

# 万家鑫动力月月购一年滚动持有混合型证 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 投资组合报告附注.....	50
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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.....	51
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>52</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>56</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	56
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>57</b>

12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	万家鑫动力月月购一年滚动持有混合型证券投资基金
基金简称	万家鑫动力月月购一年滚动持有混合
基金主代码	009688
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 6 月 18 日
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	463,218,150.51 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产长期稳健的增值。
投资策略	1、大类资产配置策略；2、股票投资策略：（1）A 股投资策略；（2）全国中小企业股份转让系统精选层挂牌股票投资策略；（3）港股通标的股票投资策略；（4）存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、可转换债券与可交换债券投资策略；6、证券公司短期公司债券投资策略；7、金融衍生产品投资策略：（1）股指期货投资策略；（2）国债期货投资策略；（3）股票期权投资策略；8、信用衍生品投资策略；9、融资及转融通证券出借业务投资策略；10、开放期投资策略；11、其他。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×65%+中国战略新兴产业成份指数收益率×10%+恒生指数收益率×5%+中债综合指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		万家基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	张燕
	联系电话	021-38909626	0755-83199084
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4008880800	95555
传真		021-38909627	0755-83195201

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）	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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）	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200122	518040
法定代表人	方一天	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.wjasset.com">http://www.wjasset.com</a>
基金中期报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区浦电路 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	103,922,650.85
本期利润	-19,538,475.65
加权平均基金份额本期利润	-0.0168
本期加权平均净值利润率	-1.48%
本期基金份额净值增长率	-1.16%
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	52,740,168.22
期末可供分配基金份额利润	0.1139
期末基金资产净值	516,561,798.35
期末基金份额净值	1.1152
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	11.52%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、上表中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。

#### 3.2 基金净值表现

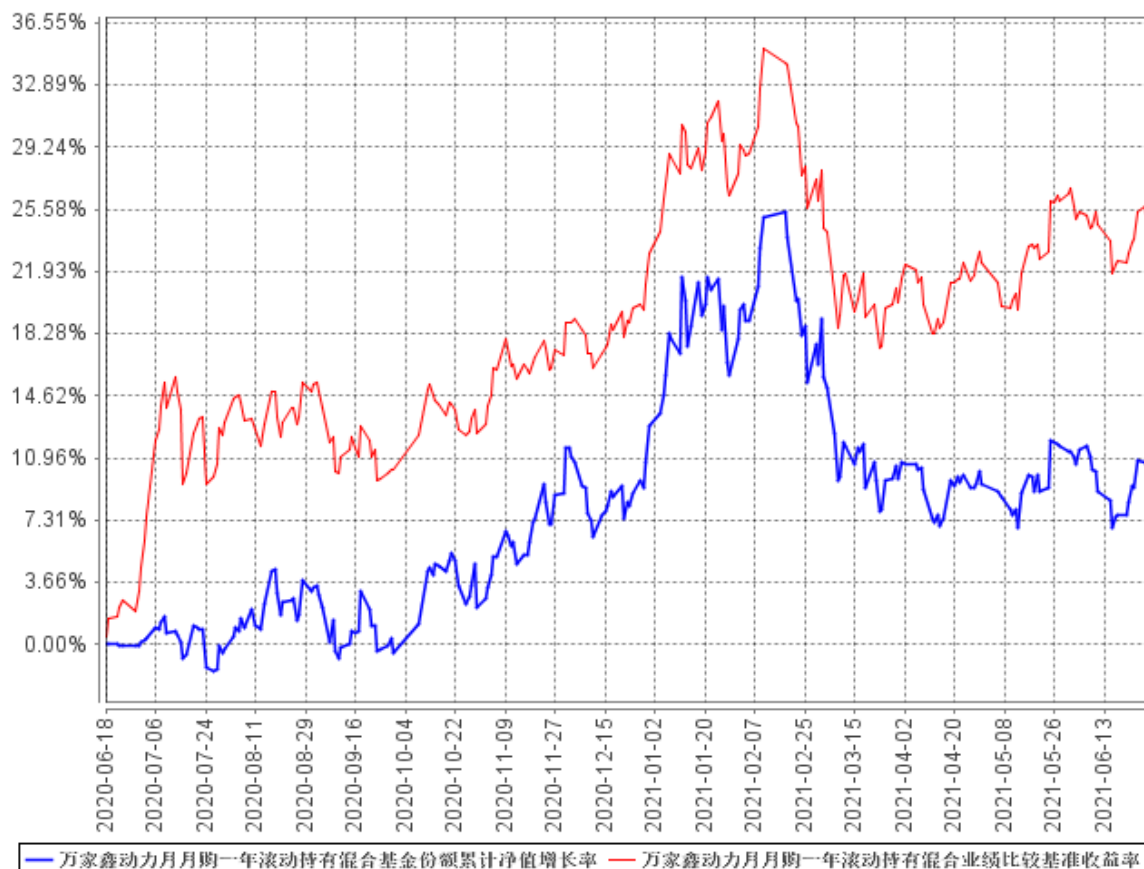
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.15%	0.72%	-0.91%	0.66%	1.06%	0.06%
过去三个月	1.63%	0.80%	4.37%	0.80%	-2.74%	0.00%
过去六个月	-1.16%	1.23%	1.96%	1.08%	-3.12%	0.15%
过去一年	11.54%	1.10%	21.56%	1.06%	-10.02%	0.04%
自基金合同生效起至今	11.52%	1.09%	25.35%	1.05%	-13.83%	0.04%



### 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

万家鑫动力月月购一年滚动持有混合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：本基金合同生效日期为 2020 年 6 月 18 日，本基金建仓期为基金合同生效后 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44 号文批准设立。公司现股东为中泰证券股份有限公司、新疆国际实业股份有限公司和齐河众鑫投资有限公司,住所:中国(上海)自由贸易试验区浦电路 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		
高源	万家消费成长股票型证券投资基金、万家潜力价值灵活配置混合型证券投资基金、万家	2020 年 6 月 18 日	-	15 年	伦敦政治经济学院会计与金融硕士。2005 年 10 月至 2007 年 7 月在光大证券股份有限公司研究所工作，担任高级研究员，主要负责股票研究等相关工作；2007 年 7 月至 2010 年 10 月在安信证券股份有限公司工作，担任研究部高级研究员；2010 年 10 月至 2017 年 4 月在申万菱信基金管理有限公司工

	<p>新机遇 价值驱 动灵活 配置混 合型证 券投资 基金、 万家鑫 动力月 月购一 年滚动 持有混 合型证 券投资 基金、 万家健 康产业 混合型 证券投 资基金 的基金 经理</p>			<p>作，先后担任投资管理部高级研究员、基金经理等职，主要从事股票研究和投资管理等工作。2017 年 4 月加入万家基金管理有 限公司，从事股票研究工作，自 2017 年 8 月起担任 投资研究部基金经理职 务。</p>
--	---	--	--	--

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》、《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

今年上半年,尤其二季度以来,市场风险偏好在流动性的驱动下维持高位,价值投资的估值体系遭遇较大的挑战。我们需要反思的是,第一,市场目前的风险偏好在多长的时间可持续,第二,投资人的容忍时间是否和前述时间匹配,以及是否需要做出对应的调整。疫情的发生,对宏观政策的判断也造成一定的扰动,财政和货币政策的预判难度加大。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.1152 元;本报告期基金份额净值增长率为-1.16%,业绩比较基准收益率为 1.96%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

大致来说,我们下半年的投资思路如下,第一,在现有货币条件下,维持对金融股的持仓,我们认为市场可能对银行股的基本面过分悲观;第二,避开盈利预期差较小的成长板块(有些行业的基本面确实较好,但我们认为股价已经较为充分地反映了 EPS 的乐观预期,股价进入纯估值驱动的阶段);第三,加大自下而上的选股,研究重点仍然集中在我们较为擅长的拐点型机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了估值委员会,定期评价现行估值政策和程序,在发生了影响估值政策和程序有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。估值委员会由总经理、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**

本基金报告期内未实施利润分配。

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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：万家鑫动力月月购一年滚动持有混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	72,306,249.46	89,274,025.05
结算备付金		636,406.05	1,473,112.16
存出保证金		257,859.68	392,071.84
交易性金融资产	6.4.7.2	452,168,049.73	1,367,159,658.30
其中：股票投资		452,168,049.73	1,367,159,658.30
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		13,568,904.44	1,540,949.49
应收利息	6.4.7.5	7,291.39	10,508.93
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		538,944,760.75	1,459,850,325.77
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		20,229,610.33	4,020,787.03
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		774,629.69	1,781,642.31
应付托管费		129,104.99	296,940.41
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,115,357.24	629,368.28
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	134,260.15	115,000.00
负债合计		22,382,962.40	6,843,738.03
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	463,218,150.51	1,287,837,952.66
未分配利润	6.4.7.10	53,343,647.84	165,168,635.08
所有者权益合计		516,561,798.35	1,453,006,587.74
负债和所有者权益总计		538,944,760.75	1,459,850,325.77

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1152 元，基金份额总额 463,218,150.51 份。

## 6.2 利润表

会计主体：万家鑫动力月月购一年滚动持有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 6 月 18 日(基 金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-4,177,934.01	526,071.55
1.利息收入		336,901.17	526,071.55
其中：存款利息收入	6.4.7.11	275,454.37	204,434.71
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		61,446.80	321,636.84
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		118,946,291.32	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	112,317,039.53	-
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	6,629,251.79	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-123,461,126.50	-
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	-	-
<b>减：二、费用</b>		15,360,541.64	747,404.16
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,884,241.53	633,278.95

2. 托管费	6.4.10.2.2	1,647,373.61	105,546.51
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	3,725,158.11	-
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	103,768.39	8,578.70
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-19,538,475.65	-221,332.61
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-19,538,475.65	-221,332.61

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家鑫动力月月购一年滚动持有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）	1,287,837,952.66	165,168,635.08	1,453,006,587.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-19,538,475.65	-19,538,475.65
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）	-824,619,802.15	-92,286,511.59	-916,906,313.74
其中：1.基金申购款	2,555,717.11	393,263.54	2,948,980.65
2.基金赎回款	-827,175,519.26	-92,679,775.13	-919,855,294.39
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）	463,218,150.51	53,343,647.84	516,561,798.35



1,287,837,952.66 元,折合 1,287,837,952.66 份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为万家基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

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(包括主板、创业板、中小板以及其他中国证监会允许上市的股票、存托凭证)、全国中小企业股份转让系统精选层挂牌股票、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、证券公司短期公司债、政府支持机构债、公开发行的次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券(含可分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品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)。本基金可参与融资业务。在条件许可的情况下,本基金可根据相关法律法规,在履行适当程序后,参与融券业务和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 65%+中国战略新兴产业成份指数收益率 $\times$ 10%+恒生指数收益率 $\times$ 5%+中债综合指数收益率 $\times$ 20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法(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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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	72,306,249.46
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	72,306,249.46

### 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	399,078,282.29	452,168,049.73	53,089,767.44
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	399,078,282.29	452,168,049.73	53,089,767.44

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

### 6.4.7.4 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

本基金本报告期末无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	6,888.99
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	286.40
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	116.00
合计	7,291.39

### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期期末未持有其他资产。

### 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	1,115,357.24
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,115,357.24



### 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	134,260.15
合计	134,260.15

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,287,837,952.66	1,287,837,952.66
本期申购	2,555,717.11	2,555,717.11
本期赎回(以“-”号填列)	-827,175,519.26	-827,175,519.26
- 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	463,218,150.51	463,218,150.51

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-11,382,258.86	176,550,893.94	165,168,635.08
本期利润	103,922,650.85	-123,461,126.50	-19,538,475.65
本期基金份额交易产生的变动数	-39,800,223.77	-52,486,287.82	-92,286,511.59
其中：基金申购款	58,086.82	335,176.72	393,263.54
基金赎回款	-39,858,310.59	-52,821,464.54	-92,679,775.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	52,740,168.22	603,479.62	53,343,647.84

### 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	264,216.35
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	9,048.44
其他	2,189.58
合计	275,454.37

### 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	1,521,149,529.37
减：卖出股票成本总额	1,408,832,489.84
买卖股票差价收入	112,317,039.53

### 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	6,629,251.79

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	6,629,251.79

#### 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	-123,461,126.50
——股票投资	-123,461,126.50
——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	-123,461,126.50

#### 6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 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	3,725,158.11
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	3,725,158.11

### 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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	400.00
银行汇划费用	5,108.24
债券帐户维护费	9,000.00
合计	103,768.39

### 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
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人、基金销售机构
中泰证券股份有限公司(“中泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10 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6月18日(基金合同生效日)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	197,036,745.45	9.26%	-	-

#### 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

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6月18日(基金合同生效日)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	-	-	489,300,000.00	49.35%

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 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	182,467.29	9.21%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年6月18日(基金合同生效日)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	-	-	-	-

#### 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6月18日(基金合同生效日) 至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	9,884,241.53	633,278.95
其中:支付销售机构的客户维护费	3,790,960.17	291,791.98

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5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6月18日(基金合同生效日) 至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,647,373.61	105,546.51

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5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。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**6.4.10.4 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**

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

**6.4.10.6 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6月18日(基金合同生效日)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
招商银行	72,306,249.46	264,216.35	585,775,514.60	114,990.25

注：本基金的银行存款由基金托管人招商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的证券。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期及上年度可比期间没有需作说明的其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期末进行利润分配。

### 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
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	-
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	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	创业板股票流通受限	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
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	2022 年 1 月 6 日	创业板股票流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
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	-
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	-
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	-
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	-
300957	贝泰妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	创业板股票流通受限	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
688079	美迪凯	2021 年 2 月 23 日	2021 年 9 月 2 日	科创板股票流通受限	10.19	18.40	10,622	108,238.18	195,444.80	-
301006	迈拓	2021 年	2021	创业板	14.42	24.89	5,051	72,835.42	125,719.39	-



	股份	5月31日	年12月7日	股票流通受限						
688689	银河微电	2021年1月15日	2021年7月27日	科创板股票流通受限	14.01	35.62	3,258	45,644.58	116,049.96	-
688639	华恒生物	2021年4月14日	2021年10月22日	科创板股票流通受限	23.16	42.28	2,302	53,314.32	97,328.56	-
688621	阳光诺和	2021年6月11日	2021年12月21日	科创板股票流通受限	26.89	63.99	1,485	39,931.65	95,025.15	-
688109	品茗股份	2021年3月22日	2021年9月30日	科创板股票流通受限	50.05	72.10	1,301	65,115.05	93,802.10	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	创业板股票流通受限	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
688314	康拓医疗	2021年5月11日	2021年11月18日	科创板股票流通受限	17.34	74.48	1,085	18,813.90	80,810.80	-
688117	圣诺生物	2021年5月26日	2021年12月3日	科创板股票流通受限	17.90	35.97	1,672	29,928.80	60,141.84	-
688328	深科达	2021年3月1日	2021年9月9日	科创板股票流通受限	16.49	37.79	1,499	24,718.51	56,647.21	-
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	创业板股票流通受限	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	创业板股票流通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
688395	正弦电气	2021年4月21日	2021年10月29日	科创板股票流通受限	15.95	22.37	1,627	25,950.65	36,395.99	-
300953	震裕	2021年	2021	创业板	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-

	科技	3月11日	年9月22日	股票流通受限							
300941	创识科技	2021年2月2日	2021年8月9日	创业板股票流通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-	
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	创业板股票流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-	
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	创业板股票流通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-	
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	创业板股票流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-	
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	创业板股票流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-	
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	创业板股票流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-	
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	创业板股票流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-	
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	创业板股票流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-	
301013	利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	创业板股票流通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-	
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	创业板股票流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-	
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	创业板股票流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-	
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	创业板股票流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-	

301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	创业板股票流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	创业板股票流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	创业板股票流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021年3月3日	2021年9月13日	创业板股票流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	创业板股票流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	创业板股票流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	创业板股票流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	创业板股票流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	创业板股票流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021年2月24日	2021年9月3日	创业板股票流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	创业板股票流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	创业板股票流通受限	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	创业板股票流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-

300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	创业板股票流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月12日	创业板股票流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300930	屹通新材	2021年1月13日	2021年7月21日	创业板股票流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	创业板股票流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	创业板股票流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
301004	嘉益股份	2021年6月18日	2021年12月27日	创业板股票流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	创业板股票流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	创业板股票流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	创业板股票流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	创业板股票流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	创业板股票流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	创业板股票流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-

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

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 6.4.12.3 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 2021 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### 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

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理融入各业务层面，建立了三道防线：以各岗位目标责任制为基础，形成第一道防线；通过相关部门、相关岗位之间相互监督制衡，形成第二道防线；由监察稽核部门、督察长对各岗位、各部门、各机构、各项业务实施监督反馈，形成第三道防线。

#### 6.4.13.2 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。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险，本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。

### 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,本期末本基金的资产均能及时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.3.1 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	72,306,249.46	-	-	-	-	-	72,306,249.46
结算备付金	636,406.05	-	-	-	-	-	636,406.05
存出保证金	257,859.68	-	-	-	-	-	257,859.68
交易性金融资产	-	-	-	-	-	452,168,049.73	452,168,049.73
应收证券清算款	-	-	-	-	-	13,568,904.44	13,568,904.44
应收利息	-	-	-	-	-	7,291.39	7,291.39
资产总计	73,200,515.19	-	-	-	-	465,744,245.56	538,944,760.75
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	20,229,610.33	20,229,610.33
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	774,629.69	774,629.69
应付托管费	-	-	-	-	-	129,104.99	129,104.99
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,115,357.24	1,115,357.24
其他负债	-	-	-	-	-	134,260.15	134,260.15
负债总计	-	-	-	-	-	22,382,962.40	22,382,962.40
利率敏感度缺口	73,200,515.19	-	-	-	-	443,361,283.16	516,561,798.35
上年度末 2020年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	89,274,025.05	-	-	-	-	-	89,274,025.05
结算备付金	1,473,112.16	-	-	-	-	-	1,473,112.16
存出保证金	392,071.84	-	-	-	-	-	392,071.84
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,367,159,658.30	1,367,159,658.30
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,540,949.49	1,540,949.49



应收利息	-	-	-	-	10,508.93	10,508.93
资产总计	91,139,209.05	-	-	-	1,368,711,116.72	1,459,850,325.77
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	4,020,787.03	4,020,787.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,781,642.31	1,781,642.31
应付托管费	-	-	-	-	296,940.41	296,940.41
应付交易费用	-	-	-	-	629,368.28	629,368.28
其他负债	-	-	-	-	115,000.00	115,000.00
负债总计	-	-	-	-	6,843,738.03	6,843,738.03
利率敏感度缺口	91,139,209.05	-	-	-	1,361,867,378.69	1,453,006,587.74

注：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者进行了分类。

#### 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和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大市场价格风险。

##### 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	452,168,049.73	87.53	1,367,159,658.30	94.09
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	452,168,049.73	87.53	1,367,159,658.30	94.09

注：本基金投资于债券类资产(含可转换债券)的比例不低于基金资产的 80%，投资于股票等权益类证券的比例不超过基金资产的 20%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如表中数据。

#### 6.4.13.4.3.2 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）
	股票基准指数下降 100 个基点	-3,910,655.44	-15,541,315.26
股票基准指数上升 100 个基点	3,910,655.44	15,541,315.26	

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。上表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	452,168,049.73	83.90
	其中：股票	452,168,049.73	83.90
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	72,942,655.51	13.53
8	其他各项资产	13,834,055.51	2.57
9	合计	538,944,760.75	100.00

注：报告期末本基金未持有全国中小企业股份转让系统挂牌的股票。

### 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	246,320,349.03	47.68
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	46,404.58	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,524,127.37	1.84
J	金融业	177,596,286.10	34.38
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	17,823,819.76	3.45
M	科学研究和技术服务业	771,826.60	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	35,554.25	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	-	-
S	综合	-	-
	合计	452,168,049.73	87.53

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002142	宁波银行	844,300	32,902,371.00	6.37
2	601166	兴业银行	1,528,300	31,406,565.00	6.08
3	600426	华鲁恒升	780,308	24,150,532.60	4.68
4	601398	工商银行	4,018,700	20,776,679.00	4.02
5	600919	江苏银行	2,897,600	20,572,960.00	3.98
6	601939	建设银行	2,995,067	19,917,195.55	3.86
7	603816	顾家家居	245,800	18,995,424.00	3.68
8	002508	老板电器	397,100	18,465,150.00	3.57
9	601288	农业银行	5,943,098	18,007,586.94	3.49
10	002027	分众传媒	1,894,136	17,823,819.76	3.45
11	600600	青岛啤酒	152,750	17,665,537.50	3.42
12	600926	杭州银行	1,176,645	17,355,513.75	3.36
13	300059	东方财富	506,944	16,622,693.76	3.22
14	300124	汇川技术	223,543	16,600,303.18	3.21
15	603833	欧派家居	109,100	15,487,836.00	3.00
16	603008	喜临门	436,000	14,392,360.00	2.79
17	600031	三一重工	427,900	12,439,053.00	2.41
18	002867	周大生	584,100	11,547,657.00	2.24
19	601058	赛轮轮胎	1,030,500	10,294,695.00	1.99
20	002920	德赛西威	90,620	9,975,449.60	1.93
21	603733	仙鹤股份	253,700	9,640,600.00	1.87
22	603501	韦尔股份	28,600	9,209,200.00	1.78
23	002572	索菲亚	379,000	9,171,800.00	1.78
24	601633	长城汽车	189,900	8,277,741.00	1.60
25	300791	仙乐健康	133,528	7,397,451.20	1.43

26	000625	长安汽车	240,600	6,322,968.00	1.22
27	688626	翔宇医疗	48,335	5,840,801.40	1.13
28	002624	完美世界	208,900	4,994,799.00	0.97
29	000683	远兴能源	974,100	4,549,047.00	0.88
30	002405	四维图新	299,000	4,395,300.00	0.85
31	603818	曲美家居	459,700	4,082,136.00	0.79
32	603518	锦泓集团	126,400	3,119,552.00	0.60
33	601567	三星医疗	124,900	2,660,370.00	0.52
34	603365	水星家纺	138,500	1,981,935.00	0.38
35	002876	三利谱	24,100	1,559,270.00	0.30
36	688131	皓元医药	1,955	676,801.45	0.13
37	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.04
38	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.04
39	688079	美迪凯	10,622	195,444.80	0.04
40	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.03
41	301006	迈拓股份	5,051	125,719.39	0.02
42	688689	银河微电	3,258	116,049.96	0.02
43	688668	鼎通科技	3,037	99,461.75	0.02
44	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.02
45	688639	华恒生物	2,302	97,328.56	0.02
46	688621	阳光诺和	1,485	95,025.15	0.02
47	688698	伟创电气	4,751	94,972.49	0.02
48	688109	品茗股份	1,301	93,802.10	0.02
49	300920	润阳科技	2,503	84,301.04	0.02
50	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.02
51	300979	华利集团	925	80,937.50	0.02
52	688314	康拓医疗	1,085	80,810.80	0.02
53	688117	圣诺生物	1,672	60,141.84	0.01
54	688328	深科达	1,499	56,647.21	0.01
55	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.01
56	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
57	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
58	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
59	688395	正弦电气	1,627	36,395.99	0.01
60	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
61	002984	森麒麟	880	32,076.00	0.01
62	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
63	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
64	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00

65	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
66	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
67	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
68	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
69	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
70	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
71	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
72	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
73	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
74	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
75	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
76	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
77	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
78	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
79	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
80	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
81	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
82	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
83	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
84	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
85	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
86	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
87	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
88	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
89	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
90	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
91	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
92	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
93	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
94	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
95	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
96	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
97	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
98	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
99	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
100	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
101	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
102	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
103	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00

104	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
105	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
106	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
107	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
108	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
109	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
110	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
111	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
112	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
113	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
114	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
115	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
116	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	601288	农业银行	82,484,468.52	5.68
2	601398	工商银行	53,505,640.00	3.68
3	601128	常熟银行	37,890,423.14	2.61
4	002572	索菲亚	30,504,462.88	2.10
5	603501	韦尔股份	29,619,117.22	2.04
6	002920	德赛西威	27,007,083.73	1.86
7	601939	建设银行	22,692,821.63	1.56
8	600926	杭州银行	21,901,777.99	1.51
9	600919	江苏银行	20,565,705.00	1.42
10	002508	老板电器	20,536,153.15	1.41
11	603816	顾家家居	19,803,170.00	1.36
12	603833	欧派家居	17,049,102.14	1.17
13	002405	四维图新	16,773,120.98	1.15
14	688561	奇安信	16,370,625.16	1.13
15	600660	福耀玻璃	15,367,476.00	1.06
16	603733	仙鹤股份	14,774,112.82	1.02
17	002867	周大生	14,411,314.00	0.99

18	002027	分众传媒	14,131,221.36	0.97
19	601318	中国平安	14,079,655.00	0.97
20	000739	普洛药业	13,859,353.70	0.95

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000333	美的集团	78,169,407.18	5.38
2	600031	三一重工	77,066,524.27	5.30
3	601166	兴业银行	61,635,317.30	4.24
4	601288	农业银行	61,609,106.00	4.24
5	601398	工商银行	59,456,427.00	4.09
6	002142	宁波银行	57,817,771.00	3.98
7	300014	亿纬锂能	55,976,310.55	3.85
8	002812	恩捷股份	55,842,522.74	3.84
9	002027	分众传媒	55,140,490.17	3.79
10	601939	建设银行	54,070,035.00	3.72
11	601211	国泰君安	52,802,617.70	3.63
12	601688	华泰证券	51,815,844.93	3.57
13	601336	新华保险	51,058,250.59	3.51
14	601318	中国平安	46,450,823.90	3.20
15	600030	中信证券	45,073,204.38	3.10
16	300059	东方财富	44,039,033.00	3.03
17	600600	青岛啤酒	37,722,244.64	2.60
18	000725	京东方 A	36,071,125.33	2.48
19	601628	中国人寿	35,778,314.67	2.46
20	601128	常熟银行	35,459,132.60	2.44
21	600926	杭州银行	33,902,863.88	2.33
22	600426	华鲁恒升	32,379,935.90	2.23
23	300253	卫宁健康	31,700,042.91	2.18
24	000100	TCL 科技	31,038,777.28	2.14
25	000651	格力电器	29,182,129.00	2.01

注：1、“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 2、报告期内卖出新三板精选层股票交易明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值
----	------	------	----------	-----------



			比例 (%)
1	835185	贝特瑞	2,265,196.63 0.44

### 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	617,302,007.77
卖出股票收入（成交）总额	1,521,149,529.37

注：买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易以套期保值为目的，利用股指期货剥离部分多头股票资产的系统性风险。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金可基于谨慎原则，以套期保值为主要目的，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	257,859.68
2	应收证券清算款	13,568,904.44
3	应收股利	-
4	应收利息	7,291.39
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,834,055.51

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 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中不存在流通受限的情况。

### 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

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
11,666	39,706.68	7,681,722.62	1.66%	455,536,427.89	98.34%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	1,079,221.63	0.2330%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年6月18日）基金份额总额	1,287,837,952.66
本报告期期初基金份额总额	1,287,837,952.66
本报告期基金总申购份额	2,555,717.11
减：本报告期基金总赎回份额	827,175,519.26
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	463,218,150.51

## § 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：

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

### 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

报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	
国盛证券	1	699,372,865.52	32.87%	651,332.51	32.89%	-
西南证券	1	624,847,678.53	29.37%	581,919.55	29.38%	-
太平洋证券	2	252,629,646.89	11.87%	235,274.77	11.88%	-
中泰证券	3	197,036,745.45	9.26%	182,467.29	9.21%	-
安信证券	1	188,271,913.02	8.85%	175,337.90	8.85%	-
申万宏源	1	138,760,366.75	6.52%	129,229.14	6.53%	-
长江证券	1	26,799,282.27	1.26%	24,958.68	1.26%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

中信证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范, 内控制度健全, 在业内有良好的声誉;
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设施满足基金进行证券交易的需要;
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平, 包括但不限于: 有较好的研究能力和行业分析能力, 能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务; 能根据公司所管理基金的特定要求, 提供专门研究报告, 具有开发量化投资组合模型的能力; 能积极为公司投资业务的开展, 投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构;
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

3、基金专用交易席位的变更情况：

无

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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
国盛证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	109,200,000.00	100.00%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-
----------	---	---	---	---	---	---

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。



## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《万家鑫动力月月购一年滚动持有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上公开披露的基金净值、季度报告、更新招募说明书及其他临时公告。
- 5、万家鑫动力月月购一年滚动持有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、《万家鑫动力月月购一年滚动持有混合型证券投资基金托管协议》。

### 12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人网站：[www.wjasset.com](http://www.wjasset.com)

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司

2021 年 8 月 30 日