

# 万家瑞隆混合型证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 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：2022 年 3 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。本年度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 2022 年 3 月 29 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。

本报告财务资料已经审计。立信会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>19</b>
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	22
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>57</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	57
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	57
8.3 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.....	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	81
8.6 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.....	82
8.7 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.....	82

8.8	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	82
8.9	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	82
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	82
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	82
8.12	投资组合报告附注	83
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>84</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	84
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	84
9.3	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	84
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>85</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>86</b>
11.1	基金份额持有人大会决议	86
11.2	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	86
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	86
11.4	基金投资策略的改变	86
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	86
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	86
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	87
<b>§12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>88</b>
12.1	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	88
<b>§13</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>89</b>
13.1	备查文件目录	89
13.2	存放地点	89
13.3	查阅方式	89

## § 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	861,132,878.08 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.wjasset.com">http://www.wjasset.com</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市南京东路 61 号 4 楼新黄浦金融大厦
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	96,300,229.71	8,108,745.57	1,165,628.63
本期利润	154,303,858.11	11,837,801.61	2,752,200.87
加权平均基金份额本期利润	0.8335	0.4402	0.2998
本期加权平均净值利润率	34.80%	30.86%	28.71%
本期基金份额净值增长率	58.06%	51.41%	37.72%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	990,411,995.86	11,853,370.76	536,165.43
期末可供分配基金份额利润	1.1501	0.3518	0.0535
期末基金资产净值	2,304,099,593.39	57,035,287.52	11,206,534.26
期末基金份额净值	2.6757	1.6928	1.1180
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	167.57%	69.28%	11.80%

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

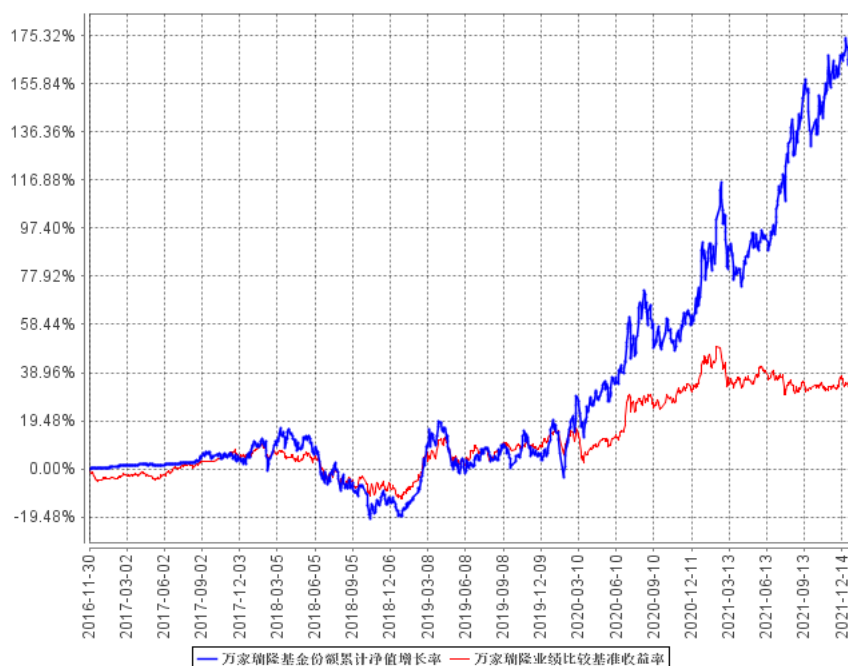
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	13.65%	1.44%	1.52%	0.59%	12.13%	0.85%
过去六个月	34.52%	1.55%	-3.21%	0.77%	37.73%	0.78%
过去一年	58.06%	1.68%	-2.29%	0.88%	60.35%	0.80%
过去三年	229.60%	1.69%	51.68%	0.96%	177.92%	0.73%
过去五年	166.82%	1.50%	40.88%	0.87%	125.94%	0.63%
自基金合同生效起至今	167.57%	1.48%	34.63%	0.86%	132.94%	0.62%

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

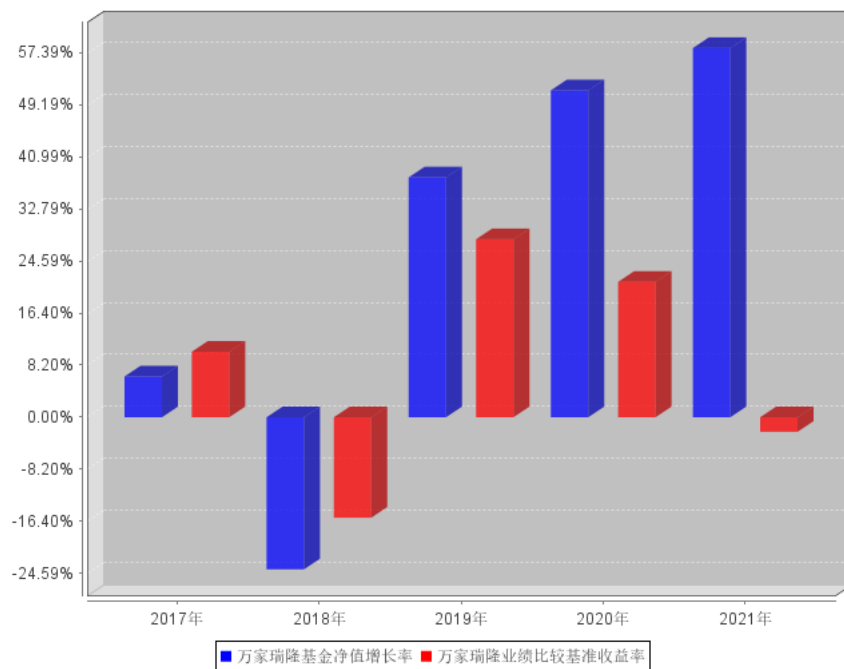


注：本基金合同生效日期为 2016 年 11 月 30 日，建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。本基金已于 2018 年 4 月 17 日召开基金持有人大会，对本基金名称、基金投资范围等事项进行相应修改。原“万家瑞隆灵活配置混合型证券投资基金”变更注册为“万家瑞隆混合型证券投资基金”。本基金份额持有人大会于 2018 年 4 月 17 日表决通过了《关于修改万家瑞隆灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，并于 2018 年 4 月 17 日修改了基金合同，修订和更新后的文件于 2018 年 4 月 17 日生效。基金合同生效后各项资产配置比例符合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。



### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家瑞隆过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金于 2016 年 11 月 30 日成立，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未分配利润。

## § 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。目前管理一百只开放式基金,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、万家中证1000指数增强型发起式证券投资基金、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、万家鑫悦纯债债券型证券投资基金、万家智造优势混合型证券投资基金、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、万家民安增利 12 个月定期开放债券型证券投资基金、万家鑫盛纯债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、万家鑫动力月月购一年滚动持有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、万家悦兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金、万家稳鑫 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、万家全球成长一年持有期混合型证券投资基金（QDII）、万家瑞泰混合型证券投资基金、万家沪港深蓝筹混合型证券投资基金、万家北交所慧选两年定期开放混合型证券投资基金、万家鼎鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家新机遇成长一年持有期混合型发起式证券投资基金。

#### 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		
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	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；

	型证券投资基金的基金经理				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。

## 4.2 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 公平交易制度和控制方法

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《万家基金管理有限公司公平交易管理办法》，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，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送，确保公平对待不同投资组合。

在投资决策上：(1) 公司投资管理实行分层次决策，投资决策委员会根据公募基金和私募投资组合的规模、风格特征等因素合理确定各投资组合经理的投资权限，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需经过严格的逐级审批程序。(2) 公司研究员撰写的研究报告等均通过统一的投研管理平台发布，确保各投资组合经理在获得投资信息、投资建议和实施决策方面享有公平的机会。

在交易执行上：(1) 公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度；(2) 对于交易公开竞价交易，所有指令必须通过系统下达，公司执行交易系统中的公平交易程序；(3) 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，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，原则上公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；(4) 对于银行间交易，交易部按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。

在行为监控上，公司定期对不同投资组合的同向交易价差、反向交易，场外交易对手议价的价格公允性及其他异常交易情况进行监控及分析，基金经理对异常交易情况进行合理性解释并留存

记录,并定期编制公平交易分析报告,由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司定期进行同向交易价差分析,即采集公司旗下管理的所有组合,连续四个季度期间内,不同时间窗下(日内、3 日内、5 日内)的同向交易样本,对两两组合之间的同向交易价差均值进行原假设为 0,95% 的置信水平下的 t 检验,并对结论进行跟踪分析,分析结果显示在样本数量大于 30 的前提下,组合之间在同向交易方面不存在违反公平交易行为。

#### 4.3.3 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

回顾 2021 年,上半年国内疫情缓解,在出口强势的带动下,上半年经济表现较为强势。下半年经济下行压力加大,12 月的中央经济工作会议正式定调,稳增长进而成为下一阶段经济工作的重点,下半年货币政策也逐步边际宽松。

市场表现方面,A 股全年维持震荡走势,指数在全年小幅上涨,但板块差异较大。从全年维度看,有色、化工等周期板块,以及新能源板块表现较好,2019-2020 年市场表现优异的医药、食品饮料等板块在 2021 年表现相对较差。

配置方面,1) 瑞隆 2021 年全年维持了较高比例的农业配置,由于下半年种业持仓比例更高,且在三季度加仓了生猪养殖个股,在农业全年市场走势 U 型下,农业板块仍给瑞隆贡献了不错的收益。我们看好种业景气上行和转基因带来行业成长空间打开的大逻辑不变。2) 一季度瑞隆配置了化工、有色等周期类个股,并及时获利了结,周期股是瑞隆获得超额受益的来源之一。3) 二季度,瑞隆布局了新能源、电子等成长类板块,以及军工板块,二三季度获得了较好收益。4) 四季度,瑞隆减仓新能源,布局了建筑、建材等稳增长板块,我们认为稳增长有望成为 2022 年国内经济工作的重点方向,行业景气度向上且估值便宜,拥有非常好的配置价值。

#### 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 2.6757 元;本报告期基金份额净值增长率为 58.06%,业绩比较基准收益率为-2.29%。

#### 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 2022 年, 预计国内经济下行压力较大、但全年流动性相对宽松。在消费和出口相对疲下, 政府将通过发力稳增长拉动全年经济增长, 预计 2022 年全年基建投资增速有望回升。

配置方面思路上, 中长线看好生物育种和新能源板块: 1) 生物育种板块: 预计 2022 年是国内转基因玉米推广元年, 转基因玉米商业化种植将打开行业成长空间。此外, 全球粮食价格处于高位水平, 种子板块景气度上行, 去年四季度开始的玉米种子提价, 有望带动行业业绩超预期。种子行业正在从政策主题投资变成有基本面的投资。2) 新能源板块: 2022 年行业仍处于高速成长期, 板块中长期景气度上行, 且经过前期股价大幅调整, 部分板块如核电和新能源运营等板块估值已经相对便宜, 具备较好的投资价值。此外, 上半年相对看好稳增长板块, 稳增长政策在上半年是密集落地期, 当前时间点估值不贵, 具备配置价值。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内, 基金管理人为防范和化解经营风险, 确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整, 主要做了以下工作:

##### (一) 加强风控文化建设

不断梳理和优化制度流程、防范操作风险、加强对员工的合规培训和加深员工对合规风控工作的理解, 确保公司各项业务合法合规。

##### (二) 制度流程建设

为加强内控管理, 保证公司各项制度流程的有效性、及时性、完备性, 本年度对投资、销售、专户业务相关的制度流程及后台部门相关制度进行了修订;

##### (三) 定期和临时稽核工作

报告期内, 监察稽核部门按计划完成了各项定期稽核和专项稽核, 检查内容覆盖公司各业务部门和业务环节, 检查完成后出具监察稽核报告和建议书, 并对整改情况进行跟踪。

##### (四) 绩效评估和风险管理工作

报告期内, 进一步完善了每日风险监控工作; 改进基金业绩评价工作, 辅助基金经理投资决策, 提供风险评估意见等; 针对由于市场流动性紧张的情况, 加大了对固定收益产品的风险管理, 防范资金交收风险。

##### (五) 员工行为管理与防控内幕交易

报告期内, 公司进一步完善防控内幕交易制度和从业人员投资申报等制度, 强化员工行为管理工作, 防范内幕交易和利益输送。

#### 4.7 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。估值委员会由负责估值业务的分管领导、合规稽核部负责人、基金运营部负责人、相关估值业务岗位人员、相关风控人员等组成。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》。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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 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 托管人对本年度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 年年度报告中的财务指标、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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	信会师报字[2022]第 ZA30212 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	万家瑞隆混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了万家瑞隆混合型证券投资基金(以下简称“万家瑞隆”)财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、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编制,公允反映了万家瑞隆 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于万家瑞隆,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
管理层和治理层对财务报表的责任	万家瑞隆的基金管理人万家基金管理有限公司管理层(以下简称管理层)负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时,管理层负责评估万家瑞隆的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督万家瑞隆的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作: (1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证

	<p>据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对万家瑞隆持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致万家瑞隆不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与管理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	立信会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	王斌   徐冬
会计师事务所的地址	中国 上海
审计报告日期	2022 年 3 月 29 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	181,637,903.20	7,830,184.25
结算备付金		5,702,188.06	256,111.47
存出保证金		963,926.19	84,780.23
交易性金融资产	7.4.7.2	2,076,989,156.54	52,141,056.40
其中：股票投资		2,074,744,707.74	52,141,056.40
基金投资		-	-
债券投资		2,244,448.80	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	100,000,000.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	38,522.09	634.84
应收股利		-	-
应收申购款		11,450,485.66	1,584,682.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,376,782,181.74	61,897,450.18
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		57,464,288.49	3,622,024.35
应付赎回款		9,896,422.59	964,271.64
应付管理人报酬		2,039,053.46	52,756.23
应付托管费		271,873.79	7,034.20
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,831,268.20	105,013.68
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	179,681.82	111,062.56
负债合计		72,682,588.35	4,862,162.66
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	861,132,878.08	33,693,216.32
未分配利润	7.4.7.10	1,442,966,715.31	23,342,071.20
所有者权益合计		2,304,099,593.39	57,035,287.52
负债和所有者权益总计		2,376,782,181.74	61,897,450.18

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.6757 元，基金份额总额 861,132,878.08 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		168,671,401.93	13,289,430.82
1. 利息收入		217,219.03	18,724.53
其中：存款利息收入	7.4.7.11	170,795.55	18,700.64
债券利息收入		33,218.00	23.89
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		13,205.48	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		106,538,016.56	8,578,233.19
其中：股票投资收益	7.4.7.12	103,597,434.60	7,900,301.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	450,140.92	32,860.97
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,490,441.04	645,070.74
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	58,003,628.40	3,729,056.04
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	3,912,537.94	963,417.06
<b>减：二、费用</b>		14,367,543.82	1,451,629.21
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	6,421,781.68	567,668.67
2. 托管费	7.4.10.2.2	856,237.54	75,689.14

3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	6,898,021.70	751,071.33
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2.90	0.07
7. 其他费用	7.4.7.20	191,500.00	57,200.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		154,303,858.11	11,837,801.61
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		154,303,858.11	11,837,801.61

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	-	154,303,858.11	154,303,858.11
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）	827,439,661.76	1,265,320,786.00	2,092,760,447.76
其中：1. 基金申购款	1,139,093,678.45	1,654,945,788.97	2,794,039,467.42
2. 基金赎回款	-311,654,016.69	-389,625,002.97	-701,279,019.66
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）	861,132,878.08	1,442,966,715.31	2,304,099,593.39
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）	10,023,423.14	1,183,111.12	11,206,534.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,837,801.61	11,837,801.61
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）	23,669,793.18	10,321,158.47	33,990,951.65
其中：1. 基金申购款	139,175,071.38	54,835,606.57	194,010,677.95
2. 基金赎回款	-115,505,278.20	-44,514,448.10	-160,019,726.30
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）	33,693,216.32	23,342,071.20	57,035,287.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 方一天 _____	_____ 陈广益 _____	_____ 尹超 _____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

万家瑞隆混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），原名万家瑞隆灵活配置混合型证券投资基金，系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]2728 号文《关于准予万家瑞隆灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》的批准，由万家基金管理有限公司作为基金管理人于 2016 年 11 月 14 日至 2016 年 11 月 25 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具(2016)验字第 60778298\_B21 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2016 年 11 月 30 日正式生效，本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为 300,048,949.89 元，有效认购资金在初始销售期内产生的利息为人民币 11.52 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 300,048,961.41 元，折合 300,048,961.41 份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记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。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%。

#### 7.4.2 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。

#### 7.4.3 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 12 月 31 日的财

务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### 1、金融资产的分类

本基金的金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### 2、金融负债的分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于



应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者（3）该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（2）不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

（3）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率逐日计提;

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率逐日计提;

(3) 卖出回购金融资产支出,按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在回购期内逐日计提;

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为 12 次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 90%,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

4、每一基金份额享有同等分配权;

5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1) 对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关

于发布《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	181,637,903.20	7,830,184.25
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：	181,637,903.20	7,830,184.25

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,012,420,275.93	2,074,744,707.74	62,324,431.81
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,247,366.00	2,244,448.80
	银行间市场	-	-
	合计	2,247,366.00	2,244,448.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,014,667,641.93	2,076,989,156.54	62,321,514.61
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	47,823,170.19	52,141,056.40	4,317,886.21
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	47,823,170.19	52,141,056.40	4,317,886.21

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	100,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	100,000,000.00	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

注：本基金上年度末未持有各项买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	23,289.47	466.09
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	2,822.60	126.72
应收债券利息	51,541.30	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-39,616.44	-
应收申购款利息	7.98	0.01
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	477.18	42.02
合计	38,522.09	634.84

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。



### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	2,831,268.20	105,013.68
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	2,831,268.20	105,013.68

### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	5,381.82	1,062.56
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	174,300.00	110,000.00
合计	179,681.82	111,062.56

### 7.4.7.9 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 12 月 31 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	1,139,093,678.45	1,139,093,678.45
本期赎回（以“-”号填列）	-311,654,016.69	-311,654,016.69
- 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	861,132,878.08	861,132,878.08

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

### 7.4.7.10 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	96,300,229.71	58,003,628.40	154,303,858.11
本期基金份额交易	882,258,395.39	383,062,390.61	1,265,320,786.00

产生的变动数			
其中：基金申购款	1,135,837,920.33	519,107,868.64	1,654,945,788.97
基金赎回款	-253,579,524.94	-136,045,478.03	-389,625,002.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	990,411,995.86	452,554,719.45	1,442,966,715.31

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	133,398.84	14,340.04
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	26,065.77	3,049.76
其他	11,330.94	1,310.84
合计	170,795.55	18,700.64

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	1,686,795,560.87	241,445,318.57
减：卖出股票成本总额	1,583,198,126.27	233,545,017.09
买卖股票差价收入	103,597,434.60	7,900,301.48

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

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12月31日	2020年1月1日至2020年12月31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	450,140.92	32,860.97
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	450,140.92	32,860.97

#### 7.4.7.13.2 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	7,565,139.51	150,685.52
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	7,099,184.11	117,800.00
减：应收利息总额	15,814.48	24.55
买卖债券差价收入	450,140.92	32,860.97

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
股票投资产生的股利收益	2,490,441.04	645,070.74
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	2,490,441.04	645,070.74

## 7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
1. 交易性金融资产	58,003,628.40	3,729,056.04
——股票投资	58,006,545.60	3,729,056.04
——债券投资	-2,917.20	-
——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	58,003,628.40	3,729,056.04

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31 日
基金赎回费收入	3,874,404.00	963,222.93
转换费收入	38,133.94	194.13
合计	3,912,537.94	963,417.06

## 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
交易所市场交易费用	6,898,021.70	751,071.33
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	6,898,021.70	751,071.33

### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	45,000.00	20,000.00
信息披露费	100,000.00	-
证券出借违约金	-	-
债券账户服务费	46,500.00	37,200.00
其他	-	-
账户维护费	-	-
开户费	-	-
合计	191,500.00	57,200.00

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》（财会〔2017〕7 号）、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》（财会〔2017〕8 号）、《企业会计准则第 24 号——套期会计》（财会〔2017〕9 号）、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（财会〔2017〕14 号）（以下简称新金融工具相关会计准则）和《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》（财会〔2020〕22 号），自 2022 年 1 月 1 日起，本基金开始执行新金融工具相关会计准则。

### 7.4.9 关联方关系

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
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
新疆国际实业股份有限公司	基金管理人的股东
齐河众鑫投资有限公司	基金管理人的股东
万家共赢资产管理有限公司	基金管理人的子公司
万家财富基金销售（天津）有限公司	基金管理人的子公司、基金销售机构
上海万家朴智投资管理有限公司	基金管理人控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行的交易。

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

#### 7.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,421,781.68	567,668.67
其中：支付销售机构的客户维护费	1,320,579.11	154,340.89

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

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

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	856,237.54	75,689.14

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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、休息日等，支付日期顺延。

### 7.4.10.3 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

### 7.4.10.4 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

#### 7.4.10.4.1 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。

#### 7.4.10.4.2 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。

### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2016 年 11 月 30 日）持有的基金份额	-	-
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	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	2,759,882.87	-
报告期末持有的基金份额	-	2,759,882.87
报告期末持有的基金份额	-	8.1912%

占基金总份额比例		
----------	--	--

#### 7.4.10.5.2 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 12 月 31 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
中泰证券股份有限公司	6,332,658.03	0.7354%	-	-
万家共赢资产管理有限公司	-	-	5,278,022.17	15.6649%

#### 7.4.10.6 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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	181,637,903.20	133,398.84	7,830,184.25	14,340.04

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。

#### 7.4.10.7 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末均未在承销期内直接购入关联方所承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间没有需作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
600941	中国移动	2021 年 12 月 24 日	2022 年 1 月 5 日	新股未上市	57.58	57.58	18,720	1,077,897.60	1,077,897.60	-



			日							
600941	中国移动	2021年 12月 24日	2022 年7 月5 日	新股 未上 市	57.58	57.58	43,681	2,515,151.98	2,515,151.98	-
001234	泰慕士	2021年 12月 31日	2022 年1 月11 日	新股 未上 市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
688262	国芯科技	2021年 12月 28日	2022 年1 月6 日	新股 未上 市	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-
301136	招标股份	2021年 12月 31日	2022 年1 月11 日	新股 未上 市	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
300774	倍杰特	2021年 7月26 日	2022 年2 月16 日	创业 板股 票流 通受 限	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021年 8月4 日	2022 年2 月14 日	创业 板股 票流 通受 限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300854	中兰环保	2021年 9月8 日	2022 年3 月16 日	创业 板股 票流 通受 限	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
300994	久祺股份	2021年 8月2 日	2022 年2 月14 日	创业 板股 票流 通受 限	11.90	45.45	402	4,783.80	18,270.90	-
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	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301021	英诺激光	2021年 6月28	2022 年1	创业 板股	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-

		日	月 6 日	票流 通受 限						
301025	读客 文化	2021 年 7 月 6 日	2022 年 1 月 24 日	创业 板股 票流 通受 限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301026	浩通 科技	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 17 日	创业 板股 票流 通受 限	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝 集团	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 19 日	创业 板股 票流 通受 限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚 机械	2021 年 7 月 12 日	2022 年 1 月 20 日	创业 板股 票流 通受 限	5.31	13.50	676	3,589.56	9,126.00	-
301029	怡合 达	2021 年 7 月 14 日	2022 年 1 月 24 日	创业 板股 票流 通受 限	14.14	89.87	427	6,037.78	38,374.49	-
301030	仕净 科技	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	创业 板股 票流 通受 限	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301032	新柴 股份	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	创业 板股 票流 通受 限	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301033	迈普 医学	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 26 日	创业 板股 票流 通受 限	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301035	润丰	2021 年	2022	创业	22.04	56.28	249	5,487.96	14,013.72	-

	股份	7月21日	年1月28日	板股 票流 通受 限							
301036	双乐 股份	2021年 7月21日	2022 年2 月16 日	创业 板股 票流 通受 限	23.38	29.93	192	4,488.96	5,746.56	-	
301037	保立 佳	2021年 7月21日	2022 年2 月7日	创业 板股 票流 通受 限	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-	
301038	深水 规院	2021年 7月22日	2022 年2 月7日	创业 板股 票流 通受 限	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-	
301039	中集 车辆	2021年 7月1日	2022 年1 月10 日	创业 板股 票流 通受 限	6.96	12.51	757	5,268.72	9,470.07	-	
301040	中环 海陆	2021年 7月26日	2022 年2 月7日	创业 板股 票流 通受 限	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-	
301041	金百 泽	2021年 8月2日	2022 年2 月11 日	创业 板股 票流 通受 限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-	
301046	能辉 科技	2021年 8月10日	2022 年2 月17 日	创业 板股 票流 通受 限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-	
301048	金鹰 重工	2021年 8月11日	2022 年2 月28 日	创业 板股 票流 通受 限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-	

301049	超越科技	2021年8月17日	2022年2月24日	创业板股票流通受限	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301050	雷电微力	2021年8月17日	2022年2月24日	创业板股票流通受限	60.64	234.74	147	8,914.08	34,506.78	-
301052	果麦文化	2021年8月23日	2022年2月28日	创业板股票流通受限	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	-
301053	远信工业	2021年8月25日	2022年3月1日	创业板股票流通受限	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301055	张小泉	2021年8月26日	2022年3月7日	创业板股票流通受限	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301056	森赫股份	2021年8月27日	2022年3月7日	创业板股票流通受限	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301057	汇隆新材	2021年8月31日	2022年3月9日	创业板股票流通受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301059	金三江	2021年9月3日	2022年3月14日	创业板股票流通受限	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301060	兰卫医学	2021年9月6日	2022年3月14日	创业板股票流通受限	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-

				限						
301062	上海艾录	2021年9月7日	2022年3月14日	创业板股票流通受限	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅股份	2021年9月9日	2022年3月24日	创业板股票流通受限	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301066	万事利	2021年9月13日	2022年3月22日	创业板股票流通受限	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
301068	大地海洋	2021年9月16日	2022年3月28日	创业板股票流通受限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021年9月16日	2022年3月28日	创业板股票流通受限	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	创业板股票流通受限	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	创业板股票流通受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301078	孩子王	2021年9月30日	2022年4月14日	创业板股票流通受限	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301079	邵阳液压	2021年10月11日	2022年4月19日	创业板股票流通受限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-

			日	通受限						
301081	严牌股份	2021年10月13日	2022年4月20日	创业板股票流通受限	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301083	百胜智能	2021年10月13日	2022年4月21日	创业板股票流通受限	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301087	可孚医疗	2021年10月15日	2022年4月25日	创业板股票流通受限	93.09	75.34	242	22,527.78	18,232.28	-
301088	戎美股份	2021年10月19日	2022年4月28日	创业板股票流通受限	33.16	24.67	391	12,965.56	9,645.97	-
301089	拓新药业	2021年10月20日	2022年4月27日	创业板股票流通受限	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301090	华润材料	2021年10月19日	2022年4月26日	创业板股票流通受限	10.45	11.22	1,560	16,302.00	17,503.20	-
301091	深城交	2021年10月20日	2022年4月29日	创业板股票流通受限	36.50	31.31	481	17,556.50	15,060.11	-
301092	争光股份	2021年10月21日	2022年5月5日	创业板股票流通受限	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301093	华兰股份	2021年10月	2022年5月	创业板股	58.08	49.85	246	14,287.68	12,263.10	-

		21 日	月 5 日	票流 通受限						
301096	百诚 医药	2021 年 12 月 13 日	2022 年 6 月 20 日	创业 板股 票流 通受限	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-
301098	金埔 园林	2021 年 11 月 4 日	2022 年 5 月 12 日	创业 板股 票流 通受限	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301099	雅创 电子	2021 年 11 月 10 日	2022 年 5 月 23 日	创业 板股 票流 通受限	21.99	71.36	351	7,718.49	25,047.36	-
301100	风光 股份	2021 年 12 月 10 日	2022 年 6 月 17 日	创业 板股 票流 通受限	27.81	31.14	599	16,658.19	18,652.86	-
301101	明月 镜片	2021 年 12 月 9 日	2022 年 6 月 16 日	创业 板股 票流 通受限	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-
301108	洁雅 股份	2021 年 11 月 25 日	2022 年 6 月 6 日	创业 板股 票流 通受限	57.27	53.71	280	16,035.60	15,038.80	-
301111	粤万 年青	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	创业 板股 票流 通受限	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301118	恒光 股份	2021 年 11 月 9 日	2022 年 5 月 18 日	创业 板股 票流 通受限	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301126	达嘉	2021 年	2022	创业	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-

	维康	11月30日	年6月7日	板股 票流 通受 限							
301127	天源环保	2021年12月23日	2022年6月30日	创业 板股 票流 通受 限	12.03	17.12	1,685	20,270.55	28,847.20	-	
301138	华研精机	2021年12月8日	2022年6月15日	创业 板股 票流 通受 限	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-	
301149	隆华新材	2021年11月3日	2022年5月10日	创业 板股 票流 通受 限	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-	
301168	通灵股份	2021年12月2日	2022年6月10日	创业 板股 票流 通受 限	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-	
301177	迪阿股份	2021年12月8日	2022年6月15日	创业 板股 票流 通受 限	116.88	116.08	502	58,673.76	58,272.16	-	
301179	泽宇智能	2021年12月1日	2022年6月8日	创业 板股 票流 通受 限	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-	
301180	万祥科技	2021年11月9日	2022年5月16日	创业 板股 票流 通受 限	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-	
301182	凯旺科技	2021年12月16日	2022年6月23日	创业 板股 票流 通受 限	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-	



301190	善水科技	2021年12月17日	2022年6月24日	创业板股票流通受限	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301193	家联科技	2021年12月2日	2022年6月9日	创业板股票流通受限	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年6月2日	创业板股票流通受限	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301211	亨迪药业	2021年12月14日	2022年6月22日	创业板股票流通受限	25.80	33.65	967	24,948.60	32,539.55	-
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年6月22日	创业板股票流通受限	69.89	88.72	280	19,569.20	24,841.60	-
688211	中科微至	2021年10月18日	2022年4月26日	科创板股票流通受限	90.20	71.32	1,688	152,257.60	120,388.16	-
688280	精进电动	2021年10月19日	2022年4月27日	科创板股票流通受限	13.78	13.63	10,605	146,136.90	144,546.15	-
688711	宏微科技	2021年8月25日	2022年3月1日	科创板股票流通受限	27.51	116.52	1,865	51,306.15	217,309.80	-
688778	厦钨新能	2021年7月29日	2022年2月7日	科创板股票流通受限	24.50	100.74	1,923	47,113.50	193,723.02	-

				限						
688798	艾为电子	2021年8月6日	2022年2月16日	科创板股票流通受限	76.58	210.33	881	67,466.98	185,300.73	-

#### 7.4.12.2 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 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金融资产款余额。

##### 7.4.12.3.2 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金融资产款余额。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

##### 7.4.13.2 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。

#### 7.4.13.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	2,244,448.80	-
合计	2,244,448.80	-

注：未评级债券为国债。

#### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有长期信用评级债券。

#### 7.4.13.3 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。

##### 7.4.13.3.1 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 7.4.12 “期末（2021 年 12 月 31 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	181,637,903.20	-	-	-	-	-	181,637,903.20
结算备付金	5,702,188.06	-	-	-	-	-	5,702,188.06
存出保证金	963,926.19	-	-	-	-	-	963,926.19
交易性金融资产	2,244,448.80	-	-	-	-	-2,074,744,707.74	2,076,989,156.54
买入返售金融资产	100,000,000.00	-	-	-	-	-	100,000,000.00

应收利息	-	-	-	-	-	38,522.09	38,522.09
应收申购款	4,217.02	-	-	-	-	11,446,268.64	11,450,485.66
资产总计	290,552,683.27	-	-	-	-	-2,086,229,498.47	2,376,782,181.74
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	57,464,288.49	57,464,288.49
应付赎回款	-	-	-	-	-	9,896,422.59	9,896,422.59
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,039,053.46	2,039,053.46
应付托管费	-	-	-	-	-	271,873.79	271,873.79
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,831,268.20	2,831,268.20
其他负债	-	-	-	-	-	179,681.82	179,681.82
负债总计	-	-	-	-	-	72,682,588.35	72,682,588.35
利率敏感度缺口	290,552,683.27	-	-	-	-	-2,013,546,910.12	2,304,099,593.39
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。

#### 7.4.13.4.1.2 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12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	318.75	-
2. 市场利率上升 25 个基点	-317.92	-	

注：上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。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	2,074,744,707.74	90.05	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	2,244,448.80	0.10	-	-
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	2,076,989,156.54	90.14	52,141,056.40	91.42

#### 7.4.13.4.3.2 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12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 股票基准指数下降 100 个基点	-9,348,723.95	-535,774.04
2. 股票基准指数上升 100 个基点	9,348,723.95	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。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### （一）公允价值

##### 1、金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 2、持续的以公允价值计量的金融工具

##### （1）各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为 2,068,979,010.04 元，属于第二层次的余额为 8,010,146.50 元，无属于第三层次的余额。（2020 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为 52,128,246.58 元，属于第二层次的余额为 12,809.82 元，无属于第三层次的余额。）

##### （2）公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次均未发生重大变动。

(3) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具本期末及上年度末均未以第三层次公允价值计量。

3、非持续的以公允价值计量的金融工具

本基金本期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

4、不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息以及其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(二)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。



## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	2,074,744,707.74	87.29
	其中：股票	2,074,744,707.74	87.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,244,448.80	0.09
	其中：债券	2,244,448.80	0.09
	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	100,000,000.00	4.21
	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	187,340,091.26	7.88
8	其他各项资产	12,452,933.94	0.52
9	合计	2,376,782,181.74	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	788,495,572.77	34.22
B	采矿业	16,717,771.00	0.73
C	制造业	866,755,945.50	37.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	111,800,750.99	4.85
E	建筑业	119,819,073.20	5.20
F	批发和零售业	11,868,448.08	0.52
G	交通运输、仓储和邮政业	29,254,326.18	1.27
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,819,946.43	1.29
J	金融业	76,966,449.08	3.34
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	19,241.25	0.00
M	科学研究和技术服务业	22,836,631.90	0.99
N	水利、环境和公共设施管理业	266,119.51	0.01

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	16,279.37	0.00
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	85,382.70	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,074,744,707.74	90.05

### 8.2.2 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。

### 8.3 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	002385	大北农	18,872,797	197,975,640.53	8.59
2	000998	隆平高科	8,395,242	195,273,328.92	8.48
3	002041	登海种业	7,338,690	189,264,815.10	8.21
4	300087	荃银高科	5,346,000	162,518,400.00	7.05
5	600371	万向德农	6,749,523	90,578,598.66	3.93
6	002714	牧原股份	1,263,212	67,404,992.32	2.93
7	300986	志特新材	728,742	46,646,775.42	2.02
8	601985	中国核电	5,506,800	45,706,440.00	1.98
9	601669	中国电建	5,384,495	43,506,719.60	1.89
10	000786	北新建材	1,154,800	41,376,484.00	1.80
11	002438	江苏神通	1,938,800	39,764,788.00	1.73
12	600285	羚锐制药	2,192,544	34,642,195.20	1.50
13	601800	中国交建	4,026,500	34,547,370.00	1.50
14	601952	苏垦农发	2,871,063	34,194,360.33	1.48
15	600483	福能股份	1,893,586	30,827,580.08	1.34
16	002179	中航光电	303,900	30,560,184.00	1.33
17	002982	湘佳股份	616,481	30,078,107.99	1.31
18	002043	兔宝宝	2,381,100	28,763,688.00	1.25
19	300761	立华股份	753,800	28,501,178.00	1.24
20	002322	理工环科	2,102,300	25,206,577.00	1.09
21	300498	温氏股份	1,290,541	24,855,819.66	1.08
22	300320	海达股份	1,396,500	22,539,510.00	0.98
23	002233	塔牌集团	2,111,500	22,339,670.00	0.97
24	688265	南模生物	318,615	22,318,980.75	0.97
25	601377	兴业证券	2,111,200	20,858,656.00	0.91

26	000858	五粮液	91,400	20,351,124.00	0.88
27	002508	老板电器	560,500	20,189,210.00	0.88
28	601636	旗滨集团	1,141,900	19,526,490.00	0.85
29	600399	抚顺特钢	753,200	18,656,764.00	0.81
30	603385	惠达卫浴	1,671,400	18,552,540.00	0.81
31	600958	东方证券	1,232,500	18,167,050.00	0.79
32	600018	上港集团	3,281,900	17,984,812.00	0.78
33	600282	南钢股份	4,815,800	17,818,460.00	0.77
34	600801	华新水泥	817,300	15,773,890.00	0.68
35	600085	同仁堂	348,900	15,693,522.00	0.68
36	601611	中国核建	1,567,500	15,627,975.00	0.68
37	002060	粤水电	2,713,380	15,059,259.00	0.65
38	000875	吉电股份	1,557,550	14,158,129.50	0.61
39	000776	广发证券	557,400	13,706,466.00	0.59
40	600030	中信证券	512,300	13,529,843.00	0.59
41	600893	航发动力	210,900	13,383,714.00	0.58
42	002202	金风科技	810,400	13,347,288.00	0.58
43	000789	万年青	1,041,400	12,725,908.00	0.55
44	002791	坚朗五金	68,600	12,457,074.00	0.54
45	601899	紫金矿业	1,224,500	11,877,650.00	0.52
46	002032	苏泊尔	190,204	11,838,296.96	0.51
47	600011	华能国际	1,193,700	11,566,953.00	0.50
48	600062	华润双鹤	855,700	11,440,709.00	0.50
49	301166	优宁维	111,000	11,433,000.00	0.50
50	300443	金雷股份	195,900	11,315,184.00	0.49
51	600993	马应龙	391,200	11,250,912.00	0.49
52	002352	顺丰控股	162,304	11,185,991.68	0.49
53	603985	恒润股份	207,680	11,094,265.60	0.48
54	002171	楚江新材	831,600	11,027,016.00	0.48
55	601390	中国中铁	1,887,858	10,930,697.82	0.47
56	603218	日月股份	326,000	10,741,700.00	0.47
57	601688	华泰证券	591,500	10,505,040.00	0.46
58	000825	太钢不锈	1,425,900	10,038,336.00	0.44
59	002049	紫光国微	44,100	9,922,500.00	0.43
60	300699	光威复材	116,500	9,841,920.00	0.43
61	002728	特一药业	564,300	9,660,816.00	0.42
62	600098	广州发展	1,172,901	9,477,040.08	0.41
63	002475	立讯精密	192,600	9,475,920.00	0.41
64	603129	春风动力	48,000	8,304,000.00	0.36

65	600089	特变电工	375,700	7,953,569.00	0.35
66	603816	顾家家居	94,700	7,307,052.00	0.32
67	600519	贵州茅台	3,300	6,765,000.00	0.29
68	688798	艾为电子	25,311	5,462,180.73	0.24
69	600188	兖矿能源	205,700	4,840,121.00	0.21
70	600941	中国移动	62,401	3,593,049.58	0.16
71	301118	恒光股份	10,842	668,641.65	0.03
72	688167	炬光科技	2,014	441,066.00	0.02
73	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.01
74	301221	光庭信息	2,791	264,566.77	0.01
75	301096	百诚医药	2,714	231,152.38	0.01
76	688206	概伦电子	6,000	220,140.00	0.01
77	688711	宏微科技	1,865	217,309.80	0.01
78	301168	通灵股份	3,281	194,447.89	0.01
79	688778	厦钨新能	1,923	193,723.02	0.01
80	688257	新锐股份	2,899	191,913.80	0.01
81	300994	久祺股份	4,011	190,131.48	0.01
82	301087	可孚医疗	2,412	189,466.98	0.01
83	688728	格科微	5,758	173,718.86	0.01
84	301190	善水科技	5,741	171,802.70	0.01
85	301108	洁雅股份	2,800	166,667.20	0.01
86	688767	博拓生物	2,220	155,178.00	0.01
87	301126	达嘉维康	6,615	147,803.83	0.01
88	688280	精进电动	10,605	144,546.15	0.01
89	688121	卓然股份	3,681	141,534.45	0.01
90	688212	澳华内镜	3,496	132,043.92	0.01
91	688211	中科微至	1,688	120,388.16	0.01
92	688091	上海谊众	2,602	116,777.76	0.01
93	605499	东鹏饮料	632	114,922.88	0.00
94	688078	龙软科技	1,920	111,744.00	0.00
95	601825	沪农商行	15,480	104,490.00	0.00
96	301088	戎美股份	3,909	100,762.17	0.00
97	300774	倍杰特	4,435	97,161.52	0.00
98	688509	正元地信	15,433	97,073.57	0.00
99	301040	中环海陆	2,401	95,680.91	0.00
100	301098	金埔园林	3,069	84,970.79	0.00
101	688511	天微电子	1,490	82,531.10	0.00
102	688787	海天瑞声	817	75,515.31	0.00
103	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.00

104	301016	雷尔伟	2,747	71,202.24	0.00
105	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.00
106	301033	迈普医学	1,076	65,640.92	0.00
107	301032	新柴股份	5,124	65,484.54	0.00
108	301004	嘉益股份	3,115	63,795.20	0.00
109	300854	中兰环保	2,026	58,735.01	0.00
110	301177	迪阿股份	502	58,272.16	0.00
111	301038	深水规院	2,660	55,607.30	0.00
112	301059	金三江	2,581	52,808.68	0.00
113	688722	同益中	3,687	50,475.03	0.00
114	301037	保立佳	1,923	48,157.08	0.00
115	301053	远信工业	1,544	45,992.00	0.00
116	301068	大地海洋	1,436	43,660.68	0.00
117	301079	邵阳液压	1,396	43,352.80	0.00
118	301057	汇隆新材	2,173	42,953.11	0.00
119	688367	工大高科	1,717	42,873.49	0.00
120	688226	威腾电气	2,693	42,791.77	0.00
121	603071	物产环能	1,627	41,098.02	0.00
122	301029	怡合达	427	38,374.49	0.00
123	688681	科汇股份	1,899	38,245.86	0.00
124	600935	华塑股份	4,811	36,756.04	0.00
125	301063	海锅股份	924	35,748.03	0.00
126	605305	中际联合	368	35,434.72	0.00
127	001213	中铁特货	5,818	35,257.08	0.00
128	605089	味知香	370	35,094.50	0.00
129	688067	爱威科技	1,259	35,012.79	0.00
130	605507	国邦医药	1,202	34,653.66	0.00
131	301050	雷电微力	147	34,506.78	0.00
132	688701	卓锦股份	2,340	32,572.80	0.00
133	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.00
134	603529	爱玛科技	679	30,942.03	0.00
135	601921	浙版传媒	3,154	30,373.02	0.00
136	603230	内蒙新华	1,140	29,491.80	0.00
137	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.00
138	605080	浙江自然	374	27,975.20	0.00
139	605555	德昌股份	655	26,724.00	0.00
140	605020	永和股份	850	26,095.00	0.00
141	001208	华菱线缆	1,754	26,011.82	0.00
142	001317	三羊马	300	25,722.00	0.00

143	601528	瑞丰银行	2,230	25,154.40	0.00
144	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.00
145	605167	利柏特	2,471	24,339.35	0.00
146	001217	华尔泰	1,239	23,925.09	0.00
147	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
148	300982	苏文电能	317	23,328.03	0.00
149	603171	税友股份	637	22,422.40	0.00
150	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
151	300957	贝泰妮	105	20,189.40	0.00
152	300953	震裕科技	154	20,107.78	0.00
153	001216	华瓷股份	1,177	19,667.67	0.00
154	603216	梦天家居	772	19,523.88	0.00
155	603836	海程邦达	733	19,241.25	0.00
156	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
157	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
158	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
159	605162	新中港	1,377	17,570.52	0.00
160	605056	咸亨国际	933	17,521.74	0.00
161	301090	华润材料	1,560	17,503.20	0.00
162	001215	千味央厨	295	17,171.95	0.00
163	605098	行动教育	289	16,279.37	0.00
164	300979	华利集团	181	16,118.05	0.00
165	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
166	001218	丽臣实业	350	15,267.00	0.00
167	605289	罗曼股份	380	15,238.00	0.00
168	301091	深城交	481	15,060.11	0.00
169	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
170	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
171	001206	依依股份	321	14,894.40	0.00
172	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
173	300614	百川畅银	303	14,544.00	0.00
174	605028	世茂能源	615	14,329.50	0.00
175	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
176	301035	润丰股份	249	14,013.72	0.00
177	301015	百洋医药	462	13,998.60	0.00
178	001205	盛航股份	577	13,992.25	0.00
179	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
180	605378	野马电池	473	13,650.78	0.00
181	605180	华生科技	384	13,555.20	0.00

182	300967	晓鸣股份	507	13,516.62	0.00
183	603048	浙江黎明	464	13,456.00	0.00
184	605567	春雪食品	629	13,397.70	0.00
185	605566	福莱茵特	435	13,350.15	0.00
186	605599	菜百股份	980	13,190.80	0.00
187	605319	无锡振华	764	12,957.44	0.00
188	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
189	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
190	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
191	605196	华通线缆	1,172	12,575.56	0.00
192	605300	佳禾食品	576	12,401.28	0.00
193	605365	立达信	645	12,364.65	0.00
194	301093	华兰股份	246	12,263.10	0.00
195	301013	利和兴	471	12,104.70	0.00
196	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
197	300997	欢乐家	690	11,957.70	0.00
198	300973	立高食品	90	11,887.20	0.00
199	300966	共同药业	286	11,731.72	0.00
200	605069	正和生态	608	11,685.76	0.00
201	300987	川网传媒	301	11,678.80	0.00
202	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
203	300962	中金辐照	576	11,422.08	0.00
204	605033	美邦股份	423	11,298.33	0.00
205	605488	福莱新材	416	11,119.68	0.00
206	605011	杭州热电	525	11,056.50	0.00
207	001210	金房节能	311	11,037.39	0.00
208	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
209	605189	富春染织	423	10,651.14	0.00
210	605580	恒盛能源	654	10,614.42	0.00
211	301011	华立科技	175	10,535.00	0.00
212	603219	富佳股份	528	10,449.12	0.00
213	301002	崧盛股份	187	10,060.60	0.00
214	605287	德才股份	349	9,991.87	0.00
215	001212	中旗新材	308	9,951.48	0.00
216	605259	绿田机械	295	9,838.25	0.00
217	300978	东箭科技	530	9,571.80	0.00
218	001288	运机集团	537	9,563.97	0.00
219	301039	中集车辆	757	9,470.07	0.00
220	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00

221	300950	德固特	219	9,143.25	0.00
222	301028	东亚机械	676	9,126.00	0.00
223	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
224	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
225	605598	上海港湾	553	8,809.29	0.00
226	300968	格林精密	638	8,772.50	0.00
227	001209	洪兴股份	321	8,756.88	0.00
228	605138	盛泰集团	723	8,733.84	0.00
229	003041	真爱美家	349	8,690.10	0.00
230	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
231	605577	龙版传媒	588	8,625.96	0.00
232	301012	扬电科技	170	8,608.80	0.00
233	300975	商络电子	492	8,575.56	0.00
234	001202	炬申股份	459	8,551.17	0.00
235	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
236	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
237	300991	创益通	254	8,359.14	0.00
238	001219	青岛食品	272	8,323.20	0.00
239	300958	建工修复	300	8,103.00	0.00
240	300961	深水海纳	394	8,017.90	0.00
241	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
242	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
243	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
244	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
245	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
246	300955	嘉亨家化	232	7,625.84	0.00
247	300985	致远新能	154	7,549.08	0.00
248	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
249	300963	中洲特材	283	6,888.22	0.00
250	300972	万辰生物	430	6,815.50	0.00
251	300998	宁波方正	201	6,699.33	0.00
252	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
253	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
254	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
255	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
256	301007	德迈仕	303	6,035.76	0.00
257	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
258	301036	双乐股份	192	5,746.56	0.00
259	300952	恒辉安防	244	5,709.60	0.00



260	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
261	300995	奇德新材	191	5,292.61	0.00
262	301010	晶雪节能	218	5,227.64	0.00
263	300992	泰福泵业	200	4,950.00	0.00
264	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
265	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
266	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
267	300981	中红医疗	43	3,437.42	0.00
268	600176	中国巨石	108	1,965.60	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	000998	隆平高科	188,355,254.24	330.24
2	002041	登海种业	176,472,365.65	309.41
3	002385	大北农	172,438,330.56	302.34
4	300087	荃银高科	164,797,953.96	288.94
5	600371	万向德农	86,190,984.50	151.12
6	002714	牧原股份	65,295,755.95	114.48
7	601669	中国电建	47,166,866.80	82.70
8	300986	志特新材	41,953,544.54	73.56
9	601985	中国核电	40,908,644.00	71.73
10	000155	川能动力	40,604,084.34	71.19
11	002466	天齐锂业	40,326,891.00	70.71
12	002192	融捷股份	39,852,145.48	69.87
13	000786	北新建材	39,447,044.73	69.16
14	600483	福能股份	39,005,604.09	68.39
15	002438	江苏神通	36,911,843.00	64.72
16	300320	海达股份	36,671,782.08	64.30
17	600499	科达制造	36,421,106.81	63.86
18	300498	温氏股份	34,066,826.06	59.73
19	601800	中国交建	33,882,164.48	59.41
20	002179	中航光电	33,470,535.00	58.68
21	601952	苏垦农发	33,029,728.26	57.91

22	600285	羚锐制药	30,943,835.14	54.25
23	002043	兔宝宝	29,777,313.24	52.21
24	601636	旗滨集团	29,598,583.42	51.90
25	300761	立华股份	28,295,693.00	49.61
26	002322	理工环科	26,994,314.39	47.33
27	002982	湘佳股份	26,972,239.90	47.29
28	603985	恒润股份	25,119,710.20	44.04
29	300443	金雷股份	24,892,751.96	43.64
30	000807	云铝股份	24,197,711.00	42.43
31	600399	抚顺特钢	23,322,103.00	40.89
32	002233	塔牌集团	22,989,077.80	40.31
33	002100	天康生物	22,545,380.40	39.53
34	688265	南模生物	22,481,583.93	39.42
35	600958	东方证券	22,314,843.66	39.12
36	000933	神火股份	21,368,573.00	37.47
37	000858	五粮液	21,331,171.00	37.40
38	600893	航发动力	20,992,676.20	36.81
39	002240	盛新锂能	20,929,057.00	36.69
40	601377	兴业证券	20,444,493.81	35.85
41	002049	紫光国微	19,551,855.00	34.28
42	600801	华新水泥	19,380,398.30	33.98
43	002531	天顺风能	19,374,810.40	33.97
44	002508	老板电器	19,178,258.90	33.63
45	002060	粤水电	18,985,254.40	33.29
46	600018	上港集团	18,370,530.00	32.21
47	002756	永兴材料	18,043,581.00	31.64
48	603385	惠达卫浴	17,971,131.00	31.51
49	600011	华能国际	17,761,919.51	31.14
50	000776	广发证券	17,613,023.00	30.88
51	002460	赣锋锂业	17,479,469.00	30.65
52	603363	傲农生物	17,398,618.15	30.51
53	600282	南钢股份	17,396,853.28	30.50
54	601611	中国核建	16,764,836.00	29.39
55	000650	仁和药业	16,723,283.49	29.32
56	000301	东方盛虹	16,466,700.00	28.87
57	601877	正泰电器	16,172,403.00	28.36

58	000875	吉电股份	15,660,289.00	27.46
59	601899	紫金矿业	15,251,557.00	26.74
60	300390	天华超净	15,031,475.00	26.35
61	601615	明阳智能	14,956,309.58	26.22
62	002074	国轩高科	14,839,544.00	26.02
63	002202	金风科技	14,741,287.00	25.85
64	600085	同仁堂	13,353,092.10	23.41
65	301063	海锅股份	12,851,708.60	22.53
66	600030	中信证券	12,793,879.00	22.43
67	000789	万年青	12,470,345.86	21.86
68	600188	兖矿能源	12,423,992.00	21.78
69	688303	大全能源	12,325,469.29	21.61
70	002738	中矿资源	12,290,562.50	21.55
71	600089	特变电工	12,263,028.50	21.50
72	603218	日月股份	12,079,008.00	21.18
73	002026	山东威达	11,977,885.00	21.00
74	002483	润邦股份	11,947,297.60	20.95
75	600062	华润双鹤	11,531,913.88	20.22
76	600993	马应龙	11,473,959.42	20.12
77	600760	中航沈飞	11,463,057.08	20.10
78	000825	太钢不锈	11,415,909.00	20.02
79	002032	苏泊尔	11,315,811.60	19.84
80	002015	协鑫能科	11,294,268.38	19.80
81	601390	中国中铁	11,218,010.73	19.67
82	002791	坚朗五金	11,171,995.00	19.59
83	688123	聚辰股份	10,987,183.86	19.26
84	301166	优宁维	10,974,311.37	19.24
85	600745	闻泰科技	10,746,384.00	18.84
86	002352	顺丰控股	10,703,532.16	18.77
87	601688	华泰证券	10,309,489.00	18.08
88	002046	国机精工	10,234,537.97	17.94
89	600098	广州发展	9,952,632.30	17.45
90	002433	太安堂	9,854,995.00	17.28
91	002171	楚江新材	9,825,646.00	17.23
92	601600	中国铝业	9,763,316.00	17.12
93	300699	光威复材	9,666,523.00	16.95

94	002475	立讯精密	9,208,871.00	16.15
95	000999	华润三九	9,017,526.00	15.81
96	002728	特一药业	8,963,554.50	15.72
97	600884	杉杉股份	8,881,320.76	15.57
98	300196	长海股份	8,815,334.00	15.46
99	601001	晋控煤业	8,264,506.88	14.49
100	301177	迪阿股份	8,043,499.40	14.10
101	301118	恒光股份	8,037,090.56	14.09
102	600487	亨通光电	7,995,523.65	14.02
103	603129	春风动力	7,992,252.00	14.01
104	603612	索通发展	7,916,956.00	13.88
105	600522	中天科技	7,667,636.00	13.44
106	603799	华友钴业	7,525,901.20	13.20
107	300569	天能重工	7,522,393.52	13.19
108	300019	硅宝科技	7,402,268.00	12.98
109	300772	运达股份	7,373,836.00	12.93
110	000012	南玻 A	7,347,435.00	12.88
111	600176	中国巨石	7,328,523.80	12.85
112	002601	龙佰集团	7,309,188.00	12.82
113	300428	立中集团	7,301,929.86	12.80
114	601168	西部矿业	7,259,223.00	12.73
115	600519	贵州茅台	7,147,022.00	12.53
116	003022	联泓新科	7,054,470.00	12.37
117	688071	华依科技	7,026,258.79	12.32
118	603816	顾家家居	7,015,333.40	12.30
119	688599	天合光能	6,897,145.34	12.09
120	002532	天山铝业	6,767,095.00	11.86
121	300393	中来股份	6,748,849.00	11.83
122	600699	均胜电子	6,646,722.00	11.65
123	688087	英科再生	6,576,600.99	11.53
124	000002	万科 A	6,500,714.00	11.40
125	688798	艾为电子	6,474,900.62	11.35
126	002054	德美化工	6,427,585.58	11.27
127	601995	中金公司	6,308,223.54	11.06
128	600150	中国船舶	6,262,717.79	10.98
129	002091	江苏国泰	6,199,604.00	10.87

130	600596	新安股份	6,170,995.00	10.82
131	600886	国投电力	6,119,670.00	10.73
132	000739	普洛药业	6,106,034.00	10.71
133	300363	博腾股份	6,054,282.00	10.61
134	002025	航天电器	6,044,865.64	10.60
135	600582	天地科技	6,035,397.00	10.58
136	300610	晨化股份	5,991,664.00	10.51
137	603085	天成自控	5,988,323.00	10.50
138	688386	泛亚微透	5,986,038.79	10.50
139	300842	帝科股份	5,954,939.00	10.44
140	603993	洛阳钼业	5,830,870.00	10.22
141	600782	新钢股份	5,826,314.00	10.22
142	600111	北方稀土	5,826,269.00	10.22
143	300748	金力永磁	5,824,489.78	10.21
144	300260	新莱应材	5,770,681.00	10.12
145	688100	威胜信息	5,750,223.45	10.08
146	002182	云海金属	5,642,275.00	9.89
147	300358	楚天科技	5,627,576.00	9.87
148	600581	八一钢铁	5,599,955.00	9.82
149	300035	中科电气	5,491,894.00	9.63
150	002135	东南网架	5,456,380.00	9.57
151	603197	保隆科技	5,417,500.23	9.50
152	002068	黑猫股份	5,341,955.98	9.37
153	300193	佳士科技	5,247,692.00	9.20
154	600577	精达股份	5,238,180.00	9.18
155	300129	泰胜风能	5,233,713.00	9.18
156	000876	新希望	5,212,647.00	9.14
157	688556	高测股份	5,209,649.20	9.13
158	600989	宝丰能源	5,205,780.00	9.13
159	002458	益生股份	5,203,347.00	9.12
160	002402	和而泰	5,167,230.00	9.06
161	603638	艾迪精密	4,959,236.38	8.70
162	002124	天邦股份	4,863,832.00	8.53
163	002493	荣盛石化	4,757,732.00	8.34
164	300171	东富龙	4,747,253.17	8.32
165	688667	菱电电控	4,728,870.07	8.29

166	600486	扬农化工	4,717,679.00	8.27
167	300244	迪安诊断	4,658,166.18	8.17
168	002996	顺博合金	4,553,798.00	7.98
169	002920	德赛西威	4,547,614.00	7.97
170	603678	火炬电子	4,534,835.00	7.95
171	601058	赛轮轮胎	4,526,960.40	7.94
172	300073	当升科技	4,505,754.00	7.90
173	600352	浙江龙盛	4,404,298.00	7.72
174	600985	淮北矿业	4,383,504.18	7.69
175	601127	小康股份	4,151,997.61	7.28
176	300715	凯伦股份	4,132,209.00	7.25
177	605068	明新旭腾	4,111,532.00	7.21
178	002795	永和智控	4,110,940.36	7.21
179	002534	杭锅股份	4,082,462.00	7.16
180	600872	中炬高新	4,069,037.75	7.13
181	601388	怡球资源	4,054,720.00	7.11
182	688408	中信博	4,050,662.81	7.10
183	600529	山东药玻	4,003,434.00	7.02
184	000830	鲁西化工	3,968,032.27	6.96
185	688700	东威科技	3,933,773.44	6.90
186	688099	晶晨股份	3,898,473.15	6.84
187	300219	鸿利智汇	3,895,728.00	6.83
188	600489	中金黄金	3,856,663.00	6.76
189	300894	火星人	3,842,739.00	6.74
190	002312	川发龙蟒	3,814,990.50	6.69
191	603688	石英股份	3,783,190.00	6.63
192	300969	恒帅股份	3,736,649.00	6.55
193	605589	圣泉集团	3,703,803.00	6.49
194	300185	通裕重工	3,699,193.00	6.49
195	601238	广汽集团	3,675,622.80	6.44
196	688186	广大特材	3,662,321.52	6.42
197	002837	英维克	3,623,896.00	6.35
198	600941	中国移动	3,593,049.58	6.30
199	600060	海信视像	3,582,343.00	6.28
200	300379	东方通	3,519,750.00	6.17
201	300034	钢研高纳	3,472,845.00	6.09

202	002557	洽洽食品	3,472,785.00	6.09
203	688272	富吉瑞	3,471,854.28	6.09
204	002311	海大集团	3,469,968.00	6.08
205	601208	东材科技	3,450,498.20	6.05
206	002241	歌尔股份	3,445,822.00	6.04
207	688550	瑞联新材	3,444,152.79	6.04
208	600298	安琪酵母	3,436,209.00	6.02
209	688005	容百科技	3,432,617.94	6.02
210	000698	沈阳化工	3,431,457.00	6.02
211	002595	豪迈科技	3,430,525.32	6.01
212	688311	盟升电子	3,392,592.85	5.95
213	002299	圣农发展	3,380,144.22	5.93
214	600496	精工钢构	3,335,502.00	5.85
215	002916	深南电路	3,291,797.05	5.77
216	300332	天壕环境	3,256,433.00	5.71
217	000902	新洋丰	3,254,491.00	5.71
218	603113	金能科技	3,254,400.00	5.71
219	300059	东方财富	3,252,604.00	5.70
220	600039	四川路桥	3,244,310.00	5.69
221	688772	珠海冠宇	3,188,205.59	5.59
222	600063	皖维高新	3,184,969.00	5.58
223	601717	郑煤机	3,160,083.00	5.54
224	688680	海优新材	3,149,466.51	5.52
225	600963	岳阳林纸	3,137,977.00	5.50
226	600598	北大荒	3,103,544.00	5.44
227	605389	长龄液压	3,091,711.76	5.42
228	688800	瑞可达	3,084,672.57	5.41
229	300416	苏试试验	3,078,591.10	5.40
230	600141	兴发集团	3,071,547.00	5.39
231	603589	口子窖	3,070,406.00	5.38
232	603109	神驰机电	3,055,683.00	5.36
233	601225	陕西煤业	3,000,583.00	5.26
234	600346	恒力石化	2,972,019.00	5.21
235	688122	西部超导	2,967,862.25	5.20
236	002157	正邦科技	2,963,168.00	5.20
237	688526	科前生物	2,928,666.46	5.13

238	601166	兴业银行	2,923,206.00	5.13
239	002484	江海股份	2,921,242.00	5.12
240	688598	金博股份	2,911,966.60	5.11
241	002709	天赐材料	2,864,740.00	5.02
242	601233	桐昆股份	2,841,014.40	4.98
243	002035	华帝股份	2,776,469.00	4.87
244	300682	朗新科技	2,702,523.50	4.74
245	300679	电连技术	2,680,637.00	4.70
246	600160	巨化股份	2,663,615.40	4.67
247	603396	金辰股份	2,663,451.00	4.67
248	600436	片仔癀	2,652,639.00	4.65
249	601118	海南橡胶	2,521,781.05	4.42
250	002487	大金重工	2,463,770.00	4.32
251	688607	康众医疗	2,402,624.99	4.21
252	002234	民和股份	2,358,172.00	4.13
253	600096	云天化	2,299,821.00	4.03
254	300374	中铁装配	2,295,359.00	4.02
255	002507	涪陵榨菜	2,205,152.70	3.87
256	300648	星云股份	2,188,213.00	3.84
257	300887	谱尼测试	2,181,139.00	3.82
258	688235	百济神州	2,174,454.00	3.81
259	600887	伊利股份	2,169,017.00	3.80
260	603501	韦尔股份	2,143,020.00	3.76
261	301050	雷电微力	2,123,112.96	3.72
262	002555	三七互娱	2,092,250.22	3.67
263	601038	一拖股份	2,070,019.00	3.63
264	688633	星球石墨	2,051,242.43	3.60
265	002706	良信股份	2,046,567.50	3.59
266	605166	聚合顺	2,043,438.00	3.58
267	002978	安宁股份	2,042,940.00	3.58
268	688022	瀚川智能	2,042,772.45	3.58
269	601677	明泰铝业	2,028,702.00	3.56
270	603259	药明康德	2,003,635.50	3.51
271	002623	亚玛顿	1,991,100.00	3.49
272	688329	艾隆科技	1,980,606.47	3.47
273	600703	三安光电	1,962,881.00	3.44



274	002624	完美世界	1,946,935.45	3.41
275	300369	绿盟科技	1,945,853.00	3.41
276	688131	皓元医药	1,896,016.09	3.32
277	002541	鸿路钢构	1,847,677.00	3.24
278	600449	宁夏建材	1,838,994.00	3.22
279	300582	英飞特	1,826,847.00	3.20
280	603867	新化股份	1,824,668.80	3.20
281	002957	科瑞技术	1,819,730.00	3.19
282	300233	金城医药	1,771,276.00	3.11
283	688388	嘉元科技	1,752,904.45	3.07
284	600284	浦东建设	1,752,302.75	3.07
285	300568	星源材质	1,752,113.00	3.07
286	002759	天际股份	1,747,076.00	3.06
287	600123	兰花科创	1,746,773.00	3.06
288	600895	张江高科	1,746,350.00	3.06
289	600409	三友化工	1,742,805.00	3.06
290	300496	中科创达	1,740,228.00	3.05
291	600639	浦东金桥	1,736,207.00	3.04
292	601808	中海油服	1,727,966.00	3.03
293	000059	华锦股份	1,724,763.00	3.02
294	300750	宁德时代	1,715,850.00	3.01
295	603986	兆易创新	1,657,260.00	2.91
296	600970	中材国际	1,651,876.09	2.90
297	688007	光峰科技	1,640,435.85	2.88
298	688779	长远锂科	1,618,595.80	2.84
299	600732	爱旭股份	1,614,961.00	2.83
300	688191	智洋创新	1,606,675.02	2.82
301	301018	申菱环境	1,583,871.00	2.78
302	603916	苏博特	1,571,133.00	2.75
303	000877	天山股份	1,570,520.00	2.75
304	300809	华辰装备	1,562,730.00	2.74
305	603203	快克股份	1,555,818.00	2.73
306	300365	恒华科技	1,553,632.00	2.72
307	603882	金域医学	1,545,644.00	2.71
308	300142	沃森生物	1,542,970.00	2.71
309	300785	值得买	1,509,312.00	2.65

310	601898	中煤能源	1,501,843.00	2.63
311	600552	凯盛科技	1,449,822.00	2.54
312	600257	大湖股份	1,440,955.00	2.53
313	300316	晶盛机电	1,426,607.00	2.50
314	000911	南宁糖业	1,414,793.00	2.48
315	600378	昊华科技	1,381,102.00	2.42
316	603893	瑞芯微	1,353,834.00	2.37
317	300487	蓝晓科技	1,247,313.00	2.19
318	002743	富煌钢构	1,242,402.00	2.18
319	603938	三孚股份	1,226,352.00	2.15
320	688078	龙软科技	1,199,330.83	2.10
321	600741	华域汽车	1,152,771.82	2.02
322	600610	中毅达	1,146,833.00	2.01

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。

#### 8.4.2 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	000155	川能动力	43,799,425.06	76.79
2	600499	科达制造	40,853,341.27	71.63
3	002466	天齐锂业	38,721,747.00	67.89
4	002192	融捷股份	36,201,978.00	63.47
5	000807	云铝股份	29,509,745.57	51.74
6	000933	神火股份	24,871,091.67	43.61
7	603985	恒润股份	24,235,335.31	42.49
8	002240	盛新锂能	24,203,429.32	42.44
9	002100	天康生物	22,601,459.15	39.63
10	002531	天顺风能	22,129,327.95	38.80
11	002756	永兴材料	20,245,398.00	35.50
12	603363	傲农生物	18,965,640.84	33.25
13	601877	正泰电器	18,527,476.00	32.48
14	000650	仁和药业	18,420,972.69	32.30
15	300390	天华超净	17,377,591.70	30.47
16	002460	赣锋锂业	17,029,567.20	29.86
17	601615	明阳智能	16,006,432.00	28.06
18	300320	海达股份	15,459,210.00	27.10
19	000301	东方盛虹	15,428,006.00	27.05

20	300443	金雷股份	14,913,991.00	26.15
21	002074	国轩高科	14,126,518.00	24.77
22	002015	协鑫能科	13,919,977.00	24.41
23	002049	紫光国微	13,252,460.00	23.24
24	002026	山东威达	13,003,113.24	22.80
25	002046	国机精工	12,474,475.00	21.87
26	002738	中矿资源	12,196,141.00	21.38
27	688123	聚辰股份	12,175,701.66	21.35
28	600760	中航沈飞	11,842,160.00	20.76
29	300498	温氏股份	11,837,564.59	20.75
30	301063	海锅股份	11,623,298.56	20.38
31	600745	闻泰科技	11,429,171.57	20.04
32	002483	润邦股份	11,308,926.40	19.83
33	000999	华润三九	10,609,423.00	18.60
34	300772	运达股份	10,386,908.00	18.21
35	002433	太安堂	10,366,277.00	18.18
36	600884	杉杉股份	10,355,967.00	18.16
37	688087	英科再生	9,861,753.29	17.29
38	600522	中天科技	9,786,466.93	17.16
39	688303	大全能源	9,750,773.02	17.10
40	603612	索通发展	9,631,380.00	16.89
41	601001	晋控煤业	9,446,505.00	16.56
42	601168	西部矿业	9,410,384.00	16.50
43	603799	华友钴业	9,317,924.00	16.34
44	600399	抚顺特钢	9,235,041.54	16.19
45	601600	中国铝业	9,025,158.00	15.82
46	300569	天能重工	8,954,432.50	15.70
47	002532	天山铝业	8,878,580.60	15.57
48	600577	精达股份	8,800,922.28	15.43
49	600011	华能国际	8,702,623.00	15.26
50	601636	旗滨集团	8,617,240.00	15.11
51	600989	宝丰能源	8,508,245.00	14.92
52	600893	航发动力	8,311,120.88	14.57
53	688071	华依科技	8,304,689.05	14.56
54	300196	长海股份	8,206,224.25	14.39
55	000012	南玻 A	8,196,824.00	14.37
56	300035	中科电气	7,913,677.00	13.88
57	000876	新希望	7,702,469.41	13.50

58	600188	兖矿能源	7,686,847.00	13.48
59	002054	德美化工	7,621,462.00	13.36
60	002493	荣盛石化	7,488,908.10	13.13
61	688599	天合光能	7,424,882.08	13.02
62	600483	福能股份	7,305,816.00	12.81
63	600176	中国巨石	7,216,951.60	12.65
64	600487	亨通光电	7,214,734.00	12.65
65	300260	新莱应材	7,214,029.00	12.65
66	300193	佳士科技	7,039,226.00	12.34
67	002182	云海金属	6,995,472.89	12.27
68	300019	硅宝科技	6,989,761.00	12.26
69	300393	中来股份	6,611,209.00	11.59
70	603197	保隆科技	6,607,677.00	11.59
71	002311	海大集团	6,590,560.00	11.56
72	300428	立中集团	6,546,241.00	11.48
73	002025	航天电器	6,525,940.00	11.44
74	000002	万科 A	6,489,295.00	11.38
75	002091	江苏国泰	6,409,254.00	11.24
76	688100	威胜信息	6,393,105.27	11.21
77	601995	中金公司	6,373,810.00	11.18
78	002714	牧原股份	6,353,761.12	11.14
79	603085	天成自控	6,182,085.56	10.84
80	600150	中国船舶	6,017,094.00	10.55
81	301177	迪阿股份	5,979,829.04	10.48
82	300842	帝科股份	5,829,138.18	10.22
83	301118	恒光股份	5,776,336.38	10.13
84	300363	博腾股份	5,772,742.00	10.12
85	600111	北方稀土	5,728,035.00	10.04
86	600886	国投电力	5,710,190.30	10.01
87	600581	八一钢铁	5,706,934.00	10.01
88	300748	金力永磁	5,692,064.00	9.98
89	600782	新钢股份	5,652,733.00	9.91
90	002601	龙佰集团	5,627,734.00	9.87
91	600582	天地科技	5,627,145.00	9.87
92	688556	高测股份	5,621,005.42	9.86
93	688386	泛亚微透	5,424,363.71	9.51
94	603638	艾迪精密	5,356,733.17	9.39
95	002124	天邦股份	5,207,676.66	9.13

96	000739	普洛药业	5,188,826.00	9.10
97	300219	鸿利智汇	5,178,568.55	9.08
98	002312	川发龙蟒	5,150,481.00	9.03
99	003022	联泓新科	5,148,644.00	9.03
100	002920	德赛西威	5,100,640.00	8.94
101	002402	和而泰	5,061,404.00	8.87
102	688667	菱电电控	5,055,109.53	8.86
103	300610	晨化股份	5,028,002.75	8.82
104	002135	东南网架	5,003,757.76	8.77
105	002996	顺博合金	4,981,220.00	8.73
106	600699	均胜电子	4,974,684.88	8.72
107	603678	火炬电子	4,914,052.75	8.62
108	688700	东威科技	4,913,139.09	8.61
109	300073	当升科技	4,886,566.00	8.57
110	600486	扬农化工	4,828,765.00	8.47
111	300358	楚天科技	4,827,965.00	8.46
112	000830	鲁西化工	4,799,446.00	8.41
113	688099	晶晨股份	4,765,499.30	8.36
114	300379	东方通	4,738,359.80	8.31
115	002458	益生股份	4,734,247.80	8.30
116	000875	吉电股份	4,731,685.00	8.30
117	600596	新安股份	4,720,469.00	8.28
118	601127	小康股份	4,699,508.00	8.24
119	300129	泰胜风能	4,698,862.00	8.24
120	603993	洛阳钼业	4,694,626.00	8.23
121	002068	黑猫股份	4,657,719.00	8.17
122	300969	恒帅股份	4,624,262.00	8.11
123	605068	明新旭腾	4,584,508.00	8.04
124	601899	紫金矿业	4,584,072.00	8.04
125	601058	赛轮轮胎	4,560,720.94	8.00
126	605589	圣泉集团	4,501,580.00	7.89
127	300034	钢研高纳	4,473,508.00	7.84
128	688772	珠海冠宇	4,418,329.29	7.75
129	300171	东富龙	4,416,550.00	7.74
130	601233	桐昆股份	4,398,770.60	7.71
131	300244	迪安诊断	4,394,380.64	7.70
132	600346	恒力石化	4,356,887.00	7.64
133	002534	杭锅股份	4,219,195.00	7.40

134	688186	广大特材	4,217,033.92	7.39
135	603688	石英股份	4,183,643.00	7.34
136	600872	中炬高新	4,179,247.66	7.33
137	601238	广汽集团	4,128,469.80	7.24
138	600985	淮北矿业	4,100,812.14	7.19
139	688272	富吉瑞	4,096,802.57	7.18
140	300185	通裕重工	4,085,844.00	7.16
141	300332	天壕环境	4,085,057.00	7.16
142	002241	歌尔股份	4,057,996.00	7.11
143	601208	东材科技	4,012,541.00	7.04
144	002837	英维克	3,961,357.00	6.95
145	688800	瑞可达	3,942,420.13	6.91
146	600060	海信视像	3,935,410.00	6.90
147	002299	圣农发展	3,916,519.00	6.87
148	601717	郑煤机	3,913,206.00	6.86
149	600963	岳阳林纸	3,888,285.62	6.82
150	002795	永和智控	3,844,853.00	6.74
151	688598	金博股份	3,823,200.00	6.70
152	600489	中金黄金	3,805,843.00	6.67
153	600352	浙江龙盛	3,779,312.00	6.63
154	002179	中航光电	3,772,965.00	6.62
155	600089	特变电工	3,729,136.00	6.54
156	002557	洽洽食品	3,725,311.00	6.53
157	000698	沈阳化工	3,664,097.00	6.42
158	688005	容百科技	3,636,663.40	6.38
159	688311	盟升电子	3,620,652.26	6.35
160	600529	山东药玻	3,590,786.00	6.30
161	601669	中国电建	3,524,180.00	6.18
162	600298	安琪酵母	3,519,135.00	6.17
163	002487	大金重工	3,515,030.00	6.16
164	002595	豪迈科技	3,514,419.00	6.16
165	300894	火星人	3,509,949.22	6.15
166	688408	中信博	3,466,047.78	6.08
167	600958	东方证券	3,426,733.00	6.01
168	688122	西部超导	3,413,928.00	5.99
169	300679	电连技术	3,407,471.68	5.97
170	300416	苏试试验	3,388,604.40	5.94
171	002043	兔宝宝	3,386,456.32	5.94

172	688550	瑞联新材	3,356,792.88	5.89
173	000776	广发证券	3,354,172.00	5.88
174	300648	星云股份	3,329,583.00	5.84
175	603589	口子窖	3,315,242.00	5.81
176	600496	精工钢构	3,307,044.00	5.80
177	002060	粤水电	3,303,916.00	5.79
178	605389	长龄液压	3,235,453.26	5.67
179	600436	片仔癀	3,219,291.00	5.64
180	300059	东方财富	3,170,349.00	5.56
181	300682	朗新科技	3,164,686.00	5.55
182	300715	凯伦股份	3,126,022.00	5.48
183	601225	陕西煤业	3,033,736.00	5.32
184	600039	四川路桥	3,023,920.00	5.30
185	000902	新洋丰	3,007,828.34	5.27
186	600887	伊利股份	3,003,117.00	5.27
187	600063	皖维高新	2,976,661.00	5.22
188	601166	兴业银行	2,916,202.00	5.11
189	601388	怡球资源	2,897,380.00	5.08
190	688526	科前生物	2,831,478.31	4.96
191	603893	瑞芯微	2,773,898.00	4.86
192	002484	江海股份	2,765,067.00	4.85
193	002916	深南电路	2,718,231.00	4.77
194	603109	神驰机电	2,717,279.00	4.76
195	300233	金城医药	2,667,258.00	4.68
196	600160	巨化股份	2,666,448.60	4.68
197	002035	华帝股份	2,621,752.00	4.60
198	002157	正邦科技	2,611,760.02	4.58
199	002709	天赐材料	2,590,694.00	4.54
200	600598	北大荒	2,590,587.00	4.54
201	601118	海南橡胶	2,564,269.00	4.50
202	688329	艾隆科技	2,559,522.30	4.49
203	301050	雷电微力	2,554,971.00	4.48
204	600141	兴发集团	2,496,511.00	4.38
205	603113	金能科技	2,483,135.00	4.35
206	688607	康众医疗	2,474,353.00	4.34
207	688779	长远锂科	2,438,363.12	4.28
208	603396	金辰股份	2,378,666.00	4.17
209	002234	民和股份	2,303,294.00	4.04

210	605166	聚合顺	2,283,573.00	4.00
211	603501	韦尔股份	2,258,720.00	3.96
212	688191	智洋创新	2,245,827.53	3.94
213	688680	海优新材	2,236,734.88	3.92
214	300369	绿盟科技	2,231,227.84	3.91
215	002978	安宁股份	2,220,985.00	3.89
216	688633	星球石墨	2,194,830.91	3.85
217	603259	药明康德	2,191,051.00	3.84
218	603986	兆易创新	2,156,312.00	3.78
219	300887	谱尼测试	2,137,608.00	3.75
220	601677	明泰铝业	2,137,204.00	3.75
221	600703	三安光电	2,118,990.00	3.72
222	688131	皓元医药	2,114,278.42	3.71
223	002759	天际股份	2,101,407.00	3.68
224	002541	鸿路钢构	2,077,910.34	3.64
225	300496	中科创达	2,012,245.00	3.53
226	600409	三友化工	1,984,752.00	3.48
227	600096	云天化	1,976,441.00	3.47
228	688022	瀚川智能	1,952,866.10	3.42
229	300582	英飞特	1,937,870.00	3.40
230	600123	兰花科创	1,922,569.00	3.37
231	600378	昊华科技	1,905,840.00	3.34
232	002957	科瑞技术	1,883,364.30	3.30
233	300374	中铁装配	1,875,454.00	3.29
234	601808	中海油服	1,866,981.00	3.27
235	002507	涪陵榨菜	1,846,459.00	3.24
236	688388	嘉元科技	1,812,850.27	3.18
237	002623	亚玛顿	1,808,721.00	3.17
238	688235	百济神州	1,806,684.59	3.17
239	600639	浦东金桥	1,792,700.00	3.14
240	600449	宁夏建材	1,790,355.00	3.14
241	600552	凯盛科技	1,776,884.00	3.12
242	600801	华新水泥	1,773,198.00	3.11
243	600732	爱旭股份	1,771,484.00	3.11
244	600284	浦东建设	1,764,651.78	3.09
245	300568	星源材质	1,759,539.00	3.09
246	300750	宁德时代	1,754,302.00	3.08
247	600895	张江高科	1,747,077.00	3.06



248	603867	新化股份	1,725,344.00	3.03
249	603203	快克股份	1,721,996.00	3.02
250	301018	申菱环境	1,701,901.00	2.98
251	300365	恒华科技	1,672,745.00	2.93
252	601038	一拖股份	1,669,542.00	2.93
253	002706	良信股份	1,665,650.00	2.92
254	000877	天山股份	1,626,119.00	2.85
255	601898	中煤能源	1,609,455.00	2.82
256	300316	晶盛机电	1,551,008.00	2.72
257	603916	苏博特	1,530,117.00	2.68
258	688078	龙软科技	1,465,414.27	2.57
259	002555	三七互娱	1,453,472.00	2.55
260	688686	奥普特	1,451,251.99	2.54
261	600257	大湖股份	1,448,201.00	2.54
262	000059	华锦股份	1,417,902.48	2.49
263	600970	中材国际	1,413,677.41	2.48
264	000911	南宁糖业	1,403,971.71	2.46
265	603938	三孚股份	1,400,448.00	2.46
266	688007	光峰科技	1,397,733.03	2.45
267	002036	联创电子	1,390,575.00	2.44
268	002624	完美世界	1,317,796.00	2.31
269	300142	沃森生物	1,309,118.00	2.30
270	300809	华辰装备	1,303,655.00	2.29
271	300785	值得买	1,292,836.00	2.27
272	300953	震裕科技	1,252,281.75	2.20
273	002743	富煌钢构	1,215,868.00	2.13
274	300680	隆盛科技	1,215,033.80	2.13
275	603882	金域医学	1,205,264.00	2.11

注：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。

### 8.4.3 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	3,547,795,232.01
卖出股票收入（成交）总额	1,686,795,560.87

### 8.5 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	2,244,448.80	0.10
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,244,448.80	0.10

### 8.6 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	2,244,448.80	0.10

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 8.10.2 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。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 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。

#### 8.11.2 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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。

### 8.12.2 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

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。

### 8.12.3 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	963,926.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	38,522.09
5	应收申购款	11,450,485.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,452,933.94

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
102,294	8,418.21	596,861,974.68	69.31%	264,270,903.40	30.69%

### 9.2 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	755,351.33	0.0877%

### 9.3 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

**§ 10 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	1,139,093,678.45
减:本报告期基金总赎回份额	311,654,016.69
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	861,132,878.08

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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：

公司高级管理人员：

2021 年 3 月 16 日，公司聘任陈广益先生担任公司总经理。

2021 年 7 月 20 日，公司聘任戴晓云女士担任公司副总经理。

2021 年 7 月 20 日，李杰先生因个人原因离职，不再担任本公司副总经理职务。

2021 年 7 月 24 日，公司聘任王静女士担任公司副总经理。

2021 年 8 月 28 日，满黎先生因个人原因离职，不再担任本公司副总经理职务。

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。

本报告期内，本基金托管人 2021 年 8 月 13 日发布公告，国然女士自 2021 年 8 月 9 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。

### 11.3 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事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期期内基金投资策略未发生改变。

### 11.5 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。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	2,573,373,905.84	49.36%	2,396,588.36	50.99%	-
国泰君安	1	2,055,733,054.70	39.43%	1,790,337.63	38.09%	-
浙商证券	1	584,138,757.60	11.20%	513,400.62	10.92%	-
中航证券	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、个股分析的报告及丰富全面的信息;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：

本报告期内，本基金新增中航证券交易单元 1 个。

### 11.7.2 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	成交金额	占当期权证成交总额的比例

				的比例		
招商证券	9,283,327.38	56.43%	-	-	-	-
国泰君安	7,166,853.50	43.57%	200,000,000.00	100.00%	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。



## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准万家瑞隆混合型证券投资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、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 年年度报告原文。
- 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》。

### 13.2 存放地点

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

### 13.3 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

2022 年 3 月 30 日