

万家瑞隆混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
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
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	53

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	53
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	53
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 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	1, 016, 357, 076. 90 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	万家瑞隆 A	万家瑞隆 C
下属分级基金的交易代码	003751	015384
报告期末下属分级基金的份额总额	947, 213, 352. 26 份	69, 143, 724. 64 份

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
	联系电话	021-38909626
	电子邮箱	lanj@wjasset.com
客户服务电话	4008880800	95577
传真	021-38909627	010-85238680
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	北京市东城区建国门内大街 22 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	北京市东城区建国门内大街 22 号
邮政编码	200122	100005

法定代表人	方一天	李民吉
-------	-----	-----

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日)	2022 年 03 月 17 日（基金合同生效日）-2022 年 06 月 30 日
	万家瑞隆 A	万家瑞隆 C
本期已实现收益	-192,793,727.93	-12,811,305.92
本期利润	-394,941,923.87	-7,982,859.65
加权平均基金份额本期利润	-0.3671	-0.0986
本期加权平均净值利润率	-15.59%	-4.34%
本期基金份额净值增长率	-13.47%	2.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	923,709,127.75	67,230,520.25
期末可供分配基金份额利润	0.9752	0.9723
期末基金资产净值	2,193,172,828.66	159,900,412.31
期末基金份额净值	2.3154	2.3126
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	131.54%	2.47%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

万家瑞隆 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.16%	0.83%	7.15%	0.80%	-7.31%	0.03%
过去三个月	-3.46%	1.67%	5.04%	1.07%	-8.50%	0.60%
过去六个月	-13.47%	1.73%	-6.34%	1.09%	-7.13%	0.64%
过去一年	16.41%	1.65%	-9.34%	0.93%	25.75%	0.72%
过去三年	129.00%	1.71%	17.77%	0.95%	111.23%	0.76%
自基金合同生效起至今	131.54%	1.51%	26.10%	0.88%	105.44%	0.63%

万家瑞隆 C

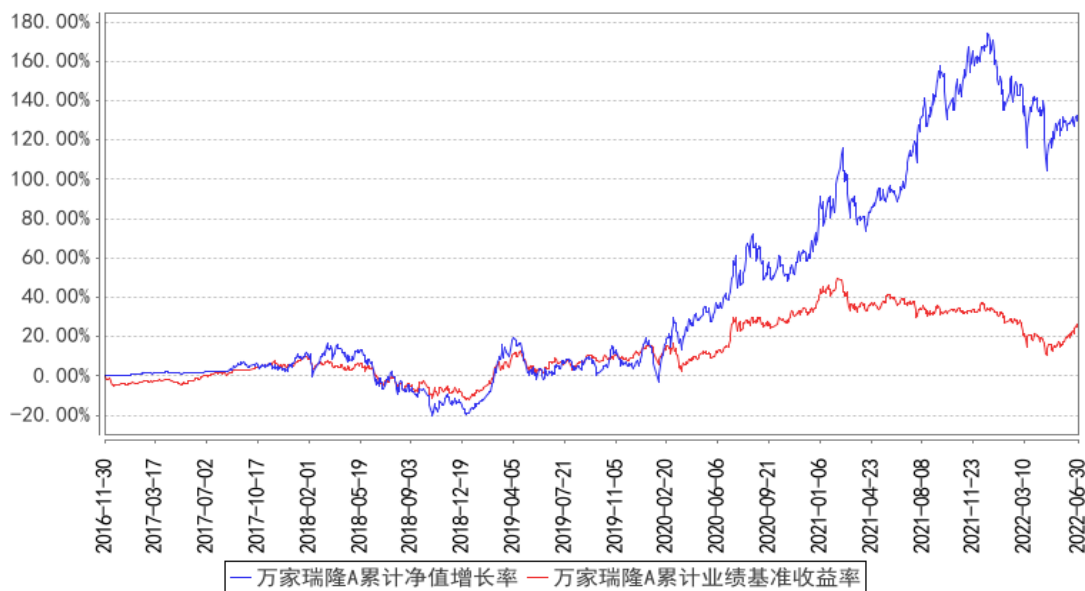
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.21%	0.83%	7.15%	0.80%	-7.36%	0.03%
过去三个月	-3.59%	1.67%	5.04%	1.07%	-8.63%	0.60%
自基金合同生效起至今	2.47%	1.60%	6.37%	1.05%	-3.90%	0.55%

注：1、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%

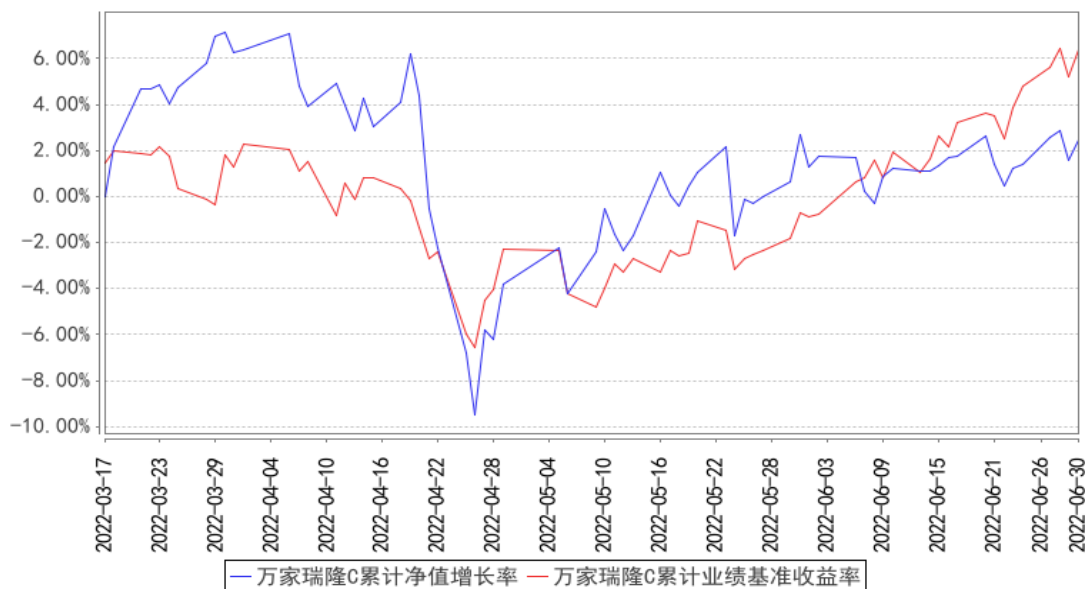
2、自 2022 年 3 月 17 日起，增设本基金 C 类份额，详情请参阅相关公告。

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A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



万家瑞隆C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：1、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。2018 年 4 月 17 日本基金表决通过了《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》，“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决议自该日起生效。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。

2、自 2022 年 3 月 17 日起，增设本基金 C 类份额，详情请参阅相关公告。

§ 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、山东省新动能基金管理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。目前管理一百零九只开放式基金,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、万家瑞瑞债券型证券投资基金、万家臻选混合型证券投资基金、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基

金、万家成长优选灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金、万家经济新动能混合型证券投资基金、万家潜力价值灵活配置混合型证券投资基金、万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家新机遇龙头企业灵活配置混合型证券投资基金、万家智造优势混合型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型证券投资基金、万家人工智能混合型证券投资基金、万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金 (LOF)、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、万家平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、万家科创主题灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、万家鑫盛纯债债券型证券投资基金、万家民安增利 12 个月定期开放债券型证券投资基金、万家汽车新趋势混合型证券投资基金、万家惠享 39 个月定期开放债券型证券投资基金、万家科技创新混合型证券投资基金、万家自主创新混合型证券投资基金、万家民丰回报一年持有期混合型证券投资基金、万家可转债债券型证券投资基金、万家民瑞祥和 6 个月持有期债券型证券投资基金、万家价值优势一年持有期混合型证券投资基金、万家养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、万家鑫动力月月购一年滚动持有混合型证券投资基金、万家科创板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家创业板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家周期优势企业混合型证券投资基金、万家健康产业混合型证券投资基金、万家互联互通中国优势量化策略混合型证券投资基金、万家战略发展产业混合型证券投资基金、万家创业板指数增强型证券投资基金、万家陆家嘴金融城金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家内需增长一年持有期混合型证券投资基金、万家互联互通核心资产量化策略混合型证券投资基金、万家民瑞祥明 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家瑞泽回报一年持有期混合型证券投资基金、万家惠裕回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、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、万家港股通精选混合型证券投资基金、万家景气驱动混合型证券投资基金、万家安恒纯债 3 个月持有期债券型发起式证券投资基金、万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫橙纯债债券型证券投资基金、万家聚优稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、万家新能源主题混合型发起式证券投资基金、万家中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金。

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、万家景气驱动混合型证券投资基金、万家周期优势企业混合型证券投资基金的基金经理	2018年9月18日	-	10.5年	上海社会科学院财政学硕士。2006年7月至2008年4月在中国建设银行洛阳分行担任国际业务部业务人员；2012年7月至2015年4月在宏源证券股份有限公司研究所担任研究员；2015年4月至2015年10月在沃胜资产管理有限公司研究部担任研究员；2015年11月加入万家基金管理有限公司，先后担任投资研究部研究员、基金经理助理，2018年9月起担任基金经理职务。

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

公司制订了明确的投资授权制度，并建立了统一的投资管理平台，确保不同投资组合获得公平的投资决策机会。实行集中交易制度，对于交易所公开竞价交易，执行交易系统内的公平交易程序；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，原则上按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；对于银行间交易，按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。为保证公平交易原则的实现，通过制度规范、流程审批、系统风控参数设置等进行事前控制，通过对投资交易系统的实时监控进行事中控制，通过对异常交易的监控和分析实现事后

控制。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 2 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

受疫情反复、欧美滞胀担忧以及俄乌冲突等因素影响，上半年 A 股走势大幅震荡，4 月底之前 A 股大幅下行，随后在新能源、消费等板块带领下开始反弹。总体来看，上半年煤炭、石油等上游资源品以及建筑、汽车等板块涨幅较好；军工和 TMT 等板块表现较差。

上半年万家瑞隆主要配置了农业、稳增长和新能源板块，其中农业板块以生物育种和生猪养殖为主，稳增长板块以建筑和地产为主，新能源板块主要配置了新能源汽车产业链和新能源运营标的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家瑞隆 A 的基金份额净值为 2.3154 元，本报告期基金份额净值增长率为 -13.47%，同期业绩比较基准收益率为 -6.34%，截至本报告期末万家瑞隆 C 的基金份额净值为 2.3126 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.47%，同期业绩比较基准收益率为 6.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，欧美经济有衰退的风险，或将影响国内出口；且受疫情反复影响，消费相对疲弱，下半年国内经济增长压力仍在。此外，在猪价上行影响下，预计国内通胀有超预期的风险，或将制约国内宽松的货币政策。市场在前期快速上涨后，预计会重回震荡走势。

投资方面，万家瑞隆继续看好处于周期上行阶段且成长空间巨大的生物育种板块：在全球气候异常下，预计粮食价格将维持在高位，种子板块维持高景气；且预计转基因玉米种子有望在下个销售季开始销售，将打开种子板块成长空间。此外，看好受益于猪价上涨和生猪产能恢复的养殖后周期——动保板块，以及中长期景气度上行的新能源板块。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了估值委员会,定期评价现行估值政策和程序,在发生了影响估值政策和程序有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。估值委员会由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》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

托管人认为,由基金管理人编制并经托管人复核的本基金 2022 年中期报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：万家瑞隆混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	88,650,045.79	181,637,903.20
结算备付金		2,529,671.06	5,702,188.06
存出保证金		1,835,986.14	963,926.19
交易性金融资产	6.4.7.2	2,293,709,721.86	2,076,989,156.54
其中：股票投资		2,186,975,056.38	2,074,744,707.74
基金投资		-	-
债券投资		106,734,665.48	2,244,448.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	100,000,000.00
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		38,263,493.62	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,639,689.16	11,450,485.66
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	38,522.09
资产总计		2,427,628,607.63	2,376,782,181.74
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	57,464,288.49
应付赎回款		68,036,172.02	9,896,422.59

应付管理人报酬		3,225,764.04	2,039,053.46
应付托管费		430,101.85	271,873.79
应付销售服务费		95,970.96	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		34.61	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	2,767,323.18	3,010,950.02
负债合计		74,555,366.66	72,682,588.35
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,016,357,076.90	861,132,878.08
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	1,336,716,164.07	1,442,966,715.31
净资产合计		2,353,073,240.97	2,304,099,593.39
负债和净资产总计		2,427,628,607.63	2,376,782,181.74

注：1、报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,016,357,076.90 份，其中万家瑞隆 A 基金份额净值 2.3154 元，基金份额总额 947,213,352.26；万家瑞隆 C 基金份额净值 2.3126 元，基金份额总额 69,143,724.64。

2、比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：万家瑞隆混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-380,395,195.36	17,284,838.32
1. 利息收入		519,876.68	34,793.55
其中：存款利息收入	6.4.7.10	465,210.41	29,308.47
债券利息收入		-	5,485.08
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		54,666.27	-
证券出借利息收入		-	-

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-188,884,006.19	25,352,932.34
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-200,412,424.31	23,809,679.72
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	187,133.38	67,746.41
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	11,341,284.74	1,475,506.21
以摊余成本计量的金 融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.17	-197,319,749.67	-9,110,492.62
4. 汇兑收益（损失以“-”号 填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号 填列）	6.4.7.18	5,288,683.82	1,007,605.05
减：二、营业总支出		22,529,588.16	2,601,813.20
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	19,558,647.34	1,109,793.58
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,607,819.65	147,972.46
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	264,552.35	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支 出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		8.67	2.00
8. 其他费用	6.4.7.20	98,560.15	1,344,045.16
三、利润总额（亏损总额以 “-”号填列）		-402,924,783.52	14,683,025.12
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-402,924,783.52	14,683,025.12
五、其他综合收益的税后净 额		-	-
六、综合收益总额		-402,924,783.52	14,683,025.12

注：比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他 综合 收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	861,132,878.08	-	1,442,966,715.31	2,304,099,593.39
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	861,132,878.08	-	1,442,966,715.31	2,304,099,593.39
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	155,224,198.82	-	-106,250,551.24	48,973,647.58
(一)、综合收益总额	-	-	-402,924,783.52	-402,924,783.52
(二)、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)	155,224,198.82	-	296,674,232.28	451,898,431.10
其中：1. 基金申购款	920,001,152.54	-	1,298,306,958.36	2,218,308,110.90
2. 基金赎回款	-764,776,953.72	-	-1,001,632,726.08	-1,766,409,679.80
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	1,016,357,076.90	-	1,336,716,164.07	2,353,073,240.97
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他 综合 收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产 (基金净值)	33,693,216.32	-	23,342,071.20	57,035,287.52
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	33,693,216.32	-	23,342,071.20	57,035,287.52
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	91,405,356.58	-	100,381,267.84	191,786,624.42
(一)、综合收益总额	-	-	14,683,025.12	14,683,025.12
(二)、本期基金份额 交易产生的基金净值 变动数 (净值减少以“-”号 填列)	91,405,356.58	-	85,698,242.72	177,103,599.30
其中: 1. 基金申购款	182,703,138.06	-	169,043,904.64	351,747,042.70
2. 基金赎回款	-91,297,781.48	-	-83,345,661.92	-174,643,443.40
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	125,098,572.90	-	123,723,339.04	248,821,911.94

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《万家瑞隆混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，经与本基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，2022 年 3 月 17 日起，本基金增设 C 类基金份额。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编

制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》中国证监会制定的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法（2020 年修订）》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本中期报告所采用的在金融工具相关会计准则上与上年度报告不一致，其他会计政策、会计估计与上年度报告一致。

会计政策变更：

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，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新准则与现行准则的差异追溯调整报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。本基金需考虑自身业务模式以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金在编制 2022 年中期财务报表时已采用上述准则，对本基金财务报表的影响具体请参见附注 6.4.5.1 会计政策变更的说明。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

自 2022 年 1 月 1 日起适用

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、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金目前暂无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

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变动计入当期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以摊余成本计量的金融资产，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

2022 年 1 月 1 日前适用

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变动计入当期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

自 2022 年 1 月 1 日起适用

金融负债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负债和以摊余成本计量的金融负债。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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

2022 年 1 月 1 日前适用

金融负债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负债和其他金融负债。本基金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卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

自 2022 年 1 月 1 日起适用

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。其他金融资产和以摊余成本计量的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；对于其他金融资产和以摊余成本计量的金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。在考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息的基础上，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失，应当分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，按照未来 12 个月内（若预期存续期少于 12 个月，则为预期存续期内）的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。本基金确定金融工具在估值日只具有较低的信用风险的，可以假设该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加（即处于第一阶段）。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取金融资产现金流量的合同权利终止；（2）金融资产已转移，且已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；（3）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，但是未保留对金融资产的控制。

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。

2022 年 1 月 1 日前适用

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。

6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

自 2022 年 1 月 1 日起适用

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

其他金融资产在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

2022 年 1 月 1 日前适用

(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。

6.4.4.4 费用的确认和计量

自 2022 年 1 月 1 日起适用

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

2022 年 1 月 1 日前适用

(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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

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, 根据衔接规定, 对可比期间信息不予调整, 首日执行新准则与现行准则的差异追溯调整报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式, 确定了三个主要的计量类别: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。本基金需考虑自身业务模式以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”, 适用于以摊余成本计量的金融资产和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

2022 年 1 月 1 日各项金融资产和金融负债按照修订前后金融工具确认计量准则的规定进行分类和计量结果对比如下:

金融资产/负债类别	修订前的金融工具确认计量准则		修订后的金融工具确认计量准则	
	计量类别	账面价值	计量类别	账面价值
金融资产				
银行存款	摊余成本(应收款项)	181,637,903.20	摊余成本	181,661,192.67
结算备付金	摊余成本(应收款项)	5,702,188.06	摊余成本	5,705,010.66
存出保证金	摊余成本(应收款项)	963,926.19	摊余成本	964,403.37
交易性金融资产	以公允价值计量且其变动计入当期损益	2,076,989,156.54	以公允价值计量且其变动计入当期损益	2,077,040,697.84
买入返售金融资产	摊余成本(应收款项)	100,000,000.00	摊余成本	99,960,383.56
应收利息	摊余成本(应收款项)	38,522.09	—	—
应收申购款	摊余成本(应收款项)	11,450,485.66	摊余成本	11,450,493.64
金融负债				
应付清算款	摊余成本	57,464,288.49	摊余成本	57,464,288.49
应付赎回款	摊余成本	9,896,422.59	摊余成本	9,896,422.59
应付管理人报酬	摊余成本	2,039,053.46	摊余成本	2,039,053.46
应付托管费	摊余成本	271,873.79	摊余成本	271,873.79
应付交易费用	摊余成本	2,831,268.20	—	—
其他负债	摊余成本	179,681.82	摊余成本	3,010,950.02

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

(一) 印花税

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

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

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

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

(二) 增值税

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

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

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

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

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

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

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收增值税。

(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；

目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内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；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	88,650,045.79
等于：本金	88,632,992.05
加：应计利息	17,053.74
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	88,650,045.79

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,323,131,345.94	-	2,186,975,056.38	-136,156,289.56
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	2,476.73	6,699,131.23	1,315,654.50
	银行间市场	99,997,600.00	100,035,534.25	-157,600.00
	合计	105,378,600.00	106,734,665.48	1,158,054.50
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,428,509,945.94	198,010.98	2,293,709,721.86	-134,998,235.06

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8,026.95
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,670,036.08
其中：交易所市场	2,669,636.08
银行间市场	400.00
应付利息	-
预提费用	89,260.15
合计	2,767,323.18

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

万家瑞隆 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	861,132,878.08	861,132,878.08
本期申购	763,573,093.66	763,573,093.66
本期赎回（以“-”号填列）	-677,492,619.48	-677,492,619.48
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	947,213,352.26	947,213,352.26

万家瑞隆 C

项目	本期 2022 年 3 月 17 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	156,428,058.88	156,428,058.88
本期赎回（以“-”号填列）	-87,284,334.24	-87,284,334.24
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	69,143,724.64	69,143,724.64

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2、自 2022 年 3 月 17 日起，增设本基金 C 类份额，详情请参阅相关公告。

6.4.7.8 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

万家瑞隆 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	990,411,995.86	452,554,719.45	1,442,966,715.31
本期利润	-192,793,727.93	-202,148,195.94	-394,941,923.87
本期基金份额交易产生的变动数	126,090,859.82	71,843,825.14	197,934,684.96
其中：基金申购款	852,000,993.14	237,618,044.35	1,089,619,037.49
基金赎回款	-725,910,133.32	-165,774,219.21	-891,684,352.53
本期已分配利润	-	-	-

本期末	923,709,127.75	322,250,348.65	1,245,959,476.40
-----	----------------	----------------	------------------

万家瑞隆 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	-12,811,305.92	4,828,446.27	-7,982,859.65
本期基金份额交易产生的变动数	80,041,826.17	18,697,721.15	98,739,547.32
其中：基金申购款	166,765,222.43	41,922,698.44	208,687,920.87
基金赎回款	-86,723,396.26	-23,224,977.29	-109,948,373.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	67,230,520.25	23,526,167.42	90,756,687.67

注：自 2022 年 3 月 17 日起，增设本基金 C 类份额，详情请参阅相关公告。

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	383,216.08
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	47,037.55
其他	34,956.78
合计	465,210.41

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-200,412,424.31
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-200,412,424.31

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,553,563,521.63
减：卖出股票成本总额	2,745,811,099.75
减：交易费用	8,164,846.19
买卖股票差价收入	-200,412,424.31

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	190,899.38
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-3,766.00
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	187,133.38

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,298,529.20
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,247,366.00
减：应计利息总额	54,529.20
减：交易费用	400.00
买卖债券差价收入	-3,766.00

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期末无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	11,341,284.74
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	11,341,284.74

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-197,319,749.67
股票投资	-198,480,721.37
债券投资	1,160,971.70
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	-197,319,749.67

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	5,196,949.72
基金转换费收入	91,734.10
合计	5,288,683.82

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,300.00

合计	98,560.15
----	-----------

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日,本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内,中国证监会核准新疆国际实业股份有限公司将其持有的万家基金 40%股权转让给山东省新动能基金管理有限公司。股权变更后,万家基金股东变更为中泰证券股份有限公司(49%),山东省新动能基金管理有限公司(40%),齐河众鑫投资有限公司(11%)。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司(“万家基金”)	基金管理人、基金销售机构
华夏银行股份有限公司(“华夏银行”)	基金托管人、基金销售机构
中泰证券股份有限公司(“中泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日

当期发生的基金应支付的管理费	19,558,647.34	1,109,793.58
其中：支付销售机构的客户维护费	3,135,050.64	299,834.68

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,607,819.65	147,972.46

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

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家瑞隆 A	万家瑞隆 C	合计
万家基金	-	102,081.68	102,081.68
中泰证券	-	757.62	757.62
合计	-	102,839.30	102,839.30
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		

方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家瑞隆 A	万家瑞隆 C	合计
合计	-	-	-

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.50%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

在通常情况下，本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日该类份额的基金资产净值计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，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销售服务费划款指令，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，由基金管理人支付给各销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

自 2022 年 3 月 17 日起，增设本基金 C 类份额，无上年度可比期间。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2022 年 3 月 17 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

	万家瑞隆 A	万家瑞隆 C
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	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 -
	万家瑞隆 A	万家瑞隆 C
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	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
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占基金总份额比例	2.2062%	-

注: 本报告期内未发生基金管理人运用自有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位: 份

万家瑞隆 A

关联方名称	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	6,332,658.03	0.6686	6,332,658.03	0.7354

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
华夏银行	88,650,045.79	383,216.08	37,873,851.01	21,965.09

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 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无需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末(2022 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
301103	何氏眼科	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股流通受限	42.50	32.02	507	16,575.00	16,234.14	-
301112	信邦智能	2022 年 6 月 20 日	6 个月	新股流通受限	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-
301122	采纳股份	2022 年 1 月 19 日	6 个月	新股流通受限	50.31	70.37	301	15,143.31	21,181.37	-
301123	奕东电子	2022 年 1 月 14 日	6 个月	新股流通受限	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84	-
301125	腾亚精工	2022 年 5 月 27 日	6 个月	新股流通受限	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-
301130	西点药业	2022 年 2 月 16 日	6 个月	新股流通受限	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301137	哈焊华通	2022 年 3 月	6 个月	新股流通受限	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-

		14 日									
301196	唯科科技	2022 年 1 月 4 日	6 个月	新股流通受限	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-	
301215	中汽股份	2022 年 2 月 28 日	6 个月	新股流通受限	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-	
301219	腾远钴业	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	173.98	87.82	578	55,847.58	50,759.96	-	
301233	盛帮股份	2022 年 6 月 24 日	1 个月内(含)	新股未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-	
301233	盛帮股份	2022 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-	
301235	华康医疗	2022 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	-	
301238	瑞泰新材	2022 年 6 月 10 日	6 个月	新股流通受限	19.18	32.07	3,497	67,072.46	112,148.79	-	
301256	华融化学	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股流通受限	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-	
301263	泰恩康	2022 年 3 月 22 日	6 个月	新股流通受限	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	-	
301266	宇邦新材	2022 年 5 月 30 日	6 个月	新股流通受限	26.86	47.07	517	13,886.62	24,335.19	-	
301268	铭利达	2022 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	-	
301298	东利机械	2022 年 5 月 27 日	6 个月	新股流通受限	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-	
301302	华如科技	2022 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72	-	
600941	中国移动	2021 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	57.58	60.26	43,681	2,515,151.98	2,632,217.06	-	

688400	凌云光	2022年6月27日	1个月内(含)	新股未上市	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23	-
--------	-----	------------	---------	-------	-------	-------	--------	------------	------------	---

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括:信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险,并设定适当的风险限额及内部控制流程,通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理融入各业务层面,建立了三道防线:以各岗位目标责任制为基础,形成第一道防线;通过相关部门、相关岗位之间相互监督制衡,形成第二道防线;由监察稽核部门、督察长对各岗位、各部门、各机构、各项业务实施监督反馈,形成第三道防线。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险,本基金均投资于具有良好信用等级的证券,且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%,且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行,在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算,因此违约风险发生的可能性很小;本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估,以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位:人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
--------	-------------------	---------------------

A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	100,035,534.25	2,244,448.80
合计	100,035,534.25	2,244,448.80

注：未评级债券为政策性金融债。

6.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	6,699,131.23	-
未评级	-	-
合计	6,699,131.23	-

注：本基金上年度末未持有长期信用评级的债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金资产的流动性风险进行管理，基金管理人建立了健全的流动性风险管理的内部控制体系，在申购赎回确认、投资交易、估值和信息披露等运作过程中专业审慎、勤勉尽责地管控基金的流动性风险，维护投资者的合法权益，公平对待投资者。本基金开放期间管理人对组合持仓集中度、短期变现能力、流动性受限资产比例、现金类资产比例等流动性指标进行持续的监测和分析，通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，对交易对手进行必要的尽职调查和准入，加强逆回购的流动性风险和交易对手风险的管理，并健全了逆回购交易质押品管理制度。

本基金所持有的证券大部分具有良好的流动性，部分证券流通暂时受限的情况参见附注 6.4.12 “期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券”，本报告期内本基金未出现因投资品种变现困难或投资集中而无法以合理价格及时变现基金资产以支付赎回款的情况。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月 30日	1个月以内	1-3 个月	3个月-1年	1-5 年	5年 以上	不计息	合计
资产							
银行存款	88,650,045.79	-	-	-	-	-	88,650,045.79
结算备付金	2,529,671.06	-	-	-	-	-	2,529,671.06
存出保证金	1,835,986.14	-	-	-	-	-	1,835,986.14
交易性金融资产	-	-	106,734,665.48	-	-	2,186,975,056.38	2,293,709,721.86
应收申购款	10,698.16	-	-	-	-	2,628,991.00	2,639,689.16
应收清算款	-	-	-	-	-	38,263,493.62	38,263,493.62
资产总计	93,026,401.15	-	106,734,665.48	-	-	2,227,867,541.00	2,427,628,607.63
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	68,036,172.02	68,036,172.02
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,225,764.04	3,225,764.04
应付托管费	-	-	-	-	-	430,101.85	430,101.85
应付销售	-	-	-	-	-	95,970.96	95,970.96

服务费							
应交税费	-	-	-	-	-	34.61	34.61
其他负债	-	-	-	-	-	2,767,323.18	2,767,323.18
负债总计	-	-	-	-	-	74,555,366.66	74,555,366.66
利率敏感度缺口	93,026,401.15	-	-106,734,665.48	-	-	-2,153,312,174.34	2,353,073,240.97
上年度末 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
其他资产	-	-	-	-	-	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
其他负债	-	-	-	-	-	3,010,950.02	3,010,950.02
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

注：该表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	若市场利率发生变动而其他市场变量保持不变	
	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 (2022 年 6 月 30 日)	上年度末 (2021 年 12 月 31 日)
分析	1. 市场利率下降 25 个基点	317,823.85	318.75
	2. 市场利率上升 25 个基点	-315,149.44	-317.92

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	2,186,975,056.38	92.94	2,074,744,707.74	90.05
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	106,734,665.48	4.54	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	2,293,709,721.86	97.48	2,076,989,156.54	90.14

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	若股票基准指数发生变动而其他市场变量保持不变	
	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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）	
分析	1. 股票基准指数下降 100 个基点	-18,672,433.44	-9,348,723.95
	2. 股票基准指数上升 100 个基点	18,672,433.44	9,348,723.95

注：本基金管理人运用资本-资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。表中为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	2,190,243,488.07	2,068,979,010.04
第二层次	100,388,494.00	8,010,146.50
第三层次	3,077,739.79	-
合计	2,293,709,721.86	2,076,989,156.54

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、新发未上市、涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本期末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,186,975,056.38	90.09
	其中：股票	2,186,975,056.38	90.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	106,734,665.48	4.40
	其中：债券	106,734,665.48	4.40
	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	91,179,716.85	3.76
8	其他各项资产	42,739,168.92	1.76
9	合计	2,427,628,607.63	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	699,390,209.58	29.72
B	采矿业	23,512,632.00	1.00
C	制造业	981,753,144.99	41.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	96,171,630.94	4.09
E	建筑业	257,052,266.77	10.92
F	批发和零售业	130,579.37	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	37,963.11	0.00

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,144,536.56	1.20
J	金融业	56,684.36	0.00
K	房地产业	100,511,354.64	4.27
L	租赁和商务服务业	13,443.22	0.00
M	科学研究和技术服务业	67,650.51	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	55,663.69	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	11,242.80	0.00
Q	卫生和社会工作	36,790.88	0.00
R	文化、体育和娱乐业	29,262.96	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,186,975,056.38	92.94

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000998	隆平高科	11,921,382	198,610,224.12	8.44
2	002385	大北农	25,140,397	196,346,500.57	8.34
3	002041	登海种业	9,243,635	194,948,262.15	8.28
4	300087	荃银高科	9,594,150	157,919,709.00	6.71
5	600195	中牧股份	7,864,969	96,424,519.94	4.10
6	002714	牧原股份	1,699,638	93,938,992.26	3.99
7	300587	天铁股份	4,059,159	82,928,618.37	3.52
8	601390	中国中铁	12,669,258	77,789,244.12	3.31
9	603566	普莱柯	2,716,340	72,607,768.20	3.09
10	601985	中国核电	8,903,972	61,081,247.92	2.60
11	601800	中国交建	6,376,200	59,171,136.00	2.51
12	601669	中国电建	6,936,195	54,587,854.65	2.32
13	600371	万向德农	4,042,923	53,973,022.05	2.29
14	002100	天康生物	5,236,800	50,901,696.00	2.16
15	300320	海达股份	3,366,800	50,535,668.00	2.15
16	601952	苏垦农发	3,256,094	45,552,755.06	1.94
17	002507	涪陵榨菜	1,153,800	39,829,176.00	1.69
18	000090	天健集团	5,623,100	38,743,159.00	1.65
19	002013	中航机电	2,974,300	36,732,605.00	1.56
20	600483	福能股份	2,493,986	35,090,383.02	1.49
21	600779	水井坊	357,246	33,059,544.84	1.40

22	002139	拓邦股份	2,679,900	32,882,373.00	1.40
23	600048	保利发展	1,789,034	31,236,533.64	1.33
24	601012	隆基绿能	453,700	30,230,031.00	1.28
25	600893	航发动力	650,100	29,586,051.00	1.26
26	600383	金地集团	2,142,100	28,789,824.00	1.22
27	600970	中材国际	2,761,700	26,760,873.00	1.14
28	002555	三七互娱	1,197,900	25,431,417.00	1.08
29	600496	精工钢构	5,419,100	25,036,242.00	1.06
30	600372	中航电子	1,277,290	24,766,653.10	1.05
31	000651	格力电器	721,500	24,328,980.00	1.03
32	000729	燕京啤酒	2,514,300	24,288,138.00	1.03
33	601155	新城控股	937,300	23,835,539.00	1.01
34	600256	广汇能源	2,230,800	23,512,632.00	1.00
35	002837	英维克	903,980	22,364,465.20	0.95
36	603919	金徽酒	636,692	21,641,161.08	0.92
37	300487	蓝晓科技	287,401	17,531,461.00	0.75
38	600325	华发股份	2,199,400	16,649,458.00	0.71
39	300896	爱美客	23,100	13,860,231.00	0.59
40	002993	奥海科技	114,490	4,758,204.40	0.20
41	600941	中国移动	43,681	2,632,217.06	0.11
42	002438	江苏神通	139,700	2,060,575.00	0.09
43	300436	广生堂	37,200	1,335,852.00	0.06
44	300871	回盛生物	16,300	360,556.00	0.02
45	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.01
46	301298	东利机械	6,340	158,423.92	0.01
47	688280	精进电动	10,605	124,078.50	0.01
48	301238	瑞泰新材	3,497	112,148.79	0.00
49	688211	中科微至	1,688	68,752.24	0.00
50	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.00
51	301219	腾远钴业	578	50,759.96	0.00
52	001227	兰州银行	7,868	38,710.56	0.00
53	301177	迪阿股份	502	37,248.40	0.00
54	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
55	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
56	301099	雅创电子	351	29,301.48	0.00
57	600862	中航高科	1,000	28,100.00	0.00
58	301302	华如科技	466	26,291.72	0.00
59	605089	味知香	370	24,978.70	0.00
60	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.00
61	605080	浙江自然	374	23,894.86	0.00
62	605555	德昌股份	917	23,355.99	0.00
63	300957	贝泰妮	105	22,840.65	0.00

64	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
65	301096	百诚医药	272	21,488.00	0.00
66	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
67	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
68	300953	震裕科技	154	21,096.46	0.00
69	301211	亨迪药业	967	20,964.56	0.00
70	301060	兰卫医学	587	20,556.74	0.00
71	301035	润丰股份	249	20,530.05	0.00
72	301101	明月镜片	371	19,043.43	0.00
73	301127	天源环保	1,685	18,754.05	0.00
74	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
75	301221	光庭信息	280	18,152.40	0.00
76	601528	瑞丰银行	2,230	17,973.80	0.00
77	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
78	603171	税友股份	637	17,823.26	0.00
79	001217	华尔泰	1,239	16,776.06	0.00
80	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
81	001215	千味央厨	295	16,605.55	0.00
82	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
83	001205	盛航股份	808	15,998.40	0.00
84	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
85	001317	三羊马	300	15,222.00	0.00
86	001216	华瓷股份	1,177	15,124.45	0.00
87	301168	通灵股份	329	14,831.32	0.00
88	603230	内蒙新华	1,140	14,261.40	0.00
89	605056	咸亨国际	933	14,153.61	0.00
90	301190	善水科技	575	13,644.75	0.00
91	603836	海程邦达	733	13,443.22	0.00
92	300979	华利集团	181	13,227.48	0.00
93	603216	梦天家居	772	12,498.68	0.00
94	301179	泽宇智能	295	12,038.95	0.00
95	001218	丽臣实业	490	11,701.20	0.00
96	301126	达嘉维康	662	11,340.06	0.00
97	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
98	605098	行动教育	405	11,242.80	0.00
99	605319	无锡振华	764	11,108.56	0.00
100	301108	洁雅股份	280	11,079.60	0.00
101	605365	立达信	645	10,687.65	0.00
102	605599	菜百股份	980	10,662.40	0.00
103	001206	依依股份	321	10,641.15	0.00
104	603219	富佳股份	528	10,517.76	0.00
105	301111	粤万年青	379	10,392.18	0.00

106	605378	野马电池	473	10,311.40	0.00
107	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
108	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
109	605566	福莱茵特	435	9,926.70	0.00
110	001296	长江材料	403	9,905.74	0.00
111	605567	春雪食品	629	9,850.14	0.00
112	605033	美邦股份	423	9,809.37	0.00
113	605300	佳禾食品	576	9,578.88	0.00
114	605488	福莱新材	603	9,491.22	0.00
115	301020	密封科技	421	9,472.50	0.00
116	300973	立高食品	90	9,355.50	0.00
117	605069	正和生态	608	9,326.72	0.00
118	301048	金鹰重工	843	9,281.43	0.00
119	605196	华通线缆	1,172	9,235.36	0.00
120	603048	浙江黎明	464	9,224.32	0.00
121	300997	欢乐家	690	9,218.40	0.00
122	605138	盛泰集团	723	9,023.04	0.00
123	001234	泰慕士	333	9,017.64	0.00
124	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
125	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
126	301138	华研精机	285	8,763.75	0.00
127	301021	英诺激光	290	8,758.00	0.00
128	300962	中金辐照	576	8,697.60	0.00
129	605180	华生科技	499	8,677.61	0.00
130	605189	富春染织	423	8,493.84	0.00
131	301013	利和兴	706	8,464.94	0.00
132	605259	绿田机械	295	8,425.20	0.00
133	001288	运机集团	537	8,382.57	0.00
134	301052	果麦文化	252	8,298.36	0.00
135	301039	中集车辆	757	8,198.31	0.00
136	301193	家联科技	297	8,063.55	0.00
137	301198	喜悦智行	341	7,689.55	0.00
138	300614	百川畅银	303	7,623.48	0.00
139	301026	浩通科技	203	7,486.64	0.00
140	301028	东亚机械	676	7,314.32	0.00
141	301182	凯旺科技	294	6,985.44	0.00
142	301012	扬电科技	170	6,971.70	0.00
143	300978	东箭科技	530	6,916.50	0.00
144	001209	洪兴股份	450	6,849.00	0.00
145	001202	炬申股份	459	6,742.71	0.00
146	605577	龙版传媒	588	6,703.20	0.00
147	300987	川网传媒	391	6,596.17	0.00

148	003041	真爱美家	419	6,532.21	0.00
149	300975	商络电子	738	6,472.26	0.00
150	301055	张小泉	355	6,311.90	0.00
151	301062	上海艾录	523	6,103.41	0.00
152	301002	崧盛股份	243	6,043.41	0.00
153	300814	中富电路	328	6,002.40	0.00
154	300958	建工修复	300	5,934.00	0.00
155	300991	创益通	406	5,838.28	0.00
156	300968	格林精密	638	5,780.28	0.00
157	301011	华立科技	175	5,755.75	0.00
158	300961	深水海纳	394	5,342.64	0.00
159	301057	汇隆新材	218	5,308.30	0.00
160	301056	森赫股份	572	4,953.52	0.00
161	301049	超越科技	196	4,647.16	0.00
162	301059	金三江	259	4,351.20	0.00
163	300992	泰福泵业	200	4,262.00	0.00
164	300854	中兰环保	203	4,035.64	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603566	普莱柯	116,624,912.89	5.06
2	600195	中牧股份	114,125,863.76	4.95
3	601390	中国中铁	94,283,398.21	4.09
4	000998	隆平高科	82,680,942.80	3.59
5	002385	大北农	69,518,741.00	3.02
6	300587	天铁股份	68,883,197.74	2.99
7	601618	中国中冶	66,678,497.00	2.89
8	002100	天康生物	65,987,359.82	2.86
9	002041	登海种业	62,557,821.24	2.72
10	600048	保利发展	56,300,665.00	2.44
11	600256	广汇能源	54,882,278.61	2.38
12	600598	北大荒	54,861,051.75	2.38
13	600079	人福医药	53,855,448.78	2.34
14	002466	天齐锂业	53,092,706.80	2.30
15	002714	牧原股份	50,334,673.56	2.18
16	300320	海达股份	48,401,647.00	2.10
17	300487	蓝晓科技	42,147,276.53	1.83
18	300436	广生堂	41,224,319.00	1.79
19	000656	金科股份	40,885,529.32	1.77
20	000090	天健集团	39,639,227.10	1.72

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600371	万向德农	65,099,893.80	2.83
2	601618	中国中冶	59,657,556.00	2.59
3	300498	温氏股份	54,656,931.94	2.37
4	002466	天齐锂业	53,490,857.00	2.32
5	600598	北大荒	50,841,166.00	2.21
6	603566	普莱柯	49,557,948.15	2.15
7	600079	人福医药	49,194,623.93	2.14
8	000786	北新建材	44,388,505.22	1.93
9	600862	中航高科	39,565,057.80	1.72
10	601952	苏垦农发	39,304,201.15	1.71
11	000915	华特达因	37,069,897.25	1.61
12	600313	农发种业	36,745,906.50	1.59
13	000875	吉电股份	36,441,484.50	1.58
14	300436	广生堂	35,486,776.00	1.54
15	002043	兔宝宝	33,164,493.25	1.44
16	600256	广汇能源	32,440,871.80	1.41
17	000933	神火股份	32,078,410.67	1.39
18	000656	金科股份	31,940,755.13	1.39
19	603612	索通发展	31,732,699.00	1.38
20	600011	华能国际	31,442,486.26	1.36

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,056,522,169.76
卖出股票收入（成交）总额	2,553,563,521.63

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

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	100,035,534.25	4.25
	其中：政策性金融债	100,035,534.25	4.25
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）	6,699,131.23	0.28
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	106,734,665.48	4.54

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	220206	22 国开 06	1,000,000	100,035,534.25	4.25
2	110086	精工转债	53,810	6,699,131.23	0.28

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的，在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,835,986.14
2	应收清算款	38,263,493.62
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,639,689.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,739,168.92

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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 (%)
万家瑞隆 A	117,394	8,068.67	689,089,303.48	72.75	258,124,048.78	27.25
万家瑞隆 C	8,296	8,334.59	57,928,794.57	83.78	11,214,930.07	16.22
合计	124,457	8,166.33	747,018,098.05	73.50	269,338,978.85	26.50

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	万家瑞隆 A	822,424.36	0.0868
	万家瑞隆 C	838.84	0.0012

	合计	823,263.20	0.0810
--	----	------------	--------

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	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	万家瑞隆 A	10~50
	万家瑞隆 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	万家瑞隆 A	0~10
	万家瑞隆 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家瑞隆 A	万家瑞隆 C
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	861,132,878.08	-
本报告期基金总申购份额	763,573,093.66	156,428,058.88
减：本报告期基金总赎回份额	677,492,619.48	87,284,334.24
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	947,213,352.26	69,143,724.64

注：自 2022 年 3 月 17 日起，增设本基金 C 类份额，详情请参阅相关公告。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

本报告期内无涉及基金管理人的重大人事变动。

基金托管人：

本报告期内，无基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
安信证券	2	2,927,557,641.09	52.27	2,726,427.97	53.37	-
国泰君安	1	1,051,279,578.43	18.77	915,564.40	17.92	-
招商证券	1	1,010,272,044.20	18.04	940,872.87	18.42	-
浙商证券	1	533,053,955.66	9.52	468,502.50	9.17	-
华金证券	1	78,226,569.45	1.40	57,206.65	1.12	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

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

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面

的信息服务;能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告,具有开发量化投资组合模型的能力;能积极为公司投资业务的开展,投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下:

(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。

(2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

3、基金专用交易席位的变更情况:

本报告期内,本基金新增安信证券交易单元 2 个,华金证券交易单元 1 个,中信建投交易单元 1 个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金,本报告期未通过基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	万家基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在上海陆金所基金销售有限公司定投起点的公告	指定媒介	2022-01-04
2	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在华福证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-01-18
3	万家瑞隆混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	指定媒介	2022-01-21
4	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在万联证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-02-09
5	万家基金管理有限公司关于旗下基金在中银国际证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-02-23
6	万家基金管理有限公司关于旗下基金在山西证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-03-01
7	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在广发证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-03-04
8	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在泰信财富开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-03-07
9	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华夏银行为销售机构并开通	指定媒介	2022-03-09

	相关业务的公告		
10	万家瑞隆混合型证券投资基金托管协议	指定媒介	2022-03-15
11	万家瑞隆混合型证券投资基金基金合同	指定媒介	2022-03-15
12	关于万家瑞隆混合型证券投资基金增设 C 类基金份额并修改基金合同与托管协议的公告	指定媒介	2022-03-15
13	万家瑞隆混合型证券投资基金招募说明书更新(2022 年第 1 号)	指定媒介	2022-03-17
14	万家瑞隆混合型证券投资基金基金产品资料概要(更新)	指定媒介	2022-03-17
15	万家基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金更新招募说明书和基金产品资料概要的提示性公告	指定媒介	2022-03-17
16	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金调整最低申购金额的公告	指定媒介	2022-03-22
17	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宜信普泽为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-03-24
18	万家瑞隆混合型证券投资基金 2021 年年度报告	指定媒介	2022-03-30
19	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商银行招赢通平台为销售机构并开通相关业务的公告	指定媒介	2022-04-11
20	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增攀赢基金为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-04-12
21	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在东方证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-04-18
22	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增杭州联合农村商业银行股份有限公司为销售机构并开通相关业务的公告	指定媒介	2022-04-18
23	万家瑞隆混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	指定媒介	2022-04-21
24	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增日照银行股份有限公司为销售机构并开通相关业务的公告	指定媒介	2022-05-13
25	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商银行股份有限公司为销	指定媒介	2022-05-17

	售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告		
26	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在华泰证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-05-20
27	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中欧财富为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-05-26
28	万家基金管理有限公司关于旗下基金在光大证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-05-30
29	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宁波银行为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-06-17
30	万家基金管理有限公司关于旗下基金在九州证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-06-18

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金于 2022 年 3 月 17 日, 增设 C 类份额, 并相应修改基金合同和托管协议中相关条款。有关详细信息参见本公司于 2022 年 3 月 15 日发布的《关于万家瑞隆混合型证券投资基金增设 C 类基金份额并修改基金合同与托管协议的公告》。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《万家瑞隆混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 4、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的基金净值、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 2022 年中期报告原文。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。

7、《万家瑞隆混合型证券投资基金托管协议》。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司

2022 年 8 月 30 日