

# 万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资 基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 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。

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

本报告期自 2021 年 8 月 17 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	17
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>19</b>
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>22</b>
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	25
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>53</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	53
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	53
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	57
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	57

8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	57
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	57
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	57
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	58
8.12	投资组合报告附注 .....	58
<b>§ 9</b>	<b>基金份额持有人信息 .....</b>	<b>60</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	60
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	61
<b>§ 10</b>	<b>开放式基金份额变动 .....</b>	<b>62</b>
<b>§ 11</b>	<b>重大事件揭示 .....</b>	<b>63</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	63
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	63
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	63
11.4	基金投资策略的改变 .....	63
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	63
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	63
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
<b>§ 12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>66</b>
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	66
<b>§ 13</b>	<b>备查文件目录 .....</b>	<b>67</b>
13.1	备查文件目录 .....	67
13.2	存放地点 .....	67
13.3	查阅方式 .....	67

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	万家招瑞回报一年持有期混合	
基金主代码	012435	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 8 月 17 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	349,722,327.30 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	万家招瑞回报一年持有期混合 A	万家招瑞回报一年持有期混合 C
下属分级基金的交易代码:	012435	012436
报告期末下属分级基金的份额总额	322,686,310.73 份	27,036,016.57 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制投资组合风险的前提下，谋求实现基金财产的长期稳健增值。
投资策略	1、大类资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、可转换债券与可交换债券投资策略；6、证券公司短期公司债券投资策略；7、股指期货投资策略；8、国债期货投资策略；9、股票期权投资策略；10、融资交易策略；11、信用衍生品投资策略。
业绩比较基准	中债新综合指数（全价）收益率×85%+沪深 300 指数收益率×10%+恒生指数收益率×5%
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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	张燕
	联系电话	021-38909626	0755-83199084
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4008880800	95555
传真		021-38909627	0755-83195201
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

	楼层 9 层)	
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)	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200122	518040
法定代表人	方一天	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.wjasset.com">http://www.wjasset.com</a>
基金年度报告备置地点	中国(上海)自由贸易试验区浦电路 360 号 8 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
会计师事务所	立信会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市南京东路 61 号 4 楼新黄浦金融大厦
注册登记机构	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、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年 8 月 17 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日	
	万家招瑞回报一年持有期混合 A	万家招瑞回报一年持有期混合 C
本期已实现收益	-304,488.94	-64,776.20
本期利润	-863,308.33	-110,278.74
加权平均基金份额本期利润	-0.0027	-0.0041
本期加权平均净值利润率	-0.27%	-0.41%
本期基金份额净值增长率	-0.27%	-0.42%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	
期末可供分配利润	-868,758.10	-112,941.05
期末可供分配基金份额利润	-0.0027	-0.0042
期末基金资产净值	321,817,552.63	26,923,075.52
期末基金份额净值	0.9973	0.9958
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	
基金份额累计净值增长率	-0.27%	-0.42%

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

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

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

4、本基金合同生效于 2021 年 8 月 17 日。

#### 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

万家招瑞回报一年持有期混合 A

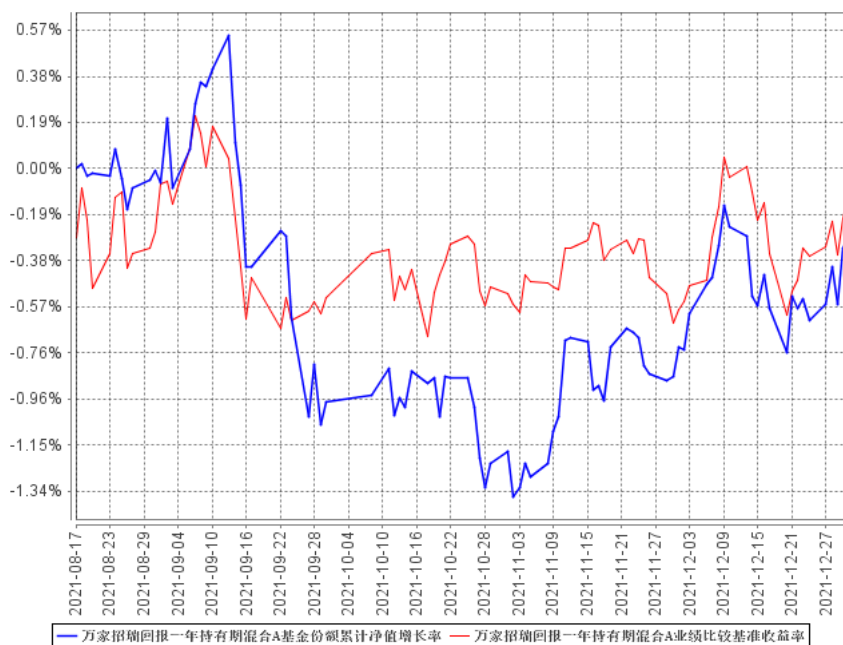
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.71%	0.12%	0.45%	0.11%	0.26%	0.01%
自基金合同生效起至今	-0.27%	0.15%	-0.09%	0.13%	-0.18%	0.02%

万家招瑞回报一年持有期混合 C

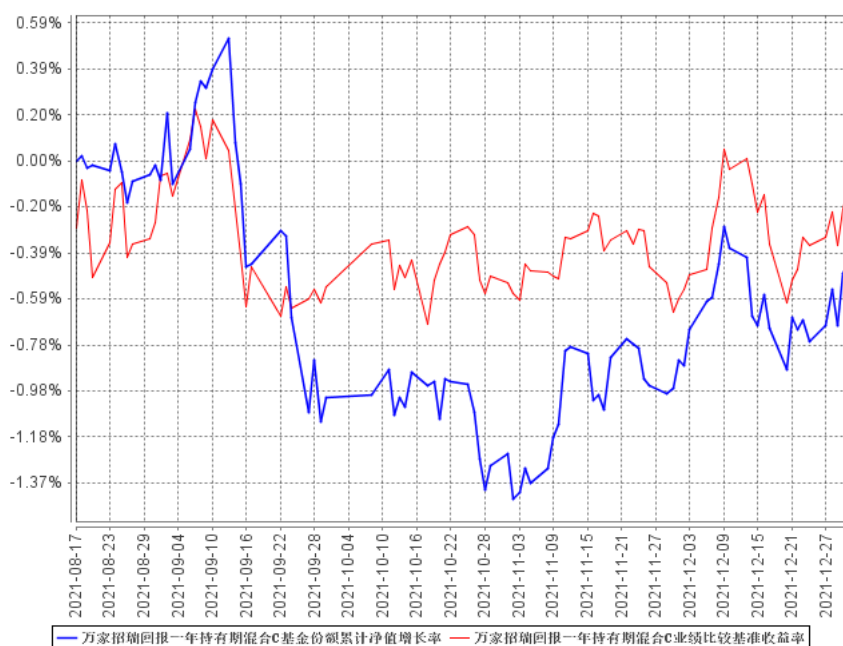
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.60%	0.12%	0.45%	0.11%	0.15%	0.01%
自基金合同生效起至今	-0.42%	0.15%	-0.09%	0.13%	-0.33%	0.02%

### 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

万家招瑞回报一年持有期混合A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



万家招瑞回报一年持有期混合C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



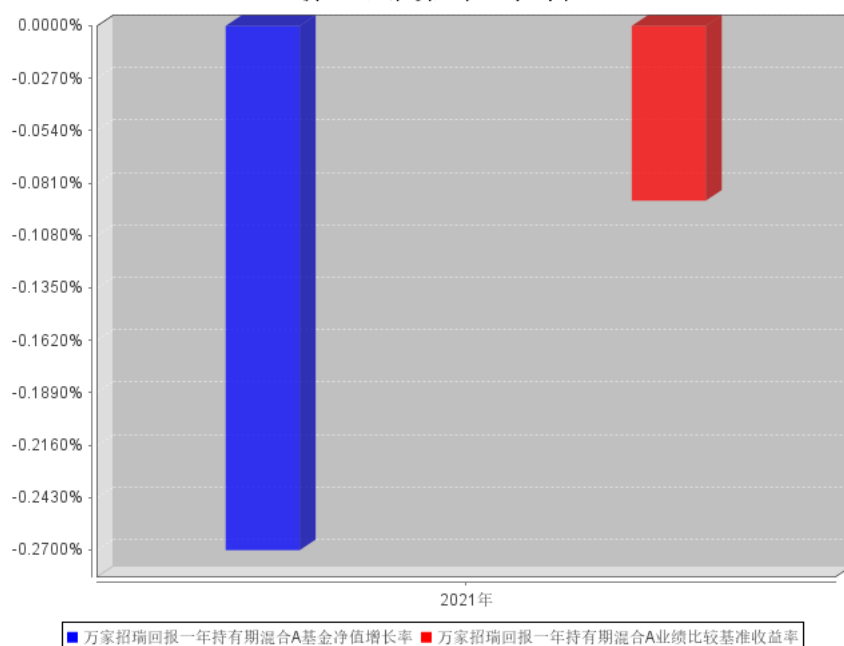


注：（1）本基金合同生效日期为 2021 年 8 月 17 日，基金合同生效起至披露时点未满一年。

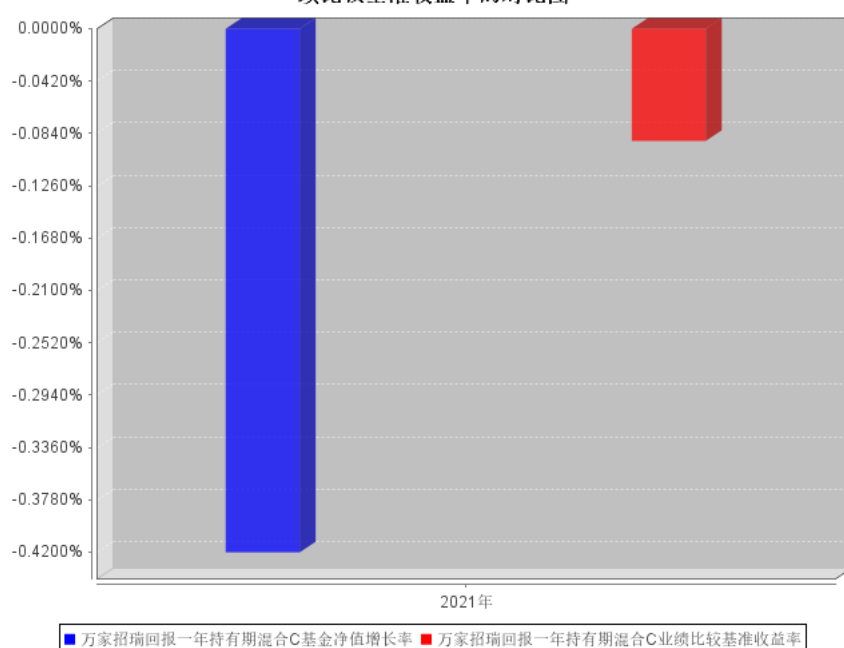
（2）根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家招瑞回报一年持有期混合A自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



万家招瑞回报一年持有期混合C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金成立（2021 年 8 月 17 日）以来未分配利润。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44号文批准设立。公司现股东为中泰证券股份有限公司、新疆国际实业股份有限公司和齐河众鑫投资有限公司,住所:中国(上海)自由贸易试验区浦电路360号8楼(名义楼层9层),办公地点:上海市浦东新区浦电路360号9楼,注册资本3亿元人民币。目前管理一百只开放式基金,分别为万家180指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选混合型证券投资基金(LOF)、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金(LOF)、万家添利债券型证券投资基金(LOF)、万家新机遇价值驱动灵活配置混合型证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家上证50交易型开放式指数证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞和灵活配置混合型证券投资基金、万家颐达灵活配置混合型证券投资基金、万家颐和灵活配置混合型证券投资基金、万家恒瑞18个月定期开放债券型证券投资基金、万家3-5年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家鑫安纯债债券型证券投资基金、万家鑫璟纯债债券型证券投资基金、万家沪深300指数增强型证券投资基金、万家家享中短债债券型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家1-3年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家瑞隆混合型证券投资基金、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家现金增利货币市场基金、万家消费成长股票型证券投资基金、万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家玖盛纯债9个月定期开放债券型证券投资基金、万家天添宝货币市场基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、万家家瑞债券型证券投资基金、万家臻选混合型证券投资基金、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金、万家中证1000指数增强型发起式证券投资基金、万家成长优选灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金、万家经济新动能混合型证券投资基金、万家潜力价值灵

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

#### 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		
苏谋东	万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家信用恒利债券	2021 年 8 月 17 日	-	12.5 年	复旦大学世界经济硕士。2008 年 7 月至 2013 年 2 月在宝钢集团财务有限责任公司工作，担任资金运用部投资经理，

	型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家民丰回报一年持有期混合型证券投资基金、万家瑞和灵活配置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、万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金的基金经理			主要从事债券研究和投资工作；2013年3月进入万家基金管理有限公司，从事债券研究工作，自2013年5月起担任基金经理职务，现任总经理助理、固定收益部总监、现金管理部总监、基金经理。
--	---	--	--	--

注：1、此处的任职日期以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司定期进行同向交易价差分析,即采集公司旗下管理的所有组合,连续四个季度期间内,不同时间窗下(日内、3日内、5日内)的同向交易样本,对两两组合之间的同向交易价差均值进行原假设为0,95%的置信水平下的t检验,并对结论进行跟踪分析,分析结果显示在样本数量大于30的前提下,组合之间在同向交易方面不存在违反公平交易行为。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共有1次,为不同基金经理管理的组合间因投

资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年国内宏观经济持续走弱，下行压力逐步加大，主要是两个原因：第一，新冠疫情的发展超出年初预期，疫苗的接种并没有起到全面免疫的作用，疫情持续对全球以及国内经济产生压制作用，国内的动态清零政策很好的保障了人民的生命安全和生产的正常进行，但是对服务业以及更广泛的消费产生了较大的负面影响。第二，2021 年宏观政策的重心是调结构和防风险，表现为双碳政策的强力推进以及地产的强力调控，宏观政策对经济增长的诉求偏低，因而，我们看到财政滞后、基建投资增速偏低等情况，以及双碳政策推进过激导致部分商品价格暴涨，能耗政策导致生产中断等情况。宏观经济的下行在四季度更加显性的体现出来，特别是在地产的下行风险更加显性暴露后。

2021 年国内债券收益整体震荡走低，债市走出了慢牛走势。上半年资金面总体宽松，但是经济下行压力尚且不明显，因而，债券收益率总体表现为震荡缓慢下行。进入三季度后，经济的下行压力逐步显现，为了对冲经济下行压力，货币政策正式进入量价宽松阶段，降准和降息的政策落地推动债券收益率在下半年出现明显下行。另外，由于政策对城投和地产的调控，机构资产配置上出现了阶段性的资产荒情形，因而机构加大了对债券资产的配置，也推动了债券收益率的下行。权益方面，2021 年是较为典型的结构分化的市场，全年指数波动不大，但是行业分化明显，跟经济周期相关的行业表现一般，跟经济结构调整相关的行业表现更好，行业之间的估值分化达到极端水平。

我们继续从疫情和宏观政策两个角度对经济进行深度跟踪和研究。全年看，本基金继续坚持以基本面为核心的信用债投资策略，在复杂的信用环境中，守住信用风险底线。在久期策略上，继续坚持以中期的视角观察宏观经济的走势、货币政策的取向以及大类资产的性价比，并进行债券资产的久期选择。从 2021 年年初开始整体战略性看多债券市场，并维持中性以上的债券久期。全年看，本基金在久期策略、杠杆策略和信用票息策略上表现的较为均衡。权益资产上，年初开始，从自上而下的角度我们降低了权益的配置比例，在行业配置上，处于估值考虑，更多的配置了估值较低的价值风格个股。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家招瑞回报一年持有期混合 A 基金份额净值为 0.9973 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.27%；截至本报告期末万家招瑞回报一年持有期混合 C 基金份额净值为 0.9958 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.42%；同期业绩比较基准收益率为-0.09%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对 2022 年的国内宏观经济整体偏乐观。在疫情防控政策更加精准灵活以及国内宏观政策已经明显的转向稳增长后,我们认为 2022 年国内经济可以逐步企稳并小幅回升。短期看债券收益率处于中性偏低水平,未来整体更大概率是震荡走势。信用风险方面,我们认为信用环境仍然较为复杂,信用风险仍需要重点防范。本基金将继续保持对疫情、经济基本面和货币政策的紧密跟踪,做好久期管理和信用风险管理。权益方面,我们认为仍然是震荡市,市场存在结构性低估的行业和个股,这为获得绝对收益提供了良好的条件。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

##### (一) 加强风控文化建设

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

##### (二) 制度流程建设

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

##### (三) 定期和临时稽核工作

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

##### (四) 绩效评估和风险管理工作

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

##### (五) 员工行为管理与防控内幕交易

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

#### 4.8 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。

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

本报告期内,本基金没有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况。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	信会师报字[2022]第 ZA30168 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金(以下简称“万家招瑞回报一年持有期混合”)财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年 8 月 17 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了万家招瑞回报一年持有期混合型 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 8 月 17 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于万家招瑞回报一年持有期混合型,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>万家招瑞回报一年持有期混合型的基金管理人万家基金管理有限责任公司管理层(以下简称管理层)负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,管理层负责评估万家招瑞回报一年持有期混合型的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运</p>

	<p>用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督万家招瑞回报一年持有期混合型的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对万家招瑞回报一年持有期混合型持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致万家招瑞回报一年持有期混合型不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价</p>

	财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与管理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	立信会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	王 斌	徐 冬
会计师事务所的地址	中国 上海	
审计报告日期	2022 年 3 月 29 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	2,053,570.81
结算备付金		1,381,382.96
存出保证金		19,121.64
交易性金融资产	7.4.7.2	379,674,261.02
其中：股票投资		58,730,281.02
基金投资		-
债券投资		320,943,980.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		1,051,582.60
应收利息	7.4.7.5	2,683,816.05
应收股利		-
应收申购款		307.62
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		386,864,042.70
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		37,000,000.00
应付证券清算款		702,009.03
应付赎回款		-
应付管理人报酬		236,273.05
应付托管费		59,068.26
应付销售服务费		9,078.46
应付交易费用	7.4.7.7	45,382.74
应交税费		7,535.20
应付利息		-15,932.19

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	80,000.00
负债合计		38,123,414.55
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	349,722,327.30
未分配利润	7.4.7.10	-981,699.15
所有者权益合计		348,740,628.15
负债和所有者权益总计		386,864,042.70

注：1、报告截止日 2021 年 12 月 31 日，万家招瑞回报一年持有期混合 A 基金份额净值 0.9973 元，基金份额总额 322,686,310.73 份；万家招瑞回报一年持有期混合 C 基金份额净值 0.9958 元，基金份额总额 27,036,016.57 份。万家招瑞回报一年持有期混合份额总额合计为 349,722,327.30 份。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末可比数据。

## 7.2 利润表

会计主体：万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 8 月 17 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2021 年 8 月 17 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		923,282.86
1.利息收入		3,167,090.53
其中：存款利息收入	7.4.7.11	19,658.88
债券利息收入		2,960,898.87
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		186,532.78
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,639,485.74
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-1,727,743.14
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-33,292.60
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	121,550.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-604,321.93
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-
<b>减：二、费用</b>		1,896,869.93
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,034,610.92
2. 托管费	7.4.10.2.2	258,652.75
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	39,671.79
4. 交易费用	7.4.7.19	149,120.46
5. 利息支出		318,773.27
其中：卖出回购金融资产支出		318,773.27
6. 税金及附加		3,884.75
7. 其他费用	7.4.7.20	92,155.99
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-973,587.07
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-973,587.07

注：1、本财务报表的实际编制期间为 2021 年 8 月 17 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 8 月 17 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 8 月 17 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	348,847,031.75	-	348,847,031.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-973,587.07	-973,587.07
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	875,295.55	-8,112.08	867,183.47
其中：1. 基金申购款	875,295.55	-8,112.08	867,183.47
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-



五、期末所有者权益（基金净值）	349,722,327.30	-981,699.15	348,740,628.15
-----------------	----------------	-------------	----------------

注：1、本财务报表的实际编制期间为 2021 年 8 月 17 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

万家招瑞回报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[2021]1622 号文《关于准予万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由万家基金管理有限公司作为基金管理人于 2021 年 8 月 2 日至 2021 年 8 月 13 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[2021]第 ZA31437 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 2021 年 8 月 17 日生效，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）为人民币 348,830,468.69 元，有效认购资金在募集期间内产生的利息为人民币 16,543.06 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 348,847,031.75 元，折合 348,847,031.75 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

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、创业板及其他中国证监会准予上市发行的股票、存托凭证）、港股通标的股票、股指期货、国债期货、股票期权、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、证券公司短期公司债、政府支持机构债、公开发行的次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、信用衍生品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。

基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的 0%-30%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；本基金投资同业存单的比例不超过基金资产的 20%；每个交易日日

终在扣除股票期权、股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中债新综合指数（全价）收益率×85%+沪深 300 指数收益率×10%+恒生指数收益率×5%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 8 月 17 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2021 年 8 月 17 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

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

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### 1、金融资产的分类

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

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

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

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的

金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.80%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 0.20%的年费率逐日计提；

(3) 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按前一日 C 类基金资

产净值的 0.40%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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；对于收益分配方式为红利再投资的基金份额，每份基金份额（原份额）所获得的红利再投资份额的持有期限，按原份额的持有期限计算；

(3) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规、基金合同的约定以及对份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指

数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

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

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

##### (一) 印花税

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

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

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

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

## (二) 增值税

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

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

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

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

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

## (三) 企业所得税

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

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

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



红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### (四) 个人所得税

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

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

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

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

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

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	2,053,570.81
定期存款	-

其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	2,053,570.81

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末可比数据。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	59,736,294.55	58,730,281.02	-1,006,013.53
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	191,556,938.95	191,858,980.00
	银行间市场	128,985,349.45	129,085,000.00
	合计	320,542,288.40	320,943,980.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	380,278,582.95	379,674,261.02	-604,321.93

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末可比数据。

#### 7.4.7.3 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。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末可比数据。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末可比数据。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末可比数据。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	252.76
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	683.87
应收债券利息	2,682,869.96
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	9.46
合计	2,683,816.05

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末可比数据。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末可比数据。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	36,006.07
银行间市场应付交易费用	9,376.67
合计	45,382.74

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末可比数据。

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	80,000.00
合计	80,000.00

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末可比数据。

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

万家招瑞回报一年持有期混合 A		
项目	本期 2021 年 8 月 17 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	322, 104, 142. 49	322, 104, 142. 49
本期申购	582, 168. 24	582, 168. 24
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	322, 686, 310. 73	322, 686, 310. 73

金额单位：人民币元

万家招瑞回报一年持有期混合 C		
项目	本期 2021 年 8 月 17 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	26, 742, 889. 26	26, 742, 889. 26
本期申购	293, 127. 31	293, 127. 31
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	27, 036, 016. 57	27, 036, 016. 57

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

万家招瑞回报一年持有期混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-304, 488. 94	-558, 819. 39	-863, 308. 33
本期基金份额交易产生的变动数	-1, 010. 78	-4, 438. 99	-5, 449. 77
其中：基金申购款	-1, 010. 78	-4, 438. 99	-5, 449. 77
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-305,499.72	-563,258.38	-868,758.10
-----	-------------	-------------	-------------

单位：人民币元

万家招瑞回报一年持有期混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-64,776.20	-45,502.54	-110,278.74
本期基金份额交易产生的变动数	-849.81	-1,812.50	-2,662.31
其中：基金申购款	-849.81	-1,812.50	-2,662.31
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-65,626.01	-47,315.04	-112,941.05

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年8月17日(基金合同生效日)至2021年12月31日
活期存款利息收入	13,753.00
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	5,822.91
其他	82.97
合计	19,658.88

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年8月17日(基金合同生效日)至2021年12月31日
卖出股票成交总额	27,989,078.92
减：卖出股票成本总额	29,716,822.06
买卖股票差价收入	-1,727,743.14

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年8月17日(基金合同生效日)至 2021年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-33,292.60
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	-33,292.60

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年8月17日(基金合同生效日)至 2021年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	81,012,384.52
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	80,549,830.00
减：应收利息总额	495,847.12
买卖债券差价收入	-33,292.60

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.13.3 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。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具投资收益。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 8 月 17 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	121,550.00
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	121,550.00

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 8 月 17 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-604,321.93
——股票投资	-1,006,013.53
——债券投资	401,691.60
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-604,321.93

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 8 月 17 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	147,095.46
银行间市场交易费用	2,025.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	149,120.46

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 8 月 17 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	30,000.00
信息披露费	50,000.00
证券出借违约金	-
其他	400.00
银行费用	8,655.99
帐户维护费	3,100.00
合计	92,155.99

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金本报告期末无需要说明的重大或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

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。

### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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
新疆国际实业股份有限公司	基金管理人的股东
齐河众鑫投资有限公司	基金管理人的股东
万家共赢资产管理有限公司	基金管理人的子公司
万家财富基金销售（天津）有限公司	基金管理人的子公司、基金销售机构
上海万家朴智投资管理有限公司	基金管理人控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。



## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期末通过关联方席位进行股票交易。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期末通过关联方席位进行债券交易。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期末通过关联方席位进行债券回购交易。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期末通过关联方席位进行权证交易。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年8月17日(基金合同生效日)至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,034,610.92
其中：支付销售机构的客户维护费	452,546.14

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无

误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 8 月 17 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	258,652.75

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.10.2.3 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		
	2021 年 8 月 17 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家招瑞回报一年持有期混合 A	万家招瑞回报一年持有期混合 C	合计
万家基金	-	2,771.90	2,771.90
招商银行	-	4,008.17	4,008.17
中泰证券	-	10,095.58	10,095.58
合计	-	16,875.65	16,875.65

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 0.40%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

##### 7.4.10.4.2 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。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本基金本报告期未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

##### 7.4.10.5.2 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

本基金本报告期内无除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 8 月 17 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	2,053,570.81	13,753.00

注：1、本基金的银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管，活期存款按银行同业利率计息。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方所承销的证券。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期没有需作说明的其他关联交易事项。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001234	泰慕士	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 11 日	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113052	兴业转债	2021 年 12 月 27 日	2022 年 1 月 14 日	新债未上市	100.00	100.00	4,170	417,000.00	417,000.00	-

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 37,000,000.00 元,于 2022 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

**7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日
A-1	59,979,000.00
A-1 以下	-
未评级	78,676,000.00
合计	138,655,000.00

注：1、未评级债券为政策性金融债、金融债和同业存单。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

**7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日
AAA	151,249,000.00
AAA 以下	10,975,980.00
未评级	20,064,000.00
合计	182,288,980.00

注：1、未评级债券为政策性金融债。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

**7.4.13.3 流动性风险**

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

本基金所持有的的证券大部分具有良好的流动性，部分证券流通暂时受限的情况参见附注 7.4.12 “期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券”，本报告期内本基金未出现因投资品种变现困难或投资集中而无法以合理价格及时变现基金资产以支付赎回款的情况。

### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持有的的证券大部分具有良好的流动性，部分证券流通暂时受限的情况参见附注 7.4.12“期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券”，本报告期内本基金未出现因投资品种变现困难或投资集中而无法以合理价格及时变现基金资产以支付赎回款的情况。

### 7.4.13.4 市场风险

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

#### 7.4.13.4.1 利率风险

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 1 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	2,053,570.81	-	-	-	-	-	2,053,570.81
结算备付金	1,381,382.96	-	-	-	-	-	1,381,382.96
存出保证金	19,121.64	-	-	-	-	-	19,121.64
交易性金融资产	-	10,968,980.00	169,058,000.00	120,853,000.00	20,064,000.00	58,730,281.02	379,674,261.02
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,051,582.60	1,051,582.60
应收利息	-	-	-	-	-	2,683,816.05	2,683,816.05
应收申购款	-	-	-	-	-	307.62	307.62
资产总计	3,454,075.41	10,968,980.00	169,058,000.00	120,853,000.00	20,064,000.00	62,465,987.29	386,864,042.70
负债							



卖出回购金融资产款	37,000,000.00	-	-	-	-	-	37,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	702,009.03	702,009.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	236,273.05	236,273.05
应付托管费	-	-	-	-	-	59,068.26	59,068.26
应付销售服务费	-	-	-	-	-	9,078.46	9,078.46
应付交易费用	-	-	-	-	-	45,382.74	45,382.74
应付利息	-	-	-	-	-	-15,932.19	-15,932.19

应交税费						7,535.20	7,535.20
其他负债						80,000.00	80,000.00
负债总计	37,000,000.00					1,123,414.55	38,123,414.55
利率敏感度缺口	-33,545,924.59	10,968,980.00	169,058,000.00	120,853,000.00	20,064,000.00	61,342,572.74	348,740,628.15

注：1、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。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.13.4.1.2 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。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） 本期末（2021 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	1,387,328.55 -
	2. 市场利率上升 25 个基点	-1,369,990.52

注：1、上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末可比数据。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价,因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	58,730,281.02	16.84
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	320,943,980.00	92.03
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	379,674,261.02	108.87

注:1、本基金股票资产占基金资产的0%-30%,其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%;本基金投资同业存单的比例不超过基金资产的20%;每个交易日日终在扣除股票期权、股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金,无上年度末可比数据。

##### 7.4.13.4.3.2 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。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)
		本期末(2021年12月31日)
	1.股票基准指数下降100个	-475,677.08

	基点	
	2. 股票基准指数上升 100 个基点	475,677.08

注：1、本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末可比数据。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (一) 公允价值

##### 1、金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 2、持续的以公允价值计量的金融工具

##### (1) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为 59,680,756.53 元，属于第二层次的余额为 319,993,504.49 元，无属于第三层次的余额。

##### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### (3) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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

##### 3、非持续的以公允价值计量的金融工具

本基金本期末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

##### 4、不以公允价值计量的金融工具

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

(二) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	58,730,281.02	15.18
	其中：股票	58,730,281.02	15.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	320,943,980.00	82.96
	其中：债券	320,943,980.00	82.96
	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	3,434,953.77	0.89
8	其他各项资产	3,754,827.91	0.97
9	合计	386,864,042.70	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	22,659,025.42	6.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	26,987,800.00	7.74
K	房地产业	7,815,850.00	2.24
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	1,233,400.00	0.35
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	29,491.80	0.01
S	综合	-	-
	合计	58,730,281.02	16.84

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601939	建设银行	1,000,000	5,860,000.00	1.68
2	002142	宁波银行	145,000	5,550,600.00	1.59
3	600030	中信证券	200,000	5,282,000.00	1.51
4	300059	东方财富	100,000	3,711,000.00	1.06
5	300263	隆华科技	250,000	2,550,000.00	0.73
6	000001	平安银行	150,000	2,472,000.00	0.71
7	000739	普洛药业	69,957	2,454,791.13	0.70
8	601398	工商银行	500,000	2,315,000.00	0.66
9	002050	三花智控	90,000	2,277,000.00	0.65
10	000333	美的集团	30,000	2,214,300.00	0.63
11	601155	新城控股	75,000	2,184,750.00	0.63
12	000656	金科股份	375,000	1,680,000.00	0.48
13	002859	洁美科技	45,000	1,674,000.00	0.48
14	600383	金地集团	120,000	1,556,400.00	0.45
15	600690	海尔智家	50,000	1,494,500.00	0.43
16	600048	保利发展	90,000	1,406,700.00	0.40
17	603986	兆易创新	7,500	1,318,875.00	0.38
18	603136	天目湖	70,000	1,233,400.00	0.35
19	600837	海通证券	100,000	1,226,000.00	0.35
20	000636	风华高科	40,000	1,192,000.00	0.34
21	002996	顺博合金	75,000	1,097,250.00	0.31
22	002241	歌尔股份	20,000	1,082,000.00	0.31
23	605007	五洲特纸	47,000	1,081,470.00	0.31
24	601233	桐昆股份	50,000	1,059,000.00	0.30

25	000002	万科 A	50,000	988,000.00	0.28
26	603799	华友钴业	8,000	882,480.00	0.25
27	601717	郑煤机	75,000	869,250.00	0.25
28	300775	三角防务	15,200	743,128.00	0.21
29	603899	晨光文具	10,000	645,100.00	0.18
30	601166	兴业银行	30,000	571,200.00	0.16
31	603230	内蒙新华	1,140	29,491.80	0.01
32	001296	长江材料	310	18,376.80	0.01
33	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
34	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601939	建设银行	6,063,000.00	1.74
2	002142	宁波银行	5,583,227.94	1.60
3	600030	中信证券	4,999,962.00	1.43
4	300059	东方财富	3,477,896.00	1.00
5	300263	隆华科技	3,047,040.00	0.87
6	000001	平安银行	2,825,044.00	0.81
7	000933	神火股份	2,755,891.32	0.79
8	000739	普洛药业	2,653,775.84	0.76
9	300775	三角防务	2,590,309.00	0.74
10	601398	工商银行	2,360,000.00	0.68
11	601155	新城控股	2,354,921.00	0.68
12	000656	金科股份	2,298,824.00	0.66
13	601600	中国铝业	2,266,689.00	0.65
14	600383	金地集团	2,242,016.00	0.64
15	000333	美的集团	2,198,330.00	0.63
16	600089	特变电工	2,183,131.00	0.63
17	002050	三花智控	2,158,632.00	0.62
18	601088	中国神华	2,145,265.00	0.62
19	600426	华鲁恒升	1,945,378.40	0.56
20	600837	海通证券	1,892,053.00	0.54

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。

### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	000933	神火股份	2,257,012.00	0.65
2	600089	特变电工	2,101,155.70	0.60
3	601088	中国神华	2,024,451.00	0.58
4	601600	中国铝业	1,881,400.00	0.54
5	300776	帝尔激光	1,874,224.87	0.54
6	300775	三角防务	1,562,509.00	0.45
7	600426	华鲁恒升	1,516,988.00	0.43
8	600438	通威股份	1,509,905.00	0.43
9	601995	中金公司	1,450,000.00	0.42
10	601877	正泰电器	1,230,000.00	0.35
11	002466	天齐锂业	1,130,619.00	0.32
12	688981	中芯国际	1,099,956.58	0.32
13	600519	贵州茅台	924,219.00	0.27
14	600383	金地集团	916,400.00	0.26
15	002594	比亚迪	883,080.00	0.25
16	002258	利尔化学	849,561.00	0.24
17	603678	火炬电子	701,091.00	0.20
18	600837	海通证券	607,500.00	0.17
19	300593	新雷能	527,306.00	0.15
20	000002	万科 A	518,097.00	0.15

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

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本(成交)总额	89,453,116.61
卖出股票收入(成交)总额	27,989,078.92

注：买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，“买入金额”按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，“卖出金额”按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。



## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	170,162,000.00	48.79
	其中：政策性金融债	40,032,000.00	11.48
4	企业债券	100,714,000.00	28.88
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,372,980.00	0.39
8	同业存单	48,695,000.00	13.96
9	其他	-	-
10	合计	320,943,980.00	92.03

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	112112115	21 北京银行 CD115	500,000	48,695,000.00	13.96
2	2080386	20 沪地产 02	300,000	30,345,000.00	8.70
3	188571	21 海通 07	300,000	30,159,000.00	8.65
4	188690	21 华宝 01	300,000	30,051,000.00	8.62
5	188794	21 兴业 S2	300,000	29,991,000.00	8.60

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期内，本基金未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

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

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

### 8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	19,121.64
2	应收证券清算款	1,051,582.60
3	应收股利	-
4	应收利息	2,683,816.05
5	应收申购款	307.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,754,827.91

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127011	中鼎转 2	955,980.00	0.27

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
万家招瑞回报一年持有期混合 A	2,507	128,714.12	497,047.05	0.15%	322,189,263.68	99.85%
万家招瑞回报一年持有期混合 C	1,780	15,188.77	-	-	27,036,016.57	100.00%
合计	4,232	82,637.60	497,047.05	0.14%	349,225,280.25	99.86%

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）。

### 9.2 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
基金管理人所有从业人员持有本基金	万家招瑞回报一年持有期混合 A	278,601.97	0.0863%
	万家招瑞回报一年持有期混合 C	1,000.12	0.0037%
	合计	279,602.09	0.0799%

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	万家招瑞回报一年持有期混合 A	0
	万家招瑞回报一年持有期混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	万家招瑞回报一年持有期混合 A	0
	万家招瑞回报一年持有期混合 C	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家招瑞回报一年 持有期混合 A	万家招瑞回报一年 持有期混合 C
基金合同生效日（2021 年 8 月 17 日）基金 份额总额	322,104,142.49	26,742,889.26
基金合同生效日起至报告期期末基金总申 购份额	582,168.24	293,127.31
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总 赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分 变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	322,686,310.73	27,036,016.57

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

2021 年 3 月 16 日，公司聘任陈广益先生担任公司总经理。

2021 年 7 月 20 日，公司聘任戴晓云女士担任公司副总经理。

2021 年 7 月 20 日，李杰先生因个人原因离职，不再担任本公司副总经理职务。

2021 年 7 月 24 日，公司聘任王静女士担任公司副总经理。

2021 年 8 月 28 日，满黎先生因个人原因离职，不再担任本公司副总经理职务。

基金托管人：

自 2021 年 10 月 27 日起，刘波先生不再担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期期内基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自基金合同生效日起由立信会计师事务所（特殊普通合伙）为基金进行审计。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	1	63,300,397.65	54.05%	58,951.45	54.26%	-
西南证券	1	51,698,943.65	44.14%	48,147.06	44.31%	-

南京证券	1	2,123,994.85	1.81%	1,553.26	1.43%	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	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：

本基金为本报告期内成立的基金，上述席位均为新增席位。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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
华泰证券	30,257,073.97	97.16%	1,363,600,000.00	100.00%	-	-



西南证券	885,449.09	2.84%	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件
- 2、《万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同》
- 3、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程
- 4、本报告期内在中国证监会指定媒介公开披露的基金净值、更新招募说明书及其他临时公告
- 5、万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金 2021 年年度报告原文
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议
- 7、《万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金基金托管协议》

### 13.2 存放地点

基金管理人的办公场所，并登载于基金管理人网站：[www.wjasset.com](http://www.wjasset.com)。

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司

2022 年 3 月 30 日