

万家行业优选混合型证券投资基金 (LOF) 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	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.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	50
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.....	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 投资组合报告附注.....	50
§8 基金份额持有人信息.....	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
8.4 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.....	52
§9 开放式基金份额变动.....	54
§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.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
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.....	57

§12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家行业优选混合型证券投资基金 (LOF)
基金简称	万家优选
场内简称	万家行业优选 LOF
基金主代码	161903
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2005 年 7 月 15 日
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	7,902,936,061.69 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2005 年 8 月 15 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资景气行业或预期景气度向好的行业股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采取优选行业和精选个股相结合的主动投资管理方式，并适度动态配置大类资产。具体包括：1、资产配置策略：（1）宏观经济因素分析、（2）国家经济政策分析；2、行业配置策略：（1）以投资时钟为核心进行行业选择、（2）行业配置权重的确定；3、个股投资策略：（1）个股行业属性界定、（2）行业优势企业选择、（3）个股的估值分析、（4）新股申购策略、（5）存托凭证投资策略；4、债券投资策略：（1）利率预期策略、（2）属类配置策略、（3）债券品种选择策略、（4）套利策略、（5）资产支持证券投资策略、（6）可转债投资策略；5、权证投资策略；6、其他衍生工具的投资策略。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数收益率+20%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金是混合型基金，风险低于股票型基金，高于货币市场基金、债券型基金，属于中等风险、中等预期收益的证券投资基金。

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	交通银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	兰剑	陆志俊
	联系电话	021-38909626	95559
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4008880800	95559
传真		021-38909627	021-62701216
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）	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 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）	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		200122	200336
法定代表人		方一天	任德奇

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）自由贸易实验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）基金管理人办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	1,383,052,854.39
本期利润	1,615,034,967.30
加权平均基金份额本期利润	0.1919
本期加权平均净值利润率	9.35%
本期基金份额净值增长率	11.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	2,579,894,465.55
期末可供分配基金份额利润	0.3264
期末基金资产净值	17,154,742,374.36
期末基金份额净值	2.1707
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	1,123.10%

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。

3.2 基金净值表现

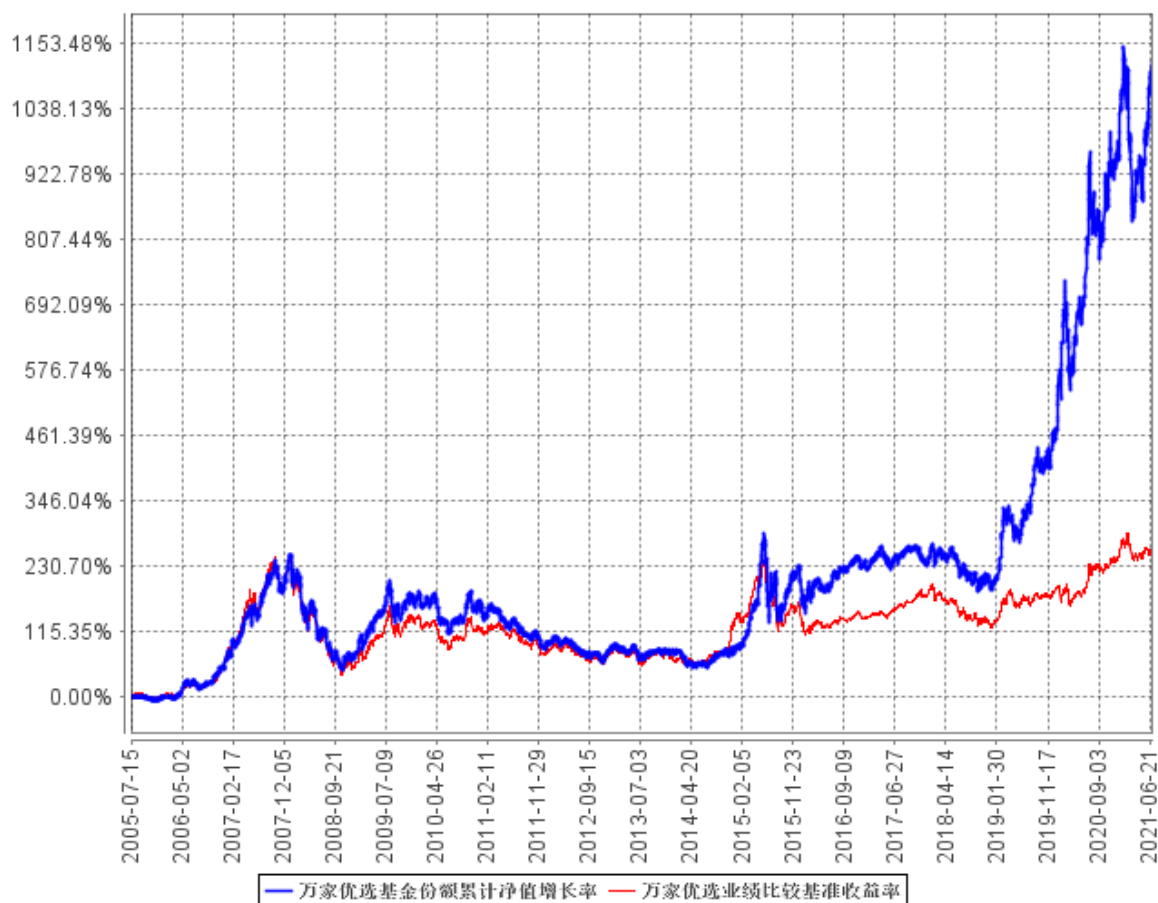
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	10.38%	1.79%	-1.58%	0.64%	11.96%	1.15%
过去三个月	23.85%	1.60%	3.00%	0.78%	20.85%	0.82%
过去六个月	11.36%	1.75%	0.69%	1.05%	10.67%	0.70%
过去一年	34.83%	1.78%	20.89%	1.07%	13.94%	0.71%
过去三年	271.20%	1.75%	42.38%	1.09%	228.82%	0.66%
自基金合同生效起至今	1,123.10%	1.63%	259.01%	1.36%	864.09%	0.27%

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

万家优选基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理（助 理）期限		证券从 业年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
黄兴亮	万家行业优选混合型证券投资基金 (LOF)、万家经济新动能混合型证券投资基金、万家自主创新混合型证券投资基金、万家科技创新混合型证券投资基金、万家创业板 2 年定期开放混合型证券投资基金的基金经理	2019 年 3 月 2 日	-	13.5 年	清华大学计算机系博士。2007 年 8 月至 2011 年 5 月在交银施罗德基金管理有限公司担任研究员。2011 年 6 月至 2018 年 10 月在光大保德信基金管理有限公司先后担任投资部研究员、基金经理。2018 年 11 月加入万家基金管

					理有限公司，2019 年 2 月起担任投资研究部基金经理。
--	--	--	--	--	-------------------------------

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

年初基金发行高峰过后市场转为下跌，一方面反映全球新冠疫情逐步控制之后可能的政策收紧的预期，另一方面也有前期交易拥挤板块的再平衡的因素。二季度市场反弹，前期的热点板块均有较大幅度的修复，尤其是医药和新能源板块，由于行业景气度维持高位，表现更具持续性。前期相对抗跌的低估值的大金融板块表现相对较弱。科技板块在最后一个半月也有所反弹。

本基金减持了交运和汽车行业，降低了工控自动化和商业服务类个股的权重，持续提高了半导体和计算机行业的持仓，截止半年度，基金风格偏成长。

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 2.1707 元；本报告期基金份额净值增长率为 11.36%，业绩比较基准收益率为 0.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在去年普遍低基数的情况下，上半年各行业的增长都比较好。下半年可能会有所分化，一些细分行业，例如物联网相关利基型芯片，模拟芯片，云计算等领域，有望维持较高景气度，也是我们重点关注的方向。长期来看，中国制造向附加值更高的中国创新转变是大势所趋，也是现阶段国内需要着力突破的瓶颈。我们将持续聚焦于拥有自主品牌力和创新力的行业与公司。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

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

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不介入基金日常估值业务。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同规定：“基金收益分配后基金份额净值不能低于基金面值；基金当期收益应先弥补前期亏损后，才可进行当期收益分配；在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年至少分配一次，最多 6 次，基金每次收益分配比例最低不低于已实现收益的 60%”。

本基金本报告期内进行了 1 次收益分配，分配金额为 1,997,441,009.55 元，符合基金合同的规定。

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出现基金资产净值低于五千万元或基金份额持有人数量不满两百人的情况。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2021 年上半年度，基金托管人在万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，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

2021 年上半年度，万家基金管理有限公司在万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本基金本报告期内进行了 1 次收益分配，分配金额为 1,997,441,009.55 元，符合基金合同的规定。

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

2021 年上半年度，由万家基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：万家行业优选混合型证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	664,393,124.42	1,280,847,636.56
结算备付金		5,734,778.61	20,695,269.10
存出保证金		3,687,151.05	4,872,198.73
交易性金融资产	6.4.7.2	16,686,657,267.31	17,980,550,751.19
其中：股票投资		16,286,177,267.31	17,980,550,751.19
基金投资		-	-
债券投资		400,480,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		18,706,282.50	297,979,011.12
应收利息	6.4.7.5	3,373,067.88	288,264.68
应收股利		-	-
应收申购款		52,951,460.00	59,797,717.68
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		17,435,503,131.77	19,645,030,849.06
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		253,062,020.84	304,937,307.71
应付管理人报酬		17,770,160.35	20,711,064.34
应付托管费		2,733,870.82	3,186,317.60
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	5,870,968.60	11,052,022.50
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,323,736.80	1,691,818.76
负债合计		280,760,757.41	341,578,530.91
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	4,454,826,704.28	4,922,800,856.79
未分配利润	6.4.7.10	12,699,915,670.08	14,380,651,461.36
所有者权益合计		17,154,742,374.36	19,303,452,318.15
负债和所有者权益总计		17,435,503,131.77	19,645,030,849.06

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.1707 元，基金份额总额 7,902,936,061.69 份。

6.2 利润表

会计主体：万家行业优选混合型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		1,773,408,995.60	2,930,208,411.51
1.利息收入		7,534,860.51	3,876,654.48
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,277,765.44	2,733,024.51
债券利息收入		3,170,191.78	1,136,879.41
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		86,903.29	6,750.56
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,516,757,834.73	274,557,022.08
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,493,562,865.43	257,953,647.46
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-20,114.08
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	-	-
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	23,194,969.30	16,623,488.70
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	231,982,112.91	2,633,790,674.50
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	17,134,187.45	17,984,060.45
减：二、费用		158,374,028.30	79,897,459.80

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	111,919,264.45	52,120,846.70
2. 托管费	6.4.10.2.2	17,218,348.35	8,018,591.85
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	29,077,475.44	19,590,638.68
5. 利息支出		-	22,388.76
其中：卖出回购金融资产支出		-	22,388.76
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	158,940.06	144,993.81
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,615,034,967.30	2,850,310,951.71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,615,034,967.30	2,850,310,951.71

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家行业优选混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,922,800,856.79	14,380,651,461.36	19,303,452,318.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,615,034,967.30	1,615,034,967.30
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）	-467,974,152.51	-1,298,329,749.03	-1,766,303,901.54
其中：1.基金申购款	2,889,801,440.44	8,153,272,573.83	11,043,074,014.27
2.基金赎回款	-3,357,775,592.95	-9,451,602,322.86	-12,809,377,915.81
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）	-	-1,997,441,009.55	-1,997,441,009.55
五、期末所有者权益（基金净值）	4,454,826,704.28	12,699,915,670.08	17,154,742,374.36

项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	979,348,755.83	1,187,160,534.07	2,166,509,289.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,850,310,951.71	2,850,310,951.71
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)	2,969,690,353.42	5,610,864,053.46	8,580,554,406.88
其中：1.基金申购款	7,097,818,743.01	13,070,683,649.55	20,168,502,392.56
2.基金赎回款	-4,128,128,389.59	-7,459,819,596.09	-11,587,947,985.68
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)	-	-807,363,655.58	-807,363,655.58
五、期末所有者权益(基金净值)	3,949,039,109.25	8,840,971,883.66	12,790,010,992.91

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

万家行业优选混合型证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”)，原天同公用事业行业股票型证券投资基金，系经中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”) 证监基金字[2005]83号文《关于同意天同公用事业行业股票型开放式证券投资基金募集的批复》的核准，由天同基金管理有限公司 (系万家基金管理有限公司的前身) 作为发起人向社会公开发行募集，基金合同于2005年7月15日正式生效，首次设立募集规模为309,958,613.24份基金份额。经中国证监会证监基金字[2006]13号文《关于同意天同基金管理有限公司变更名称及修改公司章程的批复》的核准，天同基金管理有限公司于2006年2月更名为万家基金管理有限公司；另经基金管理人董事会审议通过，基金托管人同意，中国证监会基金部核准，本基金于2006年2月更名为万家公用事业

行业股票型证券投资基金（LOF）。2008 年 3 月 3 日（拆分日），本基金管理人万家基金管理有限公司对本基金进行了基金份额拆分。拆分前，本基金的基金份额净值为人民币 1.7741 元，根据基金份额拆分公式，计算精确到小数点后第 9 位（第 9 位以后舍去）为人民币 1.774103626 元。本基金管理人于拆分日，按照 1:1.774103626 的拆分比例对本基金进行拆分。拆分后，基金份额净值为人民币 1.0000 元，基金份额面值为人民币 0.5637 元。

万家公用事业行业股票型证券投资基金（LOF）自 2013 年 6 月 7 日至 2013 年 7 月 10 日以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会讨论通过了关于修改基金名称及投资细节的议案。在基金管理人向中国证监会履行相应备案手续，并经中国证监会书面确认后，基金份额持有人大会决议生效。2013 年 8 月 28 日，中国证监会基金部函[2013]753 号文《关于万家公用事业行业股票型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会决议备案的回函》书面确认后，原《万家公用事业行业股票型证券投资基金（LOF）基金合同》失效，《万家行业优选股票型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，“万家公用事业行业股票型证券投资基金（LOF）”更名为“万家行业优选股票型证券投资基金（LOF）”，同时基金投资目标、投资范围等投资细节相应调整。根据中国证券监督管理委员会于 2014 年 8 月 8 日实行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及相关基金合同的有关规定，经与基金托管人协商一致，自 2015 年 7 月 31 日起将本基金变更为万家行业优选混合型证券投资基金，并相应修改本基金的《基金合同》。本基金为契约型上市开放式（LOF），存续期限不定。本基金的基金管理人为万家基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金主要投资景气行业或预期景气度向好的行业股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。本基金采取优选行业和精选个股相结合的主动投资管理方式，并适度动态配置大类资产。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含存托凭证）、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金股票资产占基金资产的 60%-95%；债券、现金类资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%，其中，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，权证占基金资产净值的 0-3%。

本基金将依据证券市场的阶段性变化，动态调整基金财产在股票、债券和现金类资产的配置比例。本基金的业绩比较基准为： $80\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 20\% \times \text{上证国债指数收益率}$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本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。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

（一）印花税

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

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

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

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

（二）增值税

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

利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

(三) 企业所得税

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

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

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

(四) 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息

所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	664,393,124.42
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：	664,393,124.42

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	13,086,026,082.34	16,286,177,267.31	3,200,151,184.97	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	399,788,400.00	400,480,000.00	691,600.00
	合计	399,788,400.00	400,480,000.00	691,600.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	13,485,814,482.34	16,686,657,267.31	3,200,842,784.97	

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	142,899.78
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	2,322.54
应收债券利息	3,226,301.37
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	50.91
应收黄金合约拆借孳息	-

应收出借证券利息	-
其他	1,493.28
合计	3,373,067.88

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	5,870,968.60
银行间市场应付交易费用	-
合计	5,870,968.60

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	901,845.59
应付证券出借违约金	-
其他	292,959.48
预提费用	128,931.73
合计	1,323,736.80

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,733,115,869.31	4,922,800,856.79
本期申购	5,126,563,350.68	2,889,801,440.44
本期赎回(以“-”号填列)	-5,956,743,158.30	-3,357,775,592.95
- 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	7,902,936,061.69	4,454,826,704.28

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,489,020,424.30	10,891,631,037.06	14,380,651,461.36
本期利润	1,383,052,854.39	231,982,112.91	1,615,034,967.30
本期基金份额交易产生的变动数	-294,737,803.59	-1,003,591,945.44	-1,298,329,749.03
其中：基金申购款	2,288,996,447.15	5,864,276,126.68	8,153,272,573.83
基金赎回款	-2,583,734,250.74	-6,867,868,072.12	-9,451,602,322.86
本期已分配利润	-1,997,441,009.55	-	-1,997,441,009.55
本期末	2,579,894,465.55	10,120,021,204.53	12,699,915,670.08

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	4,091,728.49
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	115,642.48
其他	70,394.47
合计	4,277,765.44

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	10,816,300,370.63
减：卖出股票成本总额	9,322,737,505.20
买卖股票差价收入	1,493,562,865.43

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	23,194,969.30
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	23,194,969.30

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	231,982,112.91
——股票投资	231,290,512.91
——债券投资	691,600.00
——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	231,982,112.91

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	17,061,549.85
转换费	72,637.60
合计	17,134,187.45

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	29,076,325.44
银行间市场交易费用	1,150.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	29,077,475.44

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	600.00
上市年费	29,752.78
银行汇划费用	11,408.33
结算服务费	18,000.00
合计	158,940.06

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日, 本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日, 本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内, 与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司	基金管理人, 基金销售机构
交通银行股份有限公司 (“交通银行”)	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: 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.9.3 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.3.1 股票交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
中泰证券	2,300,443,942.01	12.64%	2,340,723,887.79	15.13%

6.4.9.3.2 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。

6.4.9.3.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.9.3.4 权证交易

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权证交易。

6.4.9.3.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中泰证券	2,142,406.29	12.90%	913,190.35	15.55%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中泰证券	2,179,919.70	15.45%	2,179,919.70	39.03%

6.4.9.4 关联方报酬

6.4.9.4.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	111,919,264.45
其中：支付销售机构的客户维护费	39,292,190.02	15,943,087.70

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.30% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支付，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.9.4.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费	17,218,348.35

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：

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

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.9.5 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。

6.4.9.6 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

6.4.9.6.1 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。

6.4.9.6.2 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。

6.4.9.7 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.7.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.9.7.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.9.8 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	664,393,124.42	4,091,728.49	997,678,143.73	2,522,100.67

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

6.4.9.9 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不存在在承销期内直接购入关联方所承销证券的情况。

6.4.10 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2021 年 4 月 2 日	2021 年 4 月 6 日	2021 年 4 月 2 日	2.4000	1,405,453,325.28	591,987,684.27	1,997,441,009.55	
合计	-	-	-	2.4000	1,405,453,325.28	591,987,684.27	1,997,441,009.55	

6.4.11 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 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

6.4.11.1.1 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
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688499	利元亨	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 1 日	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
605162	新中港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-

301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	创业板股票流通受限	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	创业板股票流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	创业板股票流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月12日	创业板股票流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	创业板股票流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月21日	创业板股票流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300930	屹通新材	2021年1月13日	2021年7月21日	创业板股票流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	创业板股票流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	创业板股票流通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	创业板股票流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	创业板股票流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	创业板股票流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300941	创识科技	2021年2月2日	2021年8月9日	创业板股票流通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-

300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	创业板股票流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	创业板股票流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	创业板股票流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300950	德固特	2021年2月24日	2021年9月3日	创业板股票流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021年3月3日	2021年9月13日	创业板股票流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月22日	创业板股票流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	创业板股票流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	创业板股票流通受限	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	创业板股票流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	创业板股票流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	创业板股票流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	创业板股票流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	创业板股票流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月	创业板股票流	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-

		日	月 11 日	通受限							
300967	晓鸣 股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	创业板 股票流 通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-	
300968	格林 精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	创业板 股票流 通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-	
300971	博亚 精工	2021 年 4 月 7 日	2021 年 10 月 15 日	创业板 股票流 通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-	
300972	万辰 生物	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 19 日	创业板 股票流 通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-	
300973	立高 食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	创业板 股票流 通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-	
300975	商络 电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	创业板 股票流 通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-	
300978	东箭 科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	创业板 股票流 通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-	
300979	华利 集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	创业板 股票流 通受限	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-	
300981	中红 医疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	创业板 股票流 通受限	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-	
300982	苏文 电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	创业板 股票流 通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-	
300985	致远 新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 27 日	创业板 股票流 通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-	

		日	月 29 日	通受限							
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	创业板 股票流 通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-	
300987	川网传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	创业板 股票流 通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-	
300991	创益通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	创业板 股票流 通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-	
300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	创业板 股票流 通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-	
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	创业板 股票流 通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-	
300997	欢乐家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	创业板 股票流 通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-	
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	创业板 股票流 通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-	
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	创业板 股票流 通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-	
301004	嘉益股份	2021 年 6 月 18 日	2021 年 12 月 27 日	创业板 股票流 通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-	
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	创业板 股票流 通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-	
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	创业板 股票流 通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-	
301011	华立	2021 年	2021	创业板	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-	

	科技	6月9日	年12月17日	股票流通受限							
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	创业板股票流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20		-
301013	利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	创业板股票流通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81		-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	创业板股票流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46		-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	创业板股票流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50		-
688109	品茗股份	2021年3月22日	2021年9月30日	科创板股票流通受限	50.05	72.10	1,301	65,115.05	93,802.10		-
688216	气派科技	2021年6月15日	2021年12月23日	科创板股票流通受限	14.82	47.64	2,000	29,640.00	95,280.00		-
688316	青云科技	2021年3月5日	2021年9月16日	科创板股票流通受限	63.70	65.00	1,428	90,963.60	92,820.00		-
688323	瑞华泰	2021年4月21日	2021年10月28日	科创板股票流通受限	5.97	22.78	4,513	26,942.61	102,806.14		-
688601	力芯微	2021年6月18日	2021年12月28日	科创板股票流通受限	36.48	133.69	1,174	42,827.52	156,952.06		-
688625	呈和科技	2021年5月31日	2021年12月7日	科创板股票流通受限	16.48	42.63	2,672	44,034.56	113,907.36		-
688665	四方光电	2021年2月2日	2021年8月9日	科创板股票流通受限	29.53	129.46	1,687	49,817.11	218,399.02		-

688667	菱电电控	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 13 日	科创板股票流通受限	75.42	103.88	1,191	89,825.22	123,721.08	-
688696	极米科技	2021 年 2 月 23 日	2021 年 9 月 3 日	科创板股票流通受限	133.73	780.24	1,252	167,429.96	976,860.48	-

6.4.11.2 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。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 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。

6.4.11.3.2 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。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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。本基金投资于一家上市公司发行的股票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。

6.4.12.2.1 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 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	400,480,000.00	-
合计	400,480,000.00	-

注:未评级债券为政策性金融债。

6.4.12.2.2 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的债券投资。

6.4.12.3 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。

本基金所持证券均在证券交易所上市,因此,除在附注 6.4.11 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外,本报告期末本基金的其他资产均能及时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

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

6.4.12.3.1 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 6.4.11 “期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券”，本报告期内本基金未出现因投资品种变现困难或投资集中而无法以合理价格及时变现基金资产以支付赎回款的情况。

6.4.12.4 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。

6.4.12.4.1 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。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	664,393,124.42	-	-	-	-	-	664,393,124.42
结算备付金	5,734,778.61	-	-	-	-	-	5,734,778.61
存出保证金	3,687,151.05	-	-	-	-	-	3,687,151.05
交易性金融资产	-	-	400,480,000.00	-	-	16,286,177,267.31	16,686,657,267.31
应收证券清算款	-	-	-	-	-	18,706,282.50	18,706,282.50
应收利息	-	-	-	-	-	3,373,067.88	3,373,067.88
应收申购款	111,493.89	-	-	-	-	52,839,966.11	52,951,460.00

其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	673,926,547.97	-	-400,480,000.00	-	-	-16,361,096,583.80	17,435,503,131.77
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	253,062,020.84	253,062,020.84
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	17,770,160.35	17,770,160.35
应付托管费	-	-	-	-	-	2,733,870.82	2,733,870.82
应付交易费用	-	-	-	-	-	5,870,968.60	5,870,968.60
其他负债	-	-	-	-	-	1,323,736.80	1,323,736.80
负债总计	-	-	-	-	-	280,760,757.41	280,760,757.41
利率敏感度缺口	673,926,547.97	-	-400,480,000.00	-	-	-16,080,335,826.39	17,154,742,374.36
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	1,280,847,636.56	-	-	-	-	-	1,280,847,636.56
结算备付金	20,695,269.10	-	-	-	-	-	20,695,269.10
存出保证金	4,872,198.73	-	-	-	-	-	4,872,198.73
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-17,980,550,751.19	17,980,550,751.19
应收证券清算款	-	-	-	-	-	297,979,011.12	297,979,011.12
应收利息	-	-	-	-	-	288,264.68	288,264.68
应收申购款	207,176.18	-	-	-	-	59,590,541.50	59,797,717.68
资产总计	1,306,622,280.57	-	-	-	-	-18,338,408,568.49	19,645,030,849.06
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	304,937,307.71	304,937,307.71
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	20,711,064.34	20,711,064.34
应付托管费	-	-	-	-	-	3,186,317.60	3,186,317.60
应付交易费用	-	-	-	-	-	11,052,022.50	11,052,022.50
其他负债	-	-	-	-	-	1,691,818.76	1,691,818.76
负债总计	-	-	-	-	-	341,578,530.91	341,578,530.91
利率敏感度缺口	1,306,622,280.57	-	-	-	-	-17,996,830,037.58	19,303,452,318.15

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。

6.4.12.4.1.2 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6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	674,008.77	-
2. 市场利率上升 25 个基点	-671,236.29	-	

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。

6.4.12.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.12.4.3 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的股票，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。

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	16,286,177,267.31	94.94	17,980,550,751.19	93.15
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	400,480,000.00	2.33	-	-
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	16,686,657,267.31	97.27	17,980,550,751.19	93.15

注：本基金股票投资占基金资产的比例为 0-95%，其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产

的 0-50%；持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；本基金每个交易日日终在扣除股票期权、股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上表。

6.4.12.4.3.2 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6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 股票基准指数下降 100 个基点	-172, 253, 627. 33	-200, 364, 721. 58
2. 股票基准指数上升 100 个基点	172, 253, 627. 33	200, 364, 721. 58	

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。

6.4.13 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	16,286,177,267.31	93.41
	其中：股票	16,286,177,267.31	93.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	400,480,000.00	2.30
	其中：债券	400,480,000.00	2.30
	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	670,127,903.03	3.84
8	其他各项资产	78,717,961.43	0.45
9	合计	17,435,503,131.77	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	7,801,046,073.99	45.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	46,404.58	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,022,608,775.05	35.11
J	金融业	34,721.10	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,983,038,706.88	11.56
N	水利、环境和公共设施管理业	35,554.25	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	479,317,349.42	2.79
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	16,286,177,267.31	94.94

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股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	603986	兆易创新	8,333,318	1,565,830,452.20	9.13
2	300661	圣邦股份	6,000,069	1,516,397,438.37	8.84
3	002594	比亚迪	6,000,076	1,506,019,076.00	8.78
4	688012	中微公司	8,000,000	1,327,360,000.00	7.74
5	300454	深信服	4,999,944	1,297,385,469.12	7.56
6	300676	华大基因	10,000,314	1,186,037,240.40	6.91
7	688536	思瑞浦	1,856,630	1,023,003,130.00	5.96
8	600588	用友网络	30,000,077	997,802,561.02	5.82
9	688023	安恒信息	3,629,600	914,659,200.00	5.33
10	300012	华测检测	25,000,046	797,001,466.48	4.65
11	688158	优刻得	18,000,000	706,500,000.00	4.12
12	603893	瑞芯微	5,000,023	697,303,207.58	4.06
13	300124	汇川技术	8,000,093	594,086,906.18	3.46
14	688050	爱博医疗	1,475,000	557,225,500.00	3.25
15	603882	金域医学	3,000,046	479,317,349.42	2.79
16	688561	奇安信	5,000,000	461,550,000.00	2.69
17	688083	中望软件	600,000	331,380,000.00	1.93
18	002439	启明星辰	10,000,054	290,101,566.54	1.69
19	689009	九号公司	399,390	33,996,076.80	0.20
20	688696	极米科技	1,252	976,860.48	0.01
21	688665	四方光电	1,687	218,399.02	0.00
22	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.00
23	688601	力芯微	1,174	156,952.06	0.00
24	688667	菱电电控	1,191	123,721.08	0.00
25	688625	呈和科技	2,672	113,907.36	0.00

26	688323	瑞华泰	4,513	102,806.14	0.00
27	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
28	688216	气派科技	2,000	95,280.00	0.00
29	688109	品茗股份	1,301	93,802.10	0.00
30	688316	青云科技	1,428	92,820.00	0.00
31	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
32	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
33	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
34	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
35	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
36	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
37	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
38	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
39	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
40	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
41	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
42	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
43	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
44	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
45	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
46	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
47	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
48	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
49	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
50	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
51	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
52	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
53	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
54	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
55	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
56	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
57	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
58	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
59	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
60	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
61	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
62	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
63	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
64	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00

65	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
66	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
67	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
68	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
69	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
70	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
71	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
72	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
73	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
74	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
75	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
76	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
77	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
78	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
79	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
80	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
81	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
82	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
83	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
84	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
85	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
86	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
87	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
88	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
89	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
90	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
91	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
92	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	688158	优刻得	751,276,749.13	3.89
2	300676	华大基因	623,300,030.69	3.23
3	688012	中微公司	575,448,116.82	2.98

4	300661	圣邦股份	544,242,099.40	2.82
5	002594	比亚迪	430,577,027.09	2.23
6	603893	瑞芯微	407,004,110.66	2.11
7	603882	金域医学	398,691,595.74	2.07
8	600588	用友网络	384,216,085.58	1.99
9	688050	爱博医疗	320,737,594.58	1.66
10	688185	康希诺	292,891,683.03	1.52
11	688083	中望软件	291,802,133.04	1.51
12	688521	芯原股份	281,964,943.51	1.46
13	688023	安恒信息	268,129,563.12	1.39
14	688561	奇安信	259,989,001.09	1.35
15	603986	兆易创新	259,628,250.05	1.34
16	688536	思瑞浦	228,482,651.66	1.18
17	002439	启明星辰	216,674,840.18	1.12
18	300012	华测检测	196,312,908.21	1.02
19	688981	中芯国际	170,962,383.86	0.89
20	002230	科大讯飞	143,830,912.88	0.75

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。

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	002594	比亚迪	1,006,351,870.74	5.21
2	002352	顺丰控股	961,468,079.81	4.98
3	601633	长城汽车	801,719,207.70	4.15
4	002439	启明星辰	789,416,117.52	4.09
5	600588	用友网络	763,749,138.69	3.96
6	603986	兆易创新	759,043,191.28	3.93
7	603882	金域医学	668,295,486.98	3.46
8	300012	华测检测	635,538,080.32	3.29
9	300124	汇川技术	616,456,586.08	3.19
10	300454	深信服	610,458,139.21	3.16
11	300888	稳健医疗	600,918,854.41	3.11
12	300223	北京君正	492,478,172.16	2.55
13	688088	虹软科技	418,642,289.74	2.17
14	688185	康希诺	336,160,996.02	1.74

15	688085	三友医疗	222,728,991.36	1.15
16	688521	芯原股份	205,013,025.48	1.06
17	300661	圣邦股份	199,368,351.94	1.03
18	300676	华大基因	190,336,573.64	0.99
19	688981	中芯国际	163,570,097.91	0.85
20	002230	科大讯飞	147,276,379.77	0.76

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。

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	7,397,073,508.41
卖出股票收入（成交）总额	10,816,300,370.63

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	400,480,000.00	2.33
	其中：政策性金融债	400,480,000.00	2.33
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	400,480,000.00	2.33

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	210301	21 进出 01	4,000,000	400,480,000.00	2.33

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本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情况,在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

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	3,687,151.05
2	应收证券清算款	18,706,282.50
3	应收股利	-
4	应收利息	3,373,067.88
5	应收申购款	52,951,460.00
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	78,717,961.43

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

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
1,041,202	7,590.20	793,191,310.23	10.04%	7,109,744,751.46	89.96%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	朱江伦	6,030,000.00	1.13%
2	黄小江	5,582,659.00	1.05%
3	泰康资产丰选 1 号股票型 fof 养老金产品—中国工商 银行股份有限公司	5,332,000.00	1.00%
4	中信证券—华夏人寿保险股 份有限公司—万能险产品— 中信证券华夏人寿 FOF1 号 单一资	5,038,993.00	0.95%
5	中信证券—中信银行—中信 证券稳盈 FOF1 号集合资产 管理计划	4,631,056.00	0.87%
6	侯举超	4,534,740.00	0.85%
7	于先兰	4,151,691.00	0.78%
8	李一	3,274,612.00	0.62%
9	刘颖杰	3,215,678.00	0.60%
10	俞玲娣	3,189,057.00	0.60%

注：上述持有人为场内持有人

8.3 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	2,530,143.50	0.0320%

8.4 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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2005 年 7 月 15 日 ）基金份额总额	309,958,613.24
本报告期期初基金份额总额	8,733,115,869.31
本报告期基金总申购份额	5,126,563,350.68
减：本报告期基金总赎回份额	5,956,743,158.30
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	7,902,936,061.69

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

2021 年 3 月 16 日，公司聘任陈广益先生担任公司总经理。

基金托管人：

本报告期内，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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

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未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	3	2,300,443,942.01	12.64%	2,142,406.29	12.90%	-
天风证券	1	2,075,240,472.89	11.40%	1,932,666.92	11.64%	-
银河证券	2	1,933,212,798.55	10.62%	1,709,178.39	10.29%	-
海通证券	1	1,898,345,792.91	10.43%	1,805,898.48	10.87%	-
广发证券	2	1,463,757,763.23	8.04%	1,363,713.90	8.21%	-
华西证券	1	1,315,079,820.21	7.22%	1,145,295.73	6.90%	-
东方证券	2	1,172,216,342.29	6.44%	1,091,992.40	6.57%	-
信达证券	2	1,116,193,173.65	6.13%	1,039,510.54	6.26%	-

安信证券	1	1,090,129,808.69	5.99%	797,214.52	4.80%	-
中信建投	3	860,377,520.69	4.73%	801,269.06	4.82%	-
申万宏源	1	566,520,233.31	3.11%	527,601.74	3.18%	-
开源证券	2	523,459,565.63	2.88%	487,500.57	2.94%	-
方正证券	1	507,569,144.57	2.79%	472,703.54	2.85%	-
华泰证券	1	448,893,629.90	2.47%	418,054.70	2.52%	-
中银国际	1	396,738,217.16	2.18%	377,417.26	2.27%	-
华金证券	1	268,205,040.68	1.47%	249,780.02	1.50%	-
兴业证券	2	265,703,003.46	1.46%	247,621.75	1.49%	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
江南证券	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，本基金新增华安证券交易单元 2 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

本基金本报告期内未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）发行及募集的文件。
- 2、《万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）基金合同》。
- 3、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 4、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的基金净值、季度报告、更新招募说明书及其他临时公告。
- 5、万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）2021 年中期报告原文。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。
- 7、《万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）托管协议》。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司

2021 年 8 月 30 日