

# 万家智造优势混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 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                 | 15        |
| 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       | 15        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>15</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 15        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 15        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见       | 15        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>15</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 15        |
| 6.2 利润表                                 | 17        |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表                        | 18        |
| 6.4 报表附注                                | 22        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>51</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 51        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 51        |
| 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       | 52        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 54        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 56        |
| 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      | 56        |

|   |           |
|---|-----------|
| 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 ..... | 56        |
| 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 ..... | 56        |
| 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 .....    | 56        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 56        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 56        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                         | 57        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>57</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 57        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 58        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....      | 58        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>58</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>59</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 59        |
| 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 .....      | 59        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 59        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 59        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 59        |
| 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 .....         | 59        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 59        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 61        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>62</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 .....    | 62        |
| <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 .....                             | 63        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 63        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                     |                  |                 |
|---------------------|------------------|-----------------|
| 基金名称                | 万家智造优势混合型证券投资基金  |                 |
| 基金简称                | 万家智造优势混合         |                 |
| 基金主代码               | 006132           |                 |
| 基金运作方式              | 契约型开放式           |                 |
| 基金合同生效日             | 2018 年 8 月 28 日  |                 |
| 基金管理人               | 万家基金管理有限公司       |                 |
| 基金托管人               | 中国农业银行股份有限公司     |                 |
| 报告期末基金份<br>额总额      | 206,695,164.68 份 |                 |
| 基金合同存续期             | 不定期              |                 |
| 下属分级基金的基<br>金简称     | 万家智造优势混合 A       | 万家智造优势混合 C      |
| 下属分级基金的交<br>易代码     | 006132           | 006133          |
| 报告期末下属分级<br>基金的份额总额 | 166,297,465.66 份 | 40,397,699.02 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金主要投资于智造优势主题相关的优质上市公司。本基金采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，在严格管理风险的前提下，谋求基金资产的中长期稳健增值。   |
| 投资策略   | 1、大类资产配置策略；2、股票投资策略：（1）智造优势主题界定；（2）个股投资策略；（3）存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券等品种投资策略；5、可转换债券投资策略；6、其他金融衍生产品投资策略：（1）股指期货投资策略、（2）国债期货投资策略、（3）股票期权投资策略；7、融资交易策略。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率*65%+恒生指数收益率*10%+上证国债指数收益率*25%  |
| 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。<br>本基金可投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。       |

### 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       | 中国农业银行股份有限公司       |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 兰剑               | 秦一楠                |
|             | 联系电话 | 021-38909626     | 010-66060069       |
|             | 电子邮箱 | lanj@wjasset.com | tgxxpl@abchina.com |

|        |                                      |                              |
|--------|--------------------------------------|------------------------------|
| 客户服务电话 | 4008880800                           | 95599                        |
| 传真     | 021-38909627                         | 010-68121816                 |
| 注册地址   | 中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层） | 北京市东城区建国门内大街 69 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） | 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9 |
| 邮政编码   | 200122                               | 100031                       |
| 法定代表人  | 方一天                                  | 谷澍                           |

## 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《中国证券报》   |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <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 | 万家基金管理有限公司 | 中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层） |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日) |               |
|---------------|--|---------------|
|               | 万家智造优势混合 A                             | 万家智造优势混合 C    |
| 本期已实现收益       | -53,198,686.32                         | -5,798,105.06 |
| 本期利润          | -34,017,178.01                         | -286,429.97   |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.2181                                | -0.0123       |
| 本期加权平均净值利润率   | -8.08%                                 | -0.46%        |
| 本期基金份额净值增长率   | -8.55%                                 | -8.77%        |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日)                  |               |
| 期末可供分配利       | 142,187,176.74                         | 32,204,018.98 |

|              |                  |                |
|--------------|------------------|----------------|
| 润            |                  |                |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.8550           | 0.7972         |
| 期末基金资产净值     | 489,558,044.26   | 115,677,096.58 |
| 期末基金份额净值     | 2.9439           | 2.8635         |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2022年6月30日) |                |
| 基金份额累计净值增长率  | 243.57%          | 234.19%        |

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家智造优势混合 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 | 11.03%   | 1.47%       | 6.46%      | 0.83%         | 4.57%   | 0.64% |
| 过去三个月 | 11.46%   | 2.11%       | 4.37%      | 1.07%         | 7.09%   | 1.04% |
| 过去六个月 | -8.55%   | 2.02%       | -5.93%     | 1.11%         | -2.62%  | 0.91% |
| 过去一年  | 6.83%    | 1.85%       | -9.82%     | 0.95%         | 16.65%  | 0.90% |
| 过去三年  | 186.07%  | 1.84%       | 16.97%     | 0.95%         | 169.10% | 0.89% |

|                |         |       |        |       |             |       |
|----------------|---------|-------|--------|-------|-------------|-------|
| 自基金合同生效起<br>至今 | 243.57% | 1.78% | 29.47% | 1.00% | 214.10<br>% | 0.78% |
|----------------|---------|-------|--------|-------|-------------|-------|

万家智造优势混合 C

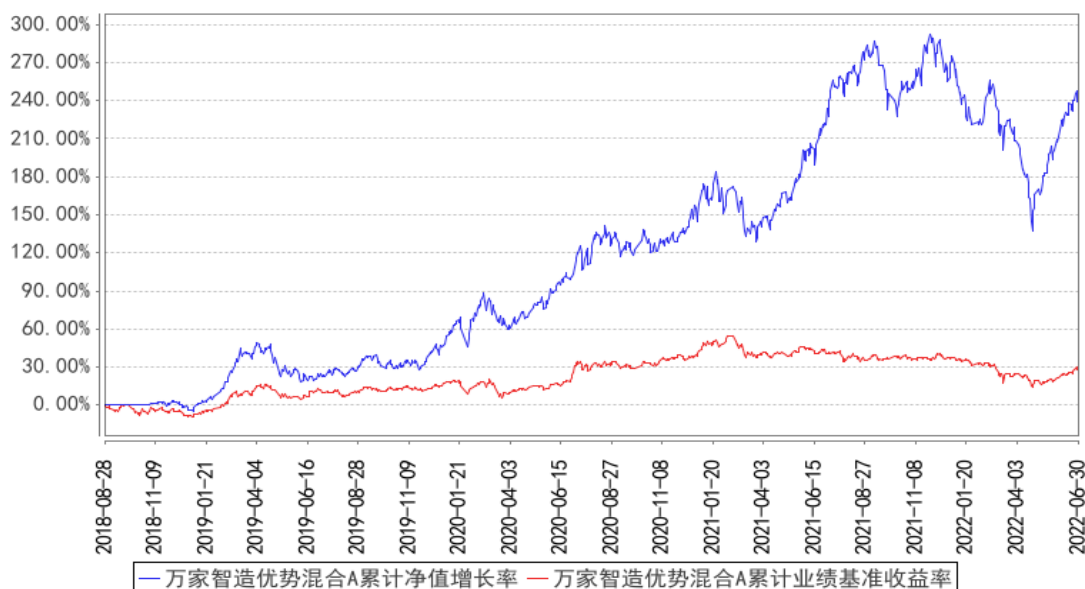
| 阶段             | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③         | ②—④   |
|----------------|----------|-------------|------------|---------------|-------------|-------|
| 过去一个月          | 10.98%   | 1.47%       | 6.46%      | 0.83%         | 4.52%       | 0.64% |
| 过去三个月          | 11.33%   | 2.11%       | 4.37%      | 1.07%         | 6.96%       | 1.04% |
| 过去六个月          | -8.77%   | 2.02%       | -5.93%     | 1.11%         | -2.84%      | 0.91% |
| 过去一年           | 6.31%    | 1.85%       | -9.82%     | 0.95%         | 16.13%      | 0.90% |
| 过去三年           | 181.68%  | 1.84%       | 16.97%     | 0.95%         | 164.71<br>% | 0.89% |
| 自基金合同生效起<br>至今 | 234.19%  | 1.78%       | 29.47%     | 1.00%         | 204.72<br>% | 0.78% |

注：基金业绩比较基准增长率=沪深 300 指数收益率\*65%+恒生指数收益率\*10%+上证国债指数收益率\*25%

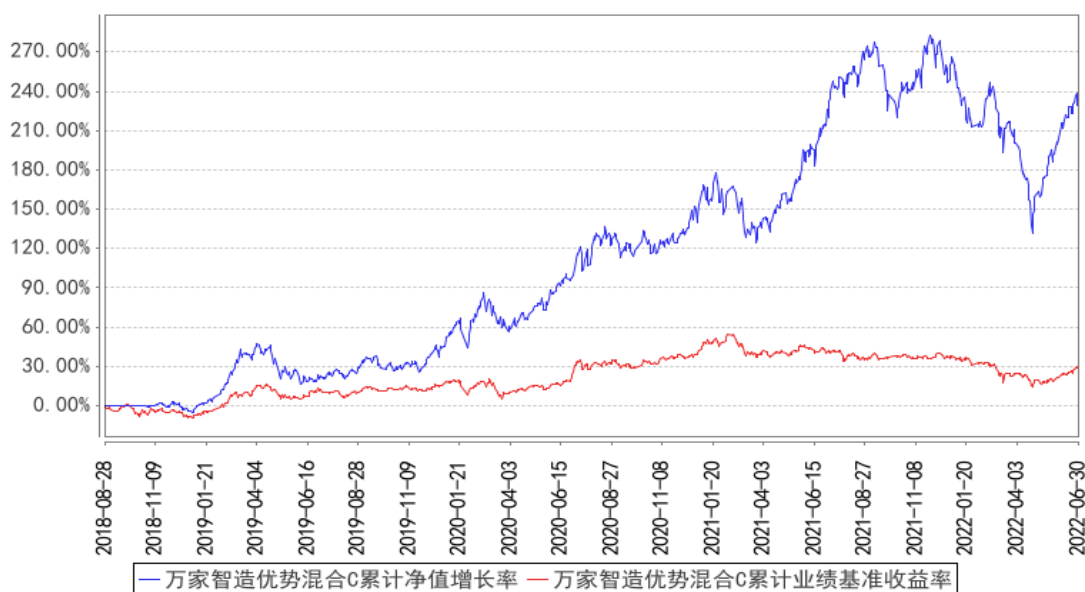


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

万家智造优势混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



万家智造优势混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同生效日期为 2018 年 8 月 28 日，建仓期为自基金合同生效日起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同要求。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、山东省新动能基金管理有限公司和齐河众鑫投资有限公司,住所：中国（上海）

自由贸易试验区浦电路 360 号 8 楼（名义楼层 9 层），办公地点：上海市浦东新区浦电路 360 号 9 楼，注册资本 3 亿元人民币。目前管理一百零九只开放式基金，分别为万家 180 指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金（LOF）、万家添利债券型证券投资基金（LOF）、万家新机遇价值驱动灵活配置混合型证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家上证 50 交易型开放式指数证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞和灵活配置混合型证券投资基金、万家颐达灵活配置混合型证券投资基金、万家颐和灵活配置混合型证券投资基金、万家恒瑞 18 个月定期开放债券型证券投资基金、万家 3-5 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家鑫安纯债债券型证券投资基金、万家鑫璟纯债债券型证券投资基金、万家沪深 300 指数增强型证券投资基金、万家家享中短债债券型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家 1-3 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家瑞隆混合型证券投资基金、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家现金增利货币市场基金、万家消费成长股票型证券投资基金、万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家玖盛纯债 9 个月定期开放债券型证券投资基金、万家天添宝货币市场基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、万家家瑞债券型证券投资基金、万家臻选混合型证券投资基金、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金、万家成长优选灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金、万家经济新动能混合型证券投资基金、万家潜力价值灵活配置混合型证券投资基金、万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家新机遇龙头企业灵活配置混合型证券投资基金、万家智造优势混合型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型证券投资基金、万家人工智能混合型证券投资基金、万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金（LOF）、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、万家平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、万

家科创主题灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、万家鑫盛纯债债券型证券投资基金、万家民安增利 12 个月定期开放债券型证券投资基金、万家汽车新趋势混合型证券投资基金、万家惠享 39 个月定期开放债券型证券投资基金、万家科技创新混合型证券投资基金、万家自主创新混合型证券投资基金、万家民丰回报一年持有期混合型证券投资基金、万家可转债债券型证券投资基金、万家民瑞祥和 6 个月持有期债券型证券投资基金、万家价值优势一年持有期混合型证券投资基金、万家养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、万家鑫动力月月购一年滚动持有混合型证券投资基金、万家科创板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家创业板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家周期优势企业混合型证券投资基金、万家健康产业混合型证券投资基金、万家互联互通中国优势量化策略混合型证券投资基金、万家战略发展产业混合型证券投资基金、万家创业板指数增强型证券投资基金、万家陆家嘴金融城金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家内需增长一年持有期混合型证券投资基金、万家互联互通核心资产量化策略混合型证券投资基金、万家民瑞祥明 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家瑞泽回报一年持有期混合型证券投资基金、万家惠裕回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家悦兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金、万家稳鑫 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、万家全球成长一年持有期混合型证券投资基金 (QDII)、万家瑞泰混合型证券投资基金、万家沪港深蓝筹混合型证券投资基金、万家北交所慧选两年定期开放混合型证券投资基金、万家鼎鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家新机遇成长一年持有期混合型发起式证券投资基金、万家港股通精选混合型证券投资基金、万家景气驱动混合型证券投资基金、万家安恒纯债 3 个月持有期债券型发起式证券投资基金、万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫橙纯债债券型证券投资基金、万家聚优稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、万家新能源主题混合型发起式证券投资基金、万家中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务                           | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|-----|------------------------------|-----------------|------|--------|--|
|     |                              | 任职日期            | 离任日期 |        |  |
| 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 | 2018 年 8 月 28 日 | -    | 12 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 |

|  |  |  |  |  |    |
|--|--|--|--|--|----|
|  | 型证券投资基金、万家科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、万家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 |  |  |  | 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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律、法规和监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋取最大利益，没有损害基金持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《公平交易管理办法》和《异常交易监控及报告管理办法》等规章制度，涵盖了研究、授权、投资决策和

交易执行等投资管理活动的各个环节,确保公平对待不同投资组合,防范导致不公平交易以及利益输送的异常交易发生。

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 2 次,为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易,有关基金经理按规定履行了审批程序。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年以来,国内外宏观经济发生了非常超预期的变化:

在国内,2022 年 4 月底奥密克戎病毒的突然爆发和蔓延,包括深圳、上海和吉林等省市受到影响,这对国内经济产生了影响。同时国内地产销售数据大幅走低(这是在我们的预期之中的),在此基础上,消费者也对期房销售尤其是民营企业期房销售持有较为明显的排斥,这加剧了地产行业的危机。这是国内经济预期较为悲观的原因,也是国内货币政策转向的根本原因。

在海外来说,俄乌之间的冲突也给欧洲经济复苏带来了担忧,同时目前看不到短期战争结束的迹象,这对全球供应链产生了很大的扰动,以石油为主的大宗商品价格在上半年大幅攀升,对我国制造业带来较大的经营困难。

但是好的方面,国内外流动性依然保持充裕,国内从 2021 年 12 月中央经济工作会议以来一直强调稳增长。3 月底新冠病毒爆发后,国内宽松政策继续加码。所以总的来说无论货币政策还是财政政策都趋向宽松。美联储从今年开始加息和缩表,好在这被市场消化的比较充分。

我们在持仓上始终坚持向高景气度的方向配置,我们相信在经济全球经济疲软,通胀高企的当下,只有业绩的高增长才能抵御估值回落的压力。所以我们依然保持新能源汽车、风电、光伏、军工等板块的配置不变。在俄乌冲突爆发后,我们快速减持了部分受原材料价格冲击较大的制造

业板块，并增加了稳增长直接受益的方向，例如基建和食品饮料。我们的持仓调整在 2 季度的反弹过程中获得了非常好的回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家智造优势混合 A 的基金份额净值为 2.9439 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.55%，同期业绩比较基准收益率为-5.93%，截至本报告期末万家智造优势混合 C 的基金份额净值为 2.8635 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.77%，同期业绩比较基准收益率为-5.93%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年下半年，我们认为国内宏观会有些积极的变化，特别是全国地产政策全面放松，中央和地方对地产方面问题开展了非常有针对性的措施，我们预期国内经济有望在基建启动和地产企稳的双重拉动下触底反弹。同时在国内疫情大幅好转的背景下，我们预计 2022 年十一前后，全国消费将大幅回升。但不利的一面是，流动性不会继续边际变好。

对于股市，我们认为市场将会步入结构性行情，总的来说在经济面临一定波动的背景下，需求较为稳定的新能源汽车、光伏、风电、军工、新材料等板块会有较好的相对收益。同时我们也要看到在二季度持续反弹后，部分细分板块和个股估值较高，我们会主动调减估值较高的个股和板块占比，阶段性加大经济复苏相关的板块（比如：基建、消费等）。

#### 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。估值委员会由负责估值业务的分管领导、合规稽核部负责人、基金运营部负责人、相关估值业务岗位人员、相关风控人员等组成。估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关从业资格,精通各自领域的理论知识,熟悉政策法规,并具有丰富的实践经验。

##### 2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不介入基金日常估值业务。

##### 3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

##### 4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

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

协议》。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—万家基金管理有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，万家基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，万家基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## § 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：万家智造优势混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 | 上年度末 |
|-----|-----|-----|------|
|-----|-----|-----|------|

|               |            | 2022 年 6 月 30 日                | 2021 年 12 月 31 日                 |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>    |            |                                |                                  |
| 银行存款          | 6.4.7.1    | 41,761,251.70                  | 25,094,942.67                    |
| 结算备付金         |            | 3,337,800.83                   | 3,366,264.10                     |
| 存出保证金         |            | 193,126.67                     | 177,949.73                       |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 564,102,359.38                 | 468,411,704.46                   |
| 其中：股票投资       |            | 564,102,359.38                 | 463,411,216.46                   |
| 基金投资          |            | -                              | -                                |
| 债券投资          |            | -                              | 5,000,488.00                     |
| 资产支持证券投资      |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资         |            | -                              | -                                |
| 其他投资          |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产        | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产      | 6.4.7.4    | -                              | -                                |
| 债权投资          |            | -                              | -                                |
| 其中：债券投资       |            | -                              | -                                |
| 资产支持证券投资      |            | -                              | -                                |
| 其他投资          |            | -                              | -                                |
| 其他债权投资        |            | -                              | -                                |
| 其他权益工具投资      |            | -                              | -                                |
| 应收清算款         |            | 10,221,238.56                  | 1,450,576.61                     |
| 应收股利          |            | -                              | -                                |
| 应收申购款         |            | 1,254,458.10                   | 1,473,346.40                     |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                              | 53,815.78                        |
| 资产总计          |            | 620,870,235.24                 | 500,028,599.75                   |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2021 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>   |            |                                |                                  |
| 短期借款          |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债       |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款     |            | -                              | -                                |
| 应付清算款         |            | 9,407,695.73                   | -                                |
| 应付赎回款         |            | 4,592,386.06                   | 5,317,531.19                     |
| 应付管理人报酬       |            | 704,903.69                     | 674,666.06                       |
| 应付托管费         |            | 117,483.94                     | 112,444.34                       |
| 应付销售服务费       |            | 43,034.45                      | 24,721.66                        |
| 应付投资顾问费       |            | -                              | -                                |
| 应交税费          |            | -                              | -                                |
| 应付利润          |            | -                              | -                                |
| 递延所得税负债       |            | -                              | -                                |
| 其他负债          | 6.4.7.6    | 769,590.53                     | 1,253,550.86                     |



|             |         |                |                |
|-------------|---------|----------------|----------------|
| 负债合计        |         | 15,635,094.40  | 7,382,914.11   |
| <b>净资产：</b> |         |                |                |
| 实收基金        | 6.4.7.7 | 206,695,164.68 | 153,528,299.10 |
| 其他综合收益      | 6.4.7.8 | -              | -              |
| 未分配利润       | 6.4.7.9 | 398,539,976.16 | 339,117,386.54 |
| 净资产合计       |         | 605,235,140.84 | 492,645,685.64 |
| 负债和净资产总计    |         | 620,870,235.24 | 500,028,599.75 |

注：1. 报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 206,695,164.68 份，其中万家智造优势混合 A 基金份额净值 2.9439 元，基金份额总额 166,297,465.66；万家智造优势混合 C 基金份额净值 2.8635 元，基金份额总额 40,397,699.02。

2. 比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：万家智造优势混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                | 附注号      | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年<br>6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年<br>6 月 30 日 |
|-------------------|----------|--|---|
| <b>一、营业总收入</b>    |          | -29,885,219.30                           | 18,787,056.38                                 |
| 1. 利息收入           |          | 132,138.66                               | 21,895.45                                     |
| 其中：存款利息收入         | 6.4.7.10 | 132,138.66                               | 21,890.88                                     |
| 债券利息收入            |          | -  | 4.57  |
| 资产支持证券利息收入        |          | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入        |          | -  | -   |
| 证券出借利息收入          |          | -  | -   |
| 其他利息收入            |          | -  | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |          | -55,217,273.07                           | 13,848,110.89                                 |
| 其中：股票投资收益         | 6.4.7.11 | -57,198,992.79                           | 13,542,151.74                                 |
| 基金投资收益            |          | -  | -   |
| 债券投资收益            | 6.4.7.12 | 3,656.59                                 | -   |
| 资产支持证券投资收益        | 6.4.7.13 | -  | -   |

|                            |            |                |               |
|----------------------------|------------|----------------|---------------|
| 贵金属投资收益                    | 6.4.7.14   | -              | -             |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.15   | -              | -             |
| 股利收益                       | 6.4.7.16   | 1,978,063.13   | 305,959.15    |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益      |            | -              | -             |
| 其他投资收益                     |            | -              | -             |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.17   | 24,693,183.40  | 4,514,750.92  |
| 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   | 506,731.71     | 402,299.12    |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 4,418,388.68   | 1,103,296.87  |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 3,571,102.55   | 549,029.61    |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 595,183.72     | 91,505.02     |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 151,076.61     | 32,180.48     |
| 4. 投资顾问费                   |            | -              | -             |
| 5. 利息支出                    |            | -              | -             |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -              | -             |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.19   | -              | -             |
| 7. 税金及附加                   |            | -              | 0.02          |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 101,025.80     | 430,581.74    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -34,303,607.98 | 17,683,759.51 |
| 减：所得税费用                    |            | -              | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -34,303,607.98 | 17,683,759.51 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -              | -             |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | -34,303,607.98 | 17,683,759.51 |

注：比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：万家智造优势混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

|    |    |
|----|----|
| 项目 | 本期 |
|----|----|

|                                     | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |        |                |                 |
|-------------------------------------|---------------------------------|--------|----------------|-----------------|
|                                     | 实收基金                            | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计           |
| 一、上期期末净资产(基金净值)                     | 153,528,299.10                  | -      | 339,117,386.54 | 492,645,685.64  |
| 加:会计政策变更                            | -                               | -      | -              | -               |
| 前期差错更正                              | -                               | -      | -              | -               |
| 其他                                  | -                               | -      | -              | -               |
| 二、本期期初净资产(基金净值)                     | 153,528,299.10                  | -      | 339,117,386.54 | 492,645,685.64  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                | 53,166,865.58                   | -      | 59,422,589.62  | 112,589,455.20  |
| (一)、综合收益总额                          | -                               | -      | -34,303,607.98 | -34,303,607.98  |
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | 53,166,865.58                   | -      | 93,726,197.60  | 146,893,063.18  |
| 其中:1.基金申购款                          | 103,848,186.53                  | -      | 179,057,197.46 | 282,905,383.99  |
| 2.基金赎回款                             | -50,681,320.95                  | -      | -85,330,999.86 | -136,012,320.81 |
| (三)、                                | -                               | -      | -              | -               |

|                                      |                                 |        |                |                |
|--------------------------------------|---------------------------------|--------|----------------|----------------|
| 本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) |                                 |        |                |                |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                     | -                               | -      | -              | -              |
| 四、本期期末净资产(基金净值)                      | 206,695,164.68                  | -      | 398,539,976.16 | 605,235,140.84 |
| 项目                                   | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |        |                |                |
|                                      | 实收基金                            | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产(基金净值)                      | 42,720,040.26                   | -      | 67,244,173.34  | 109,964,213.60 |
| 加:会计政策变更                             | -                               | -      | -              | -              |
| 前期差错更正                               | -                               | -      | -              | -              |
| 其他                                   | -                               | -      | -              | -              |
| 二、本期期初净资产(基金净值)                      | 42,720,040.26                   | -      | 67,244,173.34  | 109,964,213.60 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                 | -17,763,695.58                  | -      | -12,294,196.58 | -30,057,892.16 |

|  |                |   |                |                 |
|--|----------------|---|----------------|-----------------|
| (一)、<br>综合收益总额                               | -              | - | 17,683,759.51  | 17,683,759.51   |
| (二)、<br>本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号填列)  | -17,763,695.58 | - | -29,977,956.09 | -47,741,651.67  |
| 其中:1.<br>基金申购款                               | 19,772,138.39  | - | 34,930,797.04  | 54,702,935.43   |
| 2.<br>基金赎回款                                  | -37,535,833.97 | - | -64,908,753.13 | -102,444,587.10 |
| (三)、<br>本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -              | - | -              | -               |
| (四)、<br>其他综合收益结转留存收益                         | -              | - | -              | -               |
| 四、本期末净资产(基金净值)                               | 24,956,344.68  | - | 54,949,976.76  | 79,906,321.44   |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

方一天

陈广益

尹超

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

万家智造优势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”）《关于准予万家智造优势混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2018]854 号文）批准，由万家基金管理有限公司作为基金管理人于 2018 年 8 月 2 日至 2018 年 8 月 24 日向社会公开募集，募集期结束经立信会计师事务所（特殊普通合伙）验资并出具信会师报字[2018]第 ZA30741 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 2018 年 8 月 28 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 227,614,955.15 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 19,603.40 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 227,634,558.55 元，折合 227,634,558.55 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金主要投资具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、股指期货、国债期货、股票期权以及债券（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：沪深 300 指数收益率\*65%+恒生指数收益率\*10%+上证国债指数收益率\*25%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

发布的有关规定及允许的基金行业实务操作。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

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

会计政策变更:

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》(财会〔2017〕7 号)、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》(财会〔2017〕8 号)、《企业会计准则第 24 号——套期会计》(财会〔2017〕9 号)、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(财会〔2017〕14 号)(以下简称新金融工具相关会计准则)和《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》(财会〔2020〕22 号),自 2022 年 1 月 1 日起,本基金开始执行新金融工具相关会计准则,根据衔接规定,对可比期间信息不予调整,首日执行新准则与现行准则的差异追溯调整报告期期初未分配利润。

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

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

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

##### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

###### 1、金融资产的分类

自 2022 年 1 月 1 日起适用

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金目前暂无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

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

本基金持有的其他金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

2022 年 1 月 1 日前适用

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

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

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

## 2、金融负债的分类

自 2022 年 1 月 1 日起适用

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和以摊余成本计量的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

2022 年 1 月 1 日前适用

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

自 2022 年 1 月 1 日起适用

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。其他金融资产和以摊余成本计量的金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于



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

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取金融资产现金流量的合同权利终止；（2）金融资产已转移，且已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；（3）金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对金融资产的控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

2022 年 1 月 1 日前适用

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

自 2022 年 1 月 1 日起适用

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

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

2022 年 1 月 1 日前适用

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

#### 6.4.4.4 费用的确认和计量

自 2022 年 1 月 1 日起适用

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

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

2022 年 1 月 1 日前适用

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率逐日计提;

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提;

(3) 本基金的 A 类基金份额不收取销售服务费;本基金的 C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.50%的年费率逐日计提;

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

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

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》(财会〔2017〕7 号)、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》(财会〔2017〕8 号)、《企业会计准则第 24 号——套期会计》(财会〔2017〕9 号)、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(财会〔2017〕14 号)(以下简称新金融工具相关会计准则)和《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》(财会〔2020〕22 号),自 2022 年 1 月 1 日起,本基金开始执行新金融工具相关会计准则,根据衔接规定,对可比期间信息不予调整,首日执行新准则与现行准则的差异追溯调整报告期期初未分配利润。

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

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

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

| 金融资产/<br>负债类别 | 修订前的金融工具确认计量准则    |                | 修订后的金融工具确认计量准则    |                |
|---------------|-------------------|----------------|-------------------|----------------|
|               | 计量类别              | 账面价值           | 计量类别              | 账面价值           |
| <b>金融资产</b>   |                   |                |                   |                |
| 银行存款          | 摊余成本（应收款项）        | 25,094,942.67  | 摊余成本              | 25,102,274.51  |
| 结算备付金         | 摊余成本（应收款项）        | 3,366,264.10   | 摊余成本              | 3,367,930.49   |
| 存出保证金         | 摊余成本（应收款项）        | 177,949.73     | 摊余成本              | 178,037.84     |
| 交易性金融资产       | 以公允价值计量且其变动计入当期损益 | 468,411,704.46 | 以公允价值计量且其变动计入当期损益 | 468,456,433.45 |
| 应收清算款         | 摊余成本（应收款项）        | 1,450,576.61   | 摊余成本              | 1,450,576.61   |
| 应收利息          | 摊余成本（应收款项）        | 53,815.78      | —                 | —              |
| 应收申购款         | 摊余成本（应收款项）        | 1,473,346.40   | 摊余成本              | 1,473,346.85   |
| <b>金融负债</b>   |                   |                |                   |                |
| 应付赎回款         | 摊余成本              | 5,317,531.19   | 摊余成本              | 5,317,531.19   |
| 应付管理人报酬       | 摊余成本              | 674,666.06     | 摊余成本              | 674,666.06     |
| 应付托管费         | 摊余成本              | 112,444.34     | 摊余成本              | 112,444.34     |
| 应付销售服务费       | 摊余成本              | 24,721.66      | 摊余成本              | 24,721.66      |
| 应付交易费用        | 摊余成本              | 1,080,354.78   | —                 | —              |
| 其他负债          | 摊余成本              | 173,196.08     | 摊余成本              | 1,253,550.86   |

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### (一) 印花税

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

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

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

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

##### (二) 增值税

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

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

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

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

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

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

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

### (三) 企业所得税

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

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

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

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

### (四) 个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差

别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 41,761,251.70          |
| 等于：本金          | 41,752,657.28          |
| 加：应计利息         | 8,594.42               |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 定期存款           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |
| 加：应计利息         | -                      |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                      |
| 存款期限 1-3 个月    | -                      |
| 存款期限 3 个月以上    | -                      |
| 其他存款           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |
| 加：应计利息         | -                      |

|        |               |
|--------|---------------|
| 减：坏账准备 | -             |
| 合计     | 41,761,251.70 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2022年6月30日 |      |                |               |
|---------------|-------------------|------|----------------|---------------|
|               | 成本                | 应计利息 | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            | 484,328,114.46    | -    | 564,102,359.38 | 79,774,244.92 |
| 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            | 484,328,114.46    | -    | 564,102,359.38 | 79,774,244.92 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2022年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 6,353.27          |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 应付交易费用      | 681,414.40        |
| 其中：交易所市场    | 681,414.40        |
| 银行间市场       | -                 |
| 应付利息        | -                 |



|      |            |
|------|------------|
| 预提费用 | 81,822.86  |
| 合计   | 769,590.53 |

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

万家智造优势混合 A

| 项目            | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 133,720,706.05                        | 133,720,706.05 |
| 本期申购          | 71,840,877.59                         | 71,840,877.59  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -39,264,117.98                        | -39,264,117.98 |
| 基金拆分/份额折算前    | -                                     | -              |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                                     | -              |
| 本期申购          | -                                     | -              |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -              |
| 本期末           | 166,297,465.66                        | 166,297,465.66 |

万家智造优势混合 C

| 项目            | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 19,807,593.05                         | 19,807,593.05  |
| 本期申购          | 32,007,308.94                         | 32,007,308.94  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -11,417,202.97                        | -11,417,202.97 |
| 基金拆分/份额折算前    | -                                     | -              |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                                     | -              |
| 本期申购          | -                                     | -              |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -              |
| 本期末           | 40,397,699.02                         | 40,397,699.02  |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

#### 6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

万家智造优势混合 A

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 本期期初           | 159,465,558.82 | 137,284,718.34 | 296,750,277.16 |
| 本期利润           | -53,198,686.32 | 19,181,508.31  | -34,017,178.01 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 35,920,304.24  | 24,607,175.21  | 60,527,479.45  |
| 其中：基金申购款       | 76,685,388.52  | 50,413,977.44  | 127,099,365.96 |
| 基金赎回款          | -40,765,084.28 | -25,806,802.23 | -66,571,886.51 |

|         |                |                |                |
|---------|----------------|----------------|----------------|
| 本期已分配利润 | -              | -              | -              |
| 本期末     | 142,187,176.74 | 181,073,401.86 | 323,260,578.60 |

万家智造优势混合 C

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 本期期初           | 22,427,499.94  | 19,939,609.44 | 42,367,109.38  |
| 本期利润           | -5,798,105.06  | 5,511,675.09  | -286,429.97    |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 15,574,624.10  | 17,624,094.05 | 33,198,718.15  |
| 其中：基金申购款       | 26,953,037.53  | 25,004,793.97 | 51,957,831.50  |
| 基金赎回款          | -11,378,413.43 | -7,380,699.92 | -18,759,113.35 |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |
| 本期末            | 32,204,018.98  | 43,075,378.58 | 75,279,397.56  |

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                   |
|-----------|----------------------|
|           | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 活期存款利息收入  | 119,065.14           |
| 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 | 11,130.58            |
| 其他        | 1,942.94             |
| 合计        | 132,138.66           |

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期                   |
|------------------|----------------------|
|                  | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -57,198,992.79       |
| 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               | -57,198,992.79       |

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期                   |
|------------|----------------------|
|            | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 卖出股票成交总额   | 609,922,744.00       |
| 减：卖出股票成本总额 | 665,066,481.79       |
| 减：交易费用     | 2,055,255.00         |
| 买卖股票差价收入   | -57,198,992.79       |

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 1,097.63                   |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 2,558.96                   |
| 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                           | 3,656.59                   |

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 5,048,377.82               |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 4,999,987.20               |
| 减：应计利息总额               | 45,826.62                  |
| 减：交易费用                 | 5.04                       |
| 买卖债券差价收入               | 2,558.96                   |

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 1,978,063.13                          |
| 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            | 1,978,063.13                          |

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | 24,693,183.40                         |
| 股票投资                   | 24,693,684.20                         |
| 债券投资                   | -500.80                               |
| 资产支持证券投资               | -                                     |
| 基金投资                   | -                                     |
| 贵金属投资                  | -                                     |
| 其他                     | -                                     |
| 2. 衍生工具                | -                                     |
| 权证投资                   | -                                     |
| 3. 其他                  | -                                     |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -                                     |
| 合计                     | 24,693,183.40                         |

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 504,896.03                            |
| 基金转换费收入 | 1,835.68                              |
| 合计      | 506,731.71                            |

#### 6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|-------|---------------------------------------|
| 审计费用  | 22,315.49                             |
| 信息披露费 | 59,507.37                             |

|         |            |
|---------|------------|
| 证券出借违约金 | -          |
| 银行费用    | 10,202.94  |
| 账户维护费   | 9,000.00   |
| 合计      | 101,025.80 |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日,本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

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

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |                         | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |                         |
|-------|----------------------------|-------------------------|---------------------------------|-------------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额                            | 占当期股票<br>成交总额的比例<br>(%) |
| 中泰证券  | 192,063,715.85             | 14.28                   | 204,667,019.07                  | 100.00                  |

###### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30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 | 5,002,551.20 | 100.00           | -    | -                |

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间,本基金未通过关联方席位进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本报告期及上年度可比期间,本基金未通过关联方席位进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日      |                |           |                  |
|-------|---------------------------------|----------------|-----------|------------------|
|       | 当期佣金                            | 占当期佣金总量的比例 (%) | 期末应付佣金余额  | 占期末应付佣金总额的比例 (%) |
| 中泰证券  | 185,617.84                      | 15.34          | 68,047.48 | 9.99             |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |                |           |                  |
|       | 当期佣金                            | 占当期佣金总量的比例 (%) | 期末应付佣金余额  | 占期末应付佣金总额的比例 (%) |
| 中泰证券  | 190,606.50                      | 100.00         | 85,079.78 | 100.00           |

#### 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<br>2022年1月1日至2022年6月30日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 3,571,102.55               | 549,029.61                      |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 1,387,159.53               | 203,447.78                      |

注:1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,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、公休假等,支付日期顺延。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目             | 本期                              | 上年度可比期间                         |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
|                | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 595,183.72                      | 91,505.02                       |

注：1、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，逐日累计至每月月末，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、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期                              |            |           |
|----------------|---------------------------------|------------|-----------|
|                | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |            |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |            |           |
|                | 万家智造优势混合 A                      | 万家智造优势混合 C | 合计        |
| 万家基金管理有限公司     | -                               | 5,179.91   | 5,179.91  |
| 中泰证券股份有限公司     | -                               | 776.29     | 776.29    |
| 中国农业银行         | -                               | 58,364.05  | 58,364.05 |
| 合计             | -                               | 64,320.25  | 64,320.25 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                         |            |           |
|                | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |            |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |            |           |
|                | 万家智造优势混合 A                      | 万家智造优势混合 C | 合计        |
| 万家基金管理有限公司     | -                               | 726.78     | 726.78    |
| 中泰证券股份有限公司     | -                               | 616.02     | 616.02    |
| 合计             | -                               | 1,342.80   | 1,342.80  |

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.50%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.50% 年费率计提。

计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额的基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据相关协议支付给各销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 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

本基金本报告期末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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                         | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
|                            | 万家智造优势混合 A                 | 万家智造优势混合 C                 |
| 基金合同生效日（2018年8月28日）持有的基金份额 | -                          | -                          |
| 报告期初持有的基金份额                | 6,419,505.92               | -                          |
| 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                | 6,419,505.92               | -                          |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例        | 3.8603%                    | -                          |



| 项目                              | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30<br>日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6<br>月 30 日 |
|---------------------------------|---|---|
|                                 | 万家智造优势混合 A                                    | 万家智造优势混合 C                                    |
| 基金合同生效日（2018 年 8 月 28 日）持有的基金份额 | 0.00  | -   |
| 报告期初持有的基金份额                     | 4,392,268.83                                  | -   |
| 报告期间申购/买入总份额                    | 0.00  | -   |
| 报告期间因拆分变动份额                     | 0.00  | -   |
| 减：报告期间赎回/卖出总份<br>额              | 0.00  | -   |
| 报告期末持有的基金份额                     | 4,392,268.83                                  | -   |
| 报告期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例         | 21.8357%                                      | -   |

#### 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

##### 万家智造优势混合 A

| 关联方名称      | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |                             | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |                              |
|------------|------------------------|-----------------------------|--------------------------|------------------------------|
|            | 持有的<br>基金份额            | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比例<br>(%) | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比<br>例 (%) |
| 中泰证券股份有限公司 | 4,290,269.25           | 2.5799                      | 4,290,269.25             | 3.2084                       |

#### 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<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30<br>日 |            | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |           |
|--------|--|------------|--|-----------|
|        | 期末余额                                     | 当期利息收入     | 期末余额                                       | 当期利息收入    |
| 中国农业银行 | 41,761,251.70                            | 119,065.14 | 5,925,694.10                               | 19,956.56 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |         |        |        |        |              |           |           |    |
|----------------------|------|------------|---------|--------|--------|--------|--------------|-----------|-----------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日      | 受限期     | 流通受限类型 | 认购价格   | 期末估值单价 | 数量<br>(单位：股) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 301103               | 何氏眼科 | 2022年3月14日 | 6个月     | 新股流通受限 | 42.50  | 32.02  | 488          | 15,937.50 | 15,625.76 | -  |
| 301112               | 信邦智能 | 2022年6月20日 | 6个月     | 新股流通受限 | 27.53  | 45.04  | 399          | 10,984.47 | 17,970.96 | -  |
| 301122               | 采纳股份 | 2022年1月19日 | 6个月     | 新股流通受限 | 50.31  | 70.37  | 301          | 15,143.31 | 21,181.37 | -  |
| 301123               | 奕东电子 | 2022年1月14日 | 6个月     | 新股流通受限 | 37.23  | 25.39  | 353          | 13,142.19 | 8,962.67  | -  |
| 301125               | 腾亚精工 | 2022年5月27日 | 6个月     | 新股流通受限 | 22.49  | 27.42  | 327          | 7,354.23  | 8,966.34  | -  |
| 301130               | 西点药业 | 2022年2月16日 | 6个月     | 新股流通受限 | 22.55  | 37.70  | 237          | 5,344.35  | 8,934.90  | -  |
| 301137               | 哈焊华通 | 2022年3月14日 | 6个月     | 新股流通受限 | 15.37  | 15.99  | 644          | 9,898.28  | 10,297.56 | -  |
| 301196               | 唯科科技 | 2022年1月4日  | 6个月     | 新股流通受限 | 64.08  | 37.52  | 165          | 10,573.20 | 6,190.80  | -  |
| 301215               | 中汽股份 | 2022年2月28日 | 6个月     | 新股流通受限 | 3.80   | 6.39   | 4,110        | 15,618.00 | 26,262.90 | -  |
| 301219               | 腾远钴业 | 2022年3月10日 | 6个月     | 新股流通受限 | 173.98 | 87.82  | 115          | 11,134.72 | 10,099.30 | -  |
| 301233               | 盛帮股份 | 2022年6月24日 | 1个月内(含) | 新股未上市  | 41.52  | 41.52  | 1,418        | 58,875.36 | 58,875.36 | -  |
| 301233               | 盛帮股份 | 2022年6月24日 | 6个月     | 新股流通受限 | 41.52  | 41.52  | 158          | 6,560.16  | 6,560.16  | -  |

|        |      |             |         |        |       |       |        |              |              |   |
|--------|------|-------------|---------|--------|-------|-------|--------|--------------|--------------|---|
| 301235 | 华康医疗 | 2022年1月21日  | 6个月     | 新股流通受限 | 39.30 | 37.93 | 418    | 16,427.40    | 15,854.74    | - |
| 301238 | 瑞泰新材 | 2022年6月10日  | 6个月     | 新股流通受限 | 19.18 | 32.07 | 1,238  | 23,744.84    | 39,702.66    | - |
| 301256 | 华融化学 | 2022年3月14日  | 6个月     | 新股流通受限 | 8.05  | 10.08 | 1,831  | 14,739.55    | 18,456.48    | - |
| 301263 | 泰恩康  | 2022年3月22日  | 6个月     | 新股流通受限 | 19.93 | 31.38 | 682    | 13,592.26    | 21,401.16    | - |
| 301266 | 宇邦新材 | 2022年5月30日  | 6个月     | 新股流通受限 | 26.86 | 47.07 | 517    | 13,886.62    | 24,335.19    | - |
| 301268 | 铭利达  | 2022年3月29日  | 6个月     | 新股流通受限 | 28.50 | 34.87 | 641    | 18,268.50    | 22,351.67    | - |
| 301298 | 东利机械 | 2022年5月27日  | 6个月     | 新股流通受限 | 12.68 | 20.83 | 634    | 8,039.12     | 13,206.22    | - |
| 301302 | 华如科技 | 2022年6月16日  | 6个月     | 新股流通受限 | 52.03 | 56.42 | 402    | 20,916.06    | 22,680.84    | - |
| 600941 | 中国移动 | 2021年12月24日 | 6个月     | 新股流通受限 | 57.58 | 60.26 | 43,681 | 2,515,151.98 | 2,632,217.06 | - |
| 688270 | 臻镭科技 | 2022年1月20日  | 6个月     | 新股流通受限 | 61.88 | 59.87 | 2,892  | 178,956.96   | 173,144.04   | - |
| 688283 | 坤恒顺维 | 2022年2月8日   | 6个月     | 新股流通受限 | 33.80 | 45.41 | 1,595  | 53,911.00    | 72,428.95    | - |
| 688400 | 凌云光  | 2022年6月27日  | 1个月内(含) | 新股未上市  | 21.93 | 21.93 | 9,720  | 213,159.60   | 213,159.60   | - |

#### 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 2022 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖

出回购证券款余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                      | -                        |
| A-1 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | -                      | 5,000,488.00             |
| 合计     |                        | 5,000,488.00             |

注：未评级债券为国债。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金期末持有的流通受限证券外，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

本基金的投资市场主要为固定收益类金融工具以及股票市场，公司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。本基金运作期间公司对组合短期变现能力、流动性受限资产比例等流动性指标进行持续的监测和评估，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<br>2022年6月30日 | 1个月以内         | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计            |
|-------------------|---------------|-------|--------|------|------|-----|---------------|
| 资产                |               |       |        |      |      |     |               |
| 银行存款              | 41,761,251.70 | -     | -      | -    | -    | -   | 41,761,251.70 |

|                     |               |       |               |      |      |                 |                |
|---------------------|---------------|-------|---------------|------|------|-----------------|----------------|
| 结算备付金               | 3,337,800.83  | -     | -             | -    | -    | -               | 3,337,800.83   |
| 存出保证金               | 193,126.67    | -     | -             | -    | -    | -               | 193,126.67     |
| 交易性金融资产             | -             | -     | -             | -    | -    | -564,102,359.38 | 564,102,359.38 |
| 应收申购款               | 411.15        | -     | -             | -    | -    | 1,254,046.95    | 1,254,458.10   |
| 应收清算款               | -             | -     | -             | -    | -    | 10,221,238.56   | 10,221,238.56  |
| 资产总计                | 45,292,590.35 | -     | -             | -    | -    | -575,577,644.89 | 620,870,235.24 |
| 负债                  |               |       |               |      |      |                 |                |
| 应付赎回款               | -             | -     | -             | -    | -    | 4,592,386.06    | 4,592,386.06   |
| 应付管理人报酬             | -             | -     | -             | -    | -    | 704,903.69      | 704,903.69     |
| 应付托管费               | -             | -     | -             | -    | -    | 117,483.94      | 117,483.94     |
| 应付清算款               | -             | -     | -             | -    | -    | 9,407,695.73    | 9,407,695.73   |
| 应付销售服务费             | -             | -     | -             | -    | -    | 43,034.45       | 43,034.45      |
| 其他负债                | -             | -     | -             | -    | -    | 769,590.53      | 769,590.53     |
| 负债总计                | -             | -     | -             | -    | -    | 15,635,094.40   | 15,635,094.40  |
| 利率敏感度缺口             | 45,292,590.35 | -     | -             | -    | -    | -559,942,550.49 | 605,235,140.84 |
| 上年度末<br>2021年12月31日 | 1个月以内         | 1-3个月 | 3个月-1年        | 1-5年 | 5年以上 | 不计息             | 合计             |
| 资产                  |               |       |               |      |      |                 |                |
| 银行存款                | 25,094,942.67 | -     | -             | -    | -    | -               | 25,094,942.67  |
| 结算备付金               | 3,366,264.10  | -     | -             | -    | -    | -               | 3,366,264.10   |
| 存出保证金               | 177,949.73    | -     | -             | -    | -    | -               | 177,949.73     |
| 交易性金融资产             | -             | -     | -5,000,488.00 | -    | -    | -463,411,216.46 | 468,411,704.46 |
| 应收证券清算款             | -             | -     | -             | -    | -    | 1,450,576.61    | 1,450,576.61   |
| 其他资产                | -             | -     | -             | -    | -    | 53,815.78       | 53,815.78      |
| 应收申购款               | 1,520.00      | -     | -             | -    | -    | 1,471,826.40    | 1,473,346.40   |
| 资产总计                | 28,640,676.50 | -     | -5,000,488.00 | -    | -    | -466,387,435.25 | 500,028,599.75 |
| 负债                  |               |       |               |      |      |                 |                |
| 应付赎回款               | -             | -     | -             | -    | -    | 5,317,531.19    | 5,317,531.19   |
| 应付管理人报酬             | -             | -     | -             | -    | -    | 674,666.06      | 674,666.06     |
| 应付托管费               | -             | -     | -             | -    | -    | 112,444.34      | 112,444.34     |
| 应付销售服务费             | -             | -     | -             | -    | -    | 24,721.66       | 24,721.66      |
| 其他负债                | -             | -     | -             | -    | -    | 1,253,550.86    | 1,253,550.86   |
| 负债总计                | -             | -     | -             | -    | -    | 7,382,914.11    | 7,382,914.11   |
| 利率敏感度缺口             | 28,640,676.50 | -     | -5,000,488.00 | -    | -    | -459,004,521.14 | 492,645,685.64 |

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交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |   |                             |                        |
|----|---|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | 该利率敏感性分析基于本基金与资产负债表日的利率风险状况；  |                             |                        |
|    | 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；  |                             |                        |
|    | 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；   |                             |                        |
|    | 银行存款、结算备付金及存出保证金以活期存款计息，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；买入返售金融资产利息收益/卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响； |                             |                        |
|    | 相关风险变量的变动   | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |   | 本期末（2022 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2021 年 12 月 31 日） |
| 分析 | 市场利率下降 25 个基点   | -                           | 6,833.67               |
|    | 市场利率上升 25 个基点   | -                           | -6,807.64              |

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控，并通过外汇远期投资交易对上述外汇风险进行管理。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |              |                |    |
|----|------------------------|--------------|----------------|----|
|    | 美元<br>折合人民币<br>元       | 港币<br>折合人民币元 | 其他币种<br>折合人民币元 | 合计 |
|    |                        |              |                |    |

|               |                          |               |            |               |
|---------------|--------------------------|---------------|------------|---------------|
| 以外币计价的资产      |                          |               |            |               |
| 交易性金融资产       | -                        | 48,728,161.77 | -          | 48,728,161.77 |
| 资产合计          | -                        | 48,728,161.77 | -          | 48,728,161.77 |
| 以外币计价的负债      |                          |               |            |               |
| 负债合计          | -                        | -             | -          | -             |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | -                        | 48,728,161.77 | -          | 48,728,161.77 |
| 项目            | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |               |            |               |
|               | 美元折合人民币元                 | 港币折合人民币元      | 其他币种折合人民币元 | 合计            |
| 以外币计价的资产      |                          |               |            |               |
| 资产合计          | -                        | -             | -          | -             |
| 以外币计价的负债      |                          |               |            |               |
| 负债合计          | -                        | -             | -          | -             |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | -                        | -             | -          | -             |

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除汇率以外的其他市场变量保持不变 |                             |                        |
|----|------------------|-----------------------------|------------------------|
|    | 相关风险变量的变动        | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                  | 本期末（2022 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2021 年 12 月 31 日） |
| 分析 | 港币相对于人民币升值 5%    | 2,436,408.09                | -                      |
|    | 港币相对于人民币贬值 5%    | -2,436,408.09               | -                      |

#### 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<br>2022年6月30日 |               | 上年度末<br>2021年12月31日 |               |
|---------------|-------------------|---------------|---------------------|---------------|
|               | 公允价值              | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值                | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 564,102,359.38    | 93.20         | 463,411,216.46      | 94.07         |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                 | -             | -                   | -             |
| 交易性金融资产—债券投资  | -                 | -             | 5,000,488.00        | 1.02          |
| 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            | 564,102,359.38    | 93.20         | 468,411,704.46      | 95.08         |

注：本基金投资于股票的比例,不得高于基金资产净值的 95%,其中投资于上证 180 指数成份股的比重不低于基金资产净值的 90%;本基金持有到期日在一年以内的政府债券或者现金比例不低于基金资产净值的 5%。于资产负债表日,本基金面临的整体市场价格风险列示如表中数据。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

|           |   |                   |               |
|-----------|---|-------------------|---------------|
| 假设        | 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; |                   |               |
|           | 以下分析,除市场基准发生变动,其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。   |                   |               |
| 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)   |                   |               |
|           | 本期末(2022年6月30日)   | 上年度末(2021年12月31日) |               |
| 分析        | 1. 股票基准指数下  | -5,708,274.54     | -4,971,491.18 |

|  |                         |              |              |
|--|-------------------------|--------------|--------------|
|  | 降 100 个基点               |              |              |
|  | 2. 股票基准指数上<br>升 100 个基点 | 5,708,274.54 | 4,971,491.18 |

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

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 560,633,492.69         | 458,246,343.60           |
| 第二层次          | 278,595.12             | 10,165,360.86            |
| 第三层次          | 3,190,271.57           | -                        |
| 合计            | 564,102,359.38         | 468,411,704.46           |

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本期末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 564,102,359.38 | 90.86         |
|    | 其中：股票             | 564,102,359.38 | 90.86         |
| 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      | 45,099,052.53  | 7.26          |
| 8  | 其他各项资产            | 11,668,823.33  | 1.88          |
| 9  | 合计                | 620,870,235.24 | 100.00        |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 48,728,161.77 元，占净值比例 8.05%

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|----------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -              | -             |
| B  | 采矿业              | 39,784,937.60  | 6.57          |
| C  | 制造业              | 365,251,875.58 | 60.35         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 10,788,182.00  | 1.78          |

|   |                 |                |       |
|---|-----------------|----------------|-------|
| E | 建筑业             | 48,698,250.00  | 8.05  |
| F | 批发和零售业          | 7,873,685.16   | 1.30  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | 23,909,515.00  | 3.95  |
| H | 住宿和餐饮业          | -              | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 12,139,029.82  | 2.01  |
| J | 金融业             | -              | -     |
| K | 房地产业            | 6,852,225.00   | 1.13  |
| L | 租赁和商务服务业        | -              | -     |
| M | 科学研究和技术服务业      | 42,117.64      | 0.01  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 18,754.05      | 0.00  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   | -              | -     |
| P | 教育              | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作         | 15,625.76      | 0.00  |
| R | 文化、体育和娱乐业       | -              | -     |
| S | 综合              | -              | -     |
|   | 合计              | 515,374,197.61 | 85.15 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别     | 公允价值（人民币）     | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|---------------|--------------|
| 原材料      | -             | -            |
| 非日常生活消费品 | 33,973,773.95 | 5.61         |
| 日常消费品    | -             | -            |
| 能源       | -             | -            |
| 金融       | -             | -            |
| 医疗保健     | -             | -            |
| 工业       | -             | -            |
| 信息技术     | -             | -            |
| 通信服务     | 14,754,387.82 | 2.44         |
| 公共事业     | -             | -            |
| 房地产      | -             | -            |
| 合计       | 48,728,161.77 | 8.05         |

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）     | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 002466 | 天齐锂业 | 421,729   | 52,631,779.20 | 8.70         |
| 2  | 002192 | 融捷股份 | 258,848   | 39,784,937.60 | 6.57         |
| 3  | 002068 | 黑猫股份 | 2,309,700 | 32,220,315.00 | 5.32         |
| 4  | 600559 | 老白干酒 | 880,100   | 25,250,069.00 | 4.17         |
| 5  | 300487 | 蓝晓科技 | 410,350   | 25,031,350.00 | 4.14         |
| 6  | 03690  | 美团-W | 145,900   | 24,230,765.32 | 4.00         |
| 7  | 000729 | 燕京啤酒 | 2,488,300 | 24,036,978.00 | 3.97         |

|    |        |        |           |               |      |
|----|--------|--------|-----------|---------------|------|
| 8  | 601390 | 中国中铁   | 3,096,300 | 19,011,282.00 | 3.14 |
| 9  | 603606 | 东方电缆   | 213,400   | 16,346,440.00 | 2.70 |
| 10 | 000498 | 山东路桥   | 1,563,600 | 15,104,376.00 | 2.50 |
| 11 | 01024  | 快手-W   | 197,400   | 14,754,387.82 | 2.44 |
| 12 | 601800 | 中国交建   | 1,571,400 | 14,582,592.00 | 2.41 |
| 13 | 601686 | 友发集团   | 1,783,398 | 13,625,160.72 | 2.25 |
| 14 | 688082 | 盛美上海   | 142,441   | 13,499,133.57 | 2.23 |
| 15 | 600026 | 中远海能   | 1,298,800 | 13,416,604.00 | 2.22 |
| 16 | 002756 | 永兴材料   | 84,100    | 12,800,861.00 | 2.12 |
| 17 | 300775 | 三角防务   | 222,200   | 10,698,930.00 | 1.77 |
| 18 | 601975 | 招商南油   | 2,603,700 | 10,492,911.00 | 1.73 |
| 19 | 002865 | 钧达股份   | 109,800   | 10,470,528.00 | 1.73 |
| 20 | 688776 | 国光电气   | 56,461    | 9,597,805.39  | 1.59 |
| 21 | 688536 | 思瑞浦    | 16,888    | 9,484,131.92  | 1.57 |
| 22 | 002049 | 紫光国微   | 46,000    | 8,727,120.00  | 1.44 |
| 23 | 002594 | 比亚迪    | 25,500    | 8,503,995.00  | 1.41 |
| 24 | 688636 | 智明达    | 71,385    | 8,094,345.15  | 1.34 |
| 25 | 301263 | 泰恩康    | 226,582   | 7,873,685.16  | 1.30 |
| 26 | 01797  | 新东方在线  | 463,500   | 7,467,809.84  | 1.23 |
| 27 | 000683 | 远兴能源   | 688,700   | 7,238,237.00  | 1.20 |
| 28 | 000537 | 广宇发展   | 527,500   | 6,852,225.00  | 1.13 |
| 29 | 300745 | 欣锐科技   | 135,700   | 6,768,716.00  | 1.12 |
| 30 | 688072 | 拓荆科技   | 43,121    | 6,688,067.10  | 1.11 |
| 31 | 002304 | 洋河股份   | 35,700    | 6,538,455.00  | 1.08 |
| 32 | 603612 | 索通发展   | 174,700   | 6,437,695.00  | 1.06 |
| 33 | 688167 | 炬光科技   | 42,360    | 6,301,050.00  | 1.04 |
| 34 | 601985 | 中国核电   | 863,300   | 5,922,238.00  | 0.98 |
| 35 | 601012 | 隆基绿能   | 80,300    | 5,350,389.00  | 0.88 |
| 36 | 600372 | 中航电子   | 255,500   | 4,954,145.00  | 0.82 |
| 37 | 002056 | 横店东磁   | 183,000   | 4,871,460.00  | 0.80 |
| 38 | 600905 | 三峡能源   | 773,600   | 4,865,944.00  | 0.80 |
| 39 | 300850 | 新强联    | 44,540    | 3,965,396.20  | 0.66 |
| 40 | 300507 | 苏奥传感   | 460,160   | 3,584,646.40  | 0.59 |
| 41 | 002459 | 晶澳科技   | 40,960    | 3,231,744.00  | 0.53 |
| 42 | 603985 | 恒润股份   | 113,532   | 3,194,790.48  | 0.53 |
| 43 | 688599 | 天合光能   | 46,792    | 3,053,178.00  | 0.50 |
| 44 | 603218 | 日月股份   | 119,600   | 3,037,840.00  | 0.50 |
| 45 | 603806 | 福斯特    | 45,860    | 3,004,747.20  | 0.50 |
| 46 | 002709 | 天赐材料   | 45,500    | 2,823,730.00  | 0.47 |
| 47 | 600941 | 中国移动   | 43,681    | 2,632,217.06  | 0.43 |
| 48 | 688281 | 华秦科技   | 9,810     | 2,580,030.00  | 0.43 |
| 49 | 02015  | 理想汽车-W | 17,400    | 2,275,198.79  | 0.38 |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 50 | 300198 | 纳川股份 | 574,100 | 2,267,695.00 | 0.37 |
| 51 | 600519 | 贵州茅台 | 1,100   | 2,249,500.00 | 0.37 |
| 52 | 688385 | 复旦微电 | 29,411  | 1,917,303.09 | 0.32 |
| 53 | 002176 | 江特电机 | 48,800  | 1,221,952.00 | 0.20 |
| 54 | 605376 | 博迁新材 | 16,500  | 961,950.00   | 0.16 |
| 55 | 688639 | 华恒生物 | 5,086   | 669,724.48   | 0.11 |
| 56 | 688400 | 凌云光  | 9,720   | 213,159.60   | 0.04 |
| 57 | 688270 | 臻镭科技 | 2,892   | 173,144.04   | 0.03 |
| 58 | 688283 | 坤恒顺维 | 1,595   | 72,428.95    | 0.01 |
| 59 | 301233 | 盛帮股份 | 1,576   | 65,435.52    | 0.01 |
| 60 | 301238 | 瑞泰新材 | 1,238   | 39,702.66    | 0.01 |
| 61 | 601089 | 福元医药 | 1,749   | 36,816.45    | 0.01 |
| 62 | 301215 | 中汽股份 | 4,110   | 26,262.90    | 0.00 |
| 63 | 301266 | 宇邦新材 | 517     | 24,335.19    | 0.00 |
| 64 | 301302 | 华如科技 | 402     | 22,680.84    | 0.00 |
| 65 | 301268 | 铭利达  | 641     | 22,351.67    | 0.00 |
| 66 | 301122 | 采纳股份 | 301     | 21,181.37    | 0.00 |
| 67 | 301127 | 天源环保 | 1,685   | 18,754.05    | 0.00 |
| 68 | 301256 | 华融化学 | 1,831   | 18,456.48    | 0.00 |
| 69 | 301112 | 信邦智能 | 399     | 17,970.96    | 0.00 |
| 70 | 301235 | 华康医疗 | 418     | 15,854.74    | 0.00 |
| 71 | 301103 | 何氏眼科 | 488     | 15,625.76    | 0.00 |
| 72 | 301298 | 东利机械 | 634     | 13,206.22    | 0.00 |
| 73 | 301190 | 善水科技 | 500     | 11,865.00    | 0.00 |
| 74 | 001268 | 联合精密 | 409     | 11,337.48    | 0.00 |
| 75 | 301137 | 哈焊华通 | 644     | 10,297.56    | 0.00 |
| 76 | 301219 | 腾远钴业 | 115     | 10,099.30    | 0.00 |
| 77 | 301125 | 腾亚精工 | 327     | 8,966.34     | 0.00 |
| 78 | 301123 | 奕东电子 | 353     | 8,962.67     | 0.00 |
| 79 | 301130 | 西点药业 | 237     | 8,934.90     | 0.00 |
| 80 | 301182 | 凯旺科技 | 294     | 6,985.44     | 0.00 |
| 81 | 301196 | 唯科科技 | 165     | 6,190.80     | 0.00 |
| 82 | 871245 | 威博液压 | 200     | 2,796.00     | 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  | 300487 | 蓝晓科技 | 24,404,523.70 | 4.95           |
| 2  | 03690  | 美团-W | 22,209,729.15 | 4.51           |
| 3  | 600559 | 老白干酒 | 21,337,855.92 | 4.33           |
| 4  | 601800 | 中国交建 | 20,613,957.62 | 4.18           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 5  | 002068 | 黑猫股份 | 20,478,565.00 | 4.16 |
| 6  | 601390 | 中国中铁 | 20,135,433.00 | 4.09 |
| 7  | 00570  | 中国中药 | 20,018,749.48 | 4.06 |
| 8  | 603985 | 恒润股份 | 19,575,489.23 | 3.97 |
| 9  | 000729 | 燕京啤酒 | 19,375,640.00 | 3.93 |
| 10 | 603218 | 日月股份 | 17,269,963.25 | 3.51 |
| 11 | 01024  | 快手-W | 15,063,323.84 | 3.06 |
| 12 | 000498 | 山东路桥 | 14,998,362.00 | 3.04 |
| 13 | 601686 | 友发集团 | 14,259,223.14 | 2.89 |
| 14 | 000778 | 新兴铸管 | 13,780,205.83 | 2.80 |
| 15 | 688082 | 盛美上海 | 12,962,881.78 | 2.63 |
| 16 | 000756 | 新华制药 | 12,705,714.30 | 2.58 |
| 17 | 002466 | 天齐锂业 | 12,521,083.87 | 2.54 |
| 18 | 002873 | 新天药业 | 12,518,862.74 | 2.54 |
| 19 | 601168 | 西部矿业 | 12,338,356.00 | 2.50 |
| 20 | 603566 | 普莱柯  | 11,718,434.84 | 2.38 |
| 21 | 002865 | 钧达股份 | 10,653,929.35 | 2.16 |
| 22 | 688536 | 思瑞浦  | 10,551,635.68 | 2.14 |
| 23 | 000915 | 华特达因 | 10,522,165.00 | 2.14 |
| 24 | 600976 | 健民集团 | 10,424,794.00 | 2.12 |
| 25 | 600372 | 中航电子 | 10,297,200.68 | 2.09 |
| 26 | 600038 | 中直股份 | 10,216,831.00 | 2.07 |
| 27 | 000333 | 美的集团 | 10,147,350.00 | 2.06 |

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  | 600499 | 科达制造 | 19,768,132.96 | 4.01           |
| 2  | 00570  | 中国中药 | 18,221,656.53 | 3.70           |
| 3  | 603985 | 恒润股份 | 16,761,670.72 | 3.40           |
| 4  | 000792 | 盐湖股份 | 16,396,100.00 | 3.33           |
| 5  | 002324 | 普利特  | 15,869,529.00 | 3.22           |
| 6  | 002756 | 永兴材料 | 15,420,460.00 | 3.13           |
| 7  | 000778 | 新兴铸管 | 14,798,567.00 | 3.00           |
| 8  | 603218 | 日月股份 | 14,444,706.00 | 2.93           |
| 9  | 000877 | 天山股份 | 14,392,215.00 | 2.92           |
| 10 | 300390 | 天华超净 | 14,311,030.00 | 2.90           |
| 11 | 000915 | 华特达因 | 14,004,068.95 | 2.84           |
| 12 | 600399 | 抚顺特钢 | 13,549,362.00 | 2.75           |
| 13 | 000858 | 五粮液  | 13,202,652.00 | 2.68           |
| 14 | 000672 | 上峰水泥 | 12,415,600.00 | 2.52           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 15 | 603178 | 圣龙股份 | 12,396,880.16 | 2.52 |
| 16 | 600038 | 中直股份 | 12,079,632.08 | 2.45 |
| 17 | 600801 | 华新水泥 | 11,177,925.69 | 2.27 |
| 18 | 000657 | 中钨高新 | 10,763,571.00 | 2.18 |
| 19 | 000756 | 新华制药 | 10,224,024.00 | 2.08 |
| 20 | 000333 | 美的集团 | 10,014,526.00 | 2.03 |

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 741,063,940.51 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 609,922,744.00 |

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金可基于谨慎原则,以套期保值为主要目的,运用国债期货对基本投资组合进行管理,提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的国债期货合,通过多头或空头套期保值等



策略进行套期保值操作。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

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

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

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额            |
|----|-------|---------------|
| 1  | 存出保证金 | 193,126.67    |
| 2  | 应收清算款 | 10,221,238.56 |
| 3  | 应收股利  | -             |
| 4  | 应收利息  | -             |
| 5  | 应收申购款 | 1,254,458.10  |
| 6  | 其他应收款 | -             |
| 7  | 待摊费用  | -             |
| 8  | 其他    | -             |
| 9  | 合计    | 11,668,823.33 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 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 | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 |       |
|------|-------|-----------|-------|-------|
|      |       |           | 机构投资者 | 个人投资者 |
|      |       |           |       |       |

|                   | (户)    |          | 持有份额          | 占总份<br>额比例<br>(%) | 持有份额           | 占总<br>份额<br>比例<br>(%) |
|-------------------|--------|----------|---------------|-------------------|----------------|-----------------------|
| 万家智造<br>优势混合<br>A | 20,873 | 7,967.11 | 40,207,147.80 | 24.18             | 126,090,317.86 | 75.82                 |
| 万家智造<br>优势混合<br>C | 5,721  | 7,061.30 | 19,420,575.18 | 48.07             | 20,977,123.84  | 51.93                 |
| 合计                | 26,266 | 7,869.30 | 59,627,722.98 | 28.85             | 147,067,441.70 | 71.15                 |

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

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目                               | 份额级别       | 持有份额总数（份）  | 占基金总份额比例（%） |
|----------------------------------|------------|------------|-------------|
| 基金管<br>理人所有从业<br>人员持<br>有本基<br>金 | 万家智造优势混合 A | 453,018.86 | 0.2724      |
|                                  | 万家智造优势混合 C | 425,125.03 | 1.0523      |
|                                  | 合计         | 878,143.89 | 0.4248      |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目   | 份额级别       | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--|------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、<br>基金投资和研<br>究部门<br>负责人持有本<br>开放式<br>基金 | 万家智造优势混合 A | 10~50             |
|  | 万家智造优势混合 C | 0                 |
|  | 合计         | 10~50             |
| 本基金基金经理持有<br>本开放式基金                                | 万家智造优势混合 A | 0                 |
|  | 万家智造优势混合 C | 10~50             |
|  | 合计         | 10~50             |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                      | 万家智造优势混合 A     | 万家智造优势混合 C    |
|-------------------------|----------------|---------------|
| 基金合同生效日<br>(2018年8月28日) | 153,247,809.82 | 74,386,748.73 |

|               |                |               |
|---------------|----------------|---------------|
| 基金份额总额        |                |               |
| 本报告期期初基金份额总额  | 133,720,706.05 | 19,807,593.05 |
| 本报告期基金总申购份额   | 71,840,877.59  | 32,007,308.94 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 39,264,117.98  | 11,417,202.97 |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -              | -             |
| 本报告期期末基金份额总额  | 166,297,465.66 | 40,397,699.02 |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

本基金管理人本报告期内未发生重大人事变动。

基金托管人：

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

### 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

报告期内本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

报告期期为基金进行审计的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 交易单元数量 | 股票交易           |                  | 应支付该券商的佣金  |                | 备注 |
|--------|--------|----------------|------------------|------------|----------------|----|
|        |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| 海通证券   | 1      | 600,211,974.25 | 44.62            | 558,982.38 | 46.20          | -  |
| 方正证券   | 1      | 303,846,834.59 | 22.59            | 282,974.30 | 23.39          | -  |
| 民生证券   | 1      | 249,176,409.67 | 18.52            | 182,224.11 | 15.06          | -  |
| 中泰证券   | 2      | 192,063,715.85 | 14.28            | 185,617.84 | 15.34          | -  |
| 安信证券   | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 长城证券   | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 国盛证券   | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 恒泰证券   | 2      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 华安证券   | 2      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 华福证券   | 2      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 江海证券   | 2      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 申万宏源证券 | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 天风证券   | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 银河证券   | 2      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 中信建投   | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 中银国际证券 | 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、基金专用交易席位的变更情况：

因退租协议减少方正证券 1 个席位、安信证券 1 个席位、广发证券 1 个席位、新时代证券 1 个席位、华泰证券 2 个席位；

新增长城证券 1 个席位、恒泰证券 1 个席位、江海证券 2 个席位、中银国际证券 1 个席位。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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 (%) |
| 海通证券   | -            | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 方正证券   | -            | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 民生证券   | -            | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 中泰证券   | 5,002,551.20 | 100.00           | -      | -                  | -    | -                |
| 安信证券   | -            | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 长城证券   | -            | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 国盛证券   | -            | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 恒泰证券   | -            | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 华安证券   | -            | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 华福证券   | -            | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 江海证券   | -            | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 申万宏源证券 | -            | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 天风证券   | -            | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 银河证券   | -            | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 中信建投   | -            | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 中银国际证券 | -            | -                | -      | -                  | -    | -                |

### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项   | 法定披露方式 | 法定披露日期     |
|----|--|--------|------------|
| 1  | 关于新增宁波银行股份有限公司为万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金和万家智造优势混合型证券投资基金的销售机构的公告 | 指定媒介   | 2022-01-11 |
| 2  | 万家智造优势混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告                             | 指定媒介   | 2022-01-21 |
| 3  | 万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在泰信财富开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告             | 指定媒介   | 2022-03-07 |
| 4  | 万家基金管理有限公司关于旗下部分   | 指定媒介   | 2022-03-22 |

|    |  |      |            |
|----|--|------|------------|
|    | 基金调整最低申购金额的公告  |      |            |
| 5  | 万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宜信普泽为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告 | 指定媒介 | 2022-03-24 |
| 6  | 万家智造优势混合型证券投资基金 2021 年年度报告                             | 指定媒介 | 2022-03-30 |
| 7  | 万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增攀赢基金为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告 | 指定媒介 | 2022-04-12 |
| 8  | 万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增杭州联合农村商业银行股份有限公司为销售机构并开通相关业务的公告    | 指定媒介 | 2022-04-18 |
| 9  | 万家智造优势混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告                         | 指定媒介 | 2022-04-21 |
| 10 | 万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增日照银行股份有限公司为销售机构并开通相关业务的公告          | 指定媒介 | 2022-05-13 |
| 11 | 万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中欧财富为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告 | 指定媒介 | 2022-05-26 |
| 12 | 万家基金管理有限公司关于旗下基金在九州证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告           | 指定媒介 | 2022-06-21 |

## § 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

本基金本报告期内未发生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智造优势混合型证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《万家智造优势混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《万家智造优势混合型证券投资基金托管协议》
- 4、万家基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 5、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

6、万家智造优势混合型证券投资基金 2022 年中期报告原文

7、万家基金管理有限公司董事会决议

## 12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人网站：[www.wjasset.com](http://www.wjasset.com)

## 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅

万家基金管理有限公司

2022 年 8 月 30 日