

万家价值优势一年持有期混合型证券投资  
基金  
2023 年中期报告

2023 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2023 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                              | 6         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>7</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 7         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11        |
| 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             | 11        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 12        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 13        |
| 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       | 13        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 13        |
| 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 | 13        |
| 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       | 13        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 13        |
| 6.2 利润表                                 | 15        |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表                        | 16        |
| 6.4 报表附注                                | 18        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>37</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 37        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 37        |
| 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       | 38        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 39        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 41        |
| 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      | 41        |

|             |                                   |           |
|-------------|-----------------------------------|-----------|
| 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 | 41        |
| 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 | 41        |
| 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    | 41        |
| 7.10        | 本基金投资股指期货的投资政策                    | 41        |
| 7.11        | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明              | 41        |
| 7.12        | 投资组合报告附注                          | 42        |
| <b>§ 8</b>  | <b>基金份额持有人信息</b>                  | <b>42</b> |
| 8.1         | 期末基金份额持有人户数及持有人结构                 | 42        |
| 8.2         | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况              | 43        |
| 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      | 43        |
| <b>§ 9</b>  | <b>开放式基金份额变动</b>                  | <b>43</b> |
| <b>§ 10</b> | <b>重大事件揭示</b>                     | <b>43</b> |
| 10.1        | 基金份额持有人大会决议                       | 43        |
| 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       | 43        |
| 10.3        | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼            | 43        |
| 10.4        | 基金投资策略的改变                         | 43        |
| 10.5        | 为基金进行审计的会计师事务所情况                  | 43        |
| 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          | 43        |
| 10.7        | 基金租用证券公司交易单元的有关情况                 | 44        |
| 10.8        | 其他重大事件                            | 45        |
| <b>§ 11</b> | <b>影响投资者决策的其他重要信息</b>             | <b>45</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     | 45        |
| <b>§ 12</b> | <b>备查文件目录</b>                     | <b>46</b> |
| 12.1        | 备查文件目录                            | 46        |
| 12.2        | 存放地点                              | 46        |
| 12.3        | 查阅方式                              | 46        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                      |
|------------|----------------------|
| 基金名称       | 万家价值优势一年持有期混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 万家价值优势一年持有期混合        |
| 基金主代码      | 009199               |
| 基金运作方式     | 契约型开放式               |
| 基金合同生效日    | 2020 年 5 月 29 日      |
| 基金管理人      | 万家基金管理有限公司           |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司         |
| 报告期末基金份额总额 | 860,016,732.07 份     |
| 基金合同存续期    | 不定期                  |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的管理，对具有价值优势的股票进行选择和投资，力争获得超越业绩比较基准的收益。   |
| 投资策略   | 1、大类资产配置策略；2、股票投资策略；（1）行业配置策略；（2）个股投资策略；（3）存托凭证策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、可转换债券投资策略；6、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 8、其他。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%+上证国债指数收益率×20%  |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金可投资于港股，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                           | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 兰剑                                   | 郭明                  |
|             | 联系电话 | 021-38909626                         | 010-66105799        |
|             | 电子邮箱 | lanj@wjasset.com                     | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 4008880800                           | 95588               |
| 传真          |      | 021-38909627                         | 010-66105798        |
| 注册地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层） | 北京市西城区复兴门内大街 55 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 55 号   |
| 邮政编码        |      | 200122                               | 100140              |
| 法定代表人       |      | 方一天                                  | 陈四清                 |

## 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《中国证券报》                                       |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.wjasset.com                        |
| 基金中期报告备置地点          | 中国（上海）自由贸易试验区浦电路 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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益       | -54,823,418.86                      |
| 本期利润          | 196,860,478.55                      |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.2040                              |
| 本期加权平均净值利润率   | 13.63%                              |
| 本期基金份额净值增长率   | 13.92%                              |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023 年 6 月 30 日)               |
| 期末可供分配利润      | 475,828,187.70                      |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.5533                              |
| 期末基金资产净值      | 1,352,329,511.74                    |
| 期末基金份额净值      | 1.5724                              |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2023 年 6 月 30 日)               |
| 基金份额累计净值增长率   | 57.24%                              |

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

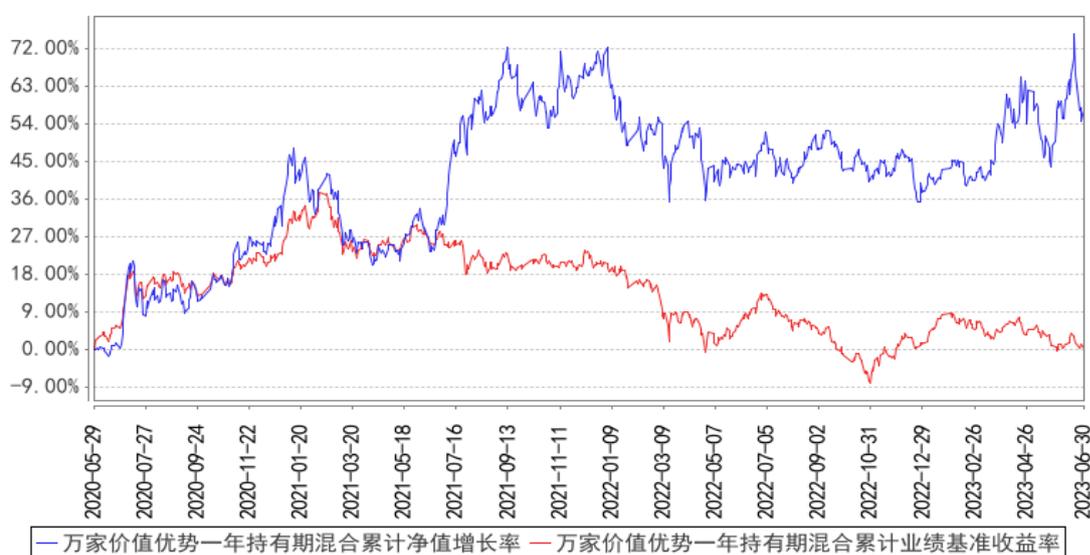
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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      | 0.16%  | 2.47% | 1.29%   | 0.73% | -1.13% | 1.74% |
| 过去三个月      | 2.48%  | 2.37% | -4.04%  | 0.67% | 6.52%  | 1.70% |
| 过去六个月      | 13.92% | 1.80% | -0.43%  | 0.69% | 14.35% | 1.11% |
| 过去一年       | 5.09%  | 1.46% | -10.59% | 0.82% | 15.68% | 0.64% |
| 过去三年       | 55.10% | 1.54% | -4.70%  | 0.95% | 59.80% | 0.59% |
| 自基金合同生效起至今 | 57.24% | 1.52% | 1.10%   | 0.94% | 56.14% | 0.58% |

### 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

万家价值优势一年持有期混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2020 年 5 月 29 日成立，根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

## § 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。截至报告期末，公司的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，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。截至报告期末，公司共管理一百三十一只开放式基金，分别为万家 180 指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选混合型证券投资基金(LOF)、

万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金（LOF）、万家添利债券型证券投资基金（LOF）、万家新机遇价值驱动灵活配置混合型证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家上证 50 交易型开放式指数证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞和灵活配置混合型证券投资基金、万家颐达灵活配置混合型证券投资基金、万家颐和灵活配置混合型证券投资基金、万家恒瑞 18 个月定期开放债券型证券投资基金、万家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、万家匠心致远一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫融纯债债券型证券投资基金、万家颐远均衡一年持有期混合型发起式证券投资基金、万家鑫耀纯债债券型证券投资基金、万家欣远混合型证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家惠利债券型证券投资基金、万家鑫怡债券型证券投资基金、万家优享平衡混合型发起式证券投资基金、万家洞见进取混合型发起式证券投资基金、万家沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、万家中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金、万家沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家元贞量化选股股票型证券投资基金、万家 CFETS0-3 年期政策性金融债指数证券投资基金、万家中证软件服务指数型发起式证券投资基金、万家先进制造混合型发起式证券投资基金、万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金、万家颐德一年持有期混合型证券投资基金、万家北证 50 成份指数型发起式证券投资基金、万家恒生互联网科技业指数型发起式证券投资基金（QDII）、万家中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家欣优混合型证券投资基金、万家集利债券型发起式证券投资基金。

#### 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 |        |  |
| 莫海波 | 公司领导副总经理；万家价值优势一年持有期混合型证券投资基金、万家和谐增长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、万家新兴蓝筹灵活配置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）、万家臻选混合型证券投资基金的基金经理 | 2020年5月29日      | -    | 13.5年  | 国籍：中国；学历：美国圣约翰大学工商管理硕士，2015年3月入职万家基金管理有限公司，现任公司副总经理、基金经理，历任投资研究部总监、总经理助理。曾任财富证券有限责任公司资产管理部研究员，中银国际证券有限责任公司证券投资部研究员、投资经理等职。 |

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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

## 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 16 次，均为量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

## 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

2023 年上半年震荡为主，上证指数收涨 3.65%，深证指数 0.1%，基本持平；上半年以 TMT 为代表的成长股表现活跃，相对更强；通信板块涨幅 50.6%居首，传媒板块涨幅 42.7%位居第二，计算机板块涨幅 27.5%位居第三。机械设备、家用电器、电子、建筑装饰、石油石化、国防军工等板块涨幅超 5%，商贸零售-23.4%跌幅居首。

本产品上半年进行了调仓换股，2022 年年底主要持仓为农林牧渔、房地产、国防军工，上半

年组合进行了调仓，提高 TMT 行业占比，减持了地产和军工行业，上半年整体仓位比例维持在 90% 左右。未来重点继续持有 AI 和农业种子板块。对于一些前期涨幅过高、估值明显有泡沫的 AI 部分标的，也会适当止盈。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家价值优势一年持有期混合的基金份额净值为 1.5724 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.92%，同期业绩比较基准收益率为-0.43%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着 6 月美国通胀数据下行，美联储下半年结束加息概率较大，全球工业品库存去化进入后期，下半年库存周期有望迎来拐点，7 月中央政治局会议公告中对资本市场、房地产、地方债务都有超预期的表述，预计相关配套支持措施会陆续出台；总体看，下半年国内外宏观形势向好，企业盈利有望触底回升，A 股有望呈现震荡向上格局。下半年继续看好 AI 带来的数字经济产业革命，同时看好厄尔尼诺和全球高温下，农产品价格持续上涨带来的农业种子板块机会。中长期角度，依然看好 AI+数字经济的产业趋势大方向，国内数字经济相关政策依然会持续发力，赛道空间大，持续时间长；短期看海外 AI 呈现高景气，订单持续兑现有望带动 A 股 AI 相关板块情绪，不断催化，但 AI 板块内部未来大概率走向分化，预计真正有技术和资金优势的龙头企业最终会走出来，组合也会适当做一些调仓。另外今年在厄尔尼诺条件下，全球高温天气和扩散超预期，或显著影响农产品生产，今年以来农产品价格大幅上涨，未来农产品供给或继续呈现偏紧状态，国内外粮食安全有望充分引起各国重视，有望带动种子板块景气度回升。

#### 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

本基金本报告期内未实施利润分配，符合基金合同的规定。

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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——万家基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人依法对万家基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：万家价值优势一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产   | 附注号     | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产：  |         |                        |                          |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 84,832,222.40          | 70,075,780.28            |

|               |            |                           |                             |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 结算备付金         |            | 210,333.31                | 908,129.79                  |
| 存出保证金         |            | 281,442.64                | 67,119.24                   |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 1,271,535,064.64          | 1,151,162,346.11            |
| 其中：股票投资       |            | 1,271,535,064.64          | 1,151,162,346.11            |
| 基金投资          |            | -                         | -                           |
| 债券投资          |            | -                         | -                           |
| 资产支持证券投资      |            | -                         | -                           |
| 贵金属投资         |            | -                         | -                           |
| 其他投资          |            | -                         | -                           |
| 衍生金融资产        | 6.4.7.3    | -                         | -                           |
| 买入返售金融资产      | 6.4.7.4    | -                         | -                           |
| 债权投资          |            | -                         | -                           |
| 其中：债券投资       |            | -                         | -                           |
| 资产支持证券投资      |            | -                         | -                           |
| 其他投资          |            | -                         | -                           |
| 其他债权投资        |            | -                         | -                           |
| 其他权益工具投资      |            | -                         | -                           |
| 应收清算款         |            | 3,993,982.74              | 2,575,922.71                |
| 应收股利          |            | -                         | -                           |
| 应收申购款         |            | 238,998.25                | 83,082.58                   |
| 递延所得税资产       |            | -                         | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                         | -                           |
| 资产总计          |            | 1,361,092,043.98          | 1,224,872,380.71            |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2023年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2022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         |            | 5,366,130.79              | -                           |
| 应付赎回款         |            | 850,841.62                | 1,596,622.08                |
| 应付管理人报酬       |            | 1,767,069.17              | 1,619,553.21                |
| 应付托管费         |            | 294,511.55                | 269,925.52                  |
| 应付销售服务费       |            | -                         | -                           |
| 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    | 483,979.11                | 455,837.58                  |
| 负债合计          |            | 8,762,532.24              | 3,941,938.39                |
| <b>净资产：</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金          | 6.4.7.7    | 860,016,732.07            | 884,546,067.94              |
| 其他综合收益        | 6.4.7.8    | -                         | -                           |

|          |         |                  |                  |
|----------|---------|------------------|------------------|
| 未分配利润    | 6.4.7.9 | 492,312,779.67   | 336,384,374.38   |
| 净资产合计    |         | 1,352,329,511.74 | 1,220,930,442.32 |
| 负债和净资产总计 |         | 1,361,092,043.98 | 1,224,872,380.71 |

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5724 元，基金份额总额 860,016,732.07 份。

## 6.2 利润表

会计主体：万家价值优势一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号      | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022<br>年 6 月 30 日 |
|------------------------|----------|--|---|
| <b>一、营业总收入</b>         |          | 209,518,036.18                           | -188,439,327.47                               |
| 1. 利息收入                |          | 229,154.49                               | 280,197.88                                    |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.10 | 229,154.49                               | 280,197.88                                    |
| 债券利息收入                 |          | -  | -   |
| 资产支持证券利息收入             |          | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入             |          | -  | -   |
| 证券出借利息收入               |          | -  | -   |
| 其他利息收入                 |          | -  | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |          | -42,395,015.72                           | -32,009,612.70                                |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.11 | -45,716,571.97                           | -34,313,432.88                                |
| 基金投资收益                 |          | -  | -   |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.12 | -  | -   |
| 资产支持证券投资               | 6.4.7.13 | -  | -   |
| 收益                     |          |  |   |
| 贵金属投资收益                | 6.4.7.14 | -  | -   |
| 衍生工具收益                 | 6.4.7.15 | -  | -   |
| 股利收益                   | 6.4.7.16 | 3,321,556.25                             | 2,303,820.18                                  |
| 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 | 251,683,897.41                           | -156,709,912.65                               |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |          | -  | -   |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.18 | -  | -   |

|                            |            |                |                 |
|----------------------------|------------|----------------|-----------------|
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 12,657,557.63  | 12,523,916.46   |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 10,762,767.46  | 10,641,815.16   |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 1,793,794.59   | 1,773,635.87    |
| 3. 销售服务费                   |            | -              | -               |
| 4. 投资顾问费                   |            | -              | -               |
| 5. 利息支出                    |            | -              | -               |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -              | -               |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.19   | -              | -               |
| 7. 税金及附加                   |            | -              | -               |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 100,995.58     | 108,465.43      |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 196,860,478.55 | -200,963,243.93 |
| 减：所得税费用                    |            | -              | -               |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 196,860,478.55 | -200,963,243.93 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -              | -               |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | 196,860,478.55 | -200,963,243.93 |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：万家价值优势一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                   | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 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）      | 884,546,067.94                        | -      | 336,384,374.38 | 1,220,930,442.32 |
| 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）      | 884,546,067.94                        | -      | 336,384,374.38 | 1,220,930,442.32 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -24,529,335.87                        | -      | 155,928,405.29 | 131,399,069.42   |
| （一）、综合收益总额           | -                                     | -      | 196,860,478.55 | 196,860,478.55   |

|  |                                 |        |                 |                  |
|--|---------------------------------|--------|-----------------|------------------|
| (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)      | -24,529,335.87                  | -      | -40,932,073.26  | -65,461,409.13   |
| 其中: 1. 基金申购款                             | 204,944,294.82                  | -      | 89,216,201.13   | 294,160,495.95   |
| 2. 基金赎回款                                 | -229,473,630.69                 | -      | -130,148,274.39 | -359,621,905.08  |
| (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)                          | 860,016,732.07                  | -      | 492,312,779.67  | 1,352,329,511.74 |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>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)                          | 948,606,444.74                  | -      | 667,111,376.54  | 1,615,717,821.28 |
| 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)                          | 948,606,444.74                  | -      | 667,111,376.54  | 1,615,717,821.28 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 35,243,760.94                   | -      | -178,819,474.01 | -143,575,713.07  |
| (一)、综合收益总额                               | -                               | -      | -200,963,243.93 | -200,963,243.93  |
| (二)、本期基金份额交易产生的                          | 35,243,760.94                   | -      | 22,143,769.92   | 57,387,530.86    |

|  |                     |   |                |                      |
|--|---------------------|---|----------------|----------------------|
| 基金净值变动数<br>(净值减少以<br>“-”号填列)                                 |                     |   |                |                      |
| 其中：1. 基金申<br>购款  | 190,337,871.31      | - | 97,119,003.54  | 287,456,874.85       |
| 2. 基金赎<br>回款   | -155,094,110.3<br>7 | - | -74,975,233.62 | -230,069,343.99      |
| (三)、本期向基<br>金份额持有人分<br>配利润产生的基<br>金净值变动(净<br>值减少以“-”号<br>填列) | -                   | - | -              | -                    |
| (四)、其他综合<br>收益结转留存收<br>益                                     | -                   | - | -              | -                    |
| 四、本期期末净<br>资产(基金净值)  | 983,850,205.68      | - | 488,291,902.53 | 1,472,142,108.2<br>1 |

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

万家价值优势一年持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]384号文《关于准予万家价值优势一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》的批准，由万家基金管理有限公司作为基金管理人于2020年5月13日至2020年5月26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）验证并出具信会师报字[2020]第ZA30844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2020年5月29日正式生效，本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为3,374,504,587.39元，有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币1,448,019.41元，以上实收基金（本息）合计为人民币3,375,952,606.80元，折合3,375,952,606.80份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为万家基金管理有限公

司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市的股票（包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、可交换债券、可转换债券（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、股指期货、国债期货、股票期权等金融工具以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。在条件许可的情况下，本基金可根据相关法律法规，在履行适当程序后，参与融券业务和转融通证券出借业务。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×70%+恒生指数收益率×10%+上证国债指数收益率×20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 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会计政策、会计估计与上年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

##### 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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

### （三）企业所得税

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

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

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

### （四）个人所得税

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

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

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

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

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 84,832,222.40          |
| 等于：本金          | 84,823,195.21          |
| 加：应计利息         | 9,027.19               |
| 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             | 84,832,222.40          |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2023年6月30日 |      |                  |                |
|---------------|-------|-------------------|------|------------------|----------------|
|               |       | 成本                | 应计利息 | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票            |       | 1,125,106,425.74  | -    | 1,271,535,064.64 | 146,428,638.90 |
| 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            |       | 1,125,106,425.74  | -    | 1,271,535,064.64 | 146,428,638.90 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有各项买入返售金融资产。

#### 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>2023年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | -                 |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 应付交易费用      | 402,156.25        |
| 其中：交易所市场    | 402,156.25        |
| 银行间市场       | -                 |
| 应付利息        | -                 |
| 预提费用        | 81,822.86         |
| 合计          | 483,979.11        |

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |                 |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额            |
| 上年度末          | 884,546,067.94                        | 884,546,067.94  |
| 本期申购          | 204,944,294.82                        | 204,944,294.82  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -229,473,630.69                       | -229,473,630.69 |
| 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           | 860,016,732.07                        | 860,016,732.07  |

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

| 项目             | 已实现部分           | 未实现部分           | 未分配利润合计         |
|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 上年度末           | 533,028,145.63  | -196,643,771.25 | 336,384,374.38  |
| 本期利润           | -54,823,418.86  | 251,683,897.41  | 196,860,478.55  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -2,376,539.07   | -38,555,534.19  | -40,932,073.26  |
| 其中：基金申购款       | 120,621,011.69  | -31,404,810.56  | 89,216,201.13   |
| 基金赎回款          | -122,997,550.76 | -7,150,723.63   | -130,148,274.39 |
| 本期已分配利润        | -               | -               | -               |
| 本期末            | 475,828,187.70  | 16,484,591.97   | 492,312,779.67  |

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |            |
|-----------|---------------------------------------|------------|
|           | 活期存款利息收入                              | 218,071.79 |
| 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 | 9,556.31                              |            |
| 其他        | 1,526.39                              |            |
| 合计        | 229,154.49                            |            |

#### 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                   |
|------------------|----------------------|
|                  | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -45,716,571.97       |
| 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               | -45,716,571.97       |

#### 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                   |
|------------|----------------------|
|            | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 卖出股票成交总额   | 1,058,783,997.96     |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,101,720,478.52     |
| 减：交易费用     | 2,780,091.41         |
| 买卖股票差价收入   | -45,716,571.97       |

#### 6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期                   |
|---------------|----------------------|
|               | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 股票投资产生的股利收益   | 3,321,556.25         |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                    |
| 基金投资产生的股利收益   | -                    |
| 合计            | 3,321,556.25         |

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期                   |
|------------|----------------------|
|            | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 1. 交易性金融资产 | 251,683,897.41       |

|                        |                |
|------------------------|----------------|
| 股票投资                   | 251,683,897.41 |
| 债券投资                   | -              |
| 资产支持证券投资               | -              |
| 基金投资                   | -              |
| 贵金属投资                  | -              |
| 其他                     | -              |
| 2. 衍生工具                | -              |
| 权证投资                   | -              |
| 3. 其他                  | -              |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -              |
| 合计                     | 251,683,897.41 |

#### 6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 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                   |
|---------|----------------------|
|         | 2023年1月1日至2023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    | 572.72               |
| 账户维护费   | 18,600.00            |
| 合计      | 100,995.58           |

#### 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

2023年1月，中国证监会下发《关于核准万家基金管理有限公司变更实际控制人的批复》（证监许可[2023]215号），核准山东能源集团有限公司成为万家基金实际控制人，对中泰证券股份有限公司依法受让齐河众鑫投资有限公司持有的万家基金11%股权无异议。2023年2月，万家基金完成工商变更登记手续，万家基金股东变更为中泰证券和山东省新动能基金管理有限公司。

#### 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    |
| 中国工商银行股份有限公司（“工商银行”） | 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>2023年1月1日至2023年6月30日 |                         | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022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  | 783,864,211.63             | 41.01                   | -                               | -                       |

##### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

##### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日      |                    |              |                      |
|-------|---------------------------------|--------------------|--------------|----------------------|
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 (%) |
| 中泰证券  | 702,579.73                      | 43.22              | 96,522.03    | 24.00                |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |                    |              |                      |
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 (%) |
| -     | -                               | -                  | -            | -                    |

## 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>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年<br>6 月 30 日 |
|-----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 10,762,767.46                            | 10,641,815.16                                 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 4,297,899.78                             | 3,942,630.39                                  |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年<br>6 月 30 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,793,794.59                             | 1,773,635.87                                  |

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

### 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

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 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>2023年1月1日至2023年6月30日 |            | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022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     |
| 工商银行  | 84,832,222.40              | 218,071.79 | 147,630,009.29                  | 273,793.39 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，存款按银行同业利率或约定利率计息。

#### 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均未在承销期内直接购入关联方所承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间没有需作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023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:<br>股) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
|--------|------|------------|-----|--------|-------|--------|------------------|-----------|-----------|----|
| 001286 | 陕西能源 | 2023年3月31日 | 6个月 | 新股流通受限 | 9.60  | 9.41   | 3,767            | 36,163.20 | 35,447.47 | -  |
| 001287 | 中电港  | 2023年3月30日 | 6个月 | 新股流通受限 | 11.88 | 21.02  | 1,386            | 16,465.68 | 29,133.72 | -  |
| 001328 | 登康口腔 | 2023年3月29日 | 6个月 | 新股流通受限 | 20.68 | 25.49  | 145              | 2,998.60  | 3,696.05  | -  |
| 001360 | 南矿集团 | 2023年3月31日 | 6个月 | 新股流通受限 | 15.38 | 14.87  | 177              | 2,722.26  | 2,631.99  | -  |
| 001367 | 海森药业 | 2023年3月30日 | 6个月 | 新股流通受限 | 44.48 | 39.48  | 55               | 2,446.40  | 2,171.40  | -  |
| 301157 | 华塑科技 | 2023年3月1日  | 6个月 | 新股流通受限 | 56.50 | 52.93  | 150              | 8,475.00  | 7,939.50  | -  |
| 301325 | 曼恩斯特 | 2023年5月4日  | 6个月 | 新股流通受限 | 76.80 | 107.95 | 364              | 27,955.20 | 39,293.80 | -  |
| 301337 | 亚华电子 | 2023年5月16日 | 6个月 | 新股流通受限 | 32.60 | 30.37  | 232              | 7,563.20  | 7,045.84  | -  |
| 301358 | 湖南裕能 | 2023年2月1日  | 6个月 | 新股流通受限 | 23.77 | 42.89  | 1,512            | 35,940.24 | 64,849.68 | -  |
| 301360 | 荣旗科技 | 2023年4月17日 | 6个月 | 新股流通受限 | 71.88 | 92.60  | 134              | 9,631.92  | 12,408.40 | -  |

|        |      |            |     |        |        |        |        |           |           |   |
|--------|------|------------|-----|--------|--------|--------|--------|-----------|-----------|---|
| 601061 | 中信金属 | 2023年3月30日 | 6个月 | 新股流通受限 | 6.58   | 7.58   | 4,016  | 26,425.28 | 30,441.28 | - |
| 601065 | 江盐集团 | 2023年3月31日 | 6个月 | 新股流通受限 | 10.36  | 11.84  | 875    | 9,065.00  | 10,360.00 | - |
| 601133 | 柏诚股份 | 2023年3月31日 | 6个月 | 新股流通受限 | 11.66  | 12.26  | 664    | 7,742.24  | 8,140.64  | - |
| 603125 | 常青科技 | 2023年3月30日 | 6个月 | 新股流通受限 | 25.98  | 24.53  | 160    | 4,156.80  | 3,924.80  | - |
| 603135 | 中重科技 | 2023年3月29日 | 6个月 | 新股流通受限 | 17.80  | 17.89  | 628    | 11,178.40 | 11,234.92 | - |
| 688334 | 西高院  | 2023年6月9日  | 6个月 | 新股流通受限 | 14.16  | 16.21  | 888    | 12,574.08 | 14,394.48 | - |
| 688469 | 中芯集成 | 2023年4月28日 | 6个月 | 新股流通受限 | 5.69   | 5.41   | 13,800 | 78,522.00 | 74,658.00 | - |
| 688472 | 阿特斯  | 2023年6月2日  | 6个月 | 新股流通受限 | 11.10  | 17.04  | 4,654  | 51,659.40 | 79,304.16 | - |
| 688478 | 晶升股份 | 2023年4月13日 | 6个月 | 新股流通受限 | 32.52  | 42.37  | 402    | 13,073.04 | 17,032.74 | - |
| 688576 | 西山科技 | 2023年5月30日 | 6个月 | 新股流通受限 | 135.80 | 120.41 | 240    | 32,592.00 | 28,898.40 | - |
| 688603 | 天承科技 | 2023年6月30日 | 6个月 | 新股流通受限 | 55.00  | 55.00  | 140    | 7,700.00  | 7,700.00  | - |

|        |      |            |         |        |       |       |       |           |           |   |
|--------|------|------------|---------|--------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| 688603 | 天承科技 | 2023年6月30日 | 1个月内(含) | 新股未上市  | 55.00 | 55.00 | 1,251 | 68,805.00 | 68,805.00 | - |
| 688620 | 安凯微  | 2023年6月15日 | 6个月     | 新股流通受限 | 10.68 | 12.34 | 1,016 | 10,850.88 | 12,537.44 | - |

#### 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 2023 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金融资产款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有

一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。(2022 年 12 月 31 日：同)

#### 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

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

本基金所持有的证券大部分具有良好的流动性，部分证券流通暂时受限的情况参见附注 6.4.12 “期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券”，本报告期内本基金未出现因投资品种变现困难或投资集中而无法以合理价格及时变现基金资产以支付赎回款的情况。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

### 6.4.13.4.1 利率风险

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

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2023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                | 84,832,222.40 | -     | -      | -    | -    | -                 | 84,832,222.40    |
| 结算备付金               | 210,333.31    | -     | -      | -    | -    | -                 | 210,333.31       |
| 存出保证金               | 281,442.64    | -     | -      | -    | -    | -                 | 281,442.64       |
| 交易性金融资产             | -             | -     | -      | -    | -    | -1,271,535,064.64 | 1,271,535,064.64 |
| 应收申购款               | 23.43         | -     | -      | -    | -    | 238,974.82        | 238,998.25       |
| 应收清算款               | -             | -     | -      | -    | -    | 3,993,982.74      | 3,993,982.74     |
| 资产总计                | 85,324,021.78 | -     | -      | -    | -    | -1,275,768,022.20 | 1,361,092,043.98 |
| 负债                  |               |       |        |      |      |                   |                  |
| 应付赎回款               | -             | -     | -      | -    | -    | 850,841.62        | 850,841.62       |
| 应付管理人报酬             | -             | -     | -      | -    | -    | 1,767,069.17      | 1,767,069.17     |
| 应付托管费               | -             | -     | -      | -    | -    | 294,511.55        | 294,511.55       |
| 应付清算款               | -             | -     | -      | -    | -    | 5,366,130.79      | 5,366,130.79     |
| 其他负债                | -             | -     | -      | -    | -    | 483,979.11        | 483,979.11       |
| 负债总计                | -             | -     | -      | -    | -    | 8,762,532.24      | 8,762,532.24     |
| 利率敏感度缺口             | 85,324,021.78 | -     | -      | -    | -    | -1,267,005,489.96 | 1,352,329,511.74 |
| 上年度末<br>2022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                | 70,075,780.28 | -     | -      | -    | -    | -                 | 70,075,780.28    |
| 结算备付金               | 908,129.79    | -     | -      | -    | -    | -                 | 908,129.79       |
| 存出保证金               | 67,119.24     | -     | -      | -    | -    | -                 | 67,119.24        |
| 交易性金融资产             | -             | -     | -      | -    | -    | -1,151,162,346.11 | 1,151,162,346.11 |
| 应收申购款               | 20,030.63     | -     | -      | -    | -    | 63,051.95         | 83,082.58        |
| 应收清算款               | -             | -     | -      | -    | -    | 2,575,922.71      | 2,575,922.71     |
| 资产总计                | 71,071,059.94 | -     | -      | -    | -    | -1,153,801,320.77 | 1,224,872,380.71 |
| 负债                  |               |       |        |      |      |                   |                  |

|         |               |   |   |   |   |                   |                  |
|---------|---------------|---|---|---|---|-------------------|------------------|
| 应付赎回款   | -             | - | - | - | - | 1,596,622.08      | 1,596,622.08     |
| 应付管理人报酬 | -             | - | - | - | - | 1,619,553.21      | 1,619,553.21     |
| 应付托管费   | -             | - | - | - | - | 269,925.52        | 269,925.52       |
| 其他负债    | -             | - | - | - | - | 455,837.58        | 455,837.58       |
| 负债总计    | -             | - | - | - | - | 3,941,938.39      | 3,941,938.39     |
| 利率敏感度缺口 | 71,071,059.94 | - | - | - | - | -1,149,859,382.38 | 1,220,930,442.32 |

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

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2022 年 12 月 31 日：同），银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2022 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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>2023 年 6 月 30 日 |                   | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |                   |
|---------------|------------------------|-------------------|--------------------------|-------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产净值<br>比例 (%) | 公允价值                     | 占基金资产净值<br>比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 1,271,535,064.64       | 94.03             | 1,151,162,346.11         | 94.29             |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                      | -                 | -                        | -                 |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                      | -                 | -                        | -                 |

|                  |                  |       |                  |       |
|------------------|------------------|-------|------------------|-------|
| 衍生金融资产<br>— 权证投资 | -                | -     | -                | -     |
| 其他               | -                | -     | -                | -     |
| 合计               | 1,271,535,064.64 | 94.03 | 1,151,162,346.11 | 94.29 |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除股票基准指数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（2023年6月30日）             | 上年度末（2022年12月31日） |
| 分析 | 1. 股票基准指数下降 100 个基点  | -15,133,074.14              | -7,960,895.25     |
|    | 2. 股票基准指数上升 100 个基点  | 15,133,074.14               | 7,960,895.25      |

#### 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>2023年6月30日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
| 第一层次          | 1,270,963,014.93  | 1,150,075,500.58    |
| 第二层次          | 76,505.00         | -                   |
| 第三层次          | 495,544.71        | 1,086,845.53        |
| 合计            | 1,271,535,064.64  | 1,151,162,346.11    |

#### 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。

#### 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、其他资产以及其他金融负债，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              | 1,271,535,064.64 | 93.42         |
|    | 其中：股票             | 1,271,535,064.64 | 93.42         |
| 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      | 85,042,555.71    | 6.25          |
| 8  | 其他各项资产            | 4,514,423.63     | 0.33          |
| 9  | 合计                | 1,361,092,043.98 | 100.00        |

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末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         | 276,659,953.43   | 20.46        |
| B  | 采矿业              | -                | -            |
| C  | 制造业              | 366,925,297.67   | 27.13        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,310,721.47     | 0.10         |
| E  | 建筑业              | 8,140.64         | 0.00         |
| F  | 批发和零售业           | 59,575.00        | 0.00         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -                | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 586,892,335.94   | 43.40        |
| J  | 金融业              | 38,473,960.00    | 2.85         |
| K  | 房地产业             | 1,024,320.00     | 0.08         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -                | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 180,760.49       | 0.01         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -                | -            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -                | -            |
| P  | 教育               | -                | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -                | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -                | -            |
| S  | 综合               | -                | -            |
|    | 合计               | 1,271,535,064.64 | 94.03        |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

### 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  | 002230 | 科大讯飞 | 1,783,916  | 121,234,931.36 | 8.96         |
| 2  | 688256 | 寒武纪  | 612,724    | 115,192,112.00 | 8.52         |
| 3  | 603019 | 中科曙光 | 2,129,300  | 108,381,370.00 | 8.01         |
| 4  | 300087 | 荃银高科 | 9,579,953  | 99,056,714.02  | 7.32         |
| 5  | 000998 | 隆平高科 | 6,131,186  | 94,113,705.10  | 6.96         |
| 6  | 002385 | 大北农  | 12,732,605 | 84,035,193.00  | 6.21         |
| 7  | 002041 | 登海种业 | 5,467,553  | 83,489,534.31  | 6.17         |
| 8  | 300494 | 盛天网络 | 3,207,600  | 79,516,404.00  | 5.88         |
| 9  | 688111 | 金山办公 | 158,266    | 74,736,370.52  | 5.53         |
| 10 | 000938 | 紫光股份 | 2,160,640  | 68,816,384.00  | 5.09         |
| 11 | 601360 | 三六零  | 5,272,800  | 66,120,912.00  | 4.89         |
| 12 | 002605 | 姚记科技 | 1,412,850  | 65,598,625.50  | 4.85         |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 13 | 002555 | 三七互娱 | 1,848,794 | 64,485,934.72 | 4.77 |
| 14 | 300033 | 同花顺  | 219,500   | 38,473,960.00 | 2.85 |
| 15 | 000063 | 中兴通讯 | 800,100   | 36,436,554.00 | 2.69 |
| 16 | 601138 | 工业富联 | 1,297,993 | 32,709,423.60 | 2.42 |
| 17 | 688041 | 海光信息 | 467,204   | 31,896,017.08 | 2.36 |
| 18 | 688559 | 海目星  | 28,181    | 1,324,788.81  | 0.10 |
| 19 | 000875 | 吉电股份 | 236,600   | 1,275,274.00  | 0.09 |
| 20 | 002314 | 南山控股 | 310,400   | 1,024,320.00  | 0.08 |
| 21 | 603396 | 金辰股份 | 14,500    | 951,200.00    | 0.07 |
| 22 | 688472 | 阿特斯  | 46,534    | 848,220.96    | 0.06 |
| 23 | 688147 | 微导纳米 | 6,293     | 332,144.54    | 0.02 |
| 24 | 688576 | 西山科技 | 2,395     | 315,642.70    | 0.02 |
| 25 | 688084 | 晶品特装 | 1,875     | 162,881.25    | 0.01 |
| 26 | 688334 | 西高院  | 8,879     | 157,912.84    | 0.01 |
| 27 | 301360 | 荣旗科技 | 1,340     | 138,170.08    | 0.01 |
| 28 | 688620 | 安凯微  | 10,157    | 135,209.66    | 0.01 |
| 29 | 688143 | 长盈通  | 2,519     | 94,966.30     | 0.01 |
| 30 | 688603 | 天承科技 | 1,391     | 76,505.00     | 0.01 |
| 31 | 688469 | 中芯集成 | 13,800    | 74,658.00     | 0.01 |
| 32 | 301358 | 湖南裕能 | 1,512     | 64,849.68     | 0.00 |
| 33 | 301325 | 曼恩斯特 | 364       | 39,293.80     | 0.00 |
| 34 | 001286 | 陕西能源 | 3,767     | 35,447.47     | 0.00 |
| 35 | 601061 | 中信金属 | 4,016     | 30,441.28     | 0.00 |
| 36 | 001287 | 中电港  | 1,386     | 29,133.72     | 0.00 |
| 37 | 301368 | 丰立智能 | 337       | 23,317.03     | 0.00 |
| 38 | 301297 | 富乐德  | 1,015     | 22,847.65     | 0.00 |
| 39 | 688478 | 晶升股份 | 402       | 17,032.74     | 0.00 |
| 40 | 603135 | 中重科技 | 628       | 11,234.92     | 0.00 |
| 41 | 601065 | 江盐集团 | 875       | 10,360.00     | 0.00 |
| 42 | 301265 | 华新环保 | 819       | 9,516.78      | 0.00 |
| 43 | 601133 | 柏诚股份 | 664       | 8,140.64      | 0.00 |
| 44 | 301157 | 华塑科技 | 150       | 7,939.50      | 0.00 |
| 45 | 301337 | 亚华电子 | 232       | 7,045.84      | 0.00 |
| 46 | 603125 | 常青科技 | 160       | 3,924.80      | 0.00 |
| 47 | 001328 | 登康口腔 | 145       | 3,696.05      | 0.00 |
| 48 | 001360 | 南矿集团 | 177       | 2,631.99      | 0.00 |
| 49 | 001367 | 海森药业 | 55        | 2,171.40      | 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  | 002230 | 科大讯飞 | 109,040,217.00 | 8.93           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 2  | 603019 | 中科曙光 | 72,100,360.87 | 5.91 |
| 3  | 601360 | 三六零  | 64,861,191.24 | 5.31 |
| 4  | 300494 | 盛天网络 | 61,846,624.50 | 5.07 |
| 5  | 600893 | 航发动力 | 60,620,669.47 | 4.97 |
| 6  | 002555 | 三七互娱 | 59,681,893.48 | 4.89 |
| 7  | 600519 | 贵州茅台 | 58,474,476.50 | 4.79 |
| 8  | 688256 | 寒武纪  | 58,002,571.04 | 4.75 |
| 9  | 600276 | 恒瑞医药 | 57,041,519.57 | 4.67 |
| 10 | 600372 | 中航电子 | 56,558,348.00 | 4.63 |
| 11 | 000938 | 紫光股份 | 56,106,548.07 | 4.60 |
| 12 | 688111 | 金山办公 | 55,738,744.02 | 4.57 |
| 13 | 000063 | 中兴通讯 | 54,475,624.00 | 4.46 |
| 14 | 300033 | 同花顺  | 42,905,182.91 | 3.51 |
| 15 | 688041 | 海光信息 | 37,132,933.00 | 3.04 |
| 16 | 002605 | 姚记科技 | 36,827,208.50 | 3.02 |
| 17 | 601138 | 工业富联 | 24,191,041.25 | 1.98 |
| 18 | 688469 | 中芯集成 | 785,185.86    | 0.06 |
| 19 | 688472 | 阿特斯  | 516,527.40    | 0.04 |
| 20 | 688515 | 裕太微  | 384,836.00    | 0.03 |

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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  | 600048 | 保利发展 | 105,915,758.28 | 8.68           |
| 2  | 002179 | 中航光电 | 89,178,950.93  | 7.30           |
| 3  | 001979 | 招商蛇口 | 76,934,510.78  | 6.30           |
| 4  | 000002 | 万科 A | 67,038,254.87  | 5.49           |
| 5  | 601390 | 中国中铁 | 65,713,437.03  | 5.38           |
| 6  | 601186 | 中国铁建 | 62,807,869.10  | 5.14           |
| 7  | 600893 | 航发动力 | 57,295,712.05  | 4.69           |
| 8  | 600519 | 贵州茅台 | 56,624,696.00  | 4.64           |
| 9  | 002013 | 中航机电 | 56,558,348.00  | 4.63           |
| 10 | 600372 | 中航电子 | 53,933,185.86  | 4.42           |
| 11 | 600276 | 恒瑞医药 | 53,289,115.50  | 4.36           |
| 12 | 000738 | 航发控制 | 50,451,105.69  | 4.13           |
| 13 | 600862 | 中航高科 | 45,597,723.00  | 3.73           |
| 14 | 601211 | 国泰君安 | 31,164,549.31  | 2.55           |
| 15 | 600528 | 中铁工业 | 30,952,024.87  | 2.54           |
| 16 | 000063 | 中兴通讯 | 30,346,367.00  | 2.49           |
| 17 | 601669 | 中国电建 | 25,850,917.00  | 2.12           |
| 18 | 600019 | 宝钢股份 | 20,439,189.76  | 1.67           |
| 19 | 002230 | 科大讯飞 | 16,133,132.00  | 1.32           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 20 | 300494 | 盛天网络 | 14,415,226.00 | 1.18 |
|----|--------|------|---------------|------|

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 970,409,299.64   |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,058,783,997.96 |

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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约，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

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 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

本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额           |
|----|-------|--------------|
| 1  | 存出保证金 | 281,442.64   |
| 2  | 应收清算款 | 3,993,982.74 |
| 3  | 应收股利  | -            |
| 4  | 应收利息  | -            |
| 5  | 应收申购款 | 238,998.25   |
| 6  | 其他应收款 | -            |
| 7  | 待摊费用  | -            |
| 8  | 其他    | -            |
| 9  | 合计    | 4,514,423.63 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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

| 持有人户数<br>(户) | 人均持有的<br>基金份额 | 持有人结构        |               |                |               |
|--------------|---------------|--------------|---------------|----------------|---------------|
|              |               | 机构投资者        |               | 个人投资者          |               |
|              |               | 持有份额         | 占总份额比例<br>(%) | 持有份额           | 占总份额比例<br>(%) |
| 29,540       | 29,113.63     | 8,886,210.20 | 1.03          | 851,130,521.87 | 98.97         |

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数（份）  | 占基金总份额比例（%） |
|------------------|------------|-------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 457,986.10 | 0.0533      |

## 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                             | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 10~50             |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                               |                  |
|-------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2020年5月29日）<br>基金份额总额 | 3,375,952,606.80 |
| 本报告期期初基金份额总额                  | 884,546,067.94   |
| 本报告期基金总申购份额                   | 204,944,294.82   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                 | 229,473,630.69   |
| 本报告期基金拆分变动份额                  | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                  | 860,016,732.07   |

## § 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

报告期内本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 交易单元数量 | 股票交易           |                  | 应支付该券商的佣金  |                | 备注 |
|--------|--------|----------------|------------------|------------|----------------|----|
|        |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| 中泰证券   | 1      | 783,864,211.63 | 41.01            | 702,579.73 | 43.22          | -  |
| 中信建投   | 1      | 492,186,327.22 | 25.75            | 458,366.20 | 28.20          | -  |
| 国元证券   | 3      | 452,249,852.90 | 23.66            | 330,733.04 | 20.35          | -  |
| 第一创业证券 | 2      | 182,972,063.63 | 9.57             | 133,798.02 | 8.23           | -  |
| 安信证券   | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 财通证券   | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 长城证券   | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 德邦证券   | 2      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 东方财富证券 | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 东吴证券   | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 东亚前海证券 | 2      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 广发证券   | 2      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 国信证券   | 2      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 华宝证券   | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 开源证券   | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 民生证券   | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 平安证券   | 2      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 山西证券   | 2      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 上海证券   | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 湘财证券   | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 招商证券   | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 浙商证券   | 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、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；

(2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

3、基金专用交易席位的变更情况：

本报告期内，本基金减少大同证券交易单元 1 个。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

### 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  | 万家价值优势一年持有期混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告                    | 指定媒介   | 2023 年 01 月 20 日 |
| 2  | 万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增微众银行为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告 | 指定媒介   | 2023 年 02 月 24 日 |
| 3  | 万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在兴业证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告       | 指定媒介   | 2023 年 03 月 08 日 |
| 4  | 万家价值优势一年持有期混合型证券投资基金 2022 年年度报告                        | 指定媒介   | 2023 年 03 月 30 日 |
| 5  | 万家价值优势一年持有期混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告                    | 指定媒介   | 2023 年 04 月 21 日 |
| 6  | 万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在华西证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告       | 指定媒介   | 2023 年 05 月 30 日 |
| 7  | 万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在陆享基金开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告       | 指定媒介   | 2023 年 06 月 01 日 |

## § 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出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《万家价值优势一年持有期混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家价值优势一年持有期混合型证券投资基金托管协议》。
- 4、万家价值优势一年持有期混合型证券投资基金 2023 年中期报告原文。
- 5、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。
- 7、本报告期内在中国证监会指定媒介公开披露的基金净值、更新招募说明书及其他临时公告。

### 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

2023 年 8 月 30 日