

# 万家中证红利指数证券投资基金(LOF) 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：中国建设银行股份有限公司

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、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。

基金托管人中国建设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、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
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内容的真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告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	48
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 .....	50
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 本基金投资股指期货的投资政策 .....	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
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	51
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情况 .....	52
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>52</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
10.8 其他重大事件 .....	54
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>56</b>
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 .....	56
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录 .....	56
12.2 存放地点 .....	56
12.3 查阅方式 .....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	万家中证红利指数证券投资基金(LOF)	
基金简称	万家红利	
场内简称	万家中证红利 LOF	
基金主代码	161907	
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)	
基金合同生效日	2011 年 3 月 17 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	58,058,196.70 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	2011 年 6 月 15 日	
下属分级基金的基 金简称	万家红利 A	万家红利 C
下属分级基金的交 易代码	161907	015558
报告期末下属分级 基金的份额总额	57,584,386.99 份	473,809.71 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式指数化投资方法,通过严格的投资纪律约束和数量化风险控制手段,在正常市场情况下,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪偏离度不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 4%,实现对中证红利指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为指数型基金,原则上采用完全复制法。 本基金的投资策略包括:1、资产配置策略;2、股票投资策略;3、债券投资策略;4、其他金融衍生产品投资策略。
业绩比较基准	95%×中证红利指数收益率+5%×银行同业存款利率。
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,预期风险高于货币市场基金、债券型基金

	及混合型基金,属于较高风险,较高预期收益的证券投资基金品种。
--	--------------------------------

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	兰剑	李申
	联系电话	021-38909626	021-60637102
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4008880800	021-60637111
传真		021-38909627	021-60635778
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)	北京市西城区金融大街 25 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)	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200122	100033
法定代表人		方一天	田国立

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网 址	<a href="http://www.wjasset.com">http://www.wjasset.com</a>
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区浦电路 360 号陆家嘴投资大厦 9 楼基 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(2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日)	报告期(2022 年 04 月 25 日-2022 年 06 月 30 日)
	万家红利 A	万家红利 C
本期已实现收益	3,752,542.14	61,517.30
本期利润	658,939.19	117,130.88
加权平均基金份 额本期利润	0.0117	0.1436
本期加权平均净	0.52%	6.39%

值利润率		
本期基金份额净值增长率	0.34%	7.62%
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	74,307,315.27	610,294.27
期末可供分配基金份额利润	1.2904	1.2881
期末基金资产净值	131,891,702.26	1,084,103.98
期末基金份额净值	2.2904	2.2881
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	129.04%	7.62%

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、上述基金业绩指标不包括持有人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。

4、自 2022 年 4 月 25 日起,增设本基金 C 类份额,详情请参阅相关公告。

### 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

万家红利 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	2.16%	0.79%	0.68%	0.80%	1.48%	-0.01%
过去三个月	-0.90%	1.37%	-3.50%	1.37%	2.60%	0.00%

过去六个月	0.34%	1.40%	-1.82%	1.41%	2.16%	-0.01%
过去一年	6.55%	1.24%	-0.75%	1.25%	7.30%	-0.01%
过去三年	38.82%	1.12%	15.39%	1.12%	23.43%	0.00%
自基金合同生效起 至今	129.04%	1.36%	55.92%	1.33%	73.12%	0.03%

万家红利 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	2.11%	0.79%	0.68%	0.80%	1.43%	-0.01%
自基金合同生效起 至今	7.62%	1.07%	4.85%	1.07%	2.77%	0.00%

注：1、业绩比较基准为 95%×中证红利指数收益率+5%×银行同业存款利率。

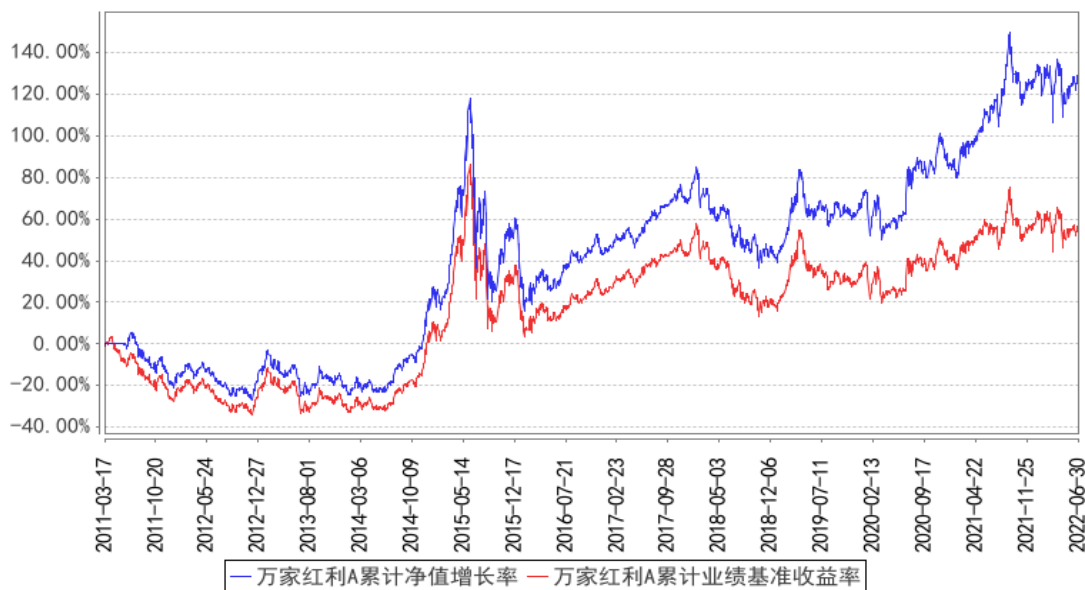
2、万家红利 C 上述“自基金合同生效起至今”实际为“自基金份额类别首次确认起至今”，下同。

3、自 2022 年 4 月 25 日起，增设本基金 C 类份额，详情请参阅相关公告。

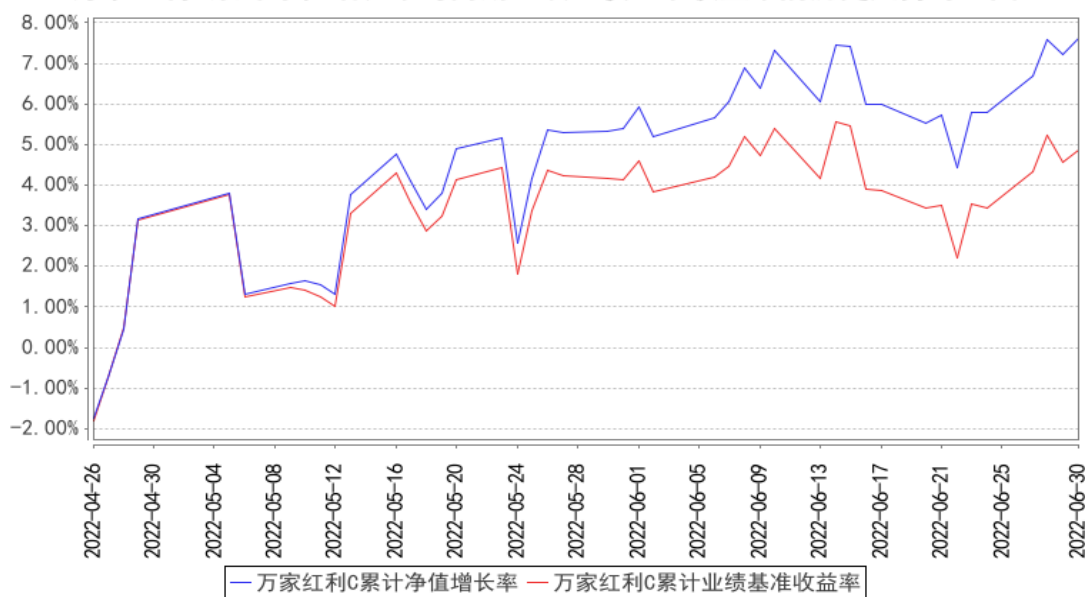


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

万家红利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



万家红利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、本基金成立于2011年3月17日，建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

2、本基金自2022年4月25日起增设C类份额，2022年4月26日起确认有C类基金份额登记在册。

## § 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		

杨坤	万家 180 指数证券投资基金、万家上证 50 交易型开放式指数证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金 (LOF)、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理	2019 年 10 月 24 日	-	8 年	法国南特矿业学院硕士，2013 年 11 月至 2014 年 12 月在 Fractabole 担任量化 IT 工程师；于 2015 年 6 月加入万家基金管理有限公司，担任研究员。2019 年 10 月起任量化投资部基金经理职务
----	---	------------------	---	-----	---

注：1、任职日期以公告为准。

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

本基金作为被动投资的指数基金，其投资目标是通过跟踪、复制中证红利指数，为投资者获取市场长期的平均收益。报告期内我们严格按照基金合同规定，原则上采取完全复制的方法进行投资管理，努力拟合标的指数，减小跟踪误差，将基金跟踪误差控制在较低范围之内。同时，本基金采用有效的量化跟踪技术，降低管理成本。导致跟踪误差的主要原因是基金参与新股申购，基金申购赎回、禁止投资成分股替代、标的指数成分股调整、成分股分红和基金费用等因素。

回顾 2022 年上半年，在一季度中，市场整体呈现震荡调整的走势，冲击了所有市场投资者，海外通胀推动的利率上行影响全球资产定价，俄乌冲突打击风险偏好，北上资金的风格切换，新发基金遇冷等因素一定程度直接冲击了原本缺乏增量资金且高仓位运行的机构配置。二季度开始，国内疫情呈现多点爆发，对经济活动造成重大冲击。前期在各种内外部风险冲击下悲观情绪达到顶点，市场深度调整，后续随着上海疫情的有效控制以及复工复产的推进，市场在二季度中后期迎来反弹，整体呈现出“深 V”走势。A 股在外围市场大幅波动的情况下，走出了相对独立的走势，交易疫情后经济的修复已经历一波可观的反弹。报告期本基金投资标的指数——中证红利指数收益率为-1.99%。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家红利 A 的基金份额净值为 2.2904 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.34%，同期业绩比较基准收益率为-1.82%，截至本报告期末万家红利 C 的基金份额净值为 2.2881 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.62%，同期业绩比较基准收益率为 4.85%。基金报告期末 A 份额、C 份额日均跟踪偏离度分别为 0.0390%、0.0703%，年跟踪误差分别为 0.9372%、1.1627%，符合基金合同中日均跟踪偏离度低于 0.35%和年跟踪误差低于 4 %的规定。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年下半年，目前海外面临较为严重的通胀压力，迫使海外国家通过加息、缩表等方式遏制通胀，但这不可避免造成经济需求的下行，对于这一风险，我们需要时刻密切关注。国内来看，相关政策面依然较好，经济未来 3 个月仍处于弱复苏轨道，市场估值安全边际依然较高，对于市场整体不必过于悲观，只是逐渐要增加谨慎心理，随着二季度的相关数据的公布以及上市公司的中期业绩的公布，未来市场波动的概率增加，当前整体我们以谨慎乐观为主。市场风格方面，小盘风格可能持续占优，历史复盘来看，小盘风格更容易在危机事件过后的市场中占优，原

因是宏观经济较弱时，国家推出与稳增长、市场流动性相关的呵护政策。在疫后复苏的阶段，小盘具备更强的业绩弹性，同时在宏观流动性充裕，政策频繁催化热点的情况下，小盘股也更易受到资金的追捧，从而呈现不错的业绩表现和向上的弹性。另外，从行业构成来看，大盘股的行业往往偏向于金融、消费等和宏观经济相关度较高的行业，而小盘股的新兴制造，科技成长属性更强，从产业发展趋势来看，小盘也更加贴合国家长期的转型方向。

本基金将继续贯彻被动投资理念，恪守基金合同规定的投资目标和投资策略，一如既往地规范、勤勉运作，将本基金打造为稳定有效的指数投资工具，为基金份额持有人谋求长期、稳定回报。

#### 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

根据基金合同规定：“基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 20% (收益分配基准日可供分配利润指截至收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数)”。

本基金报告期内未进行利润分配，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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 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

本托管人复核审查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。

## § 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：万家中证红利指数证券投资基金 (LOF)

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	8,849,687.36	6,877,985.42
结算备付金		53,788.99	34,614.54
存出保证金		10,077.34	30,137.90
交易性金融资产	6.4.7.2	125,609,837.31	109,902,701.04
其中：股票投资		125,609,837.31	109,902,701.04
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		209,697.53	725,014.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	809.53
资产总计		134,733,088.53	117,571,263.13
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		842,025.93	354,785.40
应付管理人报酬		82,691.22	72,869.29
应付托管费		16,538.25	14,573.85
应付销售服务费		1,660.53	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	814,366.36	757,779.25
负债合计		1,757,282.29	1,200,007.79
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	58,058,196.70	50,979,887.93
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	74,917,609.54	65,391,367.41
净资产合计		132,975,806.24	116,371,255.34
负债和净资产总计		134,733,088.53	117,571,263.13

注：1、报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 58,058,196.70 份，其中万家红利 A 基金份额净值 2.2904 元，基金份额总额 57,584,386.99；万家红利 C 基金份额净值 2.2881 元，基金份额总额 473,809.71。

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：万家中证红利指数证券投资基金 (LOF)

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 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
<b>一、营业总收入</b>		1,566,356.56	15,696,249.85
1. 利息收入		15,278.34	10,990.06
其中：存款利息收入	6.4.7.10	15,278.34	10,990.06
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,536,240.51	5,635,621.06
其中：股票投资收益	6.4.7.11	1,007,300.03	3,133,391.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
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	3,528,940.48	2,502,229.75
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	-3,037,989.37	10,023,107.35
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	52,827.08	26,531.38
<b>减：二、营业总支出</b>		790,286.49	675,359.70
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	473,916.82	309,116.30
2. 托管费	6.4.10.2.2	94,783.34	61,823.29
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,039.71	-

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. 其他费用	6.4.7.20		219,546.62	304,420.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）			776,070.07	15,020,890.15
减：所得税费用			-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）			776,070.07	15,020,890.15
五、其他综合收益的税后净额			-	-
六、综合收益总额			776,070.07	15,020,890.15

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：万家中证红利指数证券投资基金 (LOF)

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）	50,979,887.93	-	65,391,367.41	116,371,255.34
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）	50,979,887.93	-	65,391,367.41	116,371,255.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	7,078,308.77	-	9,526,242.13	16,604,550.90
（一）、综合收益总额	-	-	776,070.07	776,070.07
（二）、本期基金份额交易产生的	7,078,308.77	-	8,750,172.06	15,828,480.83

基金净值变动数 (净值减少以“-” 号填列)				
其中: 1. 基金申购 款	26,811,588.93	-	33,690,624.68	60,502,213.61
2. 基金赎 回款	-19,733,280.16	-	-24,940,452.62	-44,673,732.78
(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)	58,058,196.70	-	74,917,609.54	132,975,806.24
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)	22,923,205.33	-	19,777,129.56	42,700,334.89
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)	22,923,205.33	-	19,777,129.56	42,700,334.89
三、本期增减变动 额(减少以“-” 号填列)	45,137,115.89	-	58,471,716.66	103,608,832.55
(一)、综合收益 总额	-	-	15,020,890.15	15,020,890.15
(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)	45,137,115.89	-	43,450,826.51	88,587,942.40
其中: 1. 基金申购 款	55,045,421.11	-	52,970,903.67	108,016,324.78
2. 基金赎 回款	-9,908,305.22	-	-9,520,077.16	-19,428,382.38

（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）	68,060,321.22	-	78,248,846.22	146,309,167.44

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：

<u>方一天</u>	<u>陈广益</u>	<u>尹超</u>
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

万家中证红利指数型证券投资基金(LOF) (以下简称“本基金”),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[2010]1388号文《关于核准万家中证红利指数证券投资基金(LOF)募集的批复》的核准,由基金管理人万家基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于2011年3月17日正式生效,首次设立募集规模为1,088,639,584.43份基金份额。本基金为契约型开放式,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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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《万家中证红利指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,经与本基金基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,于2022年4月25日起,增设本基金C类基金份额。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括中证红利指数的成份股及经中证指数公司公告将要被选入中证红利指数的股票、新股(一级市场初次发行或增发)、债券以及法律法规或中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他金融产品出现后,本基金在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资于中证红利指数成份股及经中证指数公司公告将要被选入中证红利指数的股票的组合比例不低于基金资产净值的90%,现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较

基准为： $95\% \times \text{中证红利指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$ 。

本基金采用被动式指数化投资方法，通过严格的投资纪律约束和数量化风险控制手段，在正常市场情况下，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，实现对中证红利指数的有效跟踪。

#### 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业务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 0.75% 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 0.15% 的年费率逐日计提;

(3) 基金指数使用费按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率逐日计提, 下限为每季度人民币伍万元;

(4) 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;

(5)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
<b>金融资产</b>				
银行存款	摊余成本(应收款项)	6,877,985.42	摊余成本	6,878,762.78
结算备付金	摊余成本(应收款项)	34,614.54	摊余成本	34,631.70
存出保证金	摊余成本(应收款项)	30,137.90	摊余成本	30,152.75
交易性金融资产	以公允价值计量且其变动计入当期损益	109,902,701.04	以公允价值计量且其变动计入当期损益	109,902,701.04
应收利息	摊余成本(应收款项)	809.53	—	—
应收申购款	摊余成本(应收款项)	725,014.70	摊余成本	725,014.86

<b>金融负债</b>				
应付赎回款	摊余成本	354,785.40	摊余成本	354,785.40
应付管理人报酬	摊余成本	72,869.29	摊余成本	72,869.29
应付托管费	摊余成本	14,573.85	摊余成本	14,573.85
应付交易费用	摊余成本	166,995.84	—	—
其他负债	摊余成本	590,783.41	摊余成本	757,779.25

#### 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	8,849,687.36
等于：本金	8,848,854.03
加：应计利息	833.33
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	8,849,687.36

#### 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	128,186,712.30	-	125,609,837.31	-2,576,874.99
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	128,186,712.30	-	125,609,837.31	-2,576,874.99

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 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

本报告期末本基金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

本报告期末本基金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

本报告期末本基金未持有其他资产。

#### 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	2,458.65
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	41,953.28
其中：交易所市场	41,953.28
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	734,986.62
其他	34,967.81
合计	814,366.36

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

##### 万家红利 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	50,979,887.93	50,979,887.93
本期申购	21,434,517.68	21,434,517.68
本期赎回（以“-”号填列）	-14,830,018.62	-14,830,018.62
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	57,584,386.99	57,584,386.99

##### 万家红利 C

项目	本期 2022 年 4 月 25 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	5,377,071.25	5,377,071.25
本期赎回（以“-”号填列）	-4,903,261.54	-4,903,261.54
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	473,809.71	473,809.71

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 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

#### 万家红利 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	93,373,220.93	-27,981,853.52	65,391,367.41
本期利润	3,752,542.14	-3,093,602.95	658,939.19
本期基金份额交易产生的变动数	12,106,937.19	-3,849,928.52	8,257,008.67
其中：基金申购款	39,467,220.59	-12,416,090.92	27,051,129.67
基金赎回款	-27,360,283.40	8,566,162.40	-18,794,121.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	109,232,700.26	-34,925,384.99	74,307,315.27

#### 万家红利 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	61,517.30	55,613.58	117,130.88
本期基金份额交易产生的变动数	837,184.27	-344,020.88	493,163.39
其中：基金申购款	10,004,869.36	-3,365,374.35	6,639,495.01
基金赎回款	-9,167,685.09	3,021,353.47	-6,146,331.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	898,701.57	-288,407.30	610,294.27

### 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	14,246.84
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	789.71
其他	241.79
合计	15,278.34

注：其他为直销申购款利息收入和存出保证金利息收入。

### 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	1,007,300.03
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	1,007,300.03

#### 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	14,276,939.90
减：卖出股票成本总额	13,205,066.81
减：交易费用	64,573.06
买卖股票差价收入	1,007,300.03

#### 6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期内未投资债券。

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内未投资贵金属。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内未投资衍生工具。

#### 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	3,528,940.48
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	3,528,940.48

#### 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	-3,037,989.37
股票投资	-3,037,989.37
债券投资	-
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	-3,037,989.37

#### 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	51,641.45
基金转换费收入	1,185.63
合计	52,827.08

#### 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	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	60.00
账户维护费	9,000.00
上市费	28,663.76
指数使用费	100,000.00
合计	219,546.62

#### 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重大日后事项。

#### 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
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	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

金额单位：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	
	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	32,695,122.09	72.58	45,749,363.93	43.99

##### 6.4.10.1.2 债券交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方席位进行债券交易。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方席位进行债券回购交易。

##### 6.4.10.1.4 权证交易

本报告期间及上年度可比期间，本基金未通过关联方席位进行权证交易。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022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	30,450.87	72.58	30,450.87	72.58
关联方名称	上年度可比期间 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	42,606.83	43.99	40,010.64	43.53

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本

基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 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	473,916.82	309,116.30
其中：支付销售机构的客户维护费	154,635.70	92,951.70

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.75% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 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、休息日，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 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托管费	94,783.34	61,823.29

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，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，经基金托管人复核后于次月首日起 3 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，支付日期顺延。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

1、本基金本报告期无需要支付给关联方的销售服务费。

2、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 0.60%。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。

销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据相关协议支付给各销售机构，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3、自 2022 年 4 月 25 日起，增设本基金 C 类份额，详情请参阅相关公告。

#### 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

本报告期内及上年度可比期间未发生基金管理人运用固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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 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
建设银行	8,849,687.36	14,246.84	8,664,130.37	9,861.23

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设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没有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
688400	凌云光	2022年6月27日	1个月内(含)	新股未上市	21.93	21.93	2,396	52,544.28	52,544.28	-

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

报告期末本基金未持有暂时停牌等流通受限的股票。

##### 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 2022 年 6 月 30 日止，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 2022 年 6 月 30 日止，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。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了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同责任,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。本基金均投资于具有良好信用等级证券,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,申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外,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;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。于 2022 年 6 月 30 日,本基金未持有债券投资。

#### 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。

本基金所持大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 中列示的本基金于本报告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	8,849,687.36	-	-	-	-	-	8,849,687.36
结算备付金	53,788.99	-	-	-	-	-	53,788.99
存出保证金	10,077.34	-	-	-	-	-	10,077.34
交易性金融资产	-	-	-	-	-	125,609,837.31	125,609,837.31
应收申购款	150.18	-	-	-	-	209,547.35	209,697.53
资产总计	8,913,703.87	-	-	-	-	125,819,384.66	134,733,088.53
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	842,025.93	842,025.93
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	82,691.22	82,691.22
应付托管费	-	-	-	-	-	16,538.25	16,538.25
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,660.53	1,660.53
其他负债	-	-	-	-	-	814,366.36	814,366.36
负债总计	-	-	-	-	-	1,757,282.29	1,757,282.29
利率敏感度缺口	8,913,703.87	-	-	-	-	124,062,102.37	132,975,806.24
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	6,877,985.42	-	-	-	-	6,877,985.42
结算备付金	34,614.54	-	-	-	-	34,614.54
存出保证金	30,137.90	-	-	-	-	30,137.90
交易性金融资产	-	-	-	-	-109,902,701.04	109,902,701.04
其他资产	-	-	-	-	-	809.53
应收申购款	480.00	-	-	-	-	724,534.70
资产总计	6,943,217.86	-	-	-	-110,628,045.27	117,571,263.13
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	-	354,785.40
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	72,869.29
应付托管费	-	-	-	-	-	14,573.85
其他负债	-	-	-	-	-	757,779.25
负债总计	-	-	-	-	-	1,200,007.79
利率敏感度缺口	6,943,217.86	-	-	-	-109,428,037.48	116,371,255.34

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

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2021 年 12 月 31 日：同)，银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 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	125,609,837.31	94.46	109,902,701.04	94.44
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	125,609,837.31	94.46	109,902,701.04	94.44

注：本基金投资于中证红利指数成份股及经中证指数公司公告将要被选入中证红利指数的股票的组合比例不低于基金资产净值的 90%，现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	2. 以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
	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	-1,080,923.83	-917,148.05
	2. 股票基准指数上升 100 个基点	1,080,923.83	917,148.05

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。

#### 6.4.14 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	125,557,293.03	107,087,033.04
第二层次	52,544.28	2,815,668.00
第三层次	-	-
合计	125,609,837.31	109,902,701.04

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### 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	125,609,837.31	93.23
	其中：股票	125,609,837.31	93.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-

4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,903,476.35	6.61
8	其他各项资产	219,774.87	0.16
9	合计	134,733,088.53	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	21,057,665.34	15.84
C	制造业	47,709,159.16	35.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,741,392.88	4.32
E	建筑业	3,988,319.92	3.00
F	批发和零售业	7,597,469.77	5.71
G	交通运输、仓储和邮政业	7,431,912.01	5.59
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,526,444.92	1.15
J	金融业	14,420,178.95	10.84
K	房地产业	14,661,188.15	11.03
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,375,408.00	1.03
S	综合	-	-
	合计	125,509,139.10	94.38

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	---------	--------------

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	100,698.21	0.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	100,698.21	0.08

### 7.2.3 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。

### 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

#### 7.3.1 期末指数投资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	600188	兖矿能源	109,100	4,307,268.00	3.24
2	601088	中国神华	87,733	2,921,508.90	2.20
3	600327	大东方	506,200	2,556,310.00	1.92
4	600325	华发股份	334,900	2,535,193.00	1.91
5	601398	工商银行	495,847	2,365,190.19	1.78
6	600389	江山股份	36,000	2,186,280.00	1.64
7	601666	平煤股份	155,500	2,113,245.00	1.59
8	601225	陕西煤业	96,900	2,052,342.00	1.54

9	600153	建发股份	144,711	1,891,372.77	1.42
10	600873	梅花生物	165,900	1,871,352.00	1.41
11	000550	江铃汽车	115,100	1,850,808.00	1.39
12	000090	天健集团	268,200	1,847,898.00	1.39
13	600985	淮北矿业	124,300	1,809,808.00	1.36
14	000036	华联控股	396,190	1,711,540.80	1.29
15	601006	大秦铁路	259,239	1,708,385.01	1.28
16	000937	冀中能源	226,900	1,692,674.00	1.27
17	600971	恒源煤电	208,920	1,650,468.00	1.24
18	600395	盘江股份	182,200	1,597,894.00	1.20
19	601328	交通银行	319,653	1,591,871.94	1.20
20	600350	山东高速	299,700	1,573,425.00	1.18
21	002763	汇洁股份	207,280	1,556,672.80	1.17
22	600479	千金药业	160,300	1,545,292.00	1.16
23	002238	天威视讯	266,861	1,526,444.92	1.15
24	600348	华阳股份	97,400	1,505,804.00	1.13
25	600282	南钢股份	476,900	1,502,235.00	1.13
26	600383	金地集团	111,100	1,493,184.00	1.12
27	600376	首开股份	300,665	1,476,265.15	1.11
28	002003	伟星股份	152,490	1,448,655.00	1.09
29	601169	北京银行	318,000	1,443,720.00	1.09
30	601988	中国银行	435,274	1,418,993.24	1.07
31	600028	中国石化	344,768	1,406,653.44	1.06
32	600048	保利发展	79,300	1,384,578.00	1.04
33	601098	中南传媒	145,700	1,375,408.00	1.03
34	600729	重庆百货	62,600	1,350,282.00	1.02
35	600019	宝钢股份	223,360	1,344,627.20	1.01
36	601216	君正集团	274,500	1,339,560.00	1.01
37	601000	唐山港	480,600	1,239,948.00	0.93
38	600023	浙能电力	356,200	1,236,014.00	0.93
39	601009	南京银行	118,537	1,235,155.54	0.93
40	000581	威孚高科	63,500	1,222,375.00	0.92
41	601288	农业银行	395,895	1,195,602.90	0.90
42	600016	民生银行	318,141	1,183,484.52	0.89
43	600606	绿地控股	289,905	1,148,023.80	0.86
44	002303	美盈森	332,200	1,146,090.00	0.86
45	600027	华电国际	290,400	1,141,272.00	0.86
46	300107	建新股份	214,900	1,141,119.00	0.86
47	601003	柳钢股份	281,180	1,138,779.00	0.86
48	600594	益佰制药	202,300	1,132,880.00	0.85
49	600548	深高速	118,400	1,129,536.00	0.85
50	002088	鲁阳节能	53,540	1,127,017.00	0.85

51	002884	凌霄泵业	54,900	1,124,901.00	0.85
52	601998	中信银行	236,100	1,121,475.00	0.84
53	601818	光大银行	371,742	1,118,943.42	0.84
54	600177	雅戈尔	168,417	1,116,604.71	0.84
55	603858	步长制药	56,400	1,111,644.00	0.84
56	603878	武进不锈	173,700	1,108,206.00	0.83
57	002737	葵花药业	70,400	1,101,056.00	0.83
58	000789	万年青	101,200	1,097,008.00	0.82
59	603886	元祖股份	62,000	1,092,440.00	0.82
60	600377	宁沪高速	127,400	1,091,818.00	0.82
61	600823	世茂股份	363,900	1,084,422.00	0.82
62	000402	金融街	181,016	1,077,045.20	0.81
63	002367	康力电梯	140,700	1,051,029.00	0.79
64	603156	养元饮品	45,780	1,040,121.60	0.78
65	000961	中南建设	330,600	1,008,330.00	0.76
66	601166	兴业银行	50,598	1,006,900.20	0.76
67	002233	塔牌集团	113,700	1,006,245.00	0.76
68	000002	万科 A	48,800	1,000,400.00	0.75
69	002563	森马服饰	168,500	997,520.00	0.75
70	600261	阳光照明	295,000	994,150.00	0.75
71	601668	中国建筑	186,541	992,398.12	0.75
72	601126	四方股份	61,100	990,431.00	0.74
73	600900	长江电力	42,292	977,791.04	0.74
74	000895	双汇发展	32,900	963,970.00	0.72
75	000656	金科股份	334,400	956,384.00	0.72
76	002419	天虹股份	134,100	956,133.00	0.72
77	002146	荣盛发展	308,200	933,846.00	0.70
78	600066	宇通客车	107,797	932,444.05	0.70
79	002110	三钢闽光	152,450	928,420.50	0.70
80	600642	申能股份	151,338	859,599.84	0.65
81	002372	伟星新材	35,704	858,324.16	0.65
82	600704	物产中大	164,400	843,372.00	0.63
83	002516	旷达科技	164,700	843,264.00	0.63
84	600585	海螺水泥	23,600	832,608.00	0.63
85	300193	佳士科技	88,500	830,130.00	0.62
86	600674	川投能源	67,300	802,216.00	0.60
87	601601	中国太保	31,400	738,842.00	0.56
88	600808	马钢股份	194,900	738,671.00	0.56
89	600886	国投电力	69,000	724,500.00	0.54
90	002601	龙佰集团	35,500	711,775.00	0.54
91	600104	上汽集团	39,954	711,580.74	0.54
92	000828	东莞控股	67,200	688,800.00	0.52

93	600398	海澜之家	141,000	669,750.00	0.50
94	603355	莱克电气	24,200	610,566.00	0.46
95	600741	华域汽车	26,241	603,543.00	0.45
96	000157	中联重科	97,975	603,526.00	0.45
97	601636	旗滨集团	42,600	543,150.00	0.41
98	600688	上海石化	153,000	486,540.00	0.37
99	002206	海利得	72,120	455,798.40	0.34

### 7.3.2 期末积极投资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	688400	凌云光	2,396	52,544.28	0.04
2	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.03
3	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01

### 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	600188	兖矿能源	852,239.00	0.73
2	600327	大东方	698,946.00	0.60
3	601398	工商银行	622,598.00	0.54
4	601088	中国神华	589,947.00	0.51
5	600325	华发股份	539,994.00	0.46
6	601666	平煤股份	498,676.00	0.43
7	600479	千金药业	473,117.00	0.41
8	600153	建发股份	460,250.00	0.40
9	002763	汇洁股份	437,956.00	0.38
10	600389	江山股份	432,363.00	0.37
11	000550	江铃汽车	429,832.00	0.37
12	000090	天健集团	427,748.00	0.37
13	601006	大秦铁路	423,465.00	0.36
14	600282	南钢股份	417,066.00	0.36
15	600350	山东高速	407,889.00	0.35
16	600376	首开股份	400,648.00	0.34
17	600985	淮北矿业	399,695.00	0.34
18	000036	华联控股	392,067.00	0.34
19	002238	天威视讯	388,473.00	0.33
20	002003	伟星股份	387,462.00	0.33

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	601728	中国电信	1,645,789.87	1.41
2	600153	建发股份	446,857.00	0.38
3	600479	千金药业	322,384.00	0.28
4	600188	兖矿能源	271,379.00	0.23
5	601398	工商银行	220,276.00	0.19
6	601288	农业银行	218,020.00	0.19
7	601666	平煤股份	216,506.00	0.19
8	688789	宏华数科	205,372.50	0.18
9	601088	中国神华	203,594.00	0.17
10	600327	大东方	203,551.00	0.17
11	600325	华发股份	175,370.00	0.15
12	600389	江山股份	154,950.00	0.13
13	600985	淮北矿业	142,747.00	0.12
14	601225	陕西煤业	133,706.00	0.11
15	000090	天健集团	132,604.00	0.11
16	000937	冀中能源	131,738.00	0.11
17	688119	中钢洛耐	131,693.65	0.11
18	688778	厦钨新能	129,790.00	0.11
19	601006	大秦铁路	128,764.00	0.11
20	600350	山东高速	126,271.00	0.11

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	31,950,192.45
卖出股票收入（成交）总额	14,276,939.90

注：买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，“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。卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，“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。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

**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 本基金投资股指期货的投资政策**

根据基金合同，本基金暂不可投资股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

根据基金合同，本基金暂不可投资国债期货。

**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	10,077.34
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	209,697.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	219,774.87

**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****7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688400	凌云光	52,544.28	0.04	新股流通受限

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 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 (%)
万家红利 A	11,754	4,899.13	49,408.86	0.09	57,534,978.13	99.91
万家红利 C	360	1,316.14	0.00	0.00	473,809.71	100.00
合计	12,089	4,802.56	49,408.86	0.09	58,008,787.84	99.91

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	黄云乐	500,000.00	3.92
2	陈圣岐	280,026.00	2.20
3	张肖	234,050.00	1.83
4	刘晨阳	156,851.00	1.23
5	须燕秋	148,076.00	1.16
6	毛志强	147,364.00	1.16
7	孙寒梅	143,072.00	1.12
8	李娜	141,857.00	1.11
9	戴红艳	126,571.00	0.99
10	黄琦	115,281.00	0.90

## 8.3 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	万家红利 A	48,838.46	0.0848
	万家红利 C	2.82	0.0006
	合计	48,841.28	0.0841

## 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	万家红利 A	0
	万家红利 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	万家红利 A	0
	万家红利 C	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家红利 A	万家红利 C
基金合同生效日 (2011年3月17日) 基金份额总额	1,088,639,584.43	-
本报告期期初基金份额总额	50,979,887.93	-
本报告期基金总申购份额	21,434,517.68	5,377,071.25
减：本报告期基金总赎回份额	14,830,018.62	4,903,261.54
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	57,584,386.99	473,809.71

## § 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：

报告期内管理人无重大人事变动。

基金托管人：

报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

报告期间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、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

### 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 (%)	
中泰证券	1	32,695,122.09	72.58	30,450.87	72.58	-
方正证券	1	12,350,618.52	27.42	11,502.41	27.42	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-

西部证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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：

新增安信证券 1 个交易席位、西部证券 1 个交易席位。

### 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	关于万家基金管理有限公司旗下部分基金参加中国工商银行申购及定投优惠活动的公告	指定媒介	2022-01-05
2	万家中证红利指数证券投资基金(LOF)2021年第4季度报告	指定媒介	2022-01-21
3	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在招商证券开通定投的公告	指定媒介	2022-03-14
4	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在华龙证券开通定投的公告	指定媒介	2022-03-15
5	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在光大证券开通定投的公告	指定媒介	2022-03-17

6	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
7	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
8	万家中证红利指数证券投资基金 (LOF) 2021 年年度报告	指定媒介	2022-03-30
9	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	2022-04-15
10	万家基金管理有限公司关于旗下基金在德邦证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-04-18
11	万家中证红利指数证券投资基金 (LOF) 2022 年第 1 季度报告	指定媒介	2022-04-21
12	万家中证红利指数证券投资基金 LOF) 托管协议	指定媒介	2022-04-21
13	万家中证红利指数证券投资基金 LOF) 基金合同	指定媒介	2022-04-21
14	关于万家中证红利指数证券投资基金 (LOF) 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	2022-04-21
15	万家中证红利指数证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要 (更新)	指定媒介	2022-04-25
16	万家中证红利指数证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书 (2022 年第 1 号)	指定媒介	2022-04-25
17	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	2022-04-25
18	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
19	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
20	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
21	万家基金管理有限公司关于旗下基金	指定媒介	2022-06-21

	在泰信财富证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告		
--	--------------------------------	--	--

## § 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、中国证监会批准本基金发行及募集的文件
- 2、《万家中证红利指数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、万家中证红利指数证券投资基金 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、《万家中证红利指数证券投资基金托管协议》

### 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](http://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