

万家人工智能混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

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、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的法律责任。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。

基金托管人中国建设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、利润分配情况、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

§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.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	45
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
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.....	53
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.....	53
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.....	53
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.....	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	53
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.....	54
§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.....	62
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.....	62
§12 备查文件目录.....	63

12.1 备查文件目录.....	63
12.2 存放地点.....	63
12.3 查阅方式.....	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家人工智能混合型证券投资基金
基金简称	万家人工智能混合
基金主代码	006281
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 1 月 25 日
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	72,314,124.55 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，通过深入研究并积极投资与人工智能主题相关的优质上市公司，分享其发展和成长的机会，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、大类资产配置策略；2、股票投资策略（（1）人工智能主题的界定、（2）个股投资策略、（3）存托凭证投资策略）3、债券投资策略；4、资产支持证券等品种投资策略；5、可转换债券投资策略；6、中小企业私募债券投资策略；7、其他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、（4）权证投资策略）；8、融资交易策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×65% + 上证国债指数收益率×35%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	李申
	联系电话	021-38909626	021-60637102
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4008880800	021-60637111
传真		021-38909627	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义	北京市西城区金融大街 25 号

	楼层 9 层)	
办公地址	中国(上海)自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层(名义楼层 9 层)	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200122	100033
法定代表人	方一天	田国立

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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	29,745,113.88
本期利润	35,224,047.65
加权平均基金份额本期利润	0.4638
本期加权平均净值利润率	19.65%
本期基金份额净值增长率	22.62%
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	73,513,012.54
期末可供分配基金份额利润	1.0166
期末基金资产净值	199,364,621.15
期末基金份额净值	2.7569
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	175.69%

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

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

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

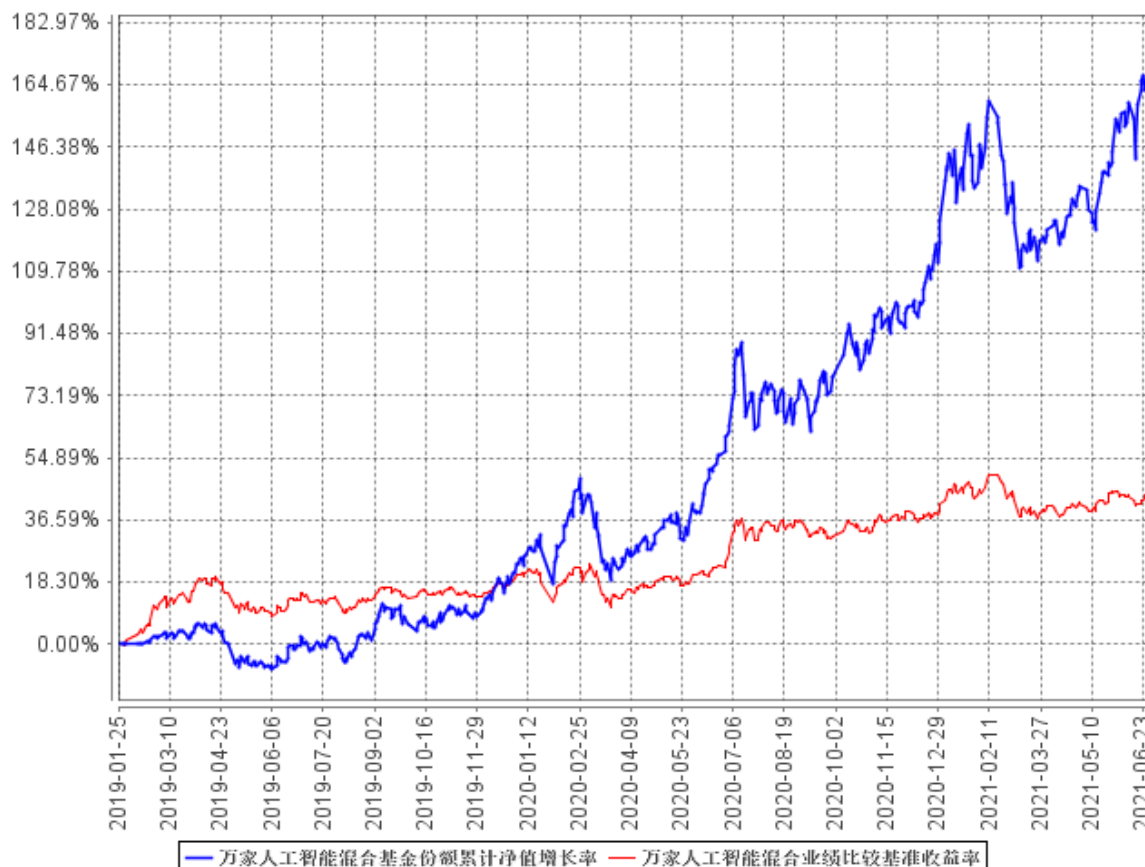
3.2 基金净值表现

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	8.39%	1.86%	-0.79%	0.50%	9.18%	1.36%
过去三个月	26.41%	1.52%	3.38%	0.57%	23.03%	0.95%
过去六个月	22.62%	1.90%	1.91%	0.79%	20.71%	1.11%
过去一年	71.00%	1.90%	15.96%	0.83%	55.04%	1.07%
自基金合同生效起至今	175.69%	1.70%	43.78%	0.87%	131.91%	0.83%

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

万家人工智能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：本基金于 2019 年 1 月 25 日成立，根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

经济新动能混合型证券投资基金、万家潜力价值灵活配置混合型证券投资基金、万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家新机遇龙头企业灵活配置混合型证券投资基金、万家智造优势混合型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型证券投资基金、万家人工智能混合型证券投资基金、万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金 (LOF)、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、万家平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫盛纯债债券型证券投资基金、万家民安增利 12 个月定期开放债券型证券投资基金、万家汽车新趋势混合型证券投资基金、万家惠享 39 个月定期开放债券型证券投资基金、万家科技创新混合型证券投资基金、万家自主创新混合型证券投资基金、万家民丰回报一年持有期混合型证券投资基金、万家可转债债券型证券投资基金、万家民瑞祥和 6 个月持有期债券型证券投资基金、万家价值优势一年持有期混合型证券投资基金、万家养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、万家鑫动力月月购一年滚动持有混合型证券投资基金、万家科创板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家创业板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家周期优势企业混合型证券投资基金、万家健康产业混合型证券投资基金、万家互联互通中国优势量化策略混合型证券投资基金、万家战略发展产业混合型证券投资基金、万家创业板指数增强型证券投资基金、万家陆家嘴金融城金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家内需增长一年持有期混合型证券投资基金、万家互联互通核心资产量化策略混合型证券投资基金、万家民瑞祥明 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家瑞泽回报一年持有期混合型证券投资基金、万家惠裕回报 6 个月持有期混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
耿嘉洲	万家人工智能混合型证券投资基金的基金经理	2020 年 5 月 14 日	-	8.5 年	2012 年 7 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、专户投资部投资经理、投资研究部基金经理助理等职务。

注：1、任职日期以及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,执行交易系统中的公平交易程序;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易,按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;对于银行间交易,按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。为保证公平交易原则的实现,通过制度规范、流程审批、系统风控参数设置等进行事前控制,通过对投资交易系统的实时监控进行事中控制,通过对异常交易的监控和分析实现事后控制。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 1 次,为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易,有关基金经理按规定履行了审批程序。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年一季报中,我们判断随着央行收紧流动性和经济复苏,市场利率预期上升,但随后我们观察到央行无论是基准利率和存款准备金率还是公开市场操作,其量价均保持稳定,而且由于今年地方债发行进度较慢、人民币升值等因素,导致二季度市场流动性实际显著好于市场预期,并且这一现象在 4 月中旬以后也被权益市场投资者所充分认知。

意识到判断偏差后我们随即对持仓品种进行了调整，主要体现在几个方向：1. 减持了利差走阔逻辑被破坏的银行股；2. 减持了基本面下行超预期且非瘟疫情减少供给逻辑被破坏的生猪养殖板块；3. 增持了行业供需紧张叠加国产替代逻辑的部分半导体品种，主要集中在包括模拟和 MCU 方向的目录型公司以及受益资本开支提升的半导体设备公司方向；4. 增持了长期景气度确定性高、基本面持续超预期的新能源车板块。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 2.7569 元；本报告期基金份额净值增长率为 22.62%，业绩比较基准收益率为 1.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们依然从流动性、经济基本面、政策环境等几个方向讨论如下：

流动性方面，我们认为目前整体流动性仍然保持充裕、货币政策保持中性且有边际宽松的预期产生，下半年美联储开始讨论缩表但并不产生实质性影响，由于下半年内外部的风险事件可能都会比较多，流动性预计也很难实质性收缩，但一些阶段性冲击需要保持警惕。

随着 7 月 7 日国常会提出通过定向降准等支持中小企业发展，市场对于流动性边际宽松开始产生期待，我们之前所判断的“Q4 存在交易再宽松预期的机会”有所提前。我们认为不宜将其理解为简单的流动性放松，但短期可能带动市场特别是偏成长方向的资产有所表现，具体来说：首先下半年国内经济确实面临一些现实压力，尤其是一些中小企业获取资金难度较大；其次下半年有大量 MLF 到期、地方债需要集中发行，对于流动性有较大挤出压力，如果后续央行确实降准，也需要持续观察其公开市场操作是否会有流动性净回笼；第三，随着美国货币政策逐步回归常态，央行提前释放一些流动性可能存在为后续货币政策腾挪空间的考虑；最后，下半年随着资管新规到期执行、各地方融资平台债务处理、一些之前长期占用大量资金的公司风险事项暴露，届时无论流动性还是经济基本面都可能产生比较大的动荡，考虑 2020 年永煤事件爆发后给资本市场带来巨大负面冲击，此次管理层可能吸取了去年的教训，提前动用政策工具避免“拆弹”过程中发生不可控的负外部性。

经济基本面方面，较一季报中的判断变化不大，整体而言我们认为目前仍在在实体投资扩张周期中，由于基数效应，我国经济增速高点大概率已于 Q2 出现，Q3-Q4 增速预期逐季向下，随着海外复工，替代逻辑产业链预期承压、资本品和中间品预期复苏。中观层面上，碳中和政策导致的供给侧过度收缩有所纠偏、海外矿产产能预期逐步恢复、美联储货币政策和美国财政补贴政策转向等因素共同减缓了大宗商品价格的上涨趋势，中游制造业压力有所缓解。

政策环境方面，近期海外政治环境平稳为主，由于美债、美国国内通胀（主要关系人民币汇率）等方面需要较多的中美合作，下半年预计外部政治环境压力有所缓解，甚至可能阶段性产生中美关系修复的感觉，大概率不构成投资决策的主要影响因素。国内政策环境方面，主要警惕资管新规和地方债务化解带来的阶段性冲击。

此外，我们已注意到近期出现了美债收益率持续走低、美元持续走强的组合，代表全球资产配置角度的避险情绪正在升温，需要密切观察是否有标志性事件带来阶段性的强冲击。

行业配置方面，在遵循基金合同规定的基础上，我们认为下半年景气度仍然较高、值得配置的方向包括：新能源车、半导体、光伏、军工和国产品牌化高端化的消费品等，但客观的说，这些资产的即期估值已经在比较高的水平，下半年要更警惕外部冲击或产业链的变化导致业绩低于预期等因素导致的调整，在配置上，我们一方面把资金收缩到景气度更确定的环节和龙头公司，另一方面在行业配置上会进行适度的分散和轮动。具体来说：

新能源车产业链中我们相对更看好上游资源环节，尤其是有矿产储备的上市公司应对今年的原材料紧缺会更加游刃有余，锂辉石资源仍然是最优质的矿产资源，从后续的盐湖扩产规划和新车型结构来看，供需两方面共同决定了下半年锂辉石资源和氢氧化锂冶炼的基本面相对更加强劲，盐湖提锂的优先级相对靠后；中游环节我们近期观察到了大量新进入者已经或计划加入到竞争中去，在行业股价整体高位的背景下对于投资者信心会有比较显著的负面影响，整体而言我们对中游整体持谨慎态度；而中游的大规模扩产解决了之前产业链的产能瓶颈问题，并且新进入者的竞争性备货会进一步拉动上游需求，下半年我们认为上游资源环节的配置价值显著优于中游加工制造环节。

半导体产业链我们认为同样需要向上游寻找标的，目前来看设计环节的景气度可能会在 Q3-Q4 面临调整，但设备自身的周期滞后于芯片需求 2-4 个季度、景气度预计可以持续到 2022 年下半年，另外从国产替代率和市占率来看，半导体设备环节的发展进程滞后于设计环节，后续份额提升逻辑相对更强，随着一些国产设备在晶元厂的主流产线得以使用，设备和材料的成长属性与周期上行共振将愈发清晰，而估值水平来看，一些设备和材料厂商仍然在比较低的位置，相比一些设计公司来说也更有优势。

光伏方面，Q2 市场预期硅料价格可能松动，市场的预期其实抢跑了基本面，但从 Q3 开始我们已经确实的观察到了硅料硅片等环节的利润收缩、进而推动整个产业更健康的发展，另外国家在储能、BIPV、分布式光伏等方面近期也推出了较多政策，对于非硅辅材和储能系统等环节我们会持续关注和适当配置。

军工和消费品牌化同样是基本面长期看好的两个方向，经过之前的调整后，一些公司估值已

经回落至理想区间，这两个方向我们会更多的通过前瞻研究结合行业中观景气度观察的方法去配置一些比较新的细分行业和投资标的。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了估值委员会,定期评价现行估值政策和程序,在发生了影响估值政策和程序有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。估值委员会由总经理、基金运营部负责人、合规稽核部负责人、权益投资部负责人、固定收益部负责人等组成。估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关从业资格,精通各自领域的理论知识,熟悉政策法规,并具有丰富的实践经验。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不介入基金日常估值业务。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中债金融估值中心有限公司签署了《中债信息产品服务协议》，本基金管理人与中证指数有限公司签署了《中证债券估值数据服务协议》、《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未发生连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或基金资产净值低于 5000 万的情况。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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。

§ 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：万家人工智能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	18,338,720.61	8,853,370.64
结算备付金		1,236,121.71	306,082.12
存出保证金		117,792.55	66,628.59
交易性金融资产	6.4.7.2	188,910,641.81	119,970,609.50
其中：股票投资		188,910,641.81	119,970,609.50
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		12,655,607.09	-
应收利息	6.4.7.5	2,275.17	1,173.01
应收股利		-	-
应收申购款		1,044,738.91	848,266.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		222,305,897.85	130,046,130.20
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		-	-
应付赎回款		21,951,093.99	967,723.79
应付管理人报酬		246,313.68	142,374.20
应付托管费		41,052.29	44,090.64
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	464,663.01	537,871.93
应交税费		6.21	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	238,147.52	161,030.19
负债合计		22,941,276.70	1,853,090.75
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	72,314,124.55	57,016,140.22
未分配利润	6.4.7.10	127,050,496.60	71,176,899.23
所有者权益合计		199,364,621.15	128,193,039.45
负债和所有者权益总计		222,305,897.85	130,046,130.20

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.7569 元，基金份额总额 72,314,124.55 份。

本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。。

6.2 利润表

会计主体：万家人工智能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		38,296,078.37	10,923,564.33
1.利息收入		37,354.87	13,833.02
其中：存款利息收入	6.4.7.11	36,836.24	13,833.02
债券利息收入		518.63	-
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）		31,953,397.47	6,636,886.81
其中：股票投资收益	6.4.7.12	30,015,703.52	6,416,223.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,111,752.47	-
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	825,941.48	220,663.53
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	5,478,933.77	4,078,254.16
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	826,392.26	194,590.34
减：二、费用		3,072,030.72	572,189.97

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,337,202.03	278,452.53
2. 托管费	6.4.10.2.2	222,867.00	46,408.74
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,438,598.43	196,013.75
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1.34	-
7. 其他费用	6.4.7.20	73,361.92	51,314.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		35,224,047.65	10,351,374.36
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		35,224,047.65	10,351,374.36

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家人工智能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）	57,016,140.22	71,176,899.23	128,193,039.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	35,224,047.65	35,224,047.65
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）	15,297,984.33	20,649,549.72	35,947,534.05
其中：1.基金申购款	94,887,396.35	133,633,283.73	228,520,680.08
2.基金赎回款	-79,589,412.02	-112,983,734.01	-192,573,146.03
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）	72,314,124.55	127,050,496.60	199,364,621.15

基金份额。本基金的基金管理人为万家基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金主要投资具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（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）、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）。本基金可参与融资业务。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。基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的 50%-95%，其中，投资于人工智能主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；权证投资占基金资产净值的 0-3%；每个交易日日终在扣除股票期权、股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金以后，本基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×65% + 上证国债指数收益率×35%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法（2020 年修订）》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本中期报告所采用的会计政策、会计估计与上年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

(一) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

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

(二) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规

定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

(三) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(四) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	18,338,720.61
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：	18,338,720.61

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	154,323,481.00	188,910,641.81	34,587,160.81
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	154,323,481.00	188,910,641.81	34,587,160.81

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	1,664.57
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	556.20
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	1.40
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	53.00
合计	2,275.17

6.4.7.6 其他资产

本报告期期末本基金未持有其他资产。

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	464,663.01
银行间市场应付交易费用	-
合计	464,663.01

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	53,599.55
应付证券出借违约金	-
预提费用	184,547.97
合计	238,147.52

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	57,016,140.22	57,016,140.22
本期申购	94,887,396.35	94,887,396.35
本期赎回(以“-”号填列)	-79,589,412.02	-79,589,412.02
- 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	72,314,124.55	72,314,124.55

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	35,078,510.51	36,098,388.72	71,176,899.23
本期利润	29,745,113.88	5,478,933.77	35,224,047.65
本期基金份额交易产生的变动数	8,689,388.15	11,960,161.57	20,649,549.72
其中：基金申购款	77,278,649.02	56,354,634.71	133,633,283.73
基金赎回款	-68,589,260.87	-44,394,473.14	-112,983,734.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	73,513,012.54	53,537,484.06	127,050,496.60

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	30,046.68
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	5,874.03
其他	915.53
合计	36,836.24

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	461,278,491.08
减：卖出股票成本总额	431,262,787.56
买卖股票差价收入	30,015,703.52

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	1,111,752.47
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	1,111,752.47

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	7,163,832.04

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	6,040,482.15
减：应收利息总额	11,597.42
买卖债券差价收入	1,111,752.47

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	825,941.48
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	825,941.48

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	5,478,933.77
——股票投资	5,478,933.77
——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	5,478,933.77
----	--------------

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	815,600.79
转换费	10,791.47
合计	826,392.26

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	1,438,598.43
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	1,438,598.43

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	14,876.39
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
其他	360.00
银行汇划费用	9,453.95
债券帐户维护费	9,000.00
合计	73,361.92

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 (“万家基金”)	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司 (“建设银行”)	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1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
中泰证券	815, 745, 878. 78	85. 67%	129, 512, 563. 80	100. 00%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
中泰证券	9, 942, 308. 90	83. 55%	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

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回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间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
中泰证券股份有限公司	759,705.06	85.67%	337,590.82	72.65%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中泰证券股份有限公司	120,615.43	100.00%	85,919.11	100.00%

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,337,202.03	278,452.53
其中：支付销售机构的客户维护费	463,727.51	115,458.56

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：

$$H = E \times 1.50\% \text{ 年管理费率} \div \text{当年天数}$$

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，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。

若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	222,867.00	46,408.74

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：

$$H = E \times 0.25\% \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。

若遇法定节假日、休息日等，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

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

基金合同生效日（2019 年 1 月 25 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	11,016,976.47	-
报告期间申购/买入总份额		-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	11,016,976.47	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	15.2349%	-

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
上海万家朴智投资管理有限公司	110,257.77	0.1525%	-	-

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	18,338,720.61	30,046.68	4,832,166.22	13,069.73

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

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
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	新股未流通	38.85	38.85	1,224	47,552.40	47,552.40	-
688367	工大高科	2021年6月21日	2021年12月28日	科创板股票流通受限	11.53	17.94	1,717	19,797.01	30,802.98	-
688269	凯立新材	2021年6月1日	2021年12月9日	科创板股票流通受限	18.94	100.92	1,698	32,160.12	171,362.16	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未流通	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688131	皓元医药	2021年6月1日	2021年12月8日	科创板股票流通受限	64.99	247.10	782	50,822.18	193,232.20	-
688097	博众精工	2021年4月29日	2021年11月12日	科创板股票流通受限	11.27	28.01	3,236	36,469.72	90,640.36	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股未流通	21.96	21.96	1,703	37,397.88	37,397.88	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未流通	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
605162	新中	2021年	2021	新股未	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-

	港	6月29日	年7月7日	流通						
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未流通	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
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	2021年7月6日	新股未流通	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
301004	嘉益	2021年	2021	创业板	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-

	股份	6月18日	年12月27日	股票流通受限							
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	-	
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	-	
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	769	3,798.86	10,035.45	-	
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	-	
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	-	
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	-	
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	-	
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	185	2,736.15	5,655.45	-	
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	183	4,556.70	4,540.23	-	
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	-	
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	86	4,178.74	7,773.54	-	

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	208	6,909.76	18,200.00	-
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	-
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	-
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	120	3,393.60	13,885.20	-
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	-
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	-
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	721	4,953.27	8,702.47	-
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	-
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	-
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	-
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	-

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	-
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	-
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	-
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	117	5,537.61	29,479.32	-
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	-
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	175	5,034.75	17,473.75	-
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	312	3,656.64	8,448.96	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	196	4,176.76	9,788.24	-
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	270	3,445.20	11,712.60	-
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	-
300933	中辰	2021年	2021	创业板	3.37	10.44	918	3,093.66	9,583.92	-

	股份	1月15日	年7月22日	股票流通受限						
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	217	5,357.73	6,881.07	-
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	-
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	234	3,067.74	5,728.32	-
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	-
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	-
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	242	2,603.92	5,372.40	-
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	-

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

本基金期末无银行间市场正回购余额,因此无银行间正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金期末无交易所市场正回购余额,因此无交易所正回购交易中作为抵押的债券。

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 2019 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。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金期末持有的流通受限证券外，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、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	18,338,720.61	-	-	-	-	-	18,338,720.61
结算备付金	1,236,121.71	-	-	-	-	-	1,236,121.71
存出保证金	117,792.55	-	-	-	-	-	117,792.55
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-188,910,641.81	188,910,641.81

应收证券清算款	-	-	-	-	-	12,655,607.09	12,655,607.09
应收利息	-	-	-	-	-	2,275.17	2,275.17
应收申购款	850.00	-	-	-	-	1,043,888.91	1,044,738.91
资产总计	19,693,484.87	-	-	-	-	-202,612,412.98	222,305,897.85
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	21,951,093.99	21,951,093.99
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	246,313.68	246,313.68
应付托管费	-	-	-	-	-	41,052.29	41,052.29
应付交易费用	-	-	-	-	-	464,663.01	464,663.01
应交税费	-	-	-	-	-	6.21	6.21
其他负债	-	-	-	-	-	238,147.52	238,147.52
负债总计	-	-	-	-	-	22,941,276.70	22,941,276.70
利率敏感度缺口	19,693,484.87	-	-	-	-	-179,671,136.28	199,364,621.15
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	8,853,370.64	-	-	-	-	-	8,853,370.64
结算备付金	306,082.12	-	-	-	-	-	306,082.12
存出保证金	66,628.59	-	-	-	-	-	66,628.59
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-119,970,609.50	119,970,609.50
应收利息	-	-	-	-	-	1,173.01	1,173.01
应收申购款	-	-	-	-	-	848,266.34	848,266.34
资产总计	9,226,081.35	-	-	-	-	-120,820,048.85	130,046,130.20
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	967,723.79	967,723.79
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	142,374.20	142,374.20
应付托管费	-	-	-	-	-	44,090.64	44,090.64
应付交易费用	-	-	-	-	-	537,871.93	537,871.93
其他负债	-	-	-	-	-	161,030.19	161,030.19
负债总计	-	-	-	-	-	1,853,090.75	1,853,090.75
利率敏感度缺口	9,226,081.35	-	-	-	-	-118,966,958.10	128,193,039.45

注：该表统计了本基金资产和负债的利率风险敞口。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、结算备付金及存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价,因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券,所面临的最大的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	188,910,641.81	94.76	119,970,609.50	93.59
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	188,910,641.81	94.76	119,970,609.50	93.59

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 若股票基准指数发生变动而其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位:人民币元)	
		本期末 (2021年6月30日)	上年度末 (2020年12月31日)
	1. 股票基准指数下降 100 个基点	-2,050,361.30	-1,527,758.56
2. 股票基准指数上升 100 个基点	2,050,361.30	1,527,758.56	

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	188,910,641.81	84.98
	其中：股票	188,910,641.81	84.98
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	19,574,842.32	8.81
8	其他各项资产	13,820,413.72	6.22
9	合计	222,305,897.85	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	11,290.28	0.01
B	采矿业	-	-
C	制造业	140,801,806.46	70.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.01
E	建筑业	25,371.37	0.01
F	批发和零售业	279,580.90	0.14
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	39,653,913.32	19.89
J	金融业	34,721.10	0.02
K	房地产业	5,780.94	0.00
L	租赁和商务服务业	49,470.30	0.02
M	科学研究和技术服务业	8,000,132.50	4.01
N	水利、环境和公共设施管理业	35,554.25	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	188,910,641.81	94.76

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	603613	国联股份	178,805	17,875,135.85	8.97
2	002709	天赐材料	150,110	15,998,723.80	8.02
3	002460	赣锋锂业	104,800	12,690,232.00	6.37
4	603799	华友钴业	101,100	11,545,620.00	5.79
5	300568	星源材质	270,634	11,196,128.58	5.62
6	000733	振华科技	161,700	9,875,019.00	4.95
7	300750	宁德时代	18,100	9,679,880.00	4.86
8	603893	瑞芯微	67,867	9,464,731.82	4.75
9	688005	容百科技	74,788	9,064,305.60	4.55
10	002371	北方华创	32,200	8,931,636.00	4.48
11	300454	深信服	34,400	8,926,112.00	4.48
12	300193	佳士科技	550,139	8,758,212.88	4.39
13	600577	精达股份	1,372,600	8,757,188.00	4.39
14	688099	晶晨股份	77,411	8,685,514.20	4.36
15	300073	当升科技	149,100	8,377,929.00	4.20
16	688131	皓元医药	22,952	7,868,264.50	3.95
17	688012	中微公司	29,869	4,955,864.48	2.49
18	600110	诺德股份	372,900	4,541,922.00	2.28
19	688023	安恒信息	16,390	4,130,280.00	2.07
20	300642	透景生命	40,300	3,458,143.00	1.73
21	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.20
22	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.13
23	688601	力芯微	1,009	185,756.90	0.09
24	688269	凯立新材	1,698	171,362.16	0.09
25	301013	利和兴	4,704	168,966.51	0.08

26	688700	东威科技	3,049	162,755.62	0.08
27	301002	崧盛股份	2,001	159,001.62	0.08
28	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.08
29	300896	爱美客	180	141,998.40	0.07
30	688216	气派科技	2,000	133,400.00	0.07
31	688621	阳光诺和	1,485	131,868.00	0.07
32	688425	铁建重工	20,872	127,736.64	0.06
33	688345	博力威	1,732	127,388.60	0.06
34	688161	威高骨科	1,180	125,139.00	0.06
35	688276	百克生物	1,179	123,299.82	0.06
36	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.06
37	301004	嘉益股份	3,115	90,654.98	0.05
38	688097	博众精工	3,236	90,640.36	0.05
39	301011	华立科技	1,750	79,474.50	0.04
40	301007	德迈仕	3,022	60,305.15	0.03
41	301012	扬电科技	1,691	56,994.16	0.03
42	301010	晶雪节能	2,172	50,480.96	0.03
43	601156	东航物流	2,090	49,470.30	0.02
44	688597	煜邦电力	3,907	49,306.34	0.02
45	688499	利元亨	1,224	47,552.40	0.02
46	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
47	603529	爱玛科技	725	42,137.00	0.02
48	688517	金冠电气	2,892	41,095.32	0.02
49	688067	爱威科技	1,259	39,520.01	0.02
50	688087	英科再生	1,703	37,397.88	0.02
51	688681	科汇股份	1,899	34,903.62	0.02
52	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.02
53	688367	工大高科	1,717	30,802.98	0.02
54	300957	贝泰妮	117	29,479.32	0.01
55	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
56	300979	华利集团	208	18,200.00	0.01
57	300953	震裕科技	175	17,473.75	0.01
58	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
59	300919	中伟股份	95	15,485.00	0.01
60	300894	火星人	226	15,368.00	0.01
61	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
62	300973	立高食品	120	13,885.20	0.01
63	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.01
64	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01

65	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.01
66	300937	药易购	244	13,105.24	0.01
67	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.01
68	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
69	300940	南极光	270	11,712.60	0.01
70	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
71	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.01
72	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.01
73	300997	欢乐家	769	10,035.45	0.01
74	300941	创识科技	196	9,788.24	0.00
75	300933	中辰股份	918	9,583.92	0.00
76	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
77	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
78	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
79	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
80	300968	格林精密	721	8,702.47	0.00
81	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
82	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
83	300952	恒辉安防	312	8,448.96	0.00
84	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
85	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
86	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
87	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
88	300981	中红医疗	86	7,773.54	0.00
89	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
90	300932	三友联众	217	6,881.07	0.00
91	300925	法本信息	258	6,782.82	0.00
92	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
93	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
94	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
95	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
96	300918	南山智尚	574	5,975.34	0.00
97	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
98	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
99	300917	特发服务	209	5,780.94	0.00
100	300930	屹通新材	234	5,728.32	0.00
101	300986	志特新材	185	5,655.45	0.00
102	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
103	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00

104	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
105	300926	博俊科技	242	5,372.40	0.00
106	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
107	300985	致远新能	183	4,540.23	0.00
108	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
109	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
110	300992	泰福泵业	200	4,064.00	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	603893	瑞芯微	16,421,734.09	12.81
2	002714	牧原股份	15,330,635.53	11.96
3	300750	宁德时代	14,619,205.00	11.40
4	002371	北方华创	13,890,304.00	10.84
5	002460	赣锋锂业	13,739,551.74	10.72
6	300193	佳士科技	13,105,578.38	10.22
7	603613	国联股份	12,926,039.45	10.08
8	688005	容百科技	8,762,468.15	6.84
9	002240	盛新锂能	8,645,584.00	6.74
10	688099	晶晨股份	8,605,929.00	6.71
11	300073	当升科技	8,025,341.00	6.26
12	000001	平安银行	8,015,630.00	6.25
13	601166	兴业银行	7,877,621.00	6.15
14	000858	五粮液	7,834,267.00	6.11
15	603501	韦尔股份	7,801,979.00	6.09
16	002304	洋河股份	7,759,323.00	6.05
17	600519	贵州茅台	7,735,247.78	6.03
18	600926	杭州银行	7,694,747.82	6.00
19	688608	恒玄科技	7,694,339.44	6.00
20	600036	招商银行	7,628,856.00	5.95
21	002142	宁波银行	7,626,892.54	5.95
22	688131	皓元医药	7,601,205.13	5.93
23	603477	巨星农牧	7,509,894.13	5.86

24	000155	川能动力	7,504,076.00	5.85
25	603363	傲农生物	7,497,389.00	5.85
26	002340	格林美	7,458,575.00	5.82
27	300568	星源材质	7,432,665.60	5.80
28	000519	中兵红箭	7,425,181.00	5.79
29	002034	旺能环境	7,389,588.00	5.76
30	600577	精达股份	7,344,444.00	5.73
31	688550	瑞联新材	7,305,546.17	5.70
32	601127	小康股份	7,297,624.00	5.69
33	601155	新城控股	7,268,380.18	5.67
34	600499	科达制造	7,222,294.00	5.63
35	002028	思源电气	7,207,818.00	5.62
36	000656	金科股份	7,189,029.00	5.61
37	600753	东方银星	7,172,935.00	5.60
38	000002	万科A	7,021,743.00	5.48
39	300601	康泰生物	7,015,261.08	5.47
40	688696	极米科技	6,758,553.39	5.27
41	600399	抚顺特钢	6,737,063.00	5.26
42	002128	露天煤业	6,405,761.00	5.00
43	002185	华天科技	6,046,586.00	4.72
44	603005	晶方科技	6,027,078.20	4.70
45	300059	东方财富	5,804,210.60	4.53
46	603799	华友钴业	5,484,737.95	4.28
47	688012	中微公司	4,828,079.33	3.77
48	002192	融捷股份	4,794,771.40	3.74
49	300233	金城医药	4,575,780.50	3.57
50	688023	安恒信息	4,566,169.81	3.56
51	000938	紫光股份	4,355,219.25	3.40
52	600110	诺德股份	4,287,508.43	3.34
53	000650	仁和药业	3,840,540.00	3.00
54	688277	天智航	3,753,823.69	2.93
55	300809	华辰装备	3,622,112.00	2.83
56	601238	广汽集团	3,597,879.44	2.81
57	002046	国机精工	3,507,787.00	2.74
58	000301	东方盛虹	3,492,380.00	2.72
59	605016	百龙创园	3,490,291.53	2.72

60	603986	兆易创新	3,485,750.00	2.72
61	300223	北京君正	3,476,800.02	2.71
62	002353	杰瑞股份	3,463,156.00	2.70
63	601808	中海油服	3,462,562.00	2.70
64	300271	华宇软件	3,390,004.00	2.64
65	000875	吉电股份	3,353,983.00	2.62
66	300887	谱尼测试	3,146,887.00	2.45
67	300642	透景生命	3,046,422.00	2.38
68	000596	古井贡酒	2,693,322.00	2.10

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	300896	爱美客	16,217,160.00	12.65
2	002240	盛新锂能	15,434,473.00	12.04
3	002714	牧原股份	13,464,286.32	10.50
4	600753	东方银星	11,262,482.40	8.79
5	002594	比亚迪	10,044,805.00	7.84
6	688696	极米科技	9,500,422.16	7.41
7	300193	佳士科技	8,878,325.00	6.93
8	002142	宁波银行	8,475,645.12	6.61
9	601127	小康股份	8,363,950.00	6.52
10	688608	恒玄科技	8,242,773.67	6.43
11	600926	杭州银行	8,218,249.00	6.41
12	000155	川能动力	7,966,759.00	6.21
13	002028	思源电气	7,835,745.68	6.11
14	600036	招商银行	7,796,767.00	6.08
15	000333	美的集团	7,778,503.00	6.07
16	600690	海尔智家	7,539,885.00	5.88
17	603267	鸿远电子	7,537,845.46	5.88
18	000519	中兵红箭	7,532,910.00	5.88
19	603477	巨星农牧	7,328,206.00	5.72
20	603501	韦尔股份	7,323,415.00	5.71
21	002304	洋河股份	7,310,800.00	5.70
22	688550	瑞联新材	7,244,416.65	5.65
23	603613	国联股份	7,217,230.00	5.63

24	601155	新城控股	7,127,783.00	5.56
25	002034	旺能环境	7,039,797.65	5.49
26	603893	瑞芯微	6,958,636.00	5.43
27	600499	科达制造	6,864,532.13	5.35
28	600399	抚顺特钢	6,852,842.00	5.35
29	601166	兴业银行	6,811,199.00	5.31
30	000001	平安银行	6,799,939.96	5.30
31	002759	天际股份	6,607,563.55	5.15
32	600519	贵州茅台	6,511,370.00	5.08
33	000002	万科A	6,502,700.00	5.07
34	688122	西部超导	6,389,552.64	4.98
35	000656	金科股份	6,360,395.00	4.96
36	603363	傲农生物	6,306,390.66	4.92
37	002340	格林美	6,296,333.94	4.91
38	300750	宁德时代	6,212,403.00	4.85
39	002128	露天煤业	5,905,998.00	4.61
40	300059	东方财富	5,782,902.40	4.51
41	000858	五粮液	5,660,081.00	4.42
42	300601	康泰生物	5,547,552.00	4.33
43	002185	华天科技	5,299,075.00	4.13
44	002371	北方华创	5,205,533.00	4.06
45	603005	晶方科技	4,824,132.00	3.76
46	002756	永兴材料	4,659,335.60	3.63
47	002475	立讯精密	4,645,931.00	3.62
48	300233	金城医药	4,635,610.82	3.62
49	002508	老板电器	4,502,852.01	3.51
50	002192	融捷股份	4,443,251.50	3.47
51	000938	紫光股份	4,360,341.00	3.40
52	000651	格力电器	4,039,951.00	3.15
53	688388	嘉元科技	3,906,881.51	3.05
54	002046	国机精工	3,871,411.00	3.02
55	000301	东方盛虹	3,710,007.00	2.89
56	688277	天智航	3,592,406.33	2.80
57	002353	杰瑞股份	3,539,212.00	2.76
58	601808	中海油服	3,487,931.00	2.72
59	000875	吉电股份	3,448,678.00	2.69
60	601238	广汽集团	3,424,378.00	2.67
61	300223	北京君正	3,403,840.00	2.66

62	603986	兆易创新	3,326,198.00	2.59
63	605016	百龙创园	3,325,956.31	2.59
64	000650	仁和药业	3,300,960.00	2.57
65	300809	华辰装备	3,283,471.00	2.56
66	300887	谱尼测试	3,203,280.68	2.50
67	300271	华宇软件	3,178,217.00	2.48
68	000596	古井贡酒	2,695,337.00	2.10

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	494,723,886.10
卖出股票收入（成交）总额	461,278,491.08

注：本项买入金额均按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用

本项卖出金额均按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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	117,792.55
2	应收证券清算款	12,655,607.09
3	应收股利	-
4	应收利息	2,275.17
5	应收申购款	1,044,738.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,820,413.72

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
41,033	1,762.34	17,086,752.39	23.63%	55,227,372.16	76.37%

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	298,296.92	0.4125%

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2019 年 1 月 25 日 ）基金份额总额	220,455,070.79
本报告期期初基金份额总额	57,016,140.22
本报告期基金总申购份额	94,887,396.35
减：本报告期基金总赎回份额	79,589,412.02
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	72,314,124.55

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

2021 年 3 月 16 日，公司聘任陈广益先生担任公司总经理。

基金托管人：

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期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

本报告期内管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或者处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	2	815,745,878.78	85.67%	759,705.06	85.67%	-
中信证券	4	72,898,940.64	7.66%	67,890.99	7.66%	-
天风证券	2	63,546,879.26	6.67%	59,181.20	6.67%	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-

浙商证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	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
中泰证券	9,942,308.90	83.55%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	1,957,073.04	16.45%	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-

广州证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

§ 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、中国证监会批准万家人工智能混合型证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《万家人工智能混合型证券投资基金基金合同》
- 3、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程
- 4、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金净值、季度报告、更新招募说明书及其他临时公告
- 5、万家人工智能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、《万家人工智能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住所，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