

万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§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.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
§8 投资组合报告	49
8.1 期末基金资产组合情况.....	49
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	49
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	65
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	66
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	66

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	66
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	66
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
8.12 投资组合报告附注	66
§9 基金份额持有人信息.....	68
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	68
§10 开放式基金份额变动.....	69
§ 11 重大事件揭示.....	70
11.1 基金份额持有人大会决议	70
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
11.4 基金投资策略的改变	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	73
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	73
§13 备查文件目录.....	74
13.1 备查文件目录	74
13.2 存放地点	74
13.3 查阅方式	74

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	万家双引擎灵活配置混合
基金主代码	519183
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 6 月 27 日
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	15,336,493.68 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过股票、债券的有效配置,把握价值、成长风格特征,精选个股,构造风格类资产组合。在有效控制风险的前提下,谋求基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金根据对宏观经济环境、经济增长前景及证券市场状况的综合分析,结合对股票市场整体估值水平、上市公司利润增长情况,债券市场整体收益率曲线变化等综合指标的分析,形成对各大类资产收益风险水平的前瞻性预测,以此确定股票、固定收益证券和现金等大类资产及中国证监会允许基金投资的其他金融工具在给定区间内的动态配置。
业绩比较基准	60%×沪深 300 指数收益率+40%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金是混合型基金,风险高于货币市场基金和债券型基金,属于中高风险、中高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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	龚小武
	联系电话	021-38909626	021-52629999-212056
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话		4008880800	95561
传真		021-38909627	021-62159217
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)	福州市湖东路 154 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	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼

	楼层 9 层)	
邮政编码	200122	200120
法定代表人	方一天	高建平

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.wjasset.com
基金年度报告备置地点	中国(上海)自由贸易试验区浦电路 360 号 8 楼(名义楼层 9 层)基金管理人办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	立信会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市南京东路 61 号 4 楼新黄浦金融大厦
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	4,498,983.13	3,392,865.31	-19,277,373.90
本期利润	6,059,589.27	5,790,469.59	-15,913,286.50
加权平均基金份额本期利润	0.3212	0.4319	-0.1793
本期加权平均净值利润率	18.05%	29.92%	-12.22%
本期基金份额净值增长率	22.70%	28.79%	-14.77%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	14,000,380.09	9,549,088.36	4,568,324.96
期末可供分配基金份额利润	0.9129	0.6500	0.2812
期末基金资产净值	31,048,273.89	24,240,708.36	20,816,427.83
期末基金份额净值	2.0245	1.6500	1.2812
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	256.91%	190.89%	125.87%

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、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。

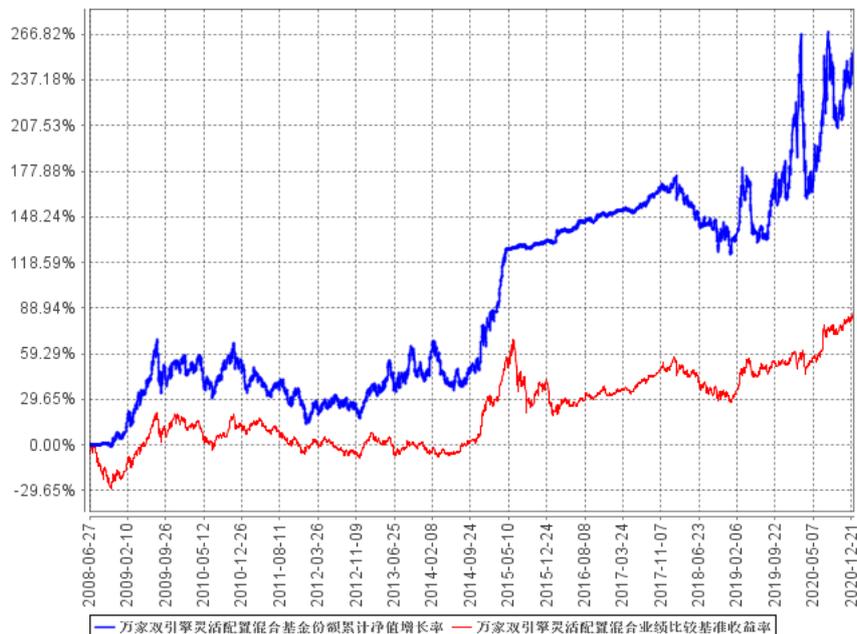
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	15.84%	1.44%	8.20%	0.60%	7.64%	0.84%
过去六个月	12.57%	1.83%	15.07%	0.81%	-2.50%	1.02%
过去一年	22.70%	2.13%	17.94%	0.86%	4.76%	1.27%
过去三年	34.68%	1.48%	25.06%	0.80%	9.62%	0.68%
过去五年	53.14%	1.15%	34.05%	0.75%	19.09%	0.40%
自基金合同生效起至今	256.91%	1.14%	86.64%	0.96%	170.27%	0.18%

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

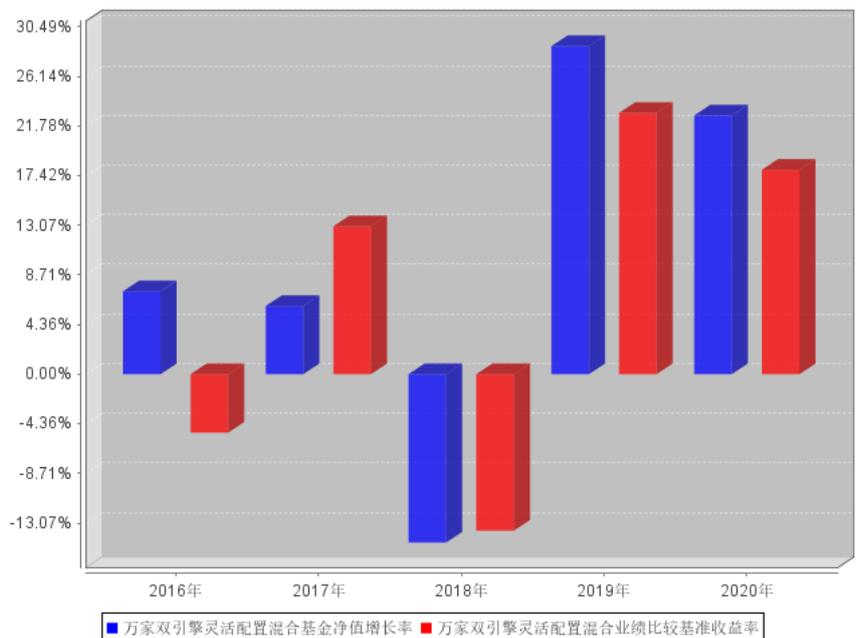
万家双引擎灵活配置混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2008 年 6 月 27 日成立，建仓期为六个月，建仓期结束时和报告期末各项资产配置比例符合基金合同要求。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家双引擎灵活配置混合过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未分配利润。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44号文批准设立。公司现股东为中泰证券股份有限公司、新疆国际实业股份有限公司和齐河众鑫投资有限公司,住所:中国(上海)自由贸易试验区浦电路360号8楼(名义楼层9层),办公地点:上海市浦东新区浦电路360号9楼,注册资本3亿元人民币。目前管理八十三只开放式基金,分别为万家180指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选混合型证券投资基金(LOF)、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金(LOF)、万家添利债券型证券投资基金(LOF)、万家新机遇价值驱动灵活配置混合型证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家上证50交易型开放式指数证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞和灵活配置混合型证券投资基金、万家颐达灵活配置混合型证券投资基金、万家颐和灵活配置混合型证券投资基金、万家恒瑞18个月定期开放债券型证券投资基金、万家3-5年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家鑫安纯债债券型证券投资基金、万家鑫璟纯债债券型证券投资基金、万家沪深300指数增强型证券投资基金、万家家享中短债债券型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家1-3年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家瑞隆混合型证券投资基金、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家现金增利货币市场基金、万家消费成长股票型证券投资基金、万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家玖盛纯债9个月定期开放债券型证券投资基金、万家天添宝货币市场基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、万家家瑞债券型证券投资基金、万家臻选混合型证券投资基金、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金、万家中证1000指数增强型发起式证券投资基金、万家成长优选灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金、万家经济新动能混合型证券投资基金、万家潜力价值灵

活配置混合型证券投资基金、万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家新机遇龙头企业灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型证券投资基金、万家智造优势混合型证券投资基金、万家稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、万家人工智能混合型证券投资基金、万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金（LOF）、万家平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、万家民安增利 12 个月定期开放债券型证券投资基金、万家鑫盛纯债债券型证券投资基金、万家汽车新趋势混合型证券投资基金、万家惠享 39 个月定期开放债券型证券投资基金、万家科技创新混合型证券投资基金、万家自主创新混合型证券投资基金、万家民丰回报一年持有期混合型证券投资基金、万家可转债债券型证券投资基金、万家民瑞祥和 6 个月持有期债券型证券投资基金、万家价值优势一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫动力月月购一年滚动持有混合型证券投资基金、万家养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金(FOF)、万家科创板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家创业板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家家丰中短债债券型证券投资基金、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。

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		
叶勇	万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2018 年 8 月 24 日	-	7 年	中国政法大学法学本科。2007 年 7 月至 2011 年 7 月在上海证券报社担任财经报道记者；2011 年 8 月至 2012 年 8 月在华泰证券研究所担任研究员；2012 年 9 月至 2013 年 8 月在大公报上海办事处担任副主任；2013 年 9 月至 2014 年 8 月在上海市北高新股份有限公司担任投资管理部经理助理；2014 年 9 月至 2015 年 2 月在上海三熙投资管理咨询有限公司担任副总经理；2015 年 3 月加入万家基金管理有限公司，曾任股权投资部副总监、权益投资二部总监、投资经理，2018 年 8 月起

					担任投资研究部基金经理职务。
--	--	--	--	--	----------------

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《万家基金管理有限公司公平交易管理办法》,涵盖了研究、授权、投资决策和交易执行等投资管理活动的各个环节,严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送,确保公平对待不同投资组合。

在投资决策上:(1)公司对不同类别的投资组合分别设定独立的投资部门,公募基金经理和私募资产管理计划投资经理不得互相兼任。(2)公司投资管理实行分层次决策,投资决策委员会根据公募基金和私募投资组合的规模、风格特征等因素合理确定各投资组合经理的投资权限,投资组合经理在授权范围内自主决策,超过投资权限的操作需经过严格的逐级审批程序。(3)公司研究员撰写的研究报告等均通过统一的投研管理平台发布,确保各投资组合经理在获得投资信息、投资建议和实施决策方面享有公平的机会。

在交易执行上:(1)公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离,实行集中交易制度;(2)对于交易公开竞价交易,所有指令必须通过系统下达,公司执行交易系统中的公平交易程序;(3)对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易,各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量,原则上公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;(4)对于银行间交易,交易部按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。

在行为监控上,公司定期对不同投资组合的同向交易价差、反向交易,场外交易对手议价的价格公允性及其他异常交易情况进行监控及分析,基金经理对异常交易情况进行合理性解释并留存记录,并定期编制公平交易分析报告,由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司定期进行同向交易价差分析,即采集公司旗下管理的所有组合,连续四个季度期间内,不

同时间窗下(日内、3 日内、5 日内)的同向交易样本,对两两组合之间的同向交易价差均值进行原假设为 0, 95% 的置信水平下的 t 检验,并对结论进行跟踪分析,分析结果显示在样本数量大于 30 的前提下,组合之间在同向交易方面不存在违反公平交易行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 7 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

2020 年年初,在宏观经济低迷,经济数据持续探底的背景下,遭遇新冠疫情黑天鹅事件,对一季度国内经济带来较大冲击,随着疫情全球蔓延,加速推动全球经济走向衰退。全球股市均在一季度发生股灾式暴跌。A 股自 2019 年 12 月以来,走出以电子、计算机、新能源汽车为代表的大科技行情,创业板指数走势最为强劲,沪深 300 指数表现较为低迷。受春节假期中国国内对疫情强力控制收效的影响,A 股在 2 月 3 日一次性反应国内疫情影响后,随即快速反弹,科技股延续了先前的强势走势,三周时间内,科技股加速上涨,冲顶。受到获利盘回吐、全球疫情蔓延和宏观利率下行不达预期的影响,科技股暴跌式回调,电子板块回调幅度高达 30%以上,基本回吐了 2019 年 12 月份以来 3 个月的涨幅。权重股指数也在 3 月份开始出现大幅回调。

二季度,在宏观经济低迷,经济数据持续探底的背景下,新冠疫情对全球经济造成重大影响,但得益于中国有力应对疫情,中国经济较快实现复苏,尽管疫情让中国一季度经济遭遇不小创伤,但是随着全力推动“六稳”“六保”政策落地见效,二季度经济增速转正可期,下半年经济将步入常态化增长,全年有望实现正增长。中国经济加速复苏犹如一盏明灯,将为世界经济照亮希望、注入信心。A 股从二季度开始逐步进入震荡上行阶段,多个板块进入恢复性上涨,尤其是创业板为代表的成长股走势强劲,医药、新能源汽车涨势较强,科技板块震荡上行。继续呈现出明显的成长风格为代表的结构性行情。

三季度,中国经济继续 V 型反弹态势,投消费双双回暖,出口大幅好于预期,进口不确定性较大房地产市场销售投资“两旺”,CPI 持续回落,PPI 低位回升,就业压力依然存在,经济增长持续回升。人民币汇率区间波动,外汇储备财政收支持续改善,货币政策基调稳健。中国经济进一步复苏态势明确,而外部经济形势则出现转好的迹象。受到经济复苏几次,A 股从三季度初开始强力反弹,并与 7 月中旬短线冲顶,然后进入两个半月的震荡调整阶段。科技、医药表现低迷,

消费股继续震荡调整，汽车、新能源汽车表现非常强势。

四季度，受益于海外出口和内需拉动，中国经济延续复苏态势。海外疫情依然较为严重，全球经济复苏仍然存在不确定性。四季度以来，顺周期风格主导了市场行情，表现强势板块是：可选消费（汽车、家电、家居、白酒）、周期股（有色金属、化工）等，新能源汽车和光伏板块。值得注意的是，这一轮顺周期风格的演绎，并不是以传统周期股为主体的，而是聚焦周期行业中真正的价值龙头，具备成长股属性的周期行业龙头受到市场的追捧。顺周期风格在 7 月份快速启动后盘整了两个半月，四季度再次启动的行情，一方面反映了这轮国内和海外加库存周期对相关行业的影响；另一方面反映了市场对于经济复苏向好的预期更加稳固。

一季度，重仓配置了科技股板块，以半导体、计算机为主。尽管受到疫情影响，但是一二月份依然取得了较为强劲的收益。但是，在二月底科技股暴跌调整的行情中，受损较为惨重，一季度出现巨大回撤。二季度，在 4 月份之后，仓位逐步调整到消费医药建材上。在 4-6 月二季度实现了稳健的净值上涨。三季度，通过医药、消费、科技等行业板块的配置，在 7 月行情中取得了一定的收益，净值一度创新高。但是在 8-9 月医药股和成长股整体的大幅调整中，由于医药股的回撤较大，导致净值出现较大回撤。四季度以来，通过配置均衡银行股、工程机械、锂电上游、汽车、家电、白酒龙头等，实现了稳健的收益。

总体来看，全年总收益跑输行业中位数水平，业绩表现不佳。主要在于对科技股和医药股的重仓投资中止损不够及时，回撤过大，给持有人造成了不好的体验，在此深表歉意。下一步将努力完善策略，不断提高选股和择时体系的能力和水平。

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 2.0245 元；本报告期基金份额净值增长率为 22.70%，业绩比较基准收益率为 17.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

后市展望方面，受到疫情反弹的影响，2021 年世界经济运行依然存在很大的不确定性，但是，受到疫苗逐步接种的影响，海外疫情在逐步缓解，可以预期的是全球经济正在不断复苏的过程中。而国内需求将加快回升步伐，宏观政策总体上将保持平稳。中央政府逆周期调节政策已经开始发力并且收效，货币政策逐步回归正常化，基金经理对于后面中国经济的表现比较乐观。在坚定房地产调控预期，去杠杆，推进科技创新和经济结构调整，不断推进股权融资、注册制和资本市场发展的大背景下，持续看好资本市场核心资产的表现，展望 2021 年一季度，市场将在经历四季度的震荡盘整蓄势后，重拾升势，进入震荡上行的格局。

这是一轮全球需求加杠杆，中国生产加杠杆的过程；疫情的扰动对中国制造是个巨大的机遇，

可以发挥中国最全面的工业体系的优势，大大强化中国产能在全球扩张的能力，迅速扩大市场，即便疫苗出来，中国制造的优势也很难被取代。在投资端（地产、基建）乏力的情况下，出口的意外走强和内需的扩大，将成为中国经济走出困境的双轮驱动，尽管周期力度比上一轮弱，制造业的复苏代表更为健康的状态，制造业的固定资产投资增速在经过了十年的探底之后迎来回升阶段，这是顺周期风格能够持续的坚实基础。

展望 2021 年的配置上，将沿着顺周期的主线，继续均衡配置周期行业中的优秀制造业龙头、食品饮料、新能源产业链等行业龙头企业。

从个股选择上，优选市场空间巨大、核心竞争力强、技术水平先进、研发实力强大、财务质量好、治理结构良好、有企业家精神的公司。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

（一）加强风控文化建设

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

（二）制度流程建设

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

（三）定期和临时稽核工作

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

（四）绩效评估和风险管理工作

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

（五）员工行为管理与防控内幕交易

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金自 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日,连续 243 个工作日基金资产净值低于五千万元。我司已经将该基金情况向证监会报备并提出解决方案,目前我司正积极加强营销,力争扩大本基金规模。本报告期内,本基金没有出现基金资产净值低于五千万元情况。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为;基金管理人在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	信会师报字[2021]第 ZA30355 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“万家双引擎灵活配置混合”）财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了万家双引擎灵活配置混合 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于万家双引擎灵活配置混合，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>万家双引擎灵活配置混合的基金管理人万家基金管理有限公司管理层（以下简称管理层）负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估万家双引擎灵活配置混合的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督万家双引擎灵活配置混合的财务报告</p>

	<p>过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对万家双引擎灵活配置混合持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致万家双引擎灵活配置混合不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与管理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项</p>

	进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	立信会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	王斌	徐冬
会计师事务所的地址	中国 上海	
审计报告日期	2021 年 3 月 29 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,801,777.08	1,592,505.65
结算备付金		312,505.20	271,245.28
存出保证金		46,307.32	29,155.57
交易性金融资产	7.4.7.2	29,182,606.97	22,780,337.66
其中：股票投资		29,182,606.97	22,780,337.66
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		513,068.13	1,541,092.20
应收利息	7.4.7.5	356.09	888.78
应收股利		-	-
应收申购款		17,436.69	76,449.96
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		31,874,057.48	26,291,675.10
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		395,962.92	1,563,698.33
应付赎回款		150,144.82	232,117.00
应付管理人报酬		20,627.87	15,942.46
应付托管费		6,446.21	4,982.02
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	171,895.81	143,700.49
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	80,705.96	90,526.44
负债合计		825,783.59	2,050,966.74
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	15,336,493.68	14,691,620.00
未分配利润	7.4.7.10	15,711,780.21	9,549,088.36
所有者权益合计		31,048,273.89	24,240,708.36
负债和所有者权益总计		31,874,057.48	26,291,675.10

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.0245 元，基金份额总额 15,336,493.68 份。

7.2 利润表

会计主体：万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		7,762,492.76	6,785,124.68
1. 利息收入		23,505.80	134,608.47
其中：存款利息收入	7.4.7.11	23,505.80	48,389.08
债券利息收入		-	45,936.27
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	40,283.12
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,867,593.77	4,230,917.28
其中：股票投资收益	7.4.7.12	5,763,621.83	4,047,328.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	116,619.35
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	103,971.94	66,969.44
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,560,606.14	2,397,604.28
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	310,787.05	21,994.65
减：二、费用		1,702,903.49	994,655.09
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	267,633.90	155,331.45
2. 托管费	7.4.10.2.2	83,635.60	48,541.07
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	7.4.7.19	1,293,028.02	723,250.18
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	2.39
7. 其他费用	7.4.7.20	58,605.97	67,530.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,059,589.27	5,790,469.59
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,059,589.27	5,790,469.59

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	14,691,620.00	9,549,088.36	24,240,708.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,059,589.27	6,059,589.27
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）	644,873.68	103,102.58	747,976.26
其中：1. 基金申购款	39,506,232.34	30,787,802.76	70,294,035.10
2. 基金赎回款	-38,861,358.66	-30,684,700.18	-69,546,058.84
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	15,336,493.68	15,711,780.21	31,048,273.89
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）	16,248,102.87	4,568,324.96	20,816,427.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,790,469.59	5,790,469.59
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）	-1,556,482.87	-809,706.19	-2,366,189.06
其中：1. 基金申购款	8,730,252.94	4,110,096.27	12,840,349.21
2. 基金赎回款	-10,286,735.81	-4,919,802.46	-15,206,538.27
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	14,691,620.00	9,549,088.36	24,240,708.36

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>方一天</u>	<u>陈广益</u>	<u>陈广益</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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金（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[2008]316 号文《关于核准万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》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 2008 年 6 月 27 日正式生效，首次设立募集规模为 353,835,521.84 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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

2015 年 5 月 25 日本基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会审议并通过《关于修改万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，内容包括本基金修改基金投资范围、投资比例、收益分配方式、及基金合同其他内容修订等事项。自持有人大会决议生效之日起，旧版《万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效且新版《万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同时生效。

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(含中小企业私募债、证券公司短期公司债券)、现金、债券回购、银行存款、资产支持证券、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金通过股票、债券的有效配置,把握价值、成长风格特征,精选个股,构造风格类资产组合。在有效控制风险的前提下,谋求基金资产的持续稳健增值。本基金的业绩比较基准为:60%×沪深 300 指数收益率+40%×上证国债指数收益率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法(2020 年修订)》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》及其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

本基金的金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、

应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

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

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

2、金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，

应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，

按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.08%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 0.25%的年费率逐日计提；

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次分配比例不低于可分配收益的 90%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按权益登记日除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

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

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

(一) 印花税

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

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

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

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

(二) 增值税

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

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

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

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

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

(三) 企业所得税

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

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

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

(四) 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开

发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	1,801,777.08	1,592,505.65
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：	1,801,777.08	1,592,505.65

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	25,933,566.44	29,182,606.97	3,249,040.53
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		25,933,566.44	29,182,606.97	3,249,040.53
项目	上年度末 2019年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票		21,091,903.27	22,780,337.66	1,688,434.39
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		21,091,903.27	22,780,337.66	1,688,434.39

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	194.56	753.58
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	140.70	122.10
应收债券利息	-	-

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	0.03	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	20.80	13.10
合计	356.09	888.78

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	171,895.81	143,700.49
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	171,895.81	143,700.49

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	232.81	53.29
应付证券出借违约金	-	-
其他应付款	10,473.15	10,473.15
预提费用	70,000.00	80,000.00
合计	80,705.96	90,526.44

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,691,620.00	14,691,620.00
本期申购	39,506,232.34	39,506,232.34
本期赎回（以“-”号填列）	-38,861,358.66	-38,861,358.66

— 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	15,336,493.68	15,336,493.68

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,572,541.22	-23,452.86	9,549,088.36
本期利润	4,498,983.13	1,560,606.14	6,059,589.27
本期基金份额交易产生的变动数	-71,144.26	174,246.84	103,102.58
其中：基金申购款	27,749,119.25	3,038,683.51	30,787,802.76
基金赎回款	-27,820,263.51	-2,864,436.67	-30,684,700.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,000,380.09	1,711,400.12	15,711,780.21

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	17,390.23	42,803.22
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	5,219.85	4,849.74
其他	895.72	736.12
合计	23,505.80	48,389.08

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	425,928,479.83	236,287,069.36
减：卖出股票成本总额	420,164,858.00	232,239,740.87
买卖股票差价收入	5,763,621.83	4,047,328.49

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-	116,619.35
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-	116,619.35

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	-	14,959,944.48
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	-	14,706,545.25
减：应收利息总额	-	136,779.88
买卖债券差价收入	-	116,619.35

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	103,971.94	66,969.44
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	103,971.94	66,969.44

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	1,560,606.14	2,397,604.28
——股票投资	1,560,606.14	2,280,945.94
——债券投资	-	116,658.34
——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	1,560,606.14	2,397,604.28

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
基金赎回费收入	288,937.77	20,362.07
转换费	21,849.28	1,632.58
合计	310,787.05	21,994.65

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	1,293,028.02	723,250.18
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	1,293,028.02	723,250.18

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	20,000.00	30,000.00
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
其他	1,200.00	1,200.00
银行费用	1,405.97	330.00
帐户维护费	36,000.00	36,000.00
合计	58,605.97	67,530.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金本报告期末无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金本报告期末无需要披露的重大日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
兴业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
新疆国际实业股份有限公司	基金管理人的股东
齐河众鑫投资有限公司	基金管理人的股东

万家共赢资产管理有限公司	基金管理人的子公司
万家财富基金销售（天津）有限公司	基金管理人的子公司、基金销售机构
上海万家朴智投资管理有限公司	基金管理人控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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
中泰证券股 份有限公司	763,682,695.76	89.84%	477,278,088.47	100.00%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例
中泰证券股 份有限公司	-	-	19,805,656.56	100.00%

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
中泰证券股 份有限公司	-	-	274,600,000.00	100.00%

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31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
中泰证券股份有限公司	711,218.57	89.84%	91,423.53	53.19%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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
中泰证券股份有限公司	444,490.39	100.00%	143,700.49	100.00%

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31 日
	当期发生的基金应支付的管理费	267,633.90
其中：支付销售机构的客户维护费	90,199.36	58,634.86

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	83,635.60	48,541.07

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期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。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例
万家财富基金销售（天津）有限公司	-	-	619,373.33	4.2200%

司				
---	--	--	--	--

7.4.10.5 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 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	1,801,777.08	17,390.23	1,592,505.65	42,803.22

注：本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限公司，2020年度获得的利息收入人民币5,219.85元(2019年度：人民币4,849.74元)，2020年末结算备付金余额为312,505.20元(2019年末：人民币271,245.28元)。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间没有需作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2020年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
605277	新亚电子	2020年12月25日	2021年1月6日	新股未上市	16.95	16.95	215	3,644.25	3,644.25	-
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	新股未上市	15.27	15.27	193	2,947.11	2,947.11	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 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金融资产款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止, 本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

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。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任, 或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息, 导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金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。

7.4.13.3 流动性风险

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

本基金所持证券全部在证券交易所上市，因此除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持有的证券大部分具有良好的流动性，部分证券流通暂时受限的情况参见附注 7.4.12 “期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券”，本报告期内本基金未出现因投资品种变现困难或投资集中而无法以合理价格及时变现基金资产以支付赎回款的情况。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

金、存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	1,801,777.08	-	-	-	-	-	1,801,777.08
结算备付金	312,505.20	-	-	-	-	-	312,505.20
存出保证金	46,307.32	-	-	-	-	-	46,307.32
交易性金融资产	-	-	-	-	-	29,182,606.97	29,182,606.97
应收证券清算款	-	-	-	-	-	513,068.13	513,068.13
应收利息	-	-	-	-	-	356.09	356.09
应收申购款	-	-	-	-	-	17,436.69	17,436.69
资产总计	2,160,589.60	-	-	-	-	29,713,467.88	31,874,057.48
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	395,962.92	395,962.92
应付赎回款	-	-	-	-	-	150,144.82	150,144.82
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	20,627.87	20,627.87
应付托管费	-	-	-	-	-	6,446.21	6,446.21
应付交易费用	-	-	-	-	-	171,895.81	171,895.81
其他负债	-	-	-	-	-	80,705.96	80,705.96
负债总计	-	-	-	-	-	825,783.59	825,783.59
利率敏感度缺口	2,160,589.60	-	-	-	-	28,887,684.29	31,048,273.89
上年度末 2019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	1,592,505.65	-	-	-	-	-	1,592,505.65
结算备付金	271,245.28	-	-	-	-	-	271,245.28
存出保证金	29,155.57	-	-	-	-	-	29,155.57
交易性金融资产	-	-	-	-	-	22,780,337.66	22,780,337.66
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,541,092.20	1,541,092.20
应收利息	-	-	-	-	-	888.78	888.78

应收申购款	-	-	-	-	76,449.96	76,449.96
资产总计	1,892,906.50	-	-	-	24,398,768.60	26,291,675.10
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	1,563,698.33	1,563,698.33
应付赎回款	-	-	-	-	232,117.00	232,117.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	15,942.46	15,942.46
应付托管费	-	-	-	-	4,982.02	4,982.02
应付交易费用	-	-	-	-	143,700.49	143,700.49
其他负债	-	-	-	-	90,526.44	90,526.44
负债总计	-	-	-	-	2,050,966.74	2,050,966.74
利率敏感度缺口	1,892,906.50	-	-	-	22,347,801.86	24,240,708.36

注：该表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，(2019 年 12 月 31 日：同) 银行存款、结算备付金以及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。(2019 年 12 月 31 日：同)

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2020 年 12 月 31 日		2019 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	29,182,606.97	93.99	22,780,337.66	93.98
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	29,182,606.97	93.99	22,780,337.66	93.98

注：股票投资占基金资产的 0%—95%。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%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等、权证占基金资产净值的 0%—3%、资产支持证券占基金资产净值的 0%—20%。

7.4.13.4.3.2 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。		
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（2020 年 12 月 31 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	1. 股票基准指数下降 100 个基点	-343,860.15	-248,637.26
2. 股票基准指数上升 100 个基点	343,860.15	248,637.26	

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

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(一) 公允价值

1、金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

2、持续的以公允价值计量的金融工具

(1) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为 29,176,015.61 元，属于第二层次的余额为 6,591.36 元，无属于第三层次的余额。（2019 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为 21,653,871.12 元，属于第二层次的余额为 1,126,466.54 元，无属于第三层次的余额。）

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(3) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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

3、非持续的以公允价值计量的金融工具

本基金本期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

4、不以公允价值计量的金融工具

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

(二)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	29,182,606.97	91.56
	其中：股票	29,182,606.97	91.56
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	2,114,282.28	6.63
8	其他各项资产	577,168.23	1.81
9	合计	31,874,057.48	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	323,820.00	1.04
B	采矿业	1,194,694.00	3.85
C	制造业	26,876,817.83	86.56
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	9,175.14	0.03
J	金融业	778,100.00	2.51
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	-	-

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	29,182,606.97	93.99

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资组合。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300769	德方纳米	11,100	1,855,920.00	5.98
2	600519	贵州茅台	900	1,798,200.00	5.79
3	601100	恒立液压	11,800	1,333,400.00	4.29
4	600031	三一重工	37,500	1,311,750.00	4.22
5	002709	天赐材料	12,600	1,307,880.00	4.21
6	601899	紫金矿业	128,600	1,194,694.00	3.85
7	300037	新宙邦	11,500	1,166,100.00	3.76
8	600563	法拉电子	10,100	1,086,255.00	3.50
9	000568	泸州老窖	4,800	1,085,568.00	3.50
10	002304	洋河股份	4,500	1,061,955.00	3.42
11	600660	福耀玻璃	22,100	1,061,905.00	3.42
12	603520	司太立	14,700	967,701.00	3.12
13	600426	华鲁恒升	25,500	951,150.00	3.06
14	000858	五粮液	3,000	875,550.00	2.82
15	002250	联化科技	33,700	808,463.00	2.60
16	000733	振华科技	13,400	788,590.00	2.54
17	300601	康泰生物	4,500	785,250.00	2.53
18	002601	龙蟠佰利	25,500	784,635.00	2.53
19	603187	海容冷链	13,000	780,000.00	2.51
20	300059	东方财富	25,100	778,100.00	2.51
21	300274	阳光电源	10,600	766,168.00	2.47
22	002507	涪陵榨菜	17,600	744,480.00	2.40
23	002594	比亚迪	3,600	699,480.00	2.25
24	688122	西部超导	8,213	653,015.63	2.10
25	600298	安琪酵母	12,600	643,482.00	2.07

26	603678	火炬电子	8,600	621,780.00	2.00
27	000636	风华高科	18,300	616,710.00	1.99
28	000333	美的集团	5,900	580,796.00	1.87
29	600438	通威股份	13,200	507,408.00	1.63
30	600346	恒力石化	17,600	492,272.00	1.59
31	000933	神火股份	51,300	409,374.00	1.32
32	002714	牧原股份	4,200	323,820.00	1.04
33	603868	飞科电器	6,300	294,714.00	0.95
34	003029	吉大正元	351	9,175.14	0.03
35	003028	振邦智能	208	8,671.52	0.03
36	605155	西大门	245	7,467.60	0.02
37	605377	华旺科技	363	7,249.11	0.02
38	605183	确成股份	379	6,427.84	0.02
39	605277	新亚电子	215	3,644.25	0.01
40	003031	中瓷电子	193	2,947.11	0.01
41	003025	思进智能	13	458.77	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002409	雅克科技	7,654,731.00	31.58
2	002156	通富微电	7,146,540.00	29.48
3	002371	北方华创	6,664,305.00	27.49
4	002185	华天科技	6,135,238.00	25.31
5	000636	风华高科	5,514,191.50	22.75
6	603986	兆易创新	4,979,182.59	20.54
7	300502	新易盛	4,853,417.00	20.02
8	688012	中微公司	4,780,883.04	19.72
9	603520	司太立	4,717,398.60	19.46
10	300223	北京君正	4,586,249.39	18.92
11	603290	斯达半导	4,386,403.00	18.10
12	600529	山东药玻	4,098,557.00	16.91
13	600519	贵州茅台	4,041,551.00	16.67
14	300014	亿纬锂能	4,015,754.00	16.57
15	300661	圣邦股份	3,910,079.00	16.13

16	000895	双汇发展	3,826,280.00	15.78
17	000672	上峰水泥	3,675,590.00	15.16
18	300601	康泰生物	3,671,059.00	15.14
19	002714	牧原股份	3,524,909.00	14.54
20	601318	中国平安	3,510,747.00	14.48
21	600588	用友网络	3,486,584.40	14.38
22	600745	闻泰科技	3,446,741.00	14.22
23	300454	深信服	3,424,654.08	14.13
24	300558	贝达药业	3,402,021.00	14.03
25	600660	福耀玻璃	3,386,798.60	13.97
26	603005	晶方科技	3,238,266.89	13.36
27	002271	东方雨虹	3,182,270.00	13.13
28	002216	三全食品	3,106,051.00	12.81
29	603501	韦尔股份	3,046,128.00	12.57
30	000858	五粮液	3,017,796.00	12.45
31	600305	恒顺醋业	3,004,011.00	12.39
32	300015	爱尔眼科	2,950,615.12	12.17
33	603378	亚士创能	2,893,622.00	11.94
34	002557	洽洽食品	2,888,723.00	11.92
35	300326	凯利泰	2,798,506.00	11.54
36	603160	汇顶科技	2,773,089.00	11.44
37	002475	立讯精密	2,768,236.70	11.42
38	002129	中环股份	2,763,780.00	11.40
39	000002	万科A	2,657,489.00	10.96
40	000100	TCL 科技	2,628,776.00	10.84
41	300357	我武生物	2,611,773.75	10.77
42	002709	天赐材料	2,484,513.30	10.25
43	600298	安琪酵母	2,471,583.00	10.20
44	300236	上海新阳	2,469,215.58	10.19
45	300373	扬杰科技	2,437,960.00	10.06
46	002299	圣农发展	2,409,967.19	9.94
47	300253	卫宁健康	2,375,453.82	9.80
48	600036	招商银行	2,364,122.00	9.75
49	600872	中炬高新	2,353,019.00	9.71
50	603605	珀莱雅	2,320,782.00	9.57
51	601939	建设银行	2,309,203.61	9.53

52	603187	海容冷链	2,241,210.00	9.25
53	600600	青岛啤酒	2,237,481.00	9.23
54	000596	古井贡酒	2,214,485.00	9.14
55	002460	赣锋锂业	2,211,673.00	9.12
56	688180	君实生物	2,063,447.48	8.51
57	002385	大北农	2,047,869.00	8.45
58	688037	芯源微	2,034,163.58	8.39
59	601933	永辉超市	2,025,632.00	8.36
60	300012	华测检测	2,004,487.00	8.27
61	603517	绝味食品	1,999,119.00	8.25
62	603027	千禾味业	1,976,692.00	8.15
63	600584	长电科技	1,945,070.00	8.02
64	600741	华域汽车	1,933,162.45	7.97
65	603881	数据港	1,871,393.00	7.72
66	002847	盐津铺子	1,866,773.00	7.70
67	000651	格力电器	1,857,764.00	7.66
68	002025	航天电器	1,826,362.00	7.53
69	300702	天宇股份	1,798,810.00	7.42
70	002624	完美世界	1,760,716.00	7.26
71	000333	美的集团	1,755,311.00	7.24
72	600809	山西汾酒	1,746,791.00	7.21
73	600185	格力地产	1,723,986.00	7.11
74	600703	三安光电	1,715,283.00	7.08
75	600346	恒力石化	1,712,487.63	7.06
76	002311	海大集团	1,704,828.92	7.03
77	001914	招商积余	1,679,322.00	6.93
78	300696	爱乐达	1,678,824.00	6.93
79	600276	恒瑞医药	1,675,500.00	6.91
80	300346	南大光电	1,661,335.00	6.85
81	300303	聚飞光电	1,658,010.00	6.84
82	600882	妙可蓝多	1,638,071.97	6.76
83	300598	诚迈科技	1,630,419.00	6.73
84	603719	良品铺子	1,627,175.60	6.71
85	300666	江丰电子	1,621,995.00	6.69
86	300623	捷捷微电	1,618,271.50	6.68
87	600690	海尔智家	1,608,601.77	6.64

88	600132	重庆啤酒	1,600,457.35	6.60
89	000001	平安银行	1,590,279.00	6.56
90	002555	三七互娱	1,588,032.00	6.55
91	000933	神火股份	1,571,163.00	6.48
92	603208	江山欧派	1,563,590.00	6.45
93	600436	片仔癀	1,558,448.00	6.43
94	603713	密尔克卫	1,537,520.00	6.34
95	000661	长春高新	1,531,299.00	6.32
96	688088	虹软科技	1,523,350.60	6.28
97	600984	建设机械	1,512,735.20	6.24
98	601100	恒立液压	1,494,331.00	6.16
99	601168	西部矿业	1,489,539.00	6.14
100	603990	麦迪科技	1,480,978.00	6.11
101	002918	蒙娜丽莎	1,474,067.00	6.08
102	300769	德方纳米	1,462,158.00	6.03
103	603686	龙马环卫	1,452,827.40	5.99
104	002250	联化科技	1,440,526.00	5.94
105	688981	中芯国际	1,396,873.06	5.76
106	002739	万达电影	1,377,545.00	5.68
107	002901	大博医疗	1,371,064.00	5.66
108	002977	天箭科技	1,365,368.00	5.63
109	600449	宁夏建材	1,363,675.00	5.63
110	603392	万泰生物	1,362,263.00	5.62
111	603127	昭衍新药	1,352,015.00	5.58
112	600926	杭州银行	1,329,964.00	5.49
113	002065	东华软件	1,297,459.00	5.35
114	601336	新华保险	1,295,053.00	5.34
115	603700	宁水集团	1,290,021.00	5.32
116	603345	安井食品	1,287,405.00	5.31
117	601818	光大银行	1,278,967.00	5.28
118	600019	宝钢股份	1,274,804.00	5.26
119	300699	光威复材	1,273,103.00	5.25
120	603179	新泉股份	1,271,077.44	5.24
121	300087	荃银高科	1,263,006.00	5.21
122	000807	云铝股份	1,254,693.00	5.18
123	000876	新希望	1,237,936.00	5.11

124	603708	家家悦	1,230,155.00	5.07
125	002493	荣盛石化	1,227,040.00	5.06
126	300573	兴齐眼药	1,220,212.00	5.03
127	300628	亿联网络	1,214,894.50	5.01
128	002916	深南电路	1,207,796.00	4.98
129	600893	航发动力	1,202,939.00	4.96
130	601899	紫金矿业	1,199,714.00	4.95
131	002127	南极电商	1,196,720.00	4.94
132	000526	紫光学大	1,189,704.00	4.91
133	603533	掌阅科技	1,188,586.00	4.90
134	601636	旗滨集团	1,177,452.00	4.86
135	002367	康力电梯	1,171,879.00	4.83
136	001979	招商蛇口	1,169,350.00	4.82
137	600048	保利地产	1,168,907.00	4.82
138	688111	金山办公	1,168,891.18	4.82
139	000710	贝瑞基因	1,162,203.60	4.79
140	300595	欧普康视	1,148,484.80	4.74
141	300470	中密控股	1,147,161.00	4.73
142	688268	华特气体	1,147,118.94	4.73
143	002572	索菲亚	1,130,704.00	4.66
144	600079	人福医药	1,124,050.00	4.64
145	300737	科顺股份	1,122,747.00	4.63
146	002242	九阳股份	1,116,889.00	4.61
147	002007	华兰生物	1,113,007.00	4.59
148	300482	万孚生物	1,110,540.00	4.58
149	600426	华鲁恒升	1,105,056.00	4.56
150	688200	华峰测控	1,098,621.91	4.53
151	002398	垒知集团	1,098,382.00	4.53
152	000786	北新建材	1,093,263.00	4.51
153	600309	万华化学	1,092,413.00	4.51
154	002697	红旗连锁	1,085,632.00	4.48
155	300896	爱美客	1,078,040.00	4.45
156	603129	春风动力	1,053,816.00	4.35
157	002444	巨星科技	1,043,629.18	4.31
158	300059	东方财富	1,042,020.00	4.30
159	002803	吉宏股份	1,031,523.00	4.26

160	300010	豆神教育	1,018,772.00	4.20
161	002318	久立特材	1,018,232.83	4.20
162	600031	三一重工	1,012,571.00	4.18
163	002690	美亚光电	1,009,460.00	4.16
164	002568	百润股份	1,009,372.00	4.16
165	600383	金地集团	998,957.52	4.12
166	300037	新宙邦	986,184.00	4.07
167	600352	浙江龙盛	977,559.00	4.03
168	002812	恩捷股份	968,538.00	4.00
169	300782	卓胜微	966,179.00	3.99
170	688023	安恒信息	948,629.79	3.91
171	002601	龙蟠佰利	948,197.00	3.91
172	300347	泰格医药	947,321.00	3.91
173	002001	新和成	943,870.00	3.89
174	603259	药明康德	936,250.00	3.86
175	000568	泸州老窖	935,253.00	3.86
176	002273	水晶光电	932,257.03	3.85
177	603960	克来机电	927,928.60	3.83
178	002635	安洁科技	927,770.00	3.83
179	600563	法拉电子	922,301.00	3.80
180	300815	玉禾田	915,513.98	3.78
181	002139	拓邦股份	913,942.00	3.77
182	002456	欧菲光	902,464.00	3.72
183	600460	士兰微	900,318.00	3.71
184	300540	深冷股份	899,639.00	3.71
185	600989	宝丰能源	899,333.00	3.71
186	002050	三花智控	897,840.00	3.70
187	603043	广州酒家	895,566.00	3.69
188	002304	洋河股份	892,675.00	3.68
189	000401	冀东水泥	891,000.00	3.68
190	000860	顺鑫农业	889,640.00	3.67
191	600585	海螺水泥	887,680.00	3.66
192	002541	鸿路钢构	887,224.00	3.66
193	603939	益丰药房	875,705.00	3.61
194	300653	正海生物	875,359.00	3.61
195	002600	领益智造	869,004.00	3.58

196	000818	航锦科技	867,291.00	3.58
197	002818	富森美	858,957.00	3.54
198	605009	豪悦护理	849,987.30	3.51
199	002791	坚朗五金	842,848.00	3.48
200	688202	美迪西	822,321.32	3.39
201	300783	三只松鼠	821,767.00	3.39
202	688396	华润微	810,445.80	3.34
203	300036	超图软件	801,040.00	3.30
204	603303	得邦照明	792,466.32	3.27
205	601689	拓普集团	788,180.00	3.25
206	000733	振华科技	767,570.00	3.17
207	603976	正川股份	767,292.00	3.17
208	688321	微芯生物	762,471.52	3.15
209	002142	宁波银行	758,695.00	3.13
210	300433	蓝思科技	757,292.00	3.12
211	300465	高伟达	754,182.00	3.11
212	002036	联创电子	748,698.00	3.09
213	002507	涪陵榨菜	746,284.00	3.08
214	600073	上海梅林	742,761.00	3.06
215	002850	科达利	740,528.00	3.05
216	002605	姚记科技	725,734.00	2.99
217	002405	四维图新	724,099.00	2.99
218	002180	纳思达	698,818.00	2.88
219	688018	乐鑫科技	694,558.10	2.87
220	002607	中公教育	691,456.00	2.85
221	002594	比亚迪	682,096.00	2.81
222	600373	中文传媒	667,981.00	2.76
223	002959	小熊电器	655,789.00	2.71
224	300274	阳光电源	651,210.00	2.69
225	300136	信维通信	649,372.00	2.68
226	688050	爱博医疗	646,986.00	2.67
227	000963	华东医药	646,295.00	2.67
228	688009	中国通号	642,677.02	2.65
229	603883	老百姓	626,957.00	2.59
230	603000	人民网	626,493.00	2.58
231	300832	新产业	624,152.99	2.57

232	300629	新劲刚	620,924.00	2.56
233	600268	国电南自	619,112.00	2.55
234	600088	中视传媒	617,115.00	2.55
235	600596	新安股份	615,959.00	2.54
236	002641	永高股份	615,721.10	2.54
237	002317	众生药业	609,919.00	2.52
238	688001	华兴源创	609,708.37	2.52
239	688122	西部超导	601,125.02	2.48
240	603886	元祖股份	592,740.00	2.45
241	603899	晨光文具	592,602.00	2.44
242	603711	香飘飘	588,241.00	2.43
243	300724	捷佳伟创	587,824.00	2.42
244	000802	北京文化	581,808.00	2.40
245	002332	仙琚制药	563,908.00	2.33
246	600438	通威股份	562,366.00	2.32
247	300395	菲利华	549,429.00	2.27
248	002241	歌尔股份	547,931.00	2.26
249	603799	华友钴业	542,367.00	2.24
250	601877	正泰电器	542,212.00	2.24
251	300413	芒果超媒	522,926.00	2.16
252	000625	长安汽车	521,464.00	2.15
253	300750	宁德时代	490,036.00	2.02
254	600136	当代文体	488,344.00	2.01
255	002008	大族激光	488,241.00	2.01
256	688166	博瑞医药	488,013.83	2.01

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。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	002409	雅克科技	8,259,592.00	34.07
2	002156	通富微电	6,844,820.17	28.24
3	002371	北方华创	6,459,357.47	26.65
4	002185	华天科技	5,778,049.00	23.84
5	300502	新易盛	5,725,064.00	23.62

6	000636	风华高科	5,254,144.00	21.67
7	688012	中微公司	5,062,020.30	20.88
8	603986	兆易创新	4,630,716.83	19.10
9	603520	司太立	4,356,184.00	17.97
10	002460	赣锋锂业	4,272,438.60	17.63
11	600529	山东药玻	4,261,395.00	17.58
12	603290	斯达半导	4,118,527.00	16.99
13	300223	北京君正	3,967,714.00	16.37
14	300014	亿纬锂能	3,935,554.00	16.24
15	000672	上峰水泥	3,863,154.00	15.94
16	002714	牧原股份	3,827,140.28	15.79
17	000895	双汇发展	3,823,675.00	15.77
18	300661	圣邦股份	3,576,795.40	14.76
19	600588	用友网络	3,439,989.00	14.19
20	002216	三全食品	3,428,804.46	14.14
21	603005	晶方科技	3,389,303.00	13.98
22	600745	闻泰科技	3,342,868.00	13.79
23	002271	东方雨虹	3,334,359.00	13.76
24	601318	中国平安	3,323,786.42	13.71
25	603378	亚士创能	3,285,600.00	13.55
26	300601	康泰生物	3,270,606.00	13.49
27	300454	深信服	3,198,528.86	13.19
28	300558	贝达药业	3,134,663.00	12.93
29	300015	爱尔眼科	3,092,569.00	12.76
30	600305	恒顺醋业	3,020,582.88	12.46
31	002557	洽洽食品	2,930,911.00	12.09
32	603501	韦尔股份	2,899,021.00	11.96
33	300326	凯利泰	2,883,901.95	11.90
34	002624	完美世界	2,711,777.00	11.19
35	002475	立讯精密	2,697,194.00	11.13
36	600660	福耀玻璃	2,684,152.13	11.07
37	000596	古井贡酒	2,611,375.00	10.77
38	000002	万 科 A	2,600,792.00	10.73
39	603160	汇顶科技	2,596,569.00	10.71
40	600036	招商银行	2,591,922.00	10.69
41	300357	我武生物	2,579,339.00	10.64
42	002129	中环股份	2,569,454.00	10.60
43	000858	五 粮 液	2,517,472.00	10.39

44	603605	珀莱雅	2,508,025.00	10.35
45	600872	中炬高新	2,426,296.87	10.01
46	002555	三七互娱	2,425,876.06	10.01
47	300253	卫宁健康	2,387,693.00	9.85
48	000100	TCL 科技	2,369,049.42	9.77
49	600519	贵州茅台	2,356,741.00	9.72
50	002299	圣农发展	2,318,024.00	9.56
51	002812	恩捷股份	2,310,392.00	9.53
52	600741	华域汽车	2,295,676.50	9.47
53	603881	数据港	2,286,061.00	9.43
54	600600	青岛啤酒	2,274,500.00	9.38
55	601939	建设银行	2,258,864.00	9.32
56	300236	上海新阳	2,229,591.00	9.20
57	688037	芯源微	2,144,163.96	8.85
58	603027	千禾味业	2,112,255.80	8.71
59	300373	扬杰科技	2,092,739.00	8.63
60	603517	绝味食品	2,082,404.00	8.59
61	603392	万泰生物	2,078,942.00	8.58
62	601933	永辉超市	2,013,367.00	8.31
63	300012	华测检测	1,984,189.00	8.19
64	002847	盐津铺子	1,982,710.00	8.18
65	600584	长电科技	1,974,699.00	8.15
66	603187	海容冷链	1,971,244.00	8.13
67	300750	宁德时代	1,952,654.00	8.06
68	001914	招商积余	1,881,003.75	7.76
69	002385	大北农	1,868,814.00	7.71
70	603799	华友钴业	1,864,685.00	7.69
71	600298	安琪酵母	1,856,184.10	7.66
72	300702	天宇股份	1,847,807.00	7.62
73	002025	航天电器	1,826,889.32	7.54
74	603990	麦迪科技	1,768,529.00	7.30
75	600690	海尔智家	1,766,044.00	7.29
76	300598	诚迈科技	1,748,534.00	7.21
77	000651	格力电器	1,736,824.00	7.16
78	603208	江山欧派	1,735,142.40	7.16
79	600809	山西汾酒	1,727,236.00	7.13
80	000001	平安银行	1,718,567.00	7.09
81	002709	天赐材料	1,674,516.20	6.91

82	600309	万华化学	1,672,524.00	6.90
83	603127	昭衍新药	1,664,632.30	6.87
84	603719	良品铺子	1,654,369.00	6.82
85	600276	恒瑞医药	1,651,429.20	6.81
86	300595	欧普康视	1,640,022.00	6.77
87	300346	南大光电	1,617,663.00	6.67
88	603129	春风动力	1,616,444.00	6.67
89	600436	片仔癀	1,612,791.00	6.65
90	300303	聚飞光电	1,602,161.00	6.61
91	603686	龙马环卫	1,588,971.00	6.55
92	603713	密尔克卫	1,586,485.00	6.54
93	600132	重庆啤酒	1,581,918.00	6.53
94	002311	海大集团	1,571,651.00	6.48
95	600703	三安光电	1,569,482.00	6.47
96	300413	芒果超媒	1,566,114.82	6.46
97	600882	妙可蓝多	1,525,769.00	6.29
98	002901	大博医疗	1,524,327.81	6.29
99	300666	江丰电子	1,522,315.00	6.28
100	000333	美的集团	1,492,316.00	6.16
101	300623	捷捷微电	1,471,877.00	6.07
102	601168	西部矿业	1,471,218.00	6.07
103	600984	建设机械	1,470,109.00	6.06
104	600185	格力地产	1,454,246.00	6.00
105	600019	宝钢股份	1,446,281.00	5.97
106	300696	爱乐达	1,444,612.17	5.96
107	000786	北新建材	1,438,766.00	5.94
108	002918	蒙娜丽莎	1,424,558.00	5.88
109	600449	宁夏建材	1,414,748.00	5.84
110	603345	安井食品	1,383,796.00	5.71
111	688981	中芯国际	1,375,252.60	5.67
112	603700	宁水集团	1,373,122.00	5.66
113	600926	杭州银行	1,356,232.16	5.59
114	002127	南极电商	1,337,530.12	5.52
115	002803	吉宏股份	1,335,892.00	5.51
116	002739	万达电影	1,332,349.00	5.50
117	600346	恒力石化	1,319,895.00	5.44
118	300628	亿联网络	1,286,489.00	5.31
119	600893	航发动力	1,281,012.61	5.28

120	002568	百润股份	1,271,011.00	5.24
121	000807	云铝股份	1,264,354.00	5.22
122	603533	掌阅科技	1,262,330.00	5.21
123	603708	家家悦	1,246,218.00	5.14
124	002065	东华软件	1,242,103.00	5.12
125	000526	紫光学大	1,232,505.00	5.08
126	000933	神火股份	1,231,472.00	5.08
127	000710	贝瑞基因	1,230,660.00	5.08
128	601818	光大银行	1,227,059.00	5.06
129	300482	万孚生物	1,220,731.00	5.04
130	603179	新泉股份	1,209,218.70	4.99
131	688023	安恒信息	1,195,685.34	4.93
132	688088	虹软科技	1,195,289.16	4.93
133	300470	中密控股	1,194,128.00	4.93
134	000876	新希望	1,193,971.00	4.93
135	601336	新华保险	1,183,838.00	4.88
136	002791	坚朗五金	1,182,870.00	4.88
137	300540	深冷股份	1,170,507.00	4.83
138	600048	保利地产	1,165,590.00	4.81
139	002977	天箭科技	1,161,260.00	4.79
140	000661	长春高新	1,149,852.00	4.74
141	688180	君实生物	1,149,027.11	4.74
142	300087	荃银高科	1,148,153.00	4.74
143	300782	卓胜微	1,143,975.00	4.72
144	688111	金山办公	1,141,061.70	4.71
145	001979	招商蛇口	1,128,600.00	4.66
146	002174	游族网络	1,127,905.00	4.65
147	002493	荣盛石化	1,127,551.05	4.65
148	600079	人福医药	1,121,311.00	4.63
149	002572	索菲亚	1,119,234.00	4.62
150	300699	光威复材	1,118,996.00	4.62
151	603659	璞泰来	1,114,078.00	4.60
152	688268	华特气体	1,105,848.80	4.56
153	688200	华峰测控	1,102,352.50	4.55
154	002242	九阳股份	1,084,203.97	4.47
155	601636	旗滨集团	1,079,794.00	4.45
156	002916	深南电路	1,074,022.00	4.43
157	002367	康力电梯	1,057,660.00	4.36

158	300737	科顺股份	1,053,528.00	4.35
159	002697	红旗连锁	1,053,106.00	4.34
160	603960	克来机电	1,051,617.00	4.34
161	300618	寒锐钴业	1,034,770.00	4.27
162	300896	爱美客	1,030,000.00	4.25
163	002690	美亚光电	1,027,399.12	4.24
164	002398	垒知集团	1,016,782.00	4.19
165	300073	当升科技	1,009,852.00	4.17
166	002050	三花智控	1,009,600.00	4.16
167	002001	新和成	1,005,660.00	4.15
168	002541	鸿路钢构	970,242.00	4.00
169	002007	华兰生物	954,866.70	3.94
170	002444	巨星科技	948,843.00	3.91
171	300450	先导智能	938,630.00	3.87
172	300010	豆神教育	931,950.00	3.84
173	002318	久立特材	915,992.00	3.78
174	300783	三只松鼠	910,266.00	3.76
175	600989	宝丰能源	908,896.00	3.75
176	600352	浙江龙盛	908,753.00	3.75
177	601066	中信建投	905,616.00	3.74
178	600383	金地集团	901,918.00	3.72
179	002139	拓邦股份	900,592.00	3.72
180	000401	冀东水泥	900,000.00	3.71
181	688202	美迪西	882,868.70	3.64
182	000860	顺鑫农业	869,968.00	3.59
183	600585	海螺水泥	865,440.00	3.57
184	603043	广州酒家	859,401.85	3.55
185	300815	玉禾田	854,296.70	3.52
186	300653	正海生物	849,247.00	3.50
187	601100	恒立液压	848,626.00	3.50
188	300347	泰格医药	830,244.00	3.42
189	605009	豪悦护理	826,480.00	3.41
190	002180	纳思达	824,827.00	3.40
191	603939	益丰药房	817,659.00	3.37
192	002456	欧菲光	817,449.00	3.37
193	603259	药明康德	814,161.00	3.36
194	300573	兴齐眼药	813,568.00	3.36
195	600460	士兰微	804,035.00	3.32

196	603303	得邦照明	795,230.00	3.28
197	002818	富森美	792,501.00	3.27
198	002273	水晶光电	791,248.00	3.26
199	601689	拓普集团	785,529.00	3.24
200	300036	超图软件	782,998.78	3.23
201	601233	桐昆股份	774,867.00	3.20
202	002600	领益智造	768,150.00	3.17
203	600596	新安股份	765,811.00	3.16
204	600073	上海梅林	762,720.00	3.15
205	300465	高伟达	755,856.00	3.12
206	002230	科大讯飞	747,829.00	3.09
207	600801	华新水泥	747,032.00	3.08
208	000725	京东方 A	741,083.00	3.06
209	688050	爱博医疗	739,965.84	3.05
210	002080	中材科技	737,384.00	3.04
211	000063	中兴通讯	734,250.00	3.03
212	002056	横店东磁	725,441.00	2.99
213	300832	新产业	722,046.00	2.98
214	002142	宁波银行	710,483.00	2.93
215	000818	航锦科技	710,104.00	2.93
216	688321	微芯生物	706,087.88	2.91
217	002405	四维图新	701,627.00	2.89
218	002635	安洁科技	695,447.00	2.87
219	002605	姚记科技	693,251.00	2.86
220	000338	潍柴动力	689,213.00	2.84
221	002850	科达利	687,219.00	2.83
222	002607	中公教育	676,664.00	2.79
223	688396	华润微	671,154.19	2.77
224	002959	小熊电器	659,899.00	2.72
225	002036	联创电子	659,840.00	2.72
226	300433	蓝思科技	658,295.00	2.72
227	603899	晨光文具	642,152.00	2.65
228	688001	华兴源创	636,588.50	2.63
229	603000	人民网	633,952.00	2.62
230	002250	联化科技	633,637.00	2.61
231	300418	昆仑万维	613,836.00	2.53
232	603883	老百姓	603,769.00	2.49
233	603976	正川股份	601,862.00	2.48

234	300724	捷佳伟创	600,301.59	2.48
235	600373	中文传媒	598,313.00	2.47
236	600088	中视传媒	593,697.79	2.45
237	002641	永高股份	585,842.00	2.42
238	603711	香飘飘	583,460.00	2.41
239	600268	国电南自	580,382.00	2.39
240	000963	华东医药	577,284.00	2.38
241	300892	品渥食品	574,080.00	2.37
242	688018	乐鑫科技	571,922.99	2.36
243	300136	信维通信	567,192.41	2.34
244	300629	新劲刚	563,505.00	2.32
245	000802	北京文化	560,278.00	2.31
246	603886	元祖股份	558,459.00	2.30
247	000026	飞亚达	555,725.00	2.29
248	002317	众生药业	543,824.00	2.24
249	688009	中国通号	526,831.70	2.17
250	002332	仙琚制药	525,576.00	2.17
251	600563	法拉电子	519,855.00	2.14
252	300395	菲利华	493,610.00	2.04
253	002241	歌尔股份	492,261.00	2.03
254	688166	博瑞医药	488,920.23	2.02
255	000625	长安汽车	488,735.00	2.02
256	002008	大族激光	486,754.00	2.01

注：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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	425,006,521.17
卖出股票收入（成交）总额	425,928,479.83

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

报告期末本基金未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货持仓。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的情况,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。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	46,307.32
2	应收证券清算款	513,068.13
3	应收股利	-
4	应收利息	356.09
5	应收申购款	17,436.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	577,168.23

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
3,476	4,412.11	2,813,066.62	18.34%	12,523,427.06	81.66%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	571.74	0.00%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

1、截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间均为 0；

2、截止本报告期末，本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2008年6月27日）基金份额总额	353,835,521.84
本报告期期初基金份额总额	14,691,620.00
本报告期基金总申购份额	39,506,232.34
减:本报告期基金总赎回份额	38,861,358.66
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	15,336,493.68

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

公司高级管理人员：

自 2020 年 1 月 16 日起，沈芳女士不再担任公司副总经理职务。

自 2020 年 8 月 8 日起，经晓云女士不再担任公司总经理职务，由董事长方一天先生代任公司总经理。

基金托管人：

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况未发生改变。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内,本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	

中泰证券	2	763,682,695.76	89.84%	711,218.57	89.84%	-
光大证券	1	62,136,023.36	7.31%	57,867.75	7.31%	-
平安证券	1	24,271,740.70	2.86%	22,604.53	2.86%	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中金	1	-	-	-	-	-

注:1、基金专用交易席位的选择标准如下:

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 4、本报告期内在中国证监会指定报纸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、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告原文。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。
- 7、《万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司

2021 年 3 月 30 日