

万家行业优选混合型证券投资基金(LOF) 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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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。

本报告中财务资料未经审计。

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	万家优选
场内简称	万家行业优选 LOF
基金主代码	161903
交易代码	161903
基金运作方式	契约型上市开放式基金 (LOF)
基金合同生效日	2005 年 7 月 15 日
报告期末基金份额总额	6,958,524,622.03 份
投资目标	本基金主要投资景气行业或预期景气度向好的行业股票，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。
投资策略	本基金采取优选行业和精选个股相结合的主动投资管理方式，并适度动态配置大类资产。具体包括：1、资产配置策略：（1）宏观经济因素分析、（2）国家经济政策分析；2、行业配置策略：（1）以投资时钟为核心进行行业选择、（2）行业配置权重的确定；3、个股投资策略：（1）个股行业属性界定、（2）行业优势企业选择、（3）个股的估值分析、（4）新股申购策略、（5）存托凭证投资策略；4、债券投资策略：（1）利率预期策略、（2）属类配置策略、（3）债券品种选择策略、（4）套利策略、（5）资产支持证券投资策略、（6）可转债投资策略；5、权证投资策略；6、其他衍生工具的投资策略。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数收益率+20%×上证国债指数收益率

风险收益特征	本基金是混合型基金，风险低于股票型基金，高于货币市场基金、债券型基金，属于中等风险、中等预期收益的证券投资基金。
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§ 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）
1. 本期已实现收益	713,462,608.14
2. 本期利润	-818,625,533.61
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1121
4. 期末基金资产净值	14,241,205,967.98
5. 期末基金份额净值	2.0466

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

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	-5.72%	1.98%	-5.17%	0.96%	-0.55%	1.02%
过去六个月	16.77%	1.81%	-2.33%	0.88%	19.10%	0.93%
过去一年	24.08%	1.78%	5.88%	0.97%	18.20%	0.81%
过去三年	260.22%	1.80%	36.91%	1.08%	223.31%	0.72%
过去五年	252.35%	1.53%	44.87%	0.96%	207.48%	0.57%
自基金合同 生效起至今	1,053.18%	1.63%	240.46%	1.35%	812.72%	0.28%

注：基金业绩比较基准增长率=80%×沪深 300 指数收益率+20%×上证国债指数收益率

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

万家优选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 2013 年 7 月 11 日召开持有人大会，会议审议通过了《关于修改万家公用事业行业股票型证券投资基金（LOF）基金合同有关事项的议案》，该议案已于 2013 年 8 月 28 日通过并完成向中国证监会的备案。根据基金份额持有人大会决议，原“万家公用事业行业股票型证券投资基金（LOF）”更名为“万家行业优选股票型证券投资基金（LOF）”。更名后基金的建仓期为持有人大会决议生效日起 6 个月。建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同要求。2015 年 7 月 31 日，“万家行业优选股票型证券投资基金（LOF）”更名为“万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）”。报告期末各项资产配置比例符合基金合同要求。

§ 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、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 3 月 2 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，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》、《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。

本基金降低了传统行业如商业服务类公司的持仓,增持了半导体行业中的模拟芯片和利基型逻辑芯片公司。截至季度末,基金风格偏成长。

4.5 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 2.0466 元;本报告期基金份额净值增长率为-5.72%,业绩比较基准收益率为-5.17%。

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,本基金没有出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情况。

§ 5 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	13,355,214,679.92	92.10
	其中：股票	13,355,214,679.92	92.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	400,560,000.00	2.76
	其中：债券	400,560,000.00	2.76
	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	682,905,797.94	4.71
8	其他资产	62,814,616.47	0.43
9	合计	14,501,495,094.33	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	5,891,975,436.84	41.37
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	6,351,716,311.14	44.60
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,111,364,043.43	7.80
N	水利、环境和公共设施管理业	38,613.78	0.00

0	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	13,355,214,679.92	93.78

5.2.2 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投资组合。

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	688536	思瑞浦	2,116,900	1,350,815,059.00	9.49
2	688023	安恒信息	3,629,600	1,281,248,800.00	9.00
3	002594	比亚迪	4,833,376	1,205,975,645.76	8.47
4	300454	深信服	5,000,003	1,173,000,703.80	8.24
5	300661	圣邦股份	3,333,364	1,109,110,203.72	7.79
6	603986	兆易创新	6,999,997	1,014,929,565.03	7.13
7	600588	用友网络	30,000,377	993,912,490.01	6.98
8	300676	华大基因	11,333,314	991,778,308.14	6.96
9	688012	中微公司	6,000,000	910,800,000.00	6.40
10	688158	优刻得	20,717,450	673,317,125.00	4.73

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

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	400,560,000.00	2.81
	其中：政策性金融债	400,560,000.00	2.81
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	400,560,000.00	2.81

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	210301	21 进出 01	4,000,000	400,560,000.00	2.81

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

本报告期末本基金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

本报告期末本基金未持有贵金属。

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

本报告期末本基金未持有权证。

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

报告期末本基金未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期末本基金未持有股指期货。

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

报告期末本基金未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

报告期末本基金未持有国债期货。

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

本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	2,522,146.95
2	应收证券清算款	915,542.19
3	应收股利	-
4	应收利息	5,914,653.46
5	应收申购款	53,462,273.87
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	62,814,616.47

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	7,902,936,061.69
报告期期间基金总申购份额	1,915,821,999.20
减:报告期期间基金总赎回份额	2,860,233,438.86
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	6,958,524,622.03

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购及买卖本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购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、《万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）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、万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）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、《万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）托管协议》。

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人网站：<http://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