,931.65	95,025.15	-
688626	翔宇医疗	2021年3月23日	2021年9月30日	科创板流通受限	28.82	104.16	3,652	105,250.64	380,392.32	-
688665	四方光电	2021年2月2日	2021年8月9日	科创板流通受限	29.53	129.46	1,687	49,817.11	218,399.02	-
688667	菱电电控	2021年3月3日	2021年9月13日	新股流通受限	75.42	103.88	1,191	89,825.22	123,721.08	-
688690	纳微科技	2021年6月16日	2021年12月23日	新股流通受限	8.07	79.89	3,477	28,059.39	277,777.53	-
688696	极米科技	2021年2月23日	2021年9月3日	新股流通受限	133.73	780.24	1,252	167,429.96	976,860.48	-
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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021年6月30日	临时停牌	56.35	2021年7月1日	59.49	5,800	225,112.75	326,830.00	-

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

截至本报告期末，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。

6.4.12.3.2 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。本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，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。

6.4.13.3 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。因此除在附注 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、存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 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	46,572,665.58	-	-	-	-	-	46,572,665.58
结算备付金	1,743,508.28	-	-	-	-	-	1,743,508.28
存出保证金	286,010.72	-	-	-	-	-	286,010.72
交易性金融 资产	-	-	-	-	-	730,986,117.62	730,986,117.62
应收证券清 算款	-	-	-	-	-	20,671,457.53	20,671,457.53
应收利息	-	-	-	-	-	14,492.10	14,492.10
应收申购款	3,500.00	-	-	-	-	997,337.49	1,000,837.49
其他资产	-	-	-	-	-	29,558.40	29,558.40
资产总计	48,605,684.58	-	-	-	-	752,698,963.14	801,304,647.72
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	22,437,763.80	22,437,763.80
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	655,445.76	655,445.76
应付托管费	-	-	-	-	-	78,653.47	78,653.47
应付销售服 务费	-	-	-	-	-	67,054.82	67,054.82
应付交易费 用	-	-	-	-	-	884,386.71	884,386.71
其他负债	-	-	-	-	-	352,283.69	352,283.69
负债总计	-	-	-	-	-	24,475,588.25	24,475,588.25
利率敏感度 缺口	48,605,684.58	-	-	-	-	728,223,374.89	776,829,059.47
上年度末 2020 年 12 月	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计

31 日							
资产							
银行存款	51,672,267.34	-	-	-	-	-	51,672,267.34
结算备付金	1,851,813.10	-	-	-	-	-	1,851,813.10
存出保证金	330,162.41	-	-	-	-	-	330,162.41
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-834,050,866.09	834,050,866.09
应收证券清算款	-	-	-	-	-	218,821.98	218,821.98
应收利息	-	-	-	-	-	22,261.02	22,261.02
应收申购款	-	-	-	-	-	851,369.58	851,369.58
资产总计	53,854,242.85	-	-	-	-	-835,143,318.67	888,997,561.52
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	55,822.70	55,822.70
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,937,057.10	1,937,057.10
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	778,393.20	778,393.20
应付托管费	-	-	-	-	-	93,407.18	93,407.18
应付销售服务费	-	-	-	-	-	91,370.36	91,370.36
应付交易费用	-	-	-	-	-	914,509.05	914,509.05
其他负债	-	-	-	-	-	365,962.09	365,962.09
负债总计	-	-	-	-	-	4,236,521.68	4,236,521.68
利率敏感度缺口	53,854,242.85	-	-	-	-	-830,906,796.99	884,761,039.84

注：该表统计了本基金交易的利率风险敞口。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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 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	730,986,117.62	94.10	834,050,866.09	94.27
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	730,986,117.62	94.10	834,050,866.09	94.27

注：本基金股票资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于标的指数成份股及其 备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终，在扣除股票期权、股指期货和国债期货合约需交纳的交易保证金后，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。

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	-7,525,761.40	-8,527,191.44
2. 股票基准指数上升 100 个基点	7,525,761.40	8,527,191.44	

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	730,986,117.62	91.22
	其中：股票	730,986,117.62	91.22
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	48,316,173.86	6.03
8	其他各项资产	22,002,356.24	2.75
9	合计	801,304,647.72	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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	1,588,618.40	0.20
B	采矿业	22,909,828.00	2.95
C	制造业	341,400,265.15	43.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,062,780.00	0.39
F	批发和零售业	14,852,542.60	1.91
G	交通运输、仓储和邮政业	15,323,844.00	1.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,816,359.60	1.13
J	金融业	147,454,884.50	18.98
K	房地产业	5,291,255.40	0.68
L	租赁和商务服务业	28,734,387.24	3.70

M	科学研究和技术服务业	12,875,899.07	1.66
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	11,479,730.16	1.48
R	文化、体育和娱乐业	9,907,599.04	1.28
S	综合	-	-
	合计	623,697,993.16	80.29

7.2.2 期末积极投资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	90,542,707.09	11.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	1,769,394.58	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	7,812,768.72	1.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,174,811.59	0.28
J	金融业	34,721.10	0.00
K	房地产业	263,555.90	0.03
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	95,025.15	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	76,926.27	0.01
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	4,468,532.02	0.58
S	综合	-	-
	合计	107,288,124.46	13.81

7.2.3 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

7.3.1 期末指数投资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	600519	贵州茅台	13,980	28,752,666.00	3.70
2	600036	招商银行	492,583	26,693,072.77	3.44
3	000725	京东方A	2,948,465	18,398,421.60	2.37
4	601888	中国中免	58,700	17,615,870.00	2.27
5	000858	五粮液	56,134	16,721,757.26	2.15
6	600809	山西汾酒	36,490	16,347,520.00	2.10
7	601211	国泰君安	946,239	16,218,536.46	2.09
8	000333	美的集团	210,630	15,032,663.10	1.94
9	300059	东方财富	432,033	14,166,362.07	1.82
10	601998	中信银行	2,749,900	14,024,490.00	1.81
11	000100	TCL科技	1,828,000	13,984,200.00	1.80
12	300124	汇川技术	187,611	13,931,992.86	1.79
13	601607	上海医药	644,600	13,620,398.00	1.75
14	600741	华域汽车	504,300	13,247,961.00	1.71
15	600309	万华化学	114,100	12,416,362.00	1.60
16	603259	药明康德	79,273	12,413,359.07	1.60
17	600887	伊利股份	321,462	11,839,445.46	1.52
18	600600	青岛啤酒	100,700	11,645,955.00	1.50
19	002129	中环股份	293,300	11,321,380.00	1.46
20	002027	分众传媒	1,181,564	11,118,517.24	1.43
21	601166	兴业银行	523,775	10,763,576.25	1.39
22	600019	宝钢股份	1,362,756	10,411,455.84	1.34
23	300015	爱尔眼科	144,242	10,238,297.16	1.32
24	601225	陕西煤业	697,800	8,268,930.00	1.06
25	600030	中信证券	331,500	8,267,610.00	1.06
26	600690	海尔智家	314,109	8,138,564.19	1.05
27	603501	韦尔股份	25,240	8,127,280.00	1.05
28	601628	中国人寿	235,953	7,996,447.17	1.03
29	600031	三一重工	266,500	7,747,155.00	1.00
30	600018	上港集团	1,623,200	7,742,664.00	1.00
31	600919	江苏银行	1,059,451	7,522,102.10	0.97
32	600176	中国巨石	478,339	7,419,037.89	0.96
33	688012	中微公司	43,955	7,293,013.60	0.94

34	002739	万达电影	460,196	7,266,494.84	0.94
35	603369	今世缘	133,918	7,252,998.88	0.93
36	601336	新华保险	153,300	7,038,003.00	0.91
37	002311	海大集团	85,704	6,993,446.40	0.90
38	601600	中国铝业	1,286,700	6,819,510.00	0.88
39	601012	隆基股份	71,248	6,329,672.32	0.81
40	601318	中国平安	92,900	5,971,612.00	0.77
41	601857	中国石油	1,086,700	5,748,643.00	0.74
42	000338	潍柴动力	305,535	5,459,910.45	0.70
43	000063	中兴通讯	160,000	5,316,800.00	0.68
44	300122	智飞生物	26,017	4,858,154.41	0.63
45	600000	浦发银行	485,400	4,854,000.00	0.62
46	000568	泸州老窖	19,593	4,622,772.42	0.60
47	601688	华泰证券	274,800	4,341,840.00	0.56
48	688111	金山办公	10,877	4,294,239.60	0.55
49	300014	亿纬锂能	37,600	3,907,768.00	0.50
50	300450	先导智能	62,838	3,779,077.32	0.49
51	603993	洛阳钼业	666,900	3,441,204.00	0.44
52	601390	中国中铁	584,500	3,062,780.00	0.39
53	000651	格力电器	55,600	2,896,760.00	0.37
54	600104	上汽集团	130,100	2,858,297.00	0.37
55	600028	中国石化	654,300	2,852,748.00	0.37
56	601377	兴业证券	294,990	2,849,603.40	0.37
57	001979	招商蛇口	255,844	2,801,491.80	0.36
58	600926	杭州银行	189,260	2,791,585.00	0.36
59	601328	交通银行	561,200	2,749,880.00	0.35
60	601919	中远海控	90,000	2,748,600.00	0.35
61	601006	大秦铁路	411,600	2,708,328.00	0.35
62	002410	广联达	39,600	2,700,720.00	0.35
63	002304	洋河股份	11,900	2,465,680.00	0.32
64	601995	中金公司	39,551	2,432,386.50	0.31
65	002371	北方华创	8,600	2,385,468.00	0.31
66	603833	欧派家居	16,400	2,328,144.00	0.30
67	300413	芒果超媒	33,847	2,321,904.20	0.30
68	601899	紫金矿业	234,300	2,270,367.00	0.29
69	300529	健帆生物	25,800	2,228,088.00	0.29
70	601319	中国人保	363,200	2,153,776.00	0.28
71	601238	广汽集团	165,739	2,146,320.05	0.28
72	002460	赣锋锂业	17,400	2,106,966.00	0.27

73	603986	兆易创新	11,200	2,104,480.00	0.27
74	300408	三环集团	48,200	2,044,644.00	0.26
75	600438	通威股份	46,600	2,016,382.00	0.26
76	600999	招商证券	97,840	1,860,916.80	0.24
77	600196	复星医药	25,200	1,817,676.00	0.23
78	000001	平安银行	79,279	1,793,290.98	0.23
79	002812	恩捷股份	7,400	1,732,340.00	0.22
80	000768	中航西飞	63,300	1,663,524.00	0.21
81	601155	新城控股	39,596	1,647,193.60	0.21
82	603659	璞泰来	11,940	1,631,004.00	0.21
83	600989	宝丰能源	119,000	1,627,920.00	0.21
84	002008	大族激光	39,500	1,595,405.00	0.21
85	002714	牧原股份	26,120	1,588,618.40	0.20
86	000776	广发证券	103,400	1,565,476.00	0.20
87	002049	紫光国微	9,400	1,449,386.00	0.19
88	603799	华友钴业	12,500	1,427,500.00	0.18
89	600115	中国东航	279,100	1,417,828.00	0.18
90	601633	长城汽车	32,500	1,416,675.00	0.18
91	300003	乐普医疗	39,600	1,271,952.00	0.16
92	603658	安图生物	13,980	1,059,264.60	0.14
93	600763	通策医疗	2,241	921,051.00	0.12
94	002179	中航光电	11,400	900,828.00	0.12
95	603899	晨光文具	10,100	854,056.00	0.11
96	601901	方正证券	90,800	849,888.00	0.11
97	600606	绿地控股	154,600	842,570.00	0.11
98	002050	三花智控	34,600	829,708.00	0.11
99	688396	华润微	8,900	810,078.00	0.10
100	000538	云南白药	6,600	763,752.00	0.10
101	603233	大参林	14,560	744,161.60	0.10
102	600588	用友网络	22,300	741,698.00	0.10
103	688036	传音控股	3,527	738,906.50	0.10
104	601111	中国国航	90,800	706,424.00	0.09
105	300677	英科医疗	5,300	661,440.00	0.09
106	600085	同仁堂	14,700	600,495.00	0.08
107	601601	中国太保	19,000	550,430.00	0.07
108	600426	华鲁恒升	16,800	519,960.00	0.07
109	600570	恒生电子	5,300	494,225.00	0.06
110	603939	益丰药房	8,700	487,983.00	0.06
111	300628	亿联网络	5,800	486,040.00	0.06

112	600660	福耀玻璃	8,600	480,310.00	0.06
113	603288	海天味业	3,700	477,115.00	0.06
114	300676	华大基因	3,900	462,540.00	0.06
115	002271	东方雨虹	8,000	442,560.00	0.06
116	600111	北方稀土	20,500	424,350.00	0.05
117	600332	白云山	12,200	412,970.00	0.05
118	300601	康泰生物	2,400	357,600.00	0.05
119	600845	宝信软件	6,590	335,431.00	0.04
120	601088	中国神华	16,800	327,936.00	0.04
121	300144	宋城演艺	19,000	319,200.00	0.04
122	300433	蓝思科技	10,000	294,100.00	0.04
123	603882	金域医学	1,800	287,586.00	0.04
124	002230	科大讯飞	3,700	250,046.00	0.03
125	688008	澜起科技	3,600	224,568.00	0.03
126	600522	中天科技	21,300	213,000.00	0.03
127	002841	视源股份	1,200	149,148.00	0.02
128	600183	生益科技	5,200	121,732.00	0.02
129	002001	新和成	4,000	114,720.00	0.01
130	601100	恒立液压	1,200	103,104.00	0.01
131	002044	美年健康	3,600	32,796.00	0.00
132	000625	长安汽车	1,100	28,908.00	0.00

7.3.2 期末积极投资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	600688	上海石化	2,225,212	8,366,797.12	1.08
2	300750	宁德时代	12,700	6,791,960.00	0.87
3	600377	宁沪高速	681,172	6,648,238.72	0.86
4	688180	君实生物	68,812	5,588,222.52	0.72
5	688981	中芯国际	89,954	5,560,956.28	0.72
6	300434	金石亚药	571,600	5,235,856.00	0.67
7	002078	太阳纸业	390,900	5,218,515.00	0.67
8	600884	杉杉股份	212,000	4,943,840.00	0.64
9	600977	中国电影	295,914	3,707,802.42	0.48
10	688185	康希诺	4,716	3,667,963.32	0.47
11	603486	科沃斯	15,800	3,603,664.00	0.46
12	300319	麦捷科技	249,400	3,005,270.00	0.39

13	601689	拓普集团	66,220	2,478,614.60	0.32
14	603156	养元饮品	84,697	2,420,640.26	0.31
15	300633	开立医疗	75,600	2,387,448.00	0.31
16	002603	以岭药业	75,600	2,204,496.00	0.28
17	603225	新凤鸣	96,516	1,959,274.80	0.25
18	000799	酒鬼酒	7,400	1,891,440.00	0.24
19	601636	旗滨集团	99,700	1,850,432.00	0.24
20	600398	海澜之家	225,400	1,631,896.00	0.21
21	688561	奇安信	17,572	1,622,071.32	0.21
22	300769	德方纳米	7,600	1,570,844.00	0.20
23	300755	华致酒行	33,400	1,363,054.00	0.18
24	002293	罗莱生活	89,500	1,198,405.00	0.15
25	601598	中国外运	230,600	1,164,530.00	0.15
26	300760	迈瑞医疗	2,400	1,152,120.00	0.15
27	002056	横店东磁	81,100	1,054,300.00	0.14
28	603228	景旺电子	39,500	1,034,900.00	0.13
29	603186	华正新材	28,321	1,032,583.66	0.13
30	603638	艾迪精密	23,060	988,582.20	0.13
31	688696	极米科技	1,252	976,860.48	0.13
32	000898	鞍钢股份	215,500	958,975.00	0.12
33	300896	爱美客	1,200	946,656.00	0.12
34	002281	光迅科技	33,200	816,720.00	0.11
35	603103	横店影视	51,680	760,729.60	0.10
36	300474	景嘉微	7,300	714,816.00	0.09
37	603260	合盛硅业	8,300	638,353.00	0.08
38	603267	鸿远电子	4,500	575,640.00	0.07
39	300869	康泰医学	7,700	545,314.00	0.07
40	603337	杰克股份	20,300	542,619.00	0.07
41	002920	德赛西威	4,200	462,336.00	0.06
42	600779	水井坊	3,500	442,225.00	0.06
43	300724	捷佳伟创	3,800	440,838.00	0.06
44	002946	新乳业	27,800	421,170.00	0.05
45	688099	晶晨股份	3,600	403,920.00	0.05
46	688626	翔宇医疗	3,652	380,392.32	0.05
47	601882	海天精工	23,200	360,760.00	0.05
48	300783	三只松鼠	7,600	359,936.00	0.05
49	300463	迈克生物	8,500	357,765.00	0.05
50	603816	顾家家居	4,300	332,304.00	0.04
51	600460	士兰微	5,800	326,830.00	0.04

52	688690	纳微科技	3,477	277,777.53	0.04
53	000918	嘉凯城	58,000	253,460.00	0.03
54	688613	奥精医疗	2,617	237,597.43	0.03
55	002180	纳思达	7,300	235,060.00	0.03
56	000012	南玻A	21,900	224,256.00	0.03
57	688665	四方光电	1,687	218,399.02	0.03
58	688388	嘉元科技	1,800	163,728.00	0.02
59	300073	当升科技	2,900	162,951.00	0.02
60	300957	贝泰妮	593	149,412.28	0.02
61	600201	生物股份	7,600	132,620.00	0.02
62	688667	菱电电控	1,191	123,721.08	0.02
63	688323	瑞华泰	4,513	102,806.14	0.01
64	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
65	688621	阳光诺和	1,485	95,025.15	0.01
66	688316	青云科技	1,428	92,820.00	0.01
67	300009	安科生物	6,100	90,890.00	0.01
68	300920	润阳科技	2,503	84,301.04	0.01
69	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
70	603305	旭升股份	2,400	80,952.00	0.01
71	300979	华利集团	925	80,937.50	0.01
72	002382	蓝帆医疗	3,700	77,145.00	0.01
73	600702	舍得酒业	300	64,134.00	0.01
74	688117	圣诺生物	1,672	60,141.84	0.01
75	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.01
76	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
77	000039	中集集团	2,775	50,449.50	0.01
78	300373	扬杰科技	800	48,432.00	0.01
79	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
80	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
81	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
82	688679	通源环境	3,139	41,372.02	0.01
83	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
84	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
85	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
86	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
87	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
88	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
89	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
90	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00

91	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
92	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
93	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
94	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
95	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
96	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
97	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
98	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
99	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
100	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
101	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
102	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
103	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
104	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
105	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
106	300917	特发服务	365	10,095.90	0.00
107	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
108	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
109	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
110	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
111	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
112	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
113	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
114	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
115	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
116	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
117	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
118	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
119	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
120	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
121	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
122	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
123	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
124	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
125	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
126	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
127	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
128	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
129	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00

130	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
131	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
132	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
133	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
134	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
135	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
136	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
137	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
138	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
139	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
140	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
141	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	601166	兴业银行	24,430,798.00	2.76
2	000100	TCL 科技	22,702,394.00	2.57
3	600809	山西汾酒	17,660,088.66	2.00
4	601998	中信银行	16,358,283.00	1.85
5	600900	长江电力	16,244,285.42	1.84
6	601607	上海医药	15,843,281.00	1.79
7	600741	华域汽车	15,532,853.22	1.76
8	002736	国信证券	15,103,430.75	1.71
9	601628	中国人寿	14,936,165.75	1.69
10	600018	上港集团	14,776,481.00	1.67
11	600309	万华化学	14,440,017.00	1.63
12	600600	青岛啤酒	13,736,491.00	1.55
13	000858	五粮液	13,477,359.96	1.52
14	601231	环旭电子	13,201,158.49	1.49
15	002129	中环股份	12,688,860.00	1.43
16	000338	潍柴动力	11,551,759.63	1.31
17	601800	中国交建	11,474,287.00	1.30
18	000069	华侨城 A	10,858,772.00	1.23

19	603259	药明康德	10,779,351.60	1.22
20	600690	海尔智家	10,419,459.54	1.18

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。

7.4.2 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	600519	贵州茅台	58,687,571.35	6.63
2	600036	招商银行	34,799,336.00	3.93
3	000333	美的集团	34,716,738.46	3.92
4	601818	光大银行	33,162,922.00	3.75
5	600276	恒瑞医药	31,428,296.42	3.55
6	601012	隆基股份	28,605,311.00	3.23
7	601318	中国平安	25,577,130.02	2.89
8	601166	兴业银行	24,137,916.00	2.73
9	600031	三一重工	20,839,590.00	2.36
10	000725	京东方 A	20,133,155.00	2.28
11	600900	长江电力	19,925,831.25	2.25
12	600887	伊利股份	19,495,124.31	2.20
13	002241	歌尔股份	16,139,872.80	1.82
14	002736	国信证券	15,207,336.75	1.72
15	601888	中国中免	14,894,976.61	1.68
16	601211	国泰君安	13,455,699.00	1.52
17	002352	顺丰控股	13,303,551.44	1.50
18	601225	陕西煤业	12,711,527.00	1.44
19	601899	紫金矿业	12,542,826.86	1.42
20	601881	中国银河	11,832,355.32	1.34

注：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。

7.4.3 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	974,789,279.17
卖出股票收入(成交)总额	1,110,372,324.80

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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

报告期末本基金未持有贵金属投资。

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

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行交易，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地实现投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金可基于谨慎原则，以套期保值为目的，运用国债期货对基本投资组合进行管理，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 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

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	286,010.72
2	应收证券清算款	20,671,457.53
3	应收股利	-
4	应收利息	14,492.10
5	应收申购款	1,000,837.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	29,558.40
8	其他	-
9	合计	22,002,356.24

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**7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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
万家沪深 300 指数增强 A	10,372	37,029.38	350,186,842.38	91.18%	33,881,922.83	8.82%
万家沪深 300 指数增强 C	11,952	7,375.59	59,584,884.99	67.59%	28,568,186.96	32.41%
合计	21,595	21,867.18	409,771,727.37	86.78%	62,450,109.79	13.22%

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	万家沪深 300 指数增强 A	389,709.25	0.1015%
	万家沪深 300 指数增强 C	45,036.47	0.0511%
	合计	434,745.72	0.0921%

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	万家沪深 300 指数增强 A	10~50
	万家沪深 300 指数增强 C	0~10

	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	万家沪深 300 指数增强 A	0
	万家沪深 300 指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家沪深 300 指数 增强 A	万家沪深 300 指数 增强 C
基金合同生效日（2016 年 9 月 26 日）基金 份额总额	200,003,856.66	8,858.96
本报告期期初基金份额总额	419,866,094.60	131,703,878.11
本报告期基金总申购份额	43,305,083.87	56,731,340.50
减：本报告期基金总赎回份额	79,102,413.26	100,282,146.66
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	384,068,765.21	88,153,071.95

§ 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 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：

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期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	1,422,186,901.95	68.53%	1,040,055.23	63.10%	-
川财证券	1	653,131,286.55	31.47%	608,264.22	36.90%	-

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
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信

息服务;能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告,具有开发量化投资组合模型的能力;能积极为公司投资业务的开展,投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下:

(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构;

(2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

3、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

本报告期末有租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

§ 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

报告期内本基金未出现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、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《万家沪深 300 指数增强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、更新招募说明书及其他临时公告。
- 5、万家沪深 300 指数增强型证券投资基金 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、《万家沪深 300 指数增强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。

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