

# 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 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2021年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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2021年1月1日起至2021年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>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<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.....	13
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等内容的真实、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>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>45</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	52
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.....	52
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.....	52
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.....	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
7.12 投资组合报告附注.....	52
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	55
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>56</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>61</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.....	61

<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>62</b>
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	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	
基金简称	万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合	
场内简称	科创主题	
基金主代码	501075	
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)	
基金合同生效日	2019 年 6 月 12 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	966,398,149.38 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2019 年 9 月 12 日	
下属分级基金的基金简称:	万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合 A	万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合 C
下属分级基金场内简称:	科创主题	-
下属分级基金的交易代码:	501075	007501
报告期末下属分级基金的份额总额	966,398,149.38 份	0.00 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略(1)当过去二十个交易日的 PB 平均水平处于过去 5 年估值水平的 80%分位及以上时,此时市场估值非常高,本基金股票资产占基金资产的比例为 0-50%;(2)当过去二十个交易日的 PB 水平处于过去 5 年估值水平的 50-80%区间内时,此时市场估值处在较高水平但仍然可控,本基金股票资产占基金资产的比例为 30%-80%;(3)当过去二十个交易日的当 PB 水平处于过去 5 年估值水平的 50%以下时,此时市场估值和风险水平相对较低,若本基金处于封闭运作期间则股票资产占基金资产的比例为 65%-100%,若本基金处于开放运作期间则股票资产占基金资产的比例为 65%-95%);2、股票投资策略(1)科技创新主题界定、(2)新股申购及战略配售股票投资策略、(3)定向增发策略);3、科创板股票投资策略;4、存托凭证投资策略;5、债券投资策略(1)利率预期策略、(2)久期控制策略、(3)类别资产配置策略、(4)债券品种选择策略、(5)套利策略、(6)可转换债券投资策略);6、资产支持证券投资策略;7、股指期货投资策略;8、国债期货投资策略;9、股票期权投资策略;10、融资交易策略。
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率*50%+中债综合指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型基金,理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。本基金可投资于科创板上市的股票,除了需要

	承担与证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临投资科创板股票的特殊风险，本基金投资科创板的风险详见招募说明书。
--	--

### 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	《上海证券报》
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	中国（上海）自由贸易试验区浦电路360号8层（名义楼层9层）基金管理人办公场所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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

基金级别	万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合 A	万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	76,621,387.73	-
本期利润	357,532,900.96	-
加权平均基金份额本期利润	0.3700	-
本期加权平均净值利润率	20.85%	-
本期基金份额净值增长率	21.38%	-
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	508,086,076.22	-
期末可供分配基金份额利润	0.5258	-
期末基金资产净值	2,030,004,974.72	-
期末基金份额净值	2.1006	-
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	110.06%	-

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

#### 3.2 基金净值表现

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

万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合 A

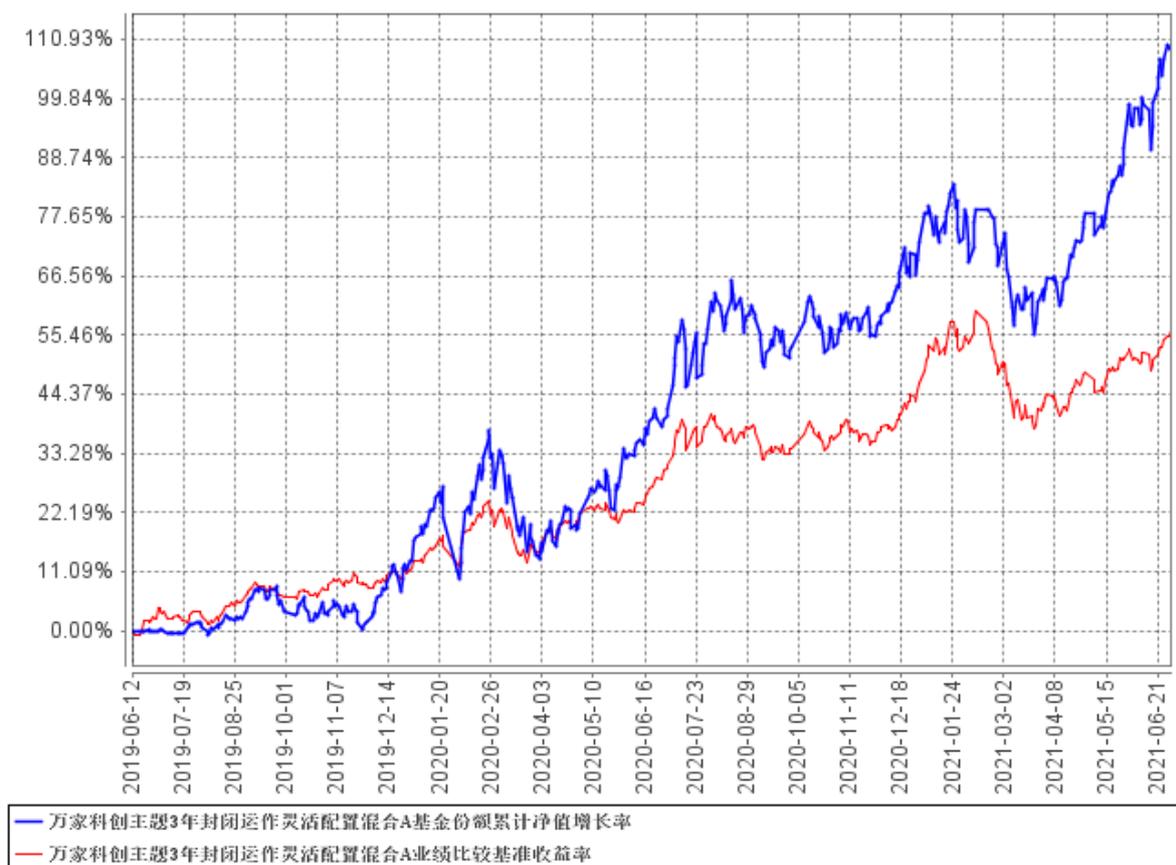
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.67%	1.56%	2.32%	0.70%	3.35%	0.86%
过去三个月	29.72%	1.36%	9.90%	0.76%	19.82%	0.60%
过去六个月	21.38%	1.59%	6.66%	1.02%	14.72%	0.57%
过去一年	50.31%	1.55%	20.08%	0.92%	30.23%	0.63%
自基金合同	110.06%	1.58%	56.18%	0.84%	53.88%	0.74%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

注：基金业绩比较基准=中国战略新兴产业成份指数收益率\*50%+中债综合指数收益率\*50%

### 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

万家科创主题3年封闭运作灵活配置混合A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 2019 年 6 月 12 日成立，根据基金合同规定，基金合同生效后 6 个月内为建仓期，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基金合同要求。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李文宾	万家成长优选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	2019年6月12日	-	10.5年	复旦大学工商管理硕士。2010年7月至2014年4月在中银国际证券有限责任公司工作，担任研究员职务；2014年5月至2015年11月在华泰资产管理有限公司工作，担任研究员职务；2015年11月进入万家基金管理有限公司，从事股票研究工作，自2017年1月起担任投资研究部基金经理职务。

	科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、万家汽车新趋势混合型证券投资基金、万家内需增长一年持有期混合型证券投资基金、万家战略发展产业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的基金经理				
--	---	--	--	--	--

注：1、任职日期以及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 公平交易制度的执行情况

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

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 1 次，为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年股市跌宕起伏，市场展现出与 2020 年和 2019 年截然不同的风格。

2021 年 1 季度中上，市场以核心资产为主要方向，集中在食品饮料和医药为代表的泛消费板块。但在春节前后，核心资产在美债上行的影响下剧烈下跌，虽然事后来看美债只是当时下跌的一个原因之一，但调整更为根本的原因在于估值过高以及基本面发生了一些负面的变化。

2021 年第二季度，市场流动性边际改善，这点与我们在 2020 年年报中对 2021 年宏观政策预测高度相符，我们当时对 2021 年宏观政策有这么几个预判：1. 国内经济会面临海外供应链复苏带来的冲击，越往后压力越大；2. 国内财政政策偏紧，货币政策将会灵活宽松。

在这两点成为市场共识后，市场呈现了非常鲜明的结构性机会：以半导体、新能源汽车、军工、高端制造等高风险偏好板块涨幅凶猛，但与经济高度挂钩的前周期板块，以及消费品板块走势疲软。

我们从1季度末开始大幅提升了产品中成长板块的占比，并集中在新能源汽车上游、军工、以及高端制造板块，这帮助我们产品净值取得了较为优秀的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家科创主题3年封闭运作灵活配置混合A基金份额净值为2.1006元，本报告期基金份额净值增长率为21.38%；同期业绩比较基准收益率为6.66%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，从宏观角度来看，我们认为海外经济复苏的进度会继续加快，国内经济将会也将继续平稳发展，我们预测国内货币政策中性偏宽松的导向不会改变。但考虑到我们持有的部分标的累计了较大的涨幅，估值并不便宜，向上的市值空间也有限，所以我们会通过及时锁定收益，并逢回调中重新买入的投资策略。从板块上看，我们继续看好新能源汽车、光伏、半导体、军工和中高端白酒等。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

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

##### 2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不介入基金日常估值业务。

##### 3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

##### 4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内，本基金未实施利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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：万家科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	220,777,437.61	328,595,586.08
结算备付金		1,655,374.50	2,474,568.61
存出保证金		267,018.20	598,384.26
交易性金融资产	6.4.7.2	1,786,524,214.15	1,318,545,745.92
其中：股票投资		1,601,408,079.75	1,318,545,745.92
基金投资		-	-
债券投资		185,116,134.40	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		29,435,824.56	26,060,738.59
应收利息	6.4.7.5	862,178.12	36,583.82
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,039,522,047.14	1,676,311,607.28
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年6月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		5,414,784.59	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,384,292.45	2,016,736.57
应付托管费		397,382.08	336,122.78
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,111,351.27	1,306,673.81
应交税费		1.88	0.36

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	209,260.15	180,000.00
负债合计		9,517,072.42	3,839,533.52
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	966,398,149.38	966,398,149.38
未分配利润	6.4.7.10	1,063,606,825.34	706,073,924.38
所有者权益合计		2,030,004,974.72	1,672,472,073.76
负债和所有者权益总计		2,039,522,047.14	1,676,311,607.28

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 966,398,149.38 份，其中万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合 A 基金份额净值 2.1006 元，份额总额 966,398,149.38 份；万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合 C 基金份额总额 0.00 份；

## 6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		376,790,124.00	275,707,875.30
1.利息收入		983,531.75	277,355.78
其中：存款利息收入	6.4.7.11	574,594.03	277,355.78
债券利息收入		95,462.37	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		313,475.35	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		94,895,079.02	133,072,603.83
其中：股票投资收益	6.4.7.12	89,146,934.64	124,349,925.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	5,748,144.38	8,722,678.30
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	280,911,513.23	142,357,915.69
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	-	-
<b>减：二、费用</b>		19,257,223.04	19,866,943.89
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	12,758,325.13	9,014,548.95
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,126,387.56	1,502,424.91
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	4,267,805.72	9,240,548.88
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.20	-
7. 其他费用	6.4.7.20	104,704.43	109,421.15
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		357,532,900.96	255,840,931.41
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		357,532,900.96	255,840,931.41

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2021年1月1日至2021年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	966,398,149.38	706,073,924.38	1,672,472,073.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	357,532,900.96	357,532,900.96
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的	-	-	-



事务所（特殊普通合伙）验资并出具信会师报字[2019]第 ZA30713 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2019 年 6 月 12 日生效。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期限不定期。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 966,371,184.70 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 26,964.68 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 966,398,149.38 元，折合 966,398,149.38 份基金份额。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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、股指期货、国债期货、股票期权以及债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可交换公司债券、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：中国战略新兴产业成份指数收益率\*50%+中债综合指数收益率\*50%。

#### 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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本中期报告所采用的会计政策、会计估计与上年度报告相一致。

## 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 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.6 税项

### (一) 印花税

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

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

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

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

### (二) 增值税

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服

务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

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

### (三) 企业所得税

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

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

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

### (四) 个人所得税

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

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

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

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
活期存款	220,777,437.61
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：	220,777,437.61

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,046,061,333.93	1,601,408,079.75	555,346,745.82
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	184,942,131.10	185,116,134.40
	银行间市场	-	-
	合计	184,942,131.10	185,116,134.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	1,231,003,465.03	1,786,524,214.15	555,520,749.12

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	26,440.01
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	744.90
应收债券利息	834,873.11
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	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	120.10
合计	862,178.12

### 6.4.7.6 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
----	-------------------

交易所市场应付交易费用	1,111,351.27
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,111,351.27

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	-
预提审计费	29,752.78
预提信息披露费	179,507.37
合计	209,260.15

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

万家科创主题3年封闭运作灵活配置混合 A		
项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	966,398,149.38	966,398,149.38
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 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	966,398,149.38	966,398,149.38

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

万家科创主题3年封闭运作灵活配置混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	431,464,688.49	274,609,235.89	706,073,924.38
本期利润	76,621,387.73	280,911,513.23	357,532,900.96

本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	508,086,076.22	555,520,749.12	1,063,606,825.34

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	553,933.82
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	17,808.46
其他	2,851.75
合计	574,594.03

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	89,146,934.64
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	89,146,934.64

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	1,425,073,859.14
减：卖出股票成本总额	1,335,926,924.50
买卖股票差价收入	89,146,934.64

### 6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无股票投资收益-证券出借差价收入。

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期末无衍生工具收益。

### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,748,144.38
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	5,748,144.38

### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	280,911,513.23
——股票投资	280,737,509.93
——债券投资	174,003.30
——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	280,911,513.23

#### 6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	4,267,805.72
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	4,267,805.72

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	360.00
银行汇划费用	6,084.28
债券帐户维护费	9,000.00
合计	104,704.43

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日,本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内,与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	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
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: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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

##### 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
中泰证券	-	-	2,898,941,396.62	48.43%

###### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方席位进行债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 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	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中泰证券	2,699,789.97	48.43%	371,238.73	15.41%

注：本基金报告期内未产生关联方佣金。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	12,758,325.13	9,014,548.95
其中：支付销售机构的客户维护费	4,967,667.77	4,233,724.11

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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5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。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,126,387.56	1,502,424.91

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

基金托管费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	万家科创主题3年封闭运作灵活配置混合 A	万家科创主题3年封闭运作灵活配置混合 C
基金合同生效日（2019年6月12日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	19,948,495.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	19,948,495.00	-
报告期末持有的基金份额	2.0642%	-

占基金总份额比例		
----------	--	--

项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	万家科创主题3年封闭运作灵 活配置混合 A	万家科创主题3年封闭运作灵 活配置混合 C
基金合同生效日（2019年6月12日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	19,948,495.00	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	19,948,495.00	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	2.0642%	-

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

万家科创主题3年封闭运作灵活配置混合 A				
关联方名称	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
上海万家朴智投资管理有限 公司	0.05	0.0000%	0.05	0.0000%

#### 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	220,777,437.61	553,933.82	111,859,800.10	235,209.12

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。

#### 6.4.11 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（2021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	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
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	新股流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	新股流通受限	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-

688083	中望软件	2021年3月4日	2021年9月13日	新股流通受限	150.50	524.08	1,837	276,468.50	962,734.96	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股流通受限	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
688609	九联科技	2021年3月15日	2021年9月23日	新股流通受限	3.99	15.29	10,372	41,384.28	158,587.88	-
688619	罗普特	2021年2月8日	2021年8月23日	新股流通受限	19.31	26.74	5,856	113,079.36	156,589.44	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股流通受限	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
688113	联测科技	2021年4月26日	2021年11月8日	新股流通受限	19.14	49.29	1,415	27,083.10	69,745.35	-
688468	科美诊断	2021年3月31日	2021年10月11日	新股流通受限	7.15	16.50	3,919	28,020.85	64,663.50	-
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	新股流通受限	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-
688260	昀冢科技	2021年3月25日	2021年10月8日	新股流通受限	9.63	16.41	2,990	28,793.70	49,065.90	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股流通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
688659	元琛科技	2021年3月24日	2021年10月8日	新股流通受限	6.50	10.46	3,671	23,861.50	38,398.66	-
688067	爱威科技	2021年6月7日	2021年12月16日	新股流通受限	14.71	24.83	1,259	18,519.89	31,260.97	-
688681	科汇股份	2021年6月4日	2021年12月	新股流通受限	9.56	14.54	1,899	18,154.44	27,611.46	-

			月 16 日							
300953	震裕科技	2021 年 3 月 11 日	2021 年 9 月 22 日	新股流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300941	创识科技	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股流通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
300932	三友联众	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股流通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300982	苏文电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	新股流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300940	南极光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	新股流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	新股流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
301013	利和兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	新股流通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
300942	易瑞生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-

300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
300955	嘉亨家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300962	中金辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 13 日	新股流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300931	通用电梯	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	新股流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300958	建工修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	新股流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网	2021 年	2021	新股流	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-

	传媒	4月28日	年11月11日	通受限						
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月7日	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300930	屹通新材	2021年1月13日	2021年7月21日	新股流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
301004	嘉益股份	2021年6月18日	2021年12月27日	新股流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新股流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-

300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	新股流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	新股流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月20日	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	新股流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券	证券	成功	可流	流通受	认购	期末估	数量	期末	期末估值总	备注
----	----	----	----	-----	----	-----	----	----	-------	----

代码	名称	认购日	通日	限类型	价格	值单价	(单位: 张)	成本总额	额	
127038	国微 转债	2021年 6月10 日	2021 年7月 14日	增发流 通受限	100.00	100.00	6,128	612,800.00	612,800.00	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 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 2021 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

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

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

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人

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

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

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	184,503,334.40	-
合计	184,503,334.40	-

注：未评级债券为国家政策性金融债券。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	612,800.00	-
未评级	-	-
合计	612,800.00	-

#### 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，本期末本基金的资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

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

#### 6.4.13.3.1 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(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券”,本报告期内本基金未出现因投资品种变现困难或投资集中而无法以合理价格及时变现基金资产以支付赎回款的情况。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2021年6月 30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							

银行存款	220,777,437.61	-	-	-	-	-	220,777,437.61
结算备付金	1,655,374.50	-	-	-	-	-	1,655,374.50
存出保证金	267,018.20	-	-	-	-	-	267,018.20
交易性金融资产	-	-185,116,134.40	-	-	-1,601,408,079.75	-	1,786,524,214.15
应收证券清算款	-	-	-	-	-	29,435,824.56	29,435,824.56
应收利息	-	-	-	-	-	862,178.12	862,178.12
资产总计	222,699,830.31	-185,116,134.40	-	-	-1,631,706,082.43	-	2,039,522,047.14
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	5,414,784.59	5,414,784.59
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,384,292.45	2,384,292.45
应付托管费	-	-	-	-	-	397,382.08	397,382.08
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,111,351.27	1,111,351.27
应交税费	-	-	-	-	-	1.88	1.88
其他负债	-	-	-	-	-	209,260.15	209,260.15
负债总计	-	-	-	-	-	9,517,072.42	9,517,072.42
利率敏感度缺口	222,699,830.31	-185,116,134.40	-	-	-1,622,189,010.01	-	2,030,004,974.72
上年度末 2020年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-	-	-
银行存款	328,595,586.08	-	-	-	-	-	328,595,586.08
结算备付金	2,474,568.61	-	-	-	-	-	2,474,568.61
存出保证金	598,384.26	-	-	-	-	-	598,384.26
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-1,318,545,745.92	1,318,545,745.92
应收证券清算款	-	-	-	-	-	26,060,738.59	26,060,738.59
应收利息	-	-	-	-	-	36,583.82	36,583.82
资产总计	331,668,538.95	-	-	-	-	-1,344,643,068.33	1,676,311,607.28
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,016,736.57	2,016,736.57
应付托管费	-	-	-	-	-	336,122.78	336,122.78
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,306,673.81	1,306,673.81
应交税费	-	-	-	-	-	0.36	0.36
其他负债	-	-	-	-	-	180,000.00	180,000.00

负债总计	-	-	-	-	-	3,839,533.52	3,839,533.52
利率敏感度缺口	331,668,538.95	-	-	-	-	-1,340,803,534.81	1,672,472,073.76

注：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者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 若市场利率发生变动而其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 市场利率下降25个基点	375,611.20	-
2. 市场利率上升25个基点	-373,842.37	-	

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	1,601,408,079.75	78.89	1,318,545,745.92	78.84

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	185,116,134.40	9.12	-	-
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	1,786,524,214.15	88.01	1,318,545,745.92	78.84

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 若股票基准指数发生变动而其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 股票基准指数下降100个基点	-18,576,826.41	-17,699,810.46
2. 股票基准指数上升100个基点	18,576,826.41	17,699,810.46	

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

#### 6.4.14 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	1,601,408,079.75	78.52
	其中：股票	1,601,408,079.75	78.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	185,116,134.40	9.08
	其中：债券	185,116,134.40	9.08
	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	222,432,812.11	10.91
8	其他各项资产	30,565,020.88	1.50
9	合计	2,039,522,047.14	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	11,290.28	0.00
B	采矿业	20,131,112.00	0.99
C	制造业	1,467,111,397.47	72.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	31,866,622.90	1.57
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	17,308,191.42	0.85
J	金融业	34,721.10	0.00
K	房地产业	30,537,724.00	1.50
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	32,690,216.78	1.61

N	水利、环境和公共设施管理业	148,268.04	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,530,144.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,601,408,079.75	78.89

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002709	天赐材料	1,436,160	153,065,932.80	7.54
2	688005	容百科技	988,968	119,862,921.60	5.90
3	688050	爱博医疗	245,310	92,673,211.80	4.57
4	603893	瑞芯微	641,966	89,528,578.36	4.41
5	600399	抚顺特钢	4,204,100	76,262,374.00	3.76
6	002541	鸿路钢构	1,116,057	65,121,925.95	3.21
7	300390	天华超净	1,229,100	59,033,673.00	2.91
8	002466	天齐锂业	898,300	55,712,566.00	2.74
9	603799	华友钴业	447,500	51,104,500.00	2.52
10	002049	紫光国微	302,600	46,657,894.00	2.30
11	688016	心脉医疗	98,858	44,941,835.38	2.21
12	002756	永兴材料	679,500	40,355,505.00	1.99
13	300009	安科生物	2,692,833	40,123,211.70	1.98
14	000933	神火股份	4,079,632	38,552,522.40	1.90
15	688390	固德威	111,459	37,227,306.00	1.83
16	600158	中体产业	2,676,400	30,537,724.00	1.50
17	000807	云铝股份	2,277,300	27,099,870.00	1.33
18	603027	千禾味业	931,020	24,476,515.80	1.21
19	603345	安井食品	91,800	23,319,036.00	1.15
20	300666	江丰电子	462,200	23,049,914.00	1.14
21	002812	恩捷股份	98,200	22,988,620.00	1.13
22	600862	中航高科	744,150	22,904,937.00	1.13
23	000657	中钨高新	2,225,300	22,564,542.00	1.11

24	600753	东方银星	563,180	21,992,179.00	1.08
25	603501	韦尔股份	68,100	21,928,200.00	1.08
26	603986	兆易创新	114,540	21,522,066.00	1.06
27	002135	东南网架	2,722,700	20,828,655.00	1.03
28	002192	融捷股份	293,200	20,131,112.00	0.99
29	000799	酒鬼酒	78,402	20,039,551.20	0.99
30	000488	晨鸣纸业	2,367,500	19,271,450.00	0.95
31	688202	美迪西	36,894	19,181,190.60	0.94
32	300726	宏达电子	236,393	16,663,342.57	0.82
33	300751	迈为股份	35,640	16,205,508.00	0.80
34	688201	信安世纪	308,763	16,132,866.75	0.79
35	688233	神工股份	257,069	13,881,726.00	0.68
36	688131	皓元医药	39,022	13,509,026.18	0.67
37	300447	全信股份	808,900	12,821,065.00	0.63
38	000858	五粮液	42,100	12,541,169.00	0.62
39	688613	奥精医疗	136,538	12,396,285.02	0.61
40	002991	甘源食品	196,938	11,881,269.54	0.59
41	002407	多氟多	274,200	9,745,068.00	0.48
42	300715	凯伦股份	385,327	9,082,157.39	0.45
43	600519	贵州茅台	3,900	8,021,130.00	0.40
44	688200	华峰测控	15,484	7,329,041.72	0.36
45	688617	惠泰医疗	18,463	7,034,218.37	0.35
46	605016	百龙创园	210,931	6,741,354.76	0.33
47	300724	捷佳伟创	57,800	6,705,378.00	0.33
48	688550	瑞联新材	69,002	6,290,912.34	0.31
49	300755	华致酒行	150,300	6,133,743.00	0.30
50	600499	科达制造	403,300	5,807,520.00	0.29
51	600760	中航沈飞	62,760	3,784,428.00	0.19
52	605499	东鹏饮料	15,032	3,770,025.60	0.19
53	003020	立方制药	67,600	3,461,120.00	0.17
54	300661	圣邦股份	12,200	3,083,306.00	0.15
55	002475	立讯精密	64,194	2,952,924.00	0.15
56	600600	青岛啤酒	22,700	2,625,255.00	0.13
57	689009	九号公司	19,813	1,686,482.56	0.08
58	300143	盈康生命	59,400	1,530,144.00	0.08
59	300973	立高食品	6,860	1,049,155.60	0.05
60	300979	华利集团	9,246	1,028,699.40	0.05
61	688083	中望软件	1,837	962,734.96	0.05
62	002724	海洋王	42,600	579,786.00	0.03

63	605089	味知香	5,570	484,701.40	0.02
64	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.02
65	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.02
66	688269	凯立新材	1,941	270,808.32	0.01
67	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.01
68	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.01
69	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.01
70	688609	九联科技	10,372	158,587.88	0.01
71	688619	罗普特	5,856	156,589.44	0.01
72	688466	金科环境	4,907	112,713.79	0.01
73	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
74	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
75	688113	联测科技	1,415	69,745.35	0.00
76	688468	科美诊断	3,919	64,663.50	0.00
77	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
78	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
79	301010	晶雪节能	2,172	50,480.96	0.00
80	688260	昀冢科技	2,990	49,065.90	0.00
81	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
82	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
83	688659	元琛科技	3,671	38,398.66	0.00
84	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
85	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.00
86	688681	科汇股份	1,899	27,611.46	0.00
87	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
88	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
89	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
90	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
91	300908	仲景食品	285	16,983.15	0.00
92	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
93	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
94	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
95	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
96	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
97	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
98	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
99	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
100	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
101	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00

102	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
103	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
104	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
105	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
106	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
107	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
108	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
109	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
110	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
111	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
112	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
113	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
114	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
115	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
116	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
117	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
118	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
119	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
120	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
121	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
122	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
123	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
124	688308	欧科亿	112	7,590.24	0.00
125	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
126	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
127	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
128	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
129	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
130	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
131	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
132	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
133	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
134	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
135	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
136	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
137	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
138	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
139	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00

140	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
141	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
142	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
143	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600399	抚顺特钢	64,538,127.50	3.86
2	603893	瑞芯微	48,776,290.62	2.92
3	300009	安科生物	43,141,293.15	2.58
4	601668	中国建筑	41,047,229.00	2.45
5	002049	紫光国微	39,553,262.97	2.36
6	600862	中航高科	34,113,142.69	2.04
7	603027	千禾味业	32,933,343.78	1.97
8	600452	涪陵电力	31,674,559.85	1.89
9	300761	立华股份	29,323,723.60	1.75
10	000933	神火股份	25,463,528.00	1.52
11	002466	天齐锂业	24,791,668.00	1.48
12	002756	永兴材料	24,695,498.97	1.48
13	000488	晨鸣纸业	24,479,666.81	1.46
14	000657	中钨高新	24,117,855.20	1.44
15	000807	云铝股份	23,492,985.00	1.40
16	600988	赤峰黄金	23,073,209.39	1.38
17	600549	厦门钨业	22,527,349.77	1.35
18	300892	品渥食品	21,805,810.67	1.30
19	000998	隆平高科	21,632,828.84	1.29
20	002135	东南网架	21,350,851.00	1.28

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	688099	晶晨股份	74,020,785.33	4.43

2	688388	嘉元科技	72,113,956.87	4.31
3	688122	西部超导	57,911,374.21	3.46
4	601456	国联证券	57,090,666.16	3.41
5	603993	洛阳钼业	54,727,238.13	3.27
6	600521	华海药业	45,506,288.26	2.72
7	601668	中国建筑	39,169,559.00	2.34
8	601339	百隆东方	36,783,852.27	2.20
9	000651	格力电器	35,827,325.52	2.14
10	600452	涪陵电力	34,403,649.75	2.06
11	600038	中直股份	32,871,316.00	1.97
12	002466	天齐锂业	31,231,390.00	1.87
13	603378	亚士创能	30,889,643.70	1.85
14	000830	鲁西化工	28,544,006.20	1.71
15	002709	天赐材料	27,798,156.92	1.66
16	603566	普莱柯	24,756,639.19	1.48
17	300761	立华股份	24,732,533.87	1.48
18	688116	天奈科技	24,412,001.33	1.46
19	300892	品渥食品	24,399,808.15	1.46
20	000799	酒鬼酒	24,297,138.00	1.45

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

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,338,051,748.40
卖出股票收入（成交）总额	1,425,073,859.14

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	184,503,334.40	9.09
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	612,800.00	0.03
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	185,116,134.40	9.12

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019654	21 国债 06	1,844,480	184,503,334.40	9.09
2	127038	国微转债	6,128	612,800.00	0.03

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易以套期保值为目的，利用股指期货剥离部分多头股票资产的系统性风险。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置。

## 7.11 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。

## 7.12 投资组合报告附注

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

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票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。

### 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	267,018.20
2	应收证券清算款	29,435,824.56
3	应收股利	-
4	应收利息	862,178.12
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,565,020.88

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 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
万家科创主题3年封闭运作灵活配置混合A	99,442	9,718.21	57,980,090.08	6.00%	908,418,059.30	94.00%
合计	99,442	9,718.21	57,980,090.08	6.00%	908,418,059.30	94.00%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

万家科创主题3年封闭运作灵活配置混合A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	渤海证券股份有限公司	15,556,373.00	8.58%
2	吴迅	13,507,923.00	7.45%
3	中国工商银行股份有限公司一兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金(FOF)	5,998,694.00	3.31%
4	成汝翠	3,690,444.00	2.03%
5	陈建燕	2,680,069.00	1.48%
6	余伟强	2,649,040.00	1.46%
7	潘小彦	2,579,143.00	1.42%
8	厦门鑫然能源开发有限公司	2,100,000.00	1.16%
9	卢国飞	1,818,670.00	1.00%
10	东方证券资管一鸿鼎财富一半年开放净值型6期一东证资管鸿鼎1号FOF单一资产管理	1,808,000.00	1.00%

### 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	万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合 A	140,229.82	0.0145%
	万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合 C	0.00	0.0000%
	合计	140,229.82	0.0145%

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合 A	10~50
	万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合 A	0
	万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合 A	万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合 C
基金合同生效日（2019 年 6 月 12 日）基金份额总额	966,398,149.38	-
本报告期期初基金份额总额	966,398,149.38	-
本报告期基金总申购份额	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	-	-
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	966,398,149.38	-

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

2021年3月16日，公司聘任陈广益先生担任公司总经理。

基金托管人：

本基金托管人未发生重大人事变动。

### 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

报告期内基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或者处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东吴证券	1	1,012,072,837.43	36.78%	942,543.17	36.77%	-
华创证券	2	511,046,912.31	18.57%	475,938.51	18.57%	-
天风证券	2	429,888,076.16	15.62%	400,355.36	15.62%	-
海通证券	1	423,974,585.73	15.41%	394,872.94	15.41%	-
国泰君安	1	148,718,935.86	5.40%	138,502.12	5.40%	-
光大证券	1	146,099,546.47	5.31%	136,063.11	5.31%	-
安信证券	1	80,235,774.03	2.92%	74,725.49	2.92%	-
方正证券	1	-	-	-	-	-

浙商证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-

注:1、基金专用交易席位的选择标准如下:

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

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：

报告期内，本基金无新增交易单元。

### 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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东吴证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	184,329,331.10	100.00%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	320,500,000.00	100.00%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准万家增强收益债券型证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《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、万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告原文
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议
- 7、《万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型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

2021 年 8 月 30 日