

万家瑞隆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：华夏银行股份有限公司

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。

基金托管人华夏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	10
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.....	12
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.....	13
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
§5 托管人报告	15
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
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
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
§7 投资组合报告.....	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
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.....	53
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	54
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	54
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.....	54
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.....	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	55
§8 基金份额持有人信息.....	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
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.....	56
§9 开放式基金份额变动.....	57
§10 重大事件揭示.....	58
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
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.....	60
§12 备查文件目录.....	61

12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家瑞隆混合型证券投资基金
基金简称	万家瑞隆
基金主代码	003751
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 30 日
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	华夏银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	125,098,572.90 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略；2、股票投资策略（（1）定性方面、（2）定量方面）；3、权证投资策略；4、普通债券投资策略；5、中小企业私募债券投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、股指期货投资策略；8、国债期货投资策略；9、股票期权投资策略；10、融资交易策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*75%+中证全债指数收益率*25%
风险收益特征	本基金是混合型基金，风险高于货币市场基金和债券型基金但低于股票型基金。

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	华夏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	郑鹏
	联系电话	021-38909626	010-85238667
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	zhengpeng@hxb.com.cn
客户服务电话		4008880800	95577
传真		021-38909627	010-85238680
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	北京市东城区建国门内大街 22 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	北京市东城区建国门内大街 22 号
邮政编码		200122	100005

法定代表人	方一天	李民吉
-------	-----	-----

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	http://www.wjasset.com
基金中期报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层 （名义楼层 9 层）基金管理人办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	万家基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

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	23,793,517.74
本期利润	14,683,025.12
加权平均基金份额本期利润	0.1845
本期加权平均净值利润率	9.74%
本期基金份额净值增长率	17.50%
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	80,473,785.61
期末可供分配基金份额利润	0.6433
期末基金资产净值	248,821,911.94
期末基金份额净值	1.9890
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	98.90%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

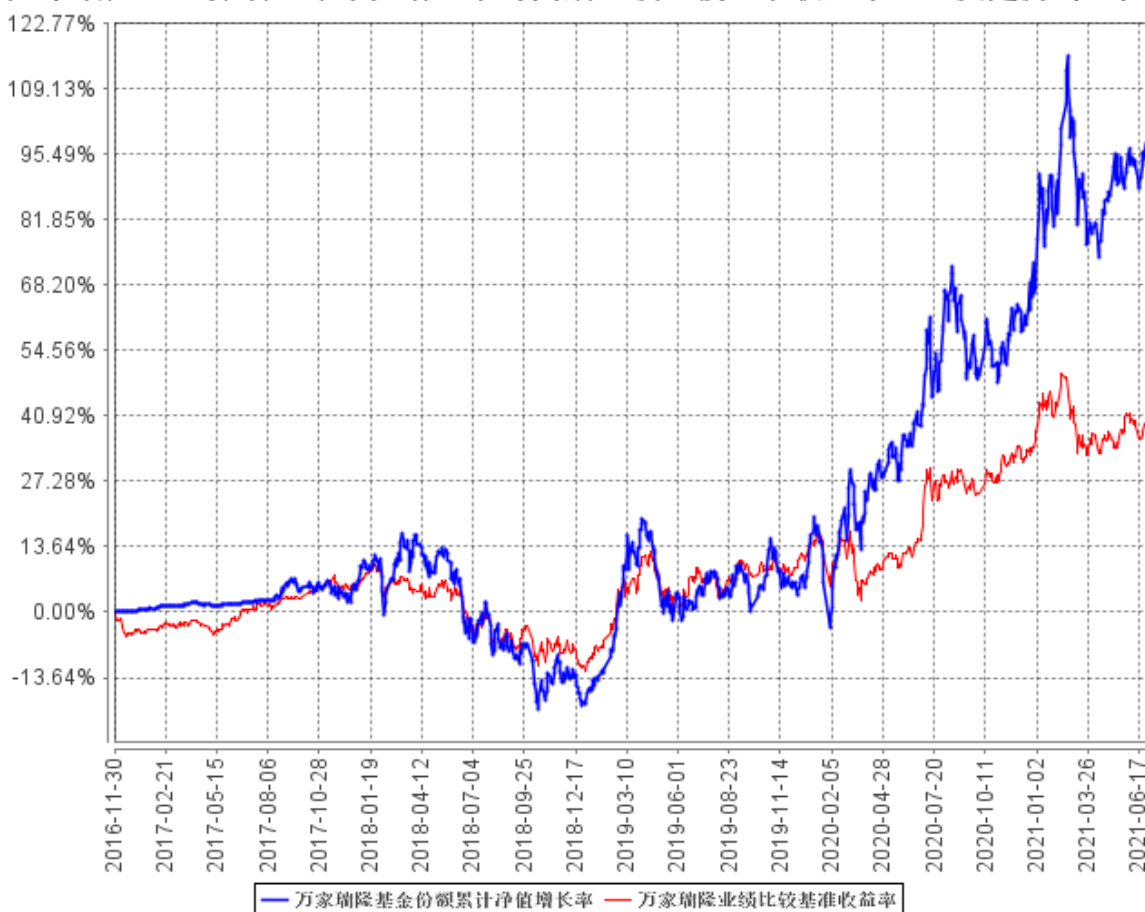
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.85%	0.90%	-1.46%	0.60%	3.31%	0.30%
过去三个月	11.24%	1.19%	2.99%	0.73%	8.25%	0.46%
过去六个月	17.50%	1.82%	0.95%	0.99%	16.55%	0.83%
过去一年	41.12%	1.84%	19.87%	1.00%	21.25%	0.84%
过去三年	101.60%	1.70%	41.50%	1.02%	60.10%	0.68%
自基金合同生效起至今	98.90%	1.47%	39.09%	0.87%	59.81%	0.60%

注：基金业绩比较基准增长率=沪深300指数收益率*75%+中证全债指数收益率*25%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

万家瑞隆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 2016 年 11 月 30 日，建仓期为 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。本基金已于 2018 年 4 月 17 日召开基金持有人大会，对本基金名称、基金投资范围等事项进行相应修改。原“万家瑞隆灵活配置混合型证券投资基金”变更注册为“万家瑞隆混合型证券投资基金”。本基金份额持有人大会于 2018 年 4 月 17 日表决通过了《关于修改万家瑞隆灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，并于 2018 年 4 月 17 日修改了基金合同，修订和更新后的文件于 2018 年 4 月 17 日生效。基金合同生效后各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44号文批准设立。公司现股东为中泰证券股份有限公司、新疆国际实业股份有限公司和齐河众鑫投资有限公司,住所:中国(上海)自由贸易试验区浦电路360号8楼(名义楼层9层),办公地点:上海市浦东新区浦电路360号9楼,注册资本3亿元人民币。目前管理九十一只开放式基金,分别为万家180指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选混合型证券投资基金(LOF)、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金(LOF)、万家添利债券型证券投资基金(LOF)、万家新机遇价值驱动灵活配置混合型证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家上证50交易型开放式指数证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞和灵活配置混合型证券投资基金、万家颐达灵活配置混合型证券投资基金、万家颐和灵活配置混合型证券投资基金、万家恒瑞18个月定期开放债券型证券投资基金、万家3-5年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家鑫安纯债债券型证券投资基金、万家鑫璟纯债债券型证券投资基金、万家沪深300指数增强型证券投资基金、万家家享中短债债券型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家1-3年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家瑞隆混合型证券投资基金、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家现金增利货币市场基金、万家消费成长股票型证券投资基金、万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家玖盛纯债9个月定期开放债券型证券投资基金、万家天添宝货币市场基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、万家家瑞债券型证券投资基金、万家臻选混合型证券投资基金、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金、万家成长优选灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金、万家

经济新动能混合型证券投资基金、万家潜力价值灵活配置混合型证券投资基金、万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家新机遇龙头企业灵活配置混合型证券投资基金、万家智造优势混合型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型证券投资基金、万家人工智能混合型证券投资基金、万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金 (LOF)、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、万家平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫盛纯债债券型证券投资基金、万家民安增利 12 个月定期开放债券型证券投资基金、万家汽车新趋势混合型证券投资基金、万家惠享 39 个月定期开放债券型证券投资基金、万家科技创新混合型证券投资基金、万家自主创新混合型证券投资基金、万家民丰回报一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、万家可转债债券型证券投资基金、万家民瑞祥和 6 个月持有期债券型证券投资基金、万家价值优势一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、万家养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、万家鑫动力月月购一年滚动持有混合型证券投资基金、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基金中基金 (FOF)、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 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、万家瑞泽回报一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、万家惠裕回报 6 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘洋	万家瑞隆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的基金经理	2018 年 9 月 18 日	-	10.5 年	上海社会科学院财政学硕士。2006 年 7 月至 2008 年 4 月在中国建设银行洛阳分行担任国际业务部业务人员；2012 年 7 月至 2015 年 4 月在宏源证券股份有限公司研究所担任研究员；2015 年 4 月至 2015 年 10 月在沃胜资产管理有限公司研究部担任研究员；2015 年 11 月加入万家基金管理有限公司，先后担任投资研究部研究员、基金经理助理，2018 年 9 月起担任基金经理职务。

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

上半年 A 股整体波动较大,农历新年前 A 股指数表现较好,但年后开始出现一轮快速下跌,

二季度以后市场逐渐企稳，高成长的新能源产业链和电子板块涨幅较大。A 股的大幅波动预计主要是由于全球货币政策预期变化，以及疫情对经济复苏的扰动导致。万家瑞隆在上半年主要持有了转基因育种和顺周期板块，并在二季度布局了新能源汽车、电子以及军工等板块，上半年取得了不错的收益。

经过过去两年大幅上涨，A 股整体估值在历史偏高水平，且不同行业估值水平分化较大。随着未来疫情好转，全球经济复苏，市场对流动性拐点的担忧可能贯穿 2021 年全年，导致 A 股全年波动可能较大。但站在当前时点，国内经济平稳，通胀压力不大，短期流动性仍将处于相对宽松状态，我们认为 A 股有望维持震荡行情，且有结构性机会。

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 1.9890 元；本报告期基金份额净值增长率为 17.50%，业绩比较基准收益率为 0.95%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

投资方面，全球经济复苏主线并未发生改变，行业景气上行、有强基本面支撑、估值相对便宜的个股是配置首选。下半年相对看好转基因育种，以及具有核心竞争力的中游制造公司。

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

本报告期内本基金未进行利润分配。

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

报告期内,本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内,基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面,能够遵守有关法律法规,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

托管人认为,由基金管理人编制并经托管人复核的本基金 2021 年中期报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：万家瑞隆混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	37,873,851.01	7,830,184.25
结算备付金		826,463.14	256,111.47
存出保证金		238,575.80	84,780.23
交易性金融资产	6.4.7.2	205,630,328.45	52,141,056.40
其中：股票投资		202,357,542.65	52,141,056.40
基金投资		-	-
债券投资		3,272,785.80	-
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	27,122.99	634.84
应收股利		-	-
应收申购款		12,945,166.39	1,584,682.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		257,541,507.78	61,897,450.18
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		5,548,144.02	3,622,024.35
应付赎回款		2,463,720.81	964,271.64
应付管理人报酬		239,830.99	52,756.23
应付托管费		31,977.46	7,034.20
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	379,494.93	105,013.68
应交税费		13.82	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	56,413.81	111,062.56
负债合计		8,719,595.84	4,862,162.66
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	125,098,572.90	33,693,216.32
未分配利润	6.4.7.10	123,723,339.04	23,342,071.20
所有者权益合计		248,821,911.94	57,035,287.52
负债和所有者权益总计		257,541,507.78	61,897,450.18

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.9890 元，基金份额总额 125,098,572.90 份。

6.2 利润表

会计主体：万家瑞隆混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		17,284,838.32	6,424,433.53
1.利息收入		34,793.55	10,603.38
其中：存款利息收入	6.4.7.11	29,308.47	10,598.87
债券利息收入		5,485.08	4.51
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）		25,352,932.34	4,054,002.55
其中：股票投资收益	6.4.7.12	23,809,679.72	3,504,835.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	67,746.41	5,347.51
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,475,506.21	543,819.07
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-9,110,492.62	1,761,932.54
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,007,605.05	597,895.06
减：二、费用		2,601,813.20	681,528.90
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,109,793.58	255,972.65
2. 托管费	6.4.10.2.2	147,972.46	34,129.67

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,291,351.78	357,908.04
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2.00	-
7. 其他费用	6.4.7.20	52,693.38	33,518.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,683,025.12	5,742,904.63
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,683,025.12	5,742,904.63

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家瑞隆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）	33,693,216.32	23,342,071.20	57,035,287.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,683,025.12	14,683,025.12
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）	91,405,356.58	85,698,242.72	177,103,599.30
其中：1.基金申购款	182,703,138.06	169,043,904.64	351,747,042.70
2.基金赎回款	-91,297,781.48	-83,345,661.92	-174,643,443.40
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）	125,098,572.90	123,723,339.04	248,821,911.94
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		

机构均为万家基金管理有限公司，基金托管人为华夏银行股份有限公司。

为提高基金资产的运作效率，保护基金份额持有人利益，经与本基金托管人华夏银行股份有限公司协商一致，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《万家瑞隆灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金管理于 2018 年 4 月 17 日，以通讯方式召开的万家瑞隆灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会审议并通过了《关于修改万家瑞隆灵活配置混合型证券投资基金合同有关事项的议案》，内容包括万家瑞隆灵活配置混合型证券投资基金变更名称、修改基金投资范围、修改投资比例限制、修改基金费率、修订基金合同等事项。自万家瑞隆灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效之日起，《万家瑞隆灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效且《万家瑞隆混合型证券投资基金基金合同》同时生效。

本基金主要投资具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、股指期货、国债期货、股票期权、权证以及债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可交换公司债券、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等金融工具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的相关规定）。本基金在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*75%+中证全债指数收益率*25%。

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 日止期间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	37,873,851.01
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：	37,873,851.01

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	207,129,599.96	202,357,542.65	-4,772,057.31
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	3,293,334.90	3,272,785.80
	银行间市场	-	-
	合计	3,293,334.90	3,272,785.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	210,422,934.86	205,630,328.45	-4,792,606.41

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	2,092.24
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	371.90
应收债券利息	24,351.46
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	199.99
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	107.40
合计	27,122.99

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	379,494.93
银行间市场应付交易费用	-

合计	379,494.93
----	------------

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	2,320.43
应付证券出借违约金	-
预提费用	54,093.38
合计	56,413.81

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	33,693,216.32	33,693,216.32
本期申购	182,703,138.06	182,703,138.06
本期赎回(以“-”号填列)	-91,297,781.48	-91,297,781.48
- 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	125,098,572.90	125,098,572.90

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	11,853,370.76	11,488,700.44	23,342,071.20
本期利润	23,793,517.74	-9,110,492.62	14,683,025.12
本期基金份额交易产生的变动数	44,826,897.11	40,871,345.61	85,698,242.72
其中：基金申购款	87,732,830.69	81,311,073.95	169,043,904.64
基金赎回款	-42,905,933.58	-40,439,728.34	-83,345,661.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	80,473,785.61	43,249,553.43	123,723,339.04

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	21,965.09
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	5,550.58
其他	1,792.80
合计	29,308.47

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	387,012,576.90
减：卖出股票成本总额	363,202,897.18
买卖股票差价收入	23,809,679.72

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	67,746.41
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	67,746.41

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	5,659,725.73
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	5,576,715.21
减：应收利息总额	15,264.11
买卖债券差价收入	67,746.41

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期末无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,475,506.21
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,475,506.21

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	-9,110,492.62
——股票投资	-9,089,943.52
——债券投资	-20,549.10
——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	-9,110,492.62

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	990,178.40
转换费收入	17,426.65
合计	1,007,605.05

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	1,291,351.78
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	1,291,351.78

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	9,916.99
信息披露费	14,876.39
证券出借违约金	-
债券账户服务费	27,900.00
其他	-

账户维护费	-
开户费	-
合计	52,693.38

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
华夏银行股份有限公司(“华夏银行”)	基金托管人
万家共赢资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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

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交易。

6.4.10.2 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无支付关联方的佣金。

6.4.10.3 关联方报酬

6.4.10.3.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,109,793.58	255,972.65

其中：支付销售机构的客户维护费	299,834.68	69,402.89
-----------------	------------	-----------

注：在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值 1.5% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.3.2 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	147,972.46	34,129.67

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.4 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。

6.4.10.5 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

6.4.10.5.1 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。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.6.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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
基金合同生效日（2016年11月30日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	2,759,882.87	2,759,882.87
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	2,759,882.87	2,759,882.87
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.2062%	9.6136%

6.4.10.6.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2021年6月30日		2020年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
万家共赢资产管理有限公司	5,278,022.17	4.2191%	5,278,022.17	15.6649%

6.4.10.7 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		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

华夏银行	37,873,851.01	21,965.09	3,112,194.70	8,606.98
------	---------------	-----------	--------------	----------

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

6.4.10.8 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金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
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	1,753	38,495.88	38,495.88	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	新股未上市	38.85	38.85	1,191	46,270.35	46,270.35	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	创业板股票流通受限	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	创业板股票流	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-

		日	6 日	通受限							
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	303	2,784.57	12,235.14	-	
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	-	
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	244	2,859.68	6,607.52	-	
300953	震裕科技	2021 年 3 月 11 日	2021 年 9 月 22 日	创业板股票流通受限	28.77	99.85	154	4,430.58	15,376.90	-	
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	-	
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	105	4,969.65	26,455.80	-	
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	-	
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	-	
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	-	
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	-	
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	-	
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	-	
300967	晓鸣股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月	创业板股票流	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-	

			月 13 日	通受限							
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	638	4,383.06	7,700.66		-
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		-
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		-
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	90	2,545.20	10,413.90		-
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		-
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	530	4,462.60	7,208.00		-
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	181	6,012.82	15,837.50		-
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	43	2,089.37	3,886.77		-
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		-
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	154	3,834.60	3,820.74		-
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月	创业板股票流	14.79	30.57	158	2,336.82	4,830.06		-

		日	月 1 日	通受限							
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	-	
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	-	
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	-	
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	-	
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	690	3,408.60	9,004.50	-	
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	-	
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	187	3,498.77	10,774.94	-	
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	-	
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	-	
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	-	
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	-	
301012	扬电	2021 年	2021	创业板	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-	

	科技	6月15日	2021年12月22日	股票流通受限							
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		-
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		-
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		-
688067	爱威科技	2021年6月7日	2021年12月16日	科创板股票流通受限	14.71	24.83	1,259	18,519.89	31,260.97		-
688681	科汇股份	2021年6月4日	2021年12月16日	科创板股票流通受限	9.56	14.54	1,899	18,154.44	27,611.46		-

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,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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	2,245,570.80	-
合计	2,245,570.80	-

注：本基金上年度末未持有债券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	1,027,215.00	-
未评级	-	-
合计	1,027,215.00	-

注：本基金上年度末未持有债券。

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。因此除在附注十二、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、债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	37,873,851.01	-	-	-	-	-	37,873,851.01
结算备付金	826,463.14	-	-	-	-	-	826,463.14
存出保证金	238,575.80	-	-	-	-	-	238,575.80
交易性金融资产	-	-	3,272,785.80	-	-	202,357,542.65	205,630,328.45
应收利息	-	-	-	-	-	27,122.99	27,122.99
应收申购款	50.00	-	-	-	-	12,945,116.39	12,945,166.39
资产总计	38,938,939.95	-	3,272,785.80	-	-	215,329,782.03	257,541,507.78
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	5,548,144.02	5,548,144.02
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,463,720.81	2,463,720.81
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	239,830.99	239,830.99
应付托管费	-	-	-	-	-	31,977.46	31,977.46
应付交易费用	-	-	-	-	-	379,494.93	379,494.93
应交税费	-	-	-	-	-	13.82	13.82
其他负债	-	-	-	-	-	56,413.81	56,413.81
负债总计	-	-	-	-	-	8,719,595.84	8,719,595.84
利率敏感度缺口	38,938,939.95	-	3,272,785.80	-	-	-206,610,186.19	248,821,911.94
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	7,830,184.25	-	-	-	-	-	7,830,184.25
结算备付金	256,111.47	-	-	-	-	-	256,111.47
存出保证金	84,780.23	-	-	-	-	-	84,780.23
交易性金融资产	-	-	-	-	-	52,141,056.40	52,141,056.40
应收利息	-	-	-	-	-	634.84	634.84
应收申购款	-	-	-	-	-	1,584,682.99	1,584,682.99

资产总计	8,171,075.95	-	-	-	-	53,726,374.23	61,897,450.18
负债							
应付证券清算款						3,622,024.35	3,622,024.35
应付赎回款						964,271.64	964,271.64
应付管理人报酬						52,756.23	52,756.23
应付托管费						7,034.20	7,034.20
应付交易费用						105,013.68	105,013.68
其他负债						111,062.56	111,062.56
负债总计						4,862,162.66	4,862,162.66
利率敏感度缺口	8,171,075.95					48,864,211.57	57,035,287.52

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

假设	若市场利率发生变动而其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	18,548.85	-
2. 市场利率上升 25 个基点	-18,266.68	-	

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	202,357,542.65	81.33	52,141,056.40	91.42
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	3,272,785.80	1.32	-	-
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	205,630,328.45	82.64	52,141,056.40	91.42

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	-1,671,722.28	-535,774.04
2. 股票基准指数上升 100 个基点	1,671,722.28	535,774.04	

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	202,357,542.65	78.57
	其中：股票	202,357,542.65	78.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,272,785.80	1.27
	其中：债券	3,272,785.80	1.27
	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	38,700,314.15	15.03
8	其他各项资产	13,210,865.18	5.13
9	合计	257,541,507.78	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	40,257,132.68	16.18
B	采矿业	11,135,984.00	4.48
C	制造业	134,155,916.10	53.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.01
E	建筑业	36,330.57	0.01
F	批发和零售业	257,526.54	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	27,865.35	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,111,079.21	4.87
J	金融业	34,721.10	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	65,464.36	0.03
M	科学研究和技术服务业	4,217,143.60	1.69
N	水利、环境和公共设施管理业	29,096.72	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	16,262.03	0.01
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	202,357,542.65	81.33

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投资股票。

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	002714	牧原股份	160,220	9,744,580.40	3.92
2	002385	大北农	1,412,963	9,608,148.40	3.86
3	000998	隆平高科	587,100	9,417,084.00	3.78
4	300087	荃银高科	401,000	8,986,410.00	3.61
5	600399	抚顺特钢	365,600	6,631,984.00	2.67
6	600577	精达股份	980,600	6,256,228.00	2.51
7	600176	中国巨石	403,136	6,252,639.36	2.51
8	603799	华友钴业	50,200	5,732,840.00	2.30
9	601899	紫金矿业	581,900	5,638,611.00	2.27
10	002041	登海种业	358,800	5,421,468.00	2.18
11	300193	佳士科技	323,900	5,156,488.00	2.07
12	002402	和而泰	214,300	5,136,771.00	2.06
13	300196	长海股份	293,600	5,038,176.00	2.02
14	601952	苏垦农发	473,700	4,917,006.00	1.98
15	688099	晶晨股份	41,772	4,686,818.40	1.88
16	002049	紫光国微	28,500	4,394,415.00	1.77
17	002299	圣农发展	166,500	3,976,020.00	1.60
18	688556	高测股份	172,217	3,971,324.02	1.60
19	002312	川发龙蟒	457,900	3,910,466.00	1.57
20	600699	均胜电子	144,900	3,697,848.00	1.49
21	600346	恒力石化	137,600	3,610,624.00	1.45
22	688598	金博股份	13,275	3,570,975.00	1.44
23	002916	深南电路	30,500	3,389,465.00	1.36
24	002601	龙蟒佰利	94,800	3,278,184.00	1.32
25	600989	宝丰能源	228,500	3,125,880.00	1.26

26	002025	航天电器	58,600	2,939,962.00	1.18
27	601168	西部矿业	227,800	2,717,654.00	1.09
28	600598	北大荒	180,500	2,700,280.00	1.09
29	002100	天康生物	291,000	2,592,810.00	1.04
30	603363	傲农生物	250,391	2,579,027.30	1.04
31	300358	楚天科技	133,200	2,492,172.00	1.00
32	688607	康众医疗	50,497	2,338,011.10	0.94
33	688329	艾隆科技	42,655	2,331,522.30	0.94
34	300374	中铁装配	163,800	2,201,472.00	0.88
35	688131	皓元医药	6,340	2,194,844.60	0.88
36	002624	完美世界	91,100	2,178,201.00	0.88
37	603986	兆易创新	11,340	2,130,786.00	0.86
38	002507	涪陵榨菜	56,400	2,124,024.00	0.85
39	300233	金城医药	72,400	2,063,400.00	0.83
40	603678	火炬电子	30,500	2,058,750.00	0.83
41	600703	三安光电	63,900	2,047,995.00	0.82
42	300416	苏试试验	88,310	2,022,299.00	0.81
43	002555	三七互娱	81,600	1,960,032.00	0.79
44	688122	西部超导	29,418	1,908,345.66	0.77
45	601038	一拖股份	115,500	1,905,750.00	0.77
46	300369	绿盟科技	114,600	1,827,870.00	0.73
47	000059	华锦股份	222,700	1,817,232.00	0.73
48	600123	兰花科创	231,200	1,789,488.00	0.72
49	600409	三友化工	161,100	1,628,721.00	0.65
50	002179	中航光电	20,300	1,604,106.00	0.64
51	300809	华辰装备	67,800	1,374,984.00	0.55
52	300785	值得买	14,200	1,349,000.00	0.54
53	002036	联创电子	80,600	1,059,890.00	0.43
54	688389	普门科技	34,232	1,049,553.12	0.42
55	600760	中航沈飞	16,900	1,019,070.00	0.41
56	600985	淮北矿业	81,100	990,231.00	0.40
57	603688	石英股份	42,000	987,000.00	0.40
58	688076	诺泰生物	13,470	918,788.70	0.37
59	003025	思进智能	23,000	698,050.00	0.28
60	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.16
61	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.10
62	301013	利和兴	4,704	168,966.51	0.07
63	688601	力芯微	915	168,451.50	0.07
64	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.06

65	688216	气派科技	2,000	133,400.00	0.05
66	688161	威高骨科	1,180	125,139.00	0.05
67	688425	铁建重工	19,712	120,637.44	0.05
68	688319	欧林生物	3,168	118,514.88	0.05
69	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.05
70	688276	百克生物	1,072	112,109.76	0.05
71	688345	博力威	1,432	105,323.60	0.04
72	301004	嘉益股份	3,115	90,654.98	0.04
73	688078	龙软科技	1,920	88,857.60	0.04
74	601156	东航物流	2,090	49,470.30	0.02
75	688499	利元亨	1,191	46,270.35	0.02
76	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
77	603529	爱玛科技	679	39,463.48	0.02
78	688087	英科再生	1,753	38,495.88	0.02
79	688367	工大高科	1,717	37,035.69	0.01
80	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
81	605089	味知香	370	32,197.40	0.01
82	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.01
83	688681	科汇股份	1,899	27,611.46	0.01
84	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
85	300957	贝泰妮	105	26,455.80	0.01
86	605080	浙江自然	374	23,487.20	0.01
87	605378	野马电池	473	21,729.62	0.01
88	605389	长龄液压	356	20,890.08	0.01
89	001206	依依股份	321	20,389.92	0.01
90	605305	中际联合	368	19,364.16	0.01
91	001205	盛航股份	577	18,850.59	0.01
92	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
93	605098	行动教育	289	16,262.03	0.01
94	605196	华通线缆	1,172	16,079.84	0.01
95	605300	佳禾食品	576	16,012.80	0.01
96	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.01
97	300979	华利集团	181	15,837.50	0.01
98	300953	震裕科技	154	15,376.90	0.01
99	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
100	605180	华生科技	384	14,208.00	0.01
101	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.01
102	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
103	300614	百川畅银	303	12,235.14	0.00

104	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
105	605488	福莱新材	416	11,103.04	0.00
106	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
107	605289	罗曼股份	380	10,959.20	0.00
108	301002	崧盛股份	187	10,774.94	0.00
109	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
110	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
111	300973	立高食品	90	10,413.90	0.00
112	605189	富春染织	423	10,190.07	0.00
113	003041	真爱美家	349	9,876.70	0.00
114	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
115	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
116	001202	炬申股份	459	9,014.76	0.00
117	300997	欢乐家	690	9,004.50	0.00
118	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
119	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
120	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
121	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
122	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
123	300968	格林精密	638	7,700.66	0.00
124	300978	东箭科技	530	7,208.00	0.00
125	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
126	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
127	300952	恒辉安防	244	6,607.52	0.00
128	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
129	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
130	301011	华立科技	175	5,922.00	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	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
134	300986	志特新材	158	4,830.06	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	300981	中红医疗	43	3,886.77	0.00
142	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

143	300985	致远新能	154	3,820.74	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	600499	科达制造	17,434,063.64	30.57
2	002714	牧原股份	11,279,031.15	19.78
3	000155	川能动力	10,987,806.00	19.26
4	002756	永兴材料	10,398,257.00	18.23
5	002385	大北农	9,238,734.00	16.20
6	002240	盛新锂能	8,913,173.00	15.63
7	300196	长海股份	8,815,334.00	15.46
8	601899	紫金矿业	8,357,004.00	14.65
9	002466	天齐锂业	8,231,597.00	14.43
10	603612	索通发展	7,916,956.00	13.88
11	000998	隆平高科	7,741,763.24	13.57
12	300087	荃银高科	7,673,762.00	13.45
13	603799	华友钴业	7,525,901.20	13.20
14	000301	东方盛虹	7,330,898.00	12.85
15	600176	中国巨石	7,328,523.80	12.85
16	002192	融捷股份	7,257,107.48	12.72
17	603363	傲农生物	6,966,237.25	12.21
18	000933	神火股份	6,844,234.00	12.00
19	002054	德美化工	6,427,585.58	11.27
20	000807	云铝股份	6,223,902.00	10.91
21	002025	航天电器	6,044,865.64	10.60
22	600399	抚顺特钢	5,855,596.00	10.27
23	601168	西部矿业	5,830,793.00	10.22
24	002601	龙佰集团	5,734,517.00	10.05
25	601600	中国铝业	5,687,153.00	9.97
26	002068	黑猫股份	5,341,955.98	9.37
27	300193	佳士科技	5,247,692.00	9.20
28	600577	精达股份	5,238,180.00	9.18

29	000876	新希望	5,212,647.00	9.14
30	002458	益生股份	5,203,347.00	9.12
31	002402	和而泰	5,167,230.00	9.06
32	601001	晋控煤业	5,141,138.00	9.01
33	600188	兖州煤业	5,136,281.00	9.01
34	000875	吉电股份	4,900,495.00	8.59
35	002124	天邦股份	4,863,832.00	8.53
36	002041	登海种业	4,585,986.80	8.04
37	002920	德赛西威	4,547,614.00	7.97
38	600352	浙江龙盛	4,404,298.00	7.72
39	600985	淮北矿业	4,383,504.18	7.69
40	601127	小康股份	4,151,997.61	7.28
41	002049	紫光国微	4,096,848.00	7.18
42	600989	宝丰能源	4,057,589.00	7.11
43	688099	晶晨股份	3,898,473.15	6.84
44	600489	中金黄金	3,856,663.00	6.76
45	300390	天华超净	3,820,602.00	6.70
46	002312	川发龙蟒	3,814,990.50	6.69
47	601952	苏垦农发	3,770,345.00	6.61
48	688556	高测股份	3,739,813.42	6.56
49	002100	天康生物	3,666,556.00	6.43
50	688550	瑞联新材	3,444,152.79	6.04
51	688005	容百科技	3,432,617.94	6.02
52	000698	沈阳化工	3,431,457.00	6.02
53	300073	当升科技	3,405,447.00	5.97
54	000776	广发证券	3,390,332.00	5.94
55	002043	兔宝宝	3,386,841.00	5.94
56	002299	圣农发展	3,380,144.22	5.93
57	600483	福能股份	3,361,344.12	5.89
58	002916	深南电路	3,291,797.05	5.77
59	300428	立中集团	3,281,270.00	5.75
60	603993	洛阳钼业	3,255,203.00	5.71
61	600958	东方证券	3,255,107.00	5.71
62	603113	金能科技	3,254,400.00	5.71
63	300059	东方财富	3,252,604.00	5.70
64	600699	均胜电子	3,252,325.00	5.70

65	600893	航发动力	3,244,233.20	5.69
66	688680	海优新材	3,149,466.51	5.52
67	600963	岳阳林纸	3,137,977.00	5.50
68	600598	北大荒	3,103,544.00	5.44
69	601225	陕西煤业	3,000,583.00	5.26
70	600346	恒力石化	2,972,019.00	5.21
71	002157	正邦科技	2,963,168.00	5.20
72	688598	金博股份	2,911,966.60	5.11
73	002709	天赐材料	2,864,740.00	5.02
74	601233	桐昆股份	2,841,014.40	4.98
75	002035	华帝股份	2,776,469.00	4.87
76	600160	巨化股份	2,663,615.40	4.67
77	002996	顺博合金	2,582,178.00	4.53
78	600760	中航沈飞	2,553,647.00	4.48
79	601118	海南橡胶	2,521,781.05	4.42
80	300358	楚天科技	2,485,597.00	4.36
81	688607	康众医疗	2,402,624.99	4.21
82	002234	民和股份	2,358,172.00	4.13
83	300374	中铁装配	2,295,359.00	4.02
84	002507	涪陵榨菜	2,205,152.70	3.87
85	300887	谱尼测试	2,181,139.00	3.82
86	600887	伊利股份	2,169,017.00	3.80
87	603501	韦尔股份	2,143,020.00	3.76
88	002555	三七互娱	2,092,250.22	3.67
89	601038	一拖股份	2,070,019.00	3.63
90	002623	亚玛顿	1,991,100.00	3.49
91	688329	艾隆科技	1,980,606.47	3.47
92	600703	三安光电	1,962,881.00	3.44
93	300416	苏试试验	1,955,945.10	3.43
94	000830	鲁西化工	1,954,491.79	3.43
95	600582	天地科技	1,953,248.00	3.42
96	002493	荣盛石化	1,948,780.00	3.42
97	002624	完美世界	1,946,935.45	3.41
98	300369	绿盟科技	1,945,853.00	3.41
99	600060	海信视像	1,943,301.00	3.41
100	688131	皓元医药	1,896,016.09	3.32

101	603678	火炬电子	1,873,601.00	3.28
102	002541	鸿路钢构	1,847,677.00	3.24
103	600449	宁夏建材	1,838,994.00	3.22
104	300582	英飞特	1,826,847.00	3.20
105	603867	新化股份	1,824,668.80	3.20
106	002957	科瑞技术	1,819,730.00	3.19
107	601636	旗滨集团	1,785,504.00	3.13
108	300233	金城医药	1,771,276.00	3.11
109	688388	嘉元科技	1,752,904.45	3.07
110	600284	浦东建设	1,752,302.75	3.07
111	300568	星源材质	1,752,113.00	3.07
112	002759	天际股份	1,747,076.00	3.06
113	600123	兰花科创	1,746,773.00	3.06
114	600895	张江高科	1,746,350.00	3.06
115	600409	三友化工	1,742,805.00	3.06
116	300496	中科创达	1,740,228.00	3.05
117	600639	浦东金桥	1,736,207.00	3.04
118	601808	中海油服	1,727,966.00	3.03
119	000059	华锦股份	1,724,763.00	3.02
120	688122	西部超导	1,724,011.94	3.02
121	300750	宁德时代	1,715,850.00	3.01
122	603986	兆易创新	1,657,260.00	2.91
123	600970	中材国际	1,651,876.09	2.90
124	300809	华辰装备	1,562,730.00	2.74
125	603203	快克股份	1,555,818.00	2.73
126	002460	赣锋锂业	1,552,520.00	2.72
127	002738	中矿资源	1,550,920.00	2.72
128	002179	中航光电	1,528,101.00	2.68
129	300785	值得买	1,509,312.00	2.65
130	601898	中煤能源	1,501,843.00	2.63
131	000911	南宁糖业	1,414,793.00	2.48
132	603893	瑞芯微	1,353,834.00	2.37
133	688078	龙软科技	1,199,330.83	2.10
134	600741	华域汽车	1,152,771.82	2.02

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600499	科达制造	19,574,843.50	34.32
2	000155	川能动力	12,317,433.00	21.60
3	000807	云铝股份	11,388,459.40	19.97
4	002756	永兴材料	10,594,902.00	18.58
5	002240	盛新锂能	9,867,970.32	17.30
6	002466	天齐锂业	9,798,503.00	17.18
7	603612	索通发展	9,631,380.00	16.89
8	000933	神火股份	8,781,601.67	15.40
9	000301	东方盛虹	8,488,316.00	14.88
10	002192	融捷股份	7,788,587.00	13.66
11	000876	新希望	7,702,469.41	13.50
12	002054	德美化工	7,621,462.00	13.36
13	002714	牧原股份	6,353,761.12	11.14
14	601001	晋控煤业	5,646,200.00	9.90
15	601600	中国铝业	5,464,508.00	9.58
16	002124	天邦股份	5,207,676.66	9.13
17	600188	兖州煤业	5,150,939.00	9.03
18	002920	德赛西威	5,100,640.00	8.94
19	002493	荣盛石化	4,993,302.00	8.75
20	300390	天华超净	4,984,860.70	8.74
21	002458	益生股份	4,734,247.80	8.30
22	000875	吉电股份	4,731,685.00	8.30
23	601127	小康股份	4,699,508.00	8.24
24	002068	黑猫股份	4,657,719.00	8.17
25	601899	紫金矿业	4,584,072.00	8.04
26	601168	西部矿业	4,574,591.00	8.02
27	601233	桐昆股份	4,398,770.60	7.71
28	600963	岳阳林纸	3,888,285.62	6.82
29	600489	中金黄金	3,805,843.00	6.67
30	300073	当升科技	3,789,787.00	6.64
31	600352	浙江龙盛	3,779,312.00	6.63
32	000698	沈阳化工	3,664,097.00	6.42
33	688005	容百科技	3,636,663.40	6.38

34	600989	宝丰能源	3,522,441.00	6.18
35	002996	顺博合金	3,511,995.00	6.16
36	600893	航发动力	3,482,055.88	6.11
37	600483	福能股份	3,429,816.64	6.01
38	600958	东方证券	3,426,733.00	6.01
39	002043	兔宝宝	3,386,456.32	5.94
40	688550	瑞联新材	3,356,792.88	5.89
41	000776	广发证券	3,354,172.00	5.88
42	002025	航天电器	3,208,884.00	5.63
43	300059	东方财富	3,170,349.00	5.56
44	600985	淮北矿业	3,159,668.14	5.54
45	603363	傲农生物	3,126,491.00	5.48
46	601225	陕西煤业	3,033,736.00	5.32
47	600887	伊利股份	3,003,117.00	5.27
48	300196	长海股份	2,976,848.00	5.22
49	002311	海大集团	2,874,808.00	5.04
50	300428	立中集团	2,857,879.00	5.01
51	603799	华友钴业	2,776,709.00	4.87
52	603893	瑞芯微	2,773,898.00	4.86
53	600160	巨化股份	2,666,448.60	4.68
54	002035	华帝股份	2,621,752.00	4.60
55	002157	正邦科技	2,611,760.02	4.58
56	002709	天赐材料	2,590,694.00	4.54
57	601118	海南橡胶	2,564,269.00	4.50
58	603993	洛阳钼业	2,538,157.00	4.45
59	603113	金能科技	2,483,135.00	4.35
60	000830	鲁西化工	2,477,921.86	4.34
61	600060	海信视像	2,458,240.00	4.31
62	600582	天地科技	2,377,972.00	4.17
63	002234	民和股份	2,303,294.00	4.04
64	603501	韦尔股份	2,258,720.00	3.96
65	688680	海优新材	2,236,734.88	3.92
66	300193	佳士科技	2,150,431.00	3.77
67	300887	谱尼测试	2,137,608.00	3.75
68	002759	天际股份	2,101,407.00	3.68
69	002541	鸿路钢构	2,077,910.34	3.64
70	300496	中科创达	2,012,245.00	3.53
71	300582	英飞特	1,937,870.00	3.40

72	002738	中矿资源	1,884,738.00	3.30
73	002957	科瑞技术	1,883,364.30	3.30
74	601808	中海油服	1,866,981.00	3.27
75	688388	嘉元科技	1,812,850.27	3.18
76	002623	亚玛顿	1,808,721.00	3.17
77	600639	浦东金桥	1,792,700.00	3.14
78	600449	宁夏建材	1,790,355.00	3.14
79	600284	浦东建设	1,764,651.78	3.09
80	300568	星源材质	1,759,539.00	3.09
81	300750	宁德时代	1,754,302.00	3.08
82	600895	张江高科	1,747,077.00	3.06
83	603867	新化股份	1,725,344.00	3.03
84	603203	快克股份	1,721,996.00	3.02
85	002460	赣锋锂业	1,633,901.00	2.86
86	601898	中煤能源	1,609,455.00	2.82
87	002601	龙佰集团	1,516,191.00	2.66
88	601636	旗滨集团	1,508,338.00	2.64
89	002100	天康生物	1,491,717.00	2.62
90	688078	龙软科技	1,465,414.27	2.57
91	688686	奥普特	1,451,251.99	2.54
92	600760	中航沈飞	1,446,782.00	2.54
93	600970	中材国际	1,413,677.41	2.48
94	000911	南宁糖业	1,403,971.71	2.46
95	600346	恒力石化	1,157,801.00	2.03
96	300171	东富龙	1,152,517.00	2.02

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	522,509,326.95
卖出股票收入（成交）总额	387,012,576.90

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,245,570.80	0.90

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,027,215.00	0.41
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,272,785.80	1.32

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019649	21 国债 01	22,440	2,245,570.80	0.90
2	127030	盛虹转债	6,750	1,027,215.00	0.41

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投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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	238,575.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	27,122.99
5	应收申购款	12,945,166.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,210,865.18

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
20,067	6,234.04	43,880,747.77	35.08%	81,217,825.13	64.92%

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	590,257.18	0.4718%

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2016 年 11 月 30 日 ）基金份额总额	300,048,961.41
本报告期期初基金份额总额	33,693,216.32
本报告期基金总申购份额	182,703,138.06
减：本报告期基金总赎回份额	91,297,781.48
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	125,098,572.90

§ 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，本基金托管人 2021 年 5 月 11 日发布公告，胡捷先生自 2021 年 4 月 30 日起担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。本基金托管人已将上述变更事项报相关监管部门备案。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
招商证券	1	505,697,104.18	55.77%	470,956.43	57.42%	-
国泰君安	1	400,981,740.55	44.23%	349,213.13	42.58%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

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

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

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

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

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

3、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
招商证券	7,377,913.60	50.73%	-	-	-	-
国泰君安	7,166,853.50	49.27%	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

§ 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、《万家瑞隆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、万家瑞隆混合型证券投资基金 2021 年中期报告原文。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。
- 7、《万家瑞隆混合型证券投资基金托管协议》。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司

2021 年 8 月 30 日