

万家创业板 2 年定期开放混合型证券投资
基金
2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 26 日

§ 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务数据未经审计。

本报告期自 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	万家创业板 2 年定期开放混合
场内简称	创业板 2 年定开
基金主代码	161914
交易代码	161914
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 8 月 14 日
报告期末基金份额总额	1,793,422,962.04 份
投资目标	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，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略包括封闭期投资策略和开放期投资策略。 封闭期投资策略包括：1、大类资产配置策略；2、股票投资策略；3、战略配售投资策略；4、债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、可转换债券投资策略；7、衍生产品投资策略；8、信用衍生品投资策略；9、融资及转融通证券出借业务投资策略；10、其他 开放期投资策略：开放期内，本基金将主要投资于高流动性的投资品种。
业绩比较基准	创业板综合指数收益率*80%+中债综合指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	万家基金管理有限公司

基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	万家创业板 2 年定期开放混合 A	万家创业板 2 年定期开放混合 C
下属分级基金的交易代码	161914	161915
报告期末下属分级基金的份额总额	1, 523, 044, 212. 29 份	270, 378, 749. 75 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021 年 7 月 1 日 — 2021 年 9 月 30 日）	
	万家创业板 2 年定期开放混合 A	万家创业板 2 年定期开放混合 C
1. 本期已实现收益	75, 786, 797. 51	12, 986, 695. 70
2. 本期利润	-182, 614, 897. 60	-32, 654, 254. 72
3. 加权平均基金份额本期利润	-0. 1199	-0. 1208
4. 期末基金资产净值	1, 691, 718, 477. 55	298, 634, 315. 00
5. 期末基金份额净值	1. 1107	1. 1045

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家创业板 2 年定期开放混合 A

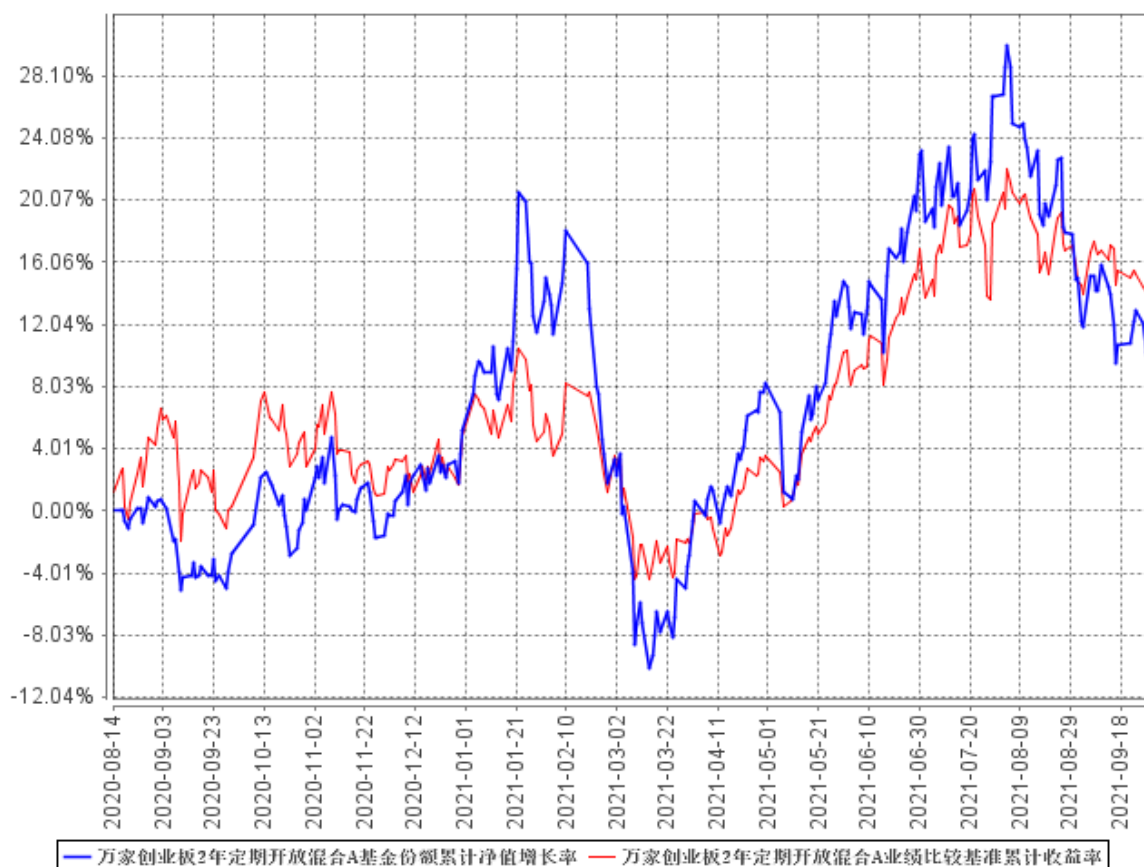
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-9. 74%	1. 67%	-2. 07%	1. 31%	-7. 67%	0. 36%
过去六个月	14. 32%	1. 64%	16. 88%	1. 17%	-2. 56%	0. 47%
过去一年	14. 27%	1. 67%	14. 16%	1. 23%	0. 11%	0. 44%
自基金合同生效起至今	11. 07%	1. 59%	14. 47%	1. 27%	-3. 40%	0. 32%

万家创业板 2 年定期开放混合 C

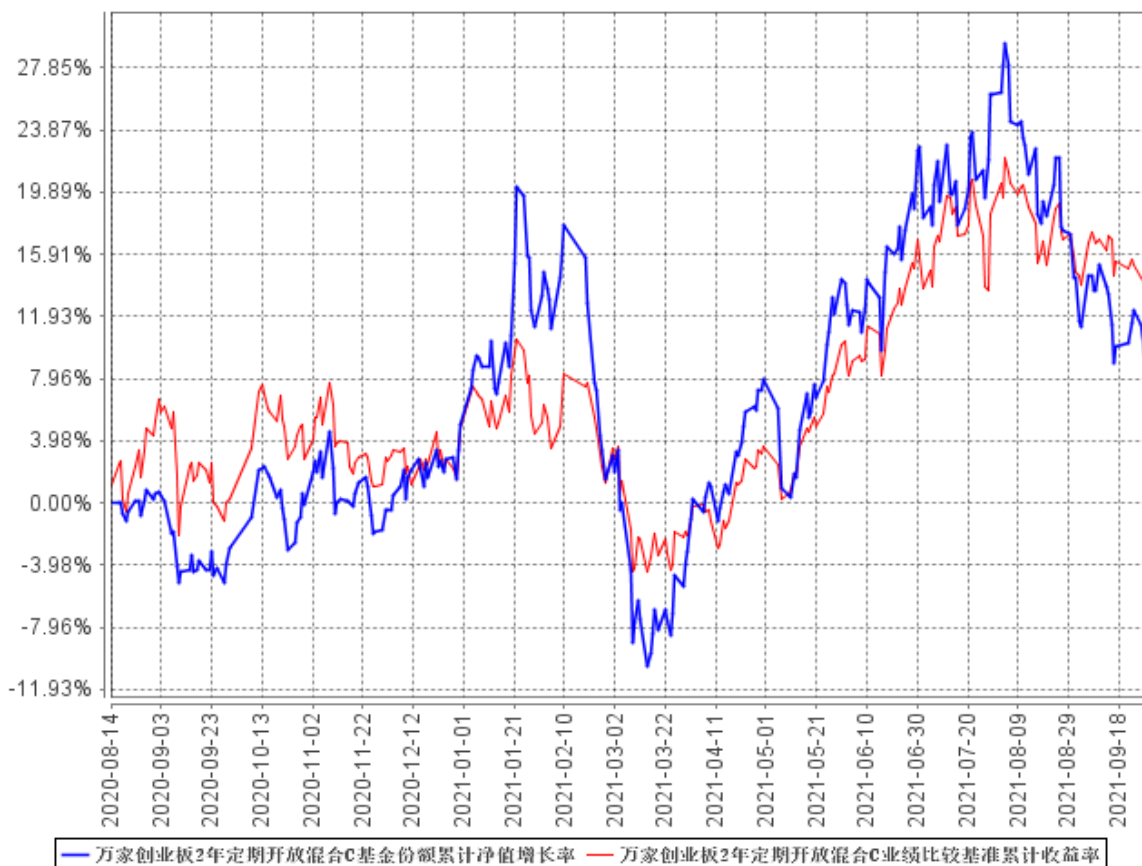
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-9.86%	1.67%	-2.07%	1.31%	-7.79%	0.36%
过去六个月	14.03%	1.64%	16.88%	1.17%	-2.85%	0.47%
过去一年	13.70%	1.67%	14.16%	1.23%	-0.46%	0.44%
自基金合同生效起至今	10.45%	1.59%	14.47%	1.27%	-4.02%	0.32%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

万家创业板2年定期开放混合A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



万家创业板2年定期开放混合C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于2020年8月14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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄兴亮	万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）、万家经济新动能混合型证券投资基金	2020年8月14日	-	13.5年	清华大学计算机系博士。2007年8月至2011年5月在交银施罗德基金管理有限公司担任研究员。2011年6月至2018年10月在光大保德信基金管理有限公司先后担任投资部研究员、基金经理。2018年11月加入万家基金管理有限公司，

	金、万家自主创新混合型证券投资基金、万家科技创新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、万家全球成长一年持有期混合型证券投资基金 (QDII) 的基金经理			2019 年 2 月起担任投资研究部基金经理。
--	--	--	--	-------------------------

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《基金合同》、《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律、法规和监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金持有人谋取最大利益,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理办法》和《异常交易监控及报告管理办法》等规章制度,涵盖了研究、授权、投资决策和交易执行等投资管理活动的各个环节,确保公平对待不同投资组合,防范导致不公平交易以及利益输送的异常交易发生。

公司制订了明确的投资授权制度,并建立了统一的投资管理平台,确保不同投资组合获得公平的投资决策机会。实行集中交易制度,对于交易所公开竞价交易,执行交易系统中的公平交易程序;

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内无下列情况:所有投资组合参与的交易所公开竞价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%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度市场结构分化明显:消费、医药等稳健增长类板块有所调整,新能源、周期等板块表现出色,大金融等低估值板块表现平稳。

本基金主要减持了医疗器械和医药研发行业,增持了广告传媒和软件行业的部分个股。截至季度末,基金持仓主要均为创业板公司。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家创业板 2 年定期开放混合 A 基金份额净值为 1.1107 元,本报告期基金份额净值增长率为-9.74%;截至本报告期末万家创业板 2 年定期开放混合 C 基金份额净值为 1.1045 元,本报告期基金份额净值增长率为-9.86%;同期业绩比较基准收益率为-2.07%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,982,576,221.31	99.39

	其中：股票	1,982,576,221.31	99.39
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	11,828,344.97	0.59
8	其他资产	257,122.55	0.01
9	合计	1,994,661,688.83	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	18,116.82	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	964,203,366.22	48.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	20,183.39	0.00
F	批发和零售业	69,676.78	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	3,345.12	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	408,446,967.36	20.52
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	112,399,876.36	5.65
M	科学研究和技术服务业	497,367,122.86	24.99
N	水利、环境和公共设施管理业	38,613.78	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	8,952.62	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,982,576,221.31	99.61

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末本基金未持有港股通股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300661	圣邦股份	546,646	181,885,523.58	9.14
2	300887	谱尼测试	2,666,629	170,184,262.78	8.55
3	300012	华测检测	6,666,633	168,999,146.55	8.49
4	300454	深信服	716,614	168,117,644.40	8.45
5	300676	华大基因	1,799,904	157,509,599.04	7.91
6	300124	汇川技术	2,499,940	157,496,220.00	7.91
7	300604	长川科技	2,999,990	143,279,522.40	7.20
8	300685	艾德生物	1,499,931	120,294,466.20	6.04
9	300058	蓝色光标	19,999,978	112,399,876.36	5.65
10	300285	国瓷材料	2,666,666	109,733,305.90	5.51

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌的股票。

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金可基于谨慎原则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。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	189,508.80
2	应收证券清算款	38,905.48
3	应收股利	-
4	应收利息	4,889.57
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	23,818.70
8	其他	-
9	合计	257,122.55

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家创业板 2 年定期开放混合 A	万家创业板 2 年定期开放混合 C
报告期期初基金份额总额	1,523,044,212.29	270,378,749.75
报告期期间基金总申购份额	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	1,523,044,212.29	270,378,749.75

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申赎及买卖本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 9 备查文件目录

9.1 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、《万家创业板 2 年定期开放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、更新招募说明书及其他临时公告。
- 5、万家创业板 2 年定期开放混合型证券投资基金 2021 年第三季度报告原文。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。
- 7、《万家创业板 2 年定期开放混合型证券投资基金托管协议》。

9.2 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。

9.3 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 10 月 26 日