

万家人工智能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：中国建设银行股份有限公司

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、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。本半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。

基金托管人中国建设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、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料已经审计，立信会计师事务所为本基金出具了标准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 1 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告	11
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.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	17
§5 托管人报告	18
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
§6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
§7 年度财务报表	22
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
§8 投资组合报告	61
8.1 期末基金资产组合情况.....	61
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	61
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.....	62
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	76
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.....	76
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.....	76

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	76
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	76
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	76
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	76
8.12	投资组合报告附注	77
§ 9	基金份额持有人信息	78
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	78
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	78
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	78
§ 10	开放式基金份额变动	79
§ 11	重大事件揭示	80
11.1	基金份额持有人大会决议	80
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	80
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	80
11.4	基金投资策略的改变	80
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	80
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	80
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	80
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	84
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	84
§ 13	备查文件目录	85
13.1	备查文件目录	85
13.2	存放地点	85
13.3	查阅方式	85

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家人工智能混合型证券投资基金	
基金简称	万家人工智能混合	
基金主代码	006281	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 1 月 25 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	142,280,496.43 份	
下属分级基金的基金简称:	万家人工智能混合 A	万家人工智能混合 C
下属分级基金的交易代码:	006281	014162
报告期末下属分级基金的份额总额	136,166,236.79 份	6,114,259.64 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,通过深入研究并积极投资与人工智能主题相关的优质上市公司,分享其发展和成长的机会,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、大类资产配置策略;2、股票投资策略(1)人工智能主题的界定、(2)个股投资策略、(3)存托凭证投资策略)3、债券投资策略;4、资产支持证券等品种投资策略;5、可转换债券投资策略;6、中小企业私募债券投资策略;7、其他金融衍生产品投资策略(1)股指期货投资策略、(2)国债期货投资策略、(3)股票期权投资策略、(4)权证投资策略);8、融资交易策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×65% + 上证国债指数收益率×35%
风险收益特征	本基金为混合型基金,理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	万家基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李申
	联系电话	021-60637102
	电子邮箱	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话	4008880800	021-60637111
传真	021-38909627	021-60635778
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层(名义楼层 9 层)	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	中国(上海)自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层(名义楼层 9 层)	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码	200122	100033
法定代表人	方一天	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.wjasset.com
基金年度报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 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		2020 年		2019 年 1 月 25 日(基金合同生效日)-2019 年 12 月 31 日	
	万家人工智能混合 A	万家人工智能混合 C	万家人工智能混合 A	万家人工智能混合 C	万家人工智能混合 A	万家人工智能混合 C
本期已实现收益	49,021,011.70	-78,827.66	15,055,464.56	-	7,996,734.66	-
本期利润	34,150,120.55	-182,372.46	38,115,762.57	-	14,044,663.69	-
加权平均基金份额本期利润	0.3556	-0.0939	0.9507	-	0.1739	-
本期加权平均净值利润率	12.51%	-3.11%	56.81%	-	17.05%	-
本期基金份额净值增长率	32.42%	-6.45%	85.83%	-	20.99%	-
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
期末可供分配利润	186,951,908.96	12,081,773.69	35,078,510.51	-	4,815,762.12	-
期末可供分配基金份额利润	1.3730	1.9760	0.6152	-	0.1683	-
期末基金资产净值	405,413,410.89	18,196,033.33	128,193,039.45	-	34,617,419.26	-
期末基金份额净值	2.9773	2.9760	2.2484	-	1.2099	-
3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
基金份额累计净值增长率	197.73%	-6.45%	124.84%	-	20.99%	-

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、自 2021 年 11 月 19 日起,增设本基金 C 类份额,详情请参阅相关公告。

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

万家人工智能混合 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	-3.11%	1.67%	1.70%	0.48%	-4.81%	1.19%
过去六个月	7.99%	2.17%	-0.61%	0.61%	8.60%	1.56%
过去一年	32.42%	2.04%	1.29%	0.70%	31.13%	1.34%
自基金合同生效起至今	197.73%	1.79%	42.90%	0.83%	154.83%	0.96%

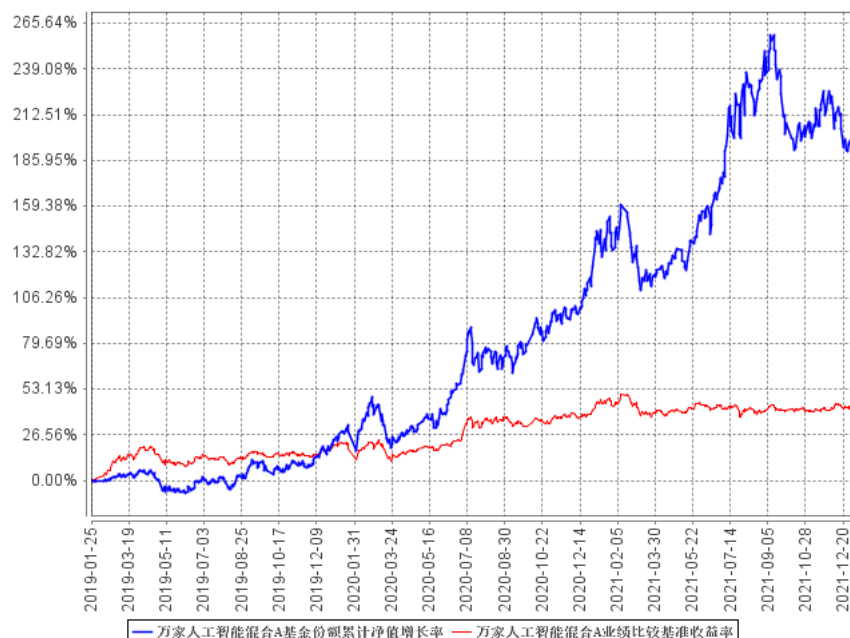
万家人工智能混合 C

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
自基金合同生效起至今	-6.45%	1.67%	1.88%	0.49%	-8.33%	1.18%

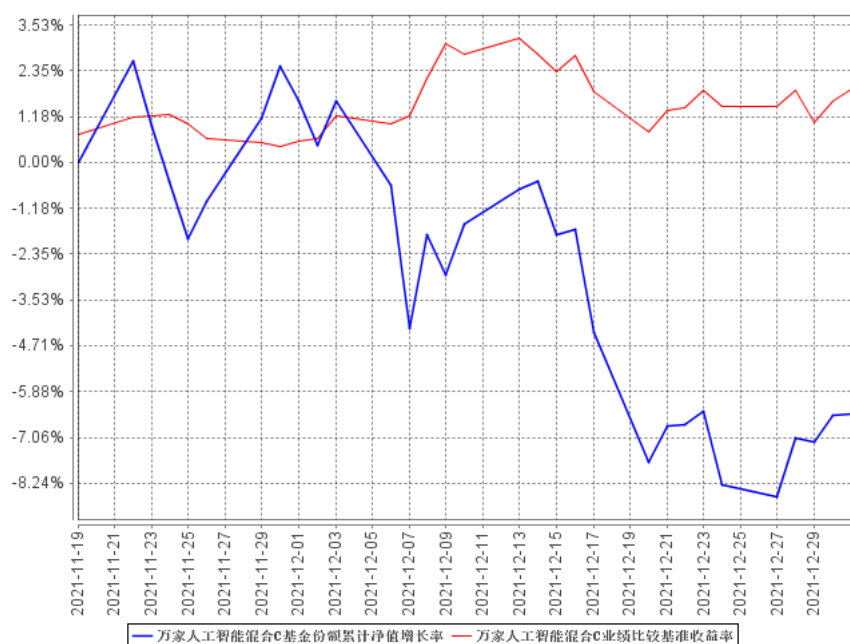
注:自 2021 年 11 月 19 日起,增设本基金 C 类份额,详情请参阅相关公告。

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

万家人工智能混合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



万家人工智能混合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

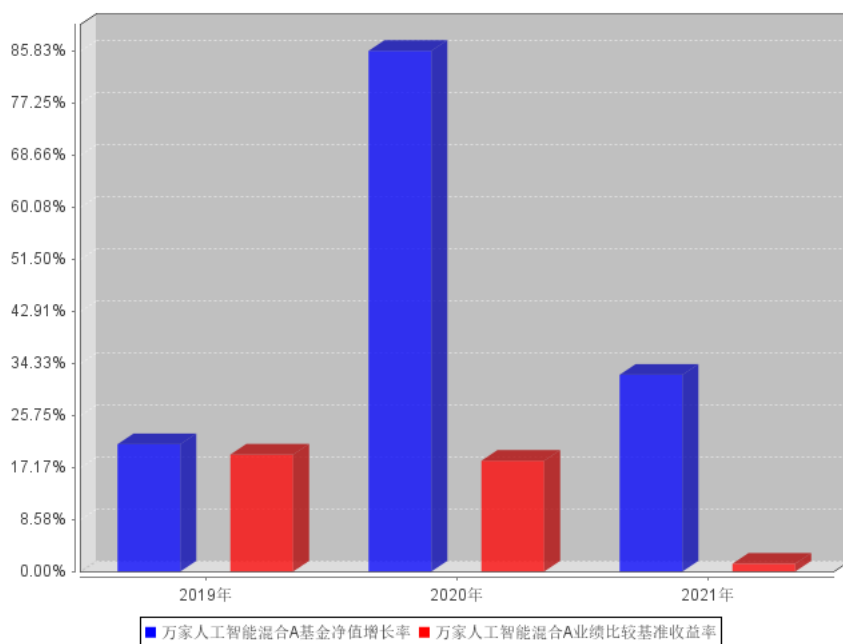


注：1、本基金成立于 2019 年 01 月 25 日，根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

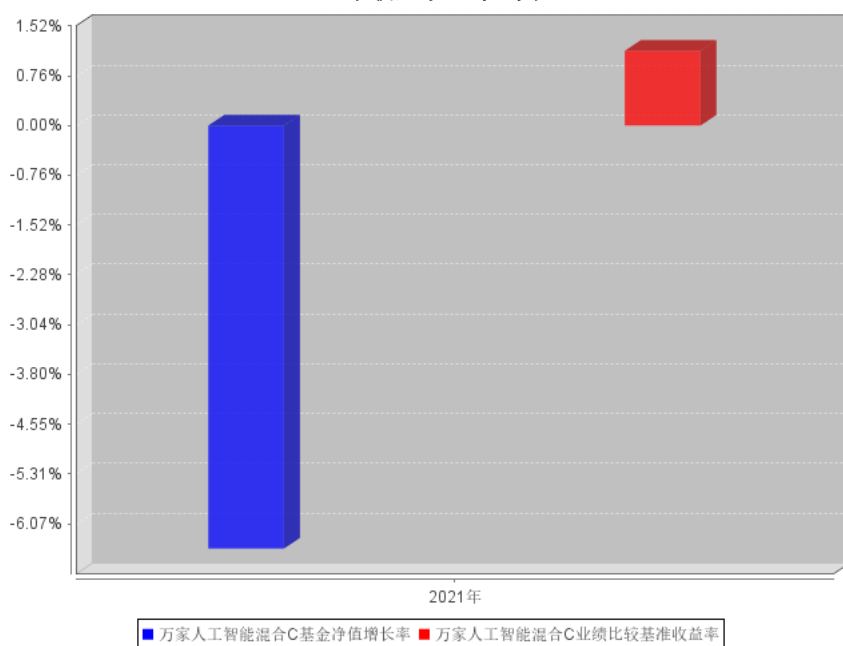
2、自 2021 年 11 月 19 日起，增设本基金 C 类份额，详情请参阅相关公告。

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

万家人工智能混合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



万家人工智能混合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（2019年1月25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		
耿嘉洲	万家人工智能混合型证券投资基金的基金经理	2020 年 5 月 14 日	-	8.5 年	2012 年 7 月加入万家基金管理有限公司，先后担任投资研究部研究员、专户投资部投资经理、投资研究部基金经理助

					理等职务
--	--	--	--	--	------

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

在投资决策上:(1)公司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

在 2021 年四季报中,我们判断未来 1-2 个季度在经济持续下滑压力下政策依然持续转向、财政和货币政策持续发力、总需求预计持续低迷,新能源为稳增长让路、机构重仓股预计持续跑输题材股、市场缺乏具有足够持续性和强度的强势方向。回顾来看我们的判断在过去 2 个月内基本准确,成长方向调整较多,而稳增长表现相对强势。

复盘一季度基本面来看:政策制定层面为稳定经济增长做出了较多努力,包括但不限于对双碳政策的持续纠偏、地产因城施策的政策调整、财政和货币的双向发力等,但从社融数据和微观调研层面来看,企业尤其是中小企业普遍信心不足、总需求仍然比较低迷,符合稳增长发力初期的特征,后续或仍需要持续提升政策力度直至经济增长信心企稳;另外,我们观察到政策制定层面面对双碳的态度又有所回转,对于新旧能源接替的态度在短期摇摆后仍然体现出较强的政策定力,即面对短期压力时仍然要提升新能源推进速度,反映在资本市场层面则体现为风光储在调整中的相对强势和相对更早的见底回升。

一季度基金操作中,我们继续维持了一些中小盘标的的配置、并在基金合同允许的范围内尽量向价值风格和传统经济链条进行了倾斜,站在目前 2 月底的时点来看,稳增长的发力起码在市场参与者的认知方面达成了较强的共识,随着政策的持续推出和后续两会经济增长目标的设定,我们认为稳增长方向将阶段性达到高点,从持续性来看预计地产链条会优于传统基建链条,而随着市场参与者对于经济企稳信心的提升,成长风格预计将阶段性占据上风。基于此判断,我们在此时点上已经对传统基建方向进行了减持、并相应增配了年初减持的成长方向,以求在接下来的反弹阶段获取更好的收益弹性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家人工智能混合 A 基金份额净值为 2.9773 元,本报告期基金份额净值增长率为 32.42%,A 类份额同期业绩比较基准收益率为 1.29%;截至本报告期末万家人工智能混合 C 基金份额净值为 2.9760 元,本报告期基金份额净值增长率为-6.45%,C 类份额同期业绩比较基准

收益率为 1.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

后续来看，我们认为地缘政治和地产政策力度仍然是一外一内的两个最主要不确定因素。地缘政治方面俄乌冲突对于大宗商品和资金风险偏好影响较大，我们倾向于认为这场冲突的持续时间可能会长于之前市场的预期，大宗品特别是能源价格可能会在较长时间内维持较高水平，可以看到西方制裁俄罗斯时有意避开了能源贸易项、以尽力控制能源价格上涨带来的通胀冲击，但高能源价格对于经济的潜在压力已经在让资本市场重新评估加息周期的节奏和力度，或将导致加息力度弱于前期市场的悲观判断，整体而言在这一阶段预计有利于 A 股的偏成长风格资产。国内地产政策方面，我们认为后续大概率会有更大力度的地产政策松绑、以刺激总需求提升，这可能会带动家电、建材等可选消费的景气度，但如果房价出现意外的快速上涨，对于资本市场而言可能产生一些压力。

展望未来一个季度，我们认为成长风格预计阶段性回暖，其中风光车储、半导体、军工需要配合其相应的淡旺季节奏和调整时长来看：预计 Q1 末光伏在上一年度抢装订单的集中出货和完工带动下相对强势，今年我们除关注组件和逆变器等受益方向外比较关注 TOPCon 产业链的超预期可能；半导体的一些细分行业基本面超出了前期市场悲观预期、而地缘冲突预计更有益于一些国产化 beta 标的，这两个将是我们的主要关注方向；风电我们认为下半年可能是更好的配置时点，相对更关注海风和零组件大型化中的紧缺环节；新能源车当前仍相对更看好上游和今年新挖掘的一些中游紧缺环节；军工我们认为可能仍需要在业绩层面获得验证，时点和优先级排序要相对靠后一些。

最后，我们接下来仍然需要紧密观察美联储动作，如果美联储在上半年意外转鸽，可能成长方向走强会更早、更有持续性，否则可能上半年仍以反弹行情为主，下半年才会出现更具可持续性的配置行情。

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

本基金报告期内未实施利润分配。

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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 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 ZA30202 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	万家人工智能混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>我们审计了万家人工智能混合型证券投资基金（以下简称“万家人工智能混合”）财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年 1 月 1 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，公允反映了万家人工智能混合 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 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，我们独立于万家人工智能混合，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>万家人工智能混合的基金管理人万家基金管理有限公司管理层（以下简称管理层）负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估万家人工智能混合的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督万家人工智能混合的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的	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

<p>责任</p>	<p>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，就可能对万家人工智能混合持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致万家人工智能混合不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与管理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，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。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>立信会计师事务所（特殊普通合伙）</p>

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：万家人工智能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	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	45,475,443.83	8,853,370.64
结算备付金		2,281,376.91	306,082.12
存出保证金		221,114.24	66,628.59
交易性金融资产	7.4.7.2	382,642,320.67	119,970,609.50
其中：股票投资		382,642,320.67	119,970,609.50
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	6,062.39	1,173.01
应收股利		-	-
应收申购款		761,896.82	848,266.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		431,388,214.86	130,046,130.20
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		4,109,649.94	-
应付赎回款		1,561,925.80	967,723.79
应付管理人报酬		539,607.98	142,374.20
应付托管费		89,934.66	44,090.64
应付销售服务费		4,955.68	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,305,544.87	537,871.93
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	167,151.71	161,030.19
负债合计		7,778,770.64	1,853,090.75
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	142,280,496.43	57,016,140.22
未分配利润	7.4.7.10	281,328,947.79	71,176,899.23
所有者权益合计		423,609,444.22	128,193,039.45
负债和所有者权益总计		431,388,214.86	130,046,130.20

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，万家人工智能混合 A 基金份额净值 2.9773 元，基金份额总额 136,166,236.79 份；万家人工智能混合 C 基金份额净值 2.9760 元，基金份额总额 6,114,259.64 份。万家人工智能混合份额总额合计为 142,280,496.43 份。

7.2 利润表

会计主体：万家人工智能混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		44,452,784.08	40,460,582.31
1.利息收入		118,907.16	35,903.55
其中：存款利息收入	7.4.7.11	118,331.44	35,552.47
债券利息收入		575.72	351.08
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）		56,962,510.00	16,472,438.59
其中：股票投资收益	7.4.7.12	55,100,172.39	15,273,703.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	1,040,152.40	790,163.15
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	822,185.21	408,571.74
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-14,974,435.95	23,060,298.01
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	2,345,802.87	891,942.16

列)			
减：二、费用		10,485,035.99	2,344,819.74
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,098,909.64	991,342.27
2. 托管费	7.4.10.2.2	683,151.61	165,223.68
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	5,082.90	-
4. 交易费用	7.4.7.19	5,496,477.97	1,051,897.55
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1.54	1.27
7. 其他费用	7.4.7.20	201,412.33	136,354.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		33,967,748.09	38,115,762.57
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		33,967,748.09	38,115,762.57

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家人工智能混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 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）	57,016,140.22	71,176,899.23	128,193,039.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	33,967,748.09	33,967,748.09
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）	85,264,356.21	176,184,300.47	261,448,656.68
其中：1. 基金申购款	277,689,036.40	533,252,878.00	810,941,914.40
2. 基金赎回款	-192,424,680.19	-357,068,577.53	-549,493,257.72
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	142,280,496.43	281,328,947.79	423,609,444.22

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	金净值)		
一、期初所有者权益（基金净值）	28,612,606.06	6,004,813.20	34,617,419.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	38,115,762.57	38,115,762.57
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）	28,403,534.16	27,056,323.46	55,459,857.62
其中：1. 基金申购款	137,850,302.50	96,850,124.83	234,700,427.33
2. 基金赎回款	-109,446,768.34	-69,793,801.37	-179,240,569.71
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）	57,016,140.22	71,176,899.23	128,193,039.45

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

万家人工智能混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予万家人工智能混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2018]1198 号文）批准，由万家基金管理有限公司作为基金管理人于 2018 年 12 月 24 日至 2019 年 1 月 22 日向社会公开募集，募集期结束经立信会计师事务所（特殊普通合伙）验资并出具信会师报字[2019]第 ZA30054 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2019 年 1 月 25 日生效。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期限不定期。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 220,432,072.85 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币

22,997.94 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 22,455,070.79 元，折合 22,455,070.79 份基金份额。本基金的基金管理人为万家基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金主要投资具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、股指期货、国债期货、股票期权、权证以及债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可交换公司债券、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的 50%-95%，其中，投资于人工智能主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；权证投资占基金资产净值的 0-3%；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以后，本基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×65%+上证国债指数收益率×35%。

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》、《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 1 月 1 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。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

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

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

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

2、金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;

或者（3）该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

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

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分

别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

- (1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率逐日计提；
- (2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；
- (3) 本基金 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 0.80%。
- (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) 《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；
- (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) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规规定、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，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

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	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	45,475,443.83	8,853,370.64
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：	45,475,443.83	8,853,370.64

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	368,508,529.58	382,642,320.67	14,133,791.09
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	368,508,529.58	382,642,320.67	14,133,791.09
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	90,862,382.46	119,970,609.50	29,108,227.04
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	90,862,382.46	119,970,609.50	29,108,227.04

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有各项买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	4,618.37	988.37
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	1,129.26	151.47
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	205.31	0.17
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	109.45	33.00
合计	6,062.39	1,173.01

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,305,544.87	537,871.93
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,305,544.87	537,871.93

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	上年度末 2020 年 12 月 31 日
----	-------------------------	--------------------------

应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	2,151.71	1,030.19
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	165,000.00	160,000.00
合计	167,151.71	161,030.19

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

万家人工智能混合 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	57,016,140.22	57,016,140.22
本期申购	271,398,012.78	271,398,012.78
本期赎回（以“-”号填列）	-192,247,916.21	-192,247,916.21
- 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	136,166,236.79	136,166,236.79

金额单位：人民币元

万家人工智能混合 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	6,291,023.62	6,291,023.62
本期赎回（以“-”号填列）	-176,763.98	-176,763.98
- 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	6,114,259.64	6,114,259.64

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

万家人工智能混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	35,078,510.51	36,098,388.72	71,176,899.23
本期利润	49,021,011.70	-14,870,891.15	34,150,120.55
本期基金份额交易产生的变动数	102,852,386.75	61,067,767.57	163,920,154.32
其中：基金申购款	327,178,730.06	193,463,709.74	520,642,439.80
基金赎回款	-224,326,343.31	-132,395,942.17	-356,722,285.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	186,951,908.96	82,295,265.14	269,247,174.10

单位：人民币元

万家人工智能混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	-78,827.66	-103,544.80	-182,372.46
本期基金份额交易产生的变动数	13,369,528.58	-1,105,382.43	12,264,146.15
其中：基金申购款	13,760,128.15	-1,149,689.95	12,610,438.20
基金赎回款	-390,599.57	44,307.52	-346,292.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,290,700.92	-1,208,927.23	12,081,773.69

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	92,919.57	30,344.19
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	21,932.11	3,925.01
其他	3,479.76	1,283.27
合计	118,331.44	35,552.47

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

卖出股票成交总额	1,728,382,019.93	330,685,067.57
减：卖出股票成本总额	1,673,281,847.54	315,411,363.87
买卖股票差价收入	55,100,172.39	15,273,703.70

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1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	1,040,152.40	790,163.15
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	1,040,152.40	790,163.15

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1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	9,292,704.54	4,912,448.30
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	8,238,799.64	4,115,924.60
减：应收利息总额	13,752.50	6,360.55
买卖债券差价收入	1,040,152.40	790,163.15

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	822,185.21	408,571.74
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	822,185.21	408,571.74

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 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-14,974,435.95	23,060,298.01
——股票投资	-14,974,435.95	23,060,298.01
——债券投资	-	-
——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	-14,974,435.95	23,060,298.01

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	2,285,101.61	887,610.62
转换费收入	60,701.26	4,331.54
合计	2,345,802.87	891,942.16

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	5,496,477.97	1,051,897.55
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	5,496,477.97	1,051,897.55

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	45,000.00	30,000.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
其他	360.00	360.00
银行汇划费用	18,052.33	7,994.97
债券帐户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	201,412.33	136,354.97

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
建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中泰证券股份有限公司	基金管理人的股东
新疆国际实业股份有限公司	基金管理人的股东
齐河众鑫投资有限公司	基金管理人的股东
万家共赢资产管理有限公司	基金管理人的子公司
万家财富基金销售（天津）有限公司	基金管理人的子公司、基金销售机构
上海万家朴智投资管理有限公司	基金管理人控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
中泰证券股份有 限公司	1,954,236,038.77	53.37%	707,059,997.18	100.00%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
中泰证券股份有 限公司	14,154,584.70	87.22%	9,034,371.80	100.00%

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中泰证券股份有限公司	1,819,967.11	53.37%	443,334.10	33.96%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中泰证券股份有限公司	658,487.36	100.00%	537,871.93	100.00%

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	4,098,909.64
其中：支付销售机构的客户维护费	1,409,303.94	360,681.78

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：

$$H = E \times 1.50\% \text{ 年管理费率} \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。

若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	683,151.61	165,223.68

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

算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。

若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

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 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家人工智能混合 A	万家人工智能混合 C	合计
万家基金股份有限公司	-	968.92	968.92
中泰证券股份有限公司	-	1,889.95	1,889.95
合计	-	2,858.87	2,858.87
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家人工智能混合 A	万家人工智能混合 C	合计
合计	-	-	-

注：销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.80% 年费率计提。计算方法如下：

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

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，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

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

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

7.4.10.4 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

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

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

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

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

份额单位：份

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	万家人工智能混合 A	万家人工智能混合 C
基金合同生效日（2019 年 1 月 25 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	11,016,976.47	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	11,016,976.47	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	万家人工智能混合 A	万家人工智能混合 C
基金合同生效日（2019 年 1 月 25 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	11,016,976.47	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	11,016,976.47	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	19.3226%	-

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

份额单位：份

万家人工智能混合 A				
关联方名称	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中泰证券股份有限公司	3,204,704.98	2.3535%	-	-

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 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	45,475,443.83	92,919.57	8,853,370.64	30,344.19

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，活期存款按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券

7.4.10.8 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

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	新股上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
300774	倍杰特	2021 年 7 月 26 日	2022 年 2 月 16 日	创业板股票流通受限	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021 年 8 月 4 日	2022 年 2 月 14 日	创业板股票流通受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300854	中兰环保	2021 年 9 月 8 日	2022 年 3 月 16 日	创业板股票流通受限	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
300994	久祺股份	2021 年 8 月 2 日	2022 年 2 月 14 日	创业板股票流通受限	11.90	45.45	409	4,867.10	18,589.05	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	创业板股票流通受限	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301021	英诺	2021 年	2022	创业板	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-

	激光	6月28日	2021年7月6日	2022年1月6日	创业板股票受限	股 流 受							
301025	读客文化	2021年7月6日	2021年7月6日	2022年1月24日	创业板股票受限	业 股 流 受	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-	
301026	浩通科技	2021年7月8日	2021年7月8日	2022年1月17日	创业板股票受限	业 股 流 受	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-	
301027	华蓝集团	2021年7月8日	2021年7月8日	2022年1月19日	创业板股票受限	业 股 流 受	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-	
301028	东亚机械	2021年7月12日	2021年7月12日	2022年1月20日	创业板股票受限	业 股 流 受	5.31	13.50	605	3,212.55	8,167.50	-	
301029	怡合达	2021年7月14日	2021年7月14日	2022年1月24日	创业板股票受限	业 股 流 受	14.14	89.87	352	4,977.28	31,634.24	-	
301030	仕净科技	2021年7月15日	2021年7月15日	2022年1月24日	创业板股票受限	业 股 流 受	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-	
301032	新柴股份	2021年7月15日	2021年7月15日	2022年1月24日	创业板股票受限	业 股 流 受	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-	
301033	迈普医学	2021年7月15日	2021年7月15日	2022年1月26日	创业板股票受限	业 股 流 受	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-	

301035	润丰股份	2021年7月21日	2022年1月28日	创业板股票受限	业股流受	22.04	56.28	217	4,782.68	12,212.76	-
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年2月16日	创业板股票受限	业股流受	23.38	29.93	167	3,904.46	4,998.31	-
301037	保立佳	2021年7月21日	2022年2月7日	创业板股票受限	业股流受	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301038	深水规院	2021年7月22日	2022年2月7日	创业板股票受限	业股流受	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301039	中集车辆	2021年7月1日	2022年1月10日	创业板股票受限	业股流受	6.96	12.51	723	5,032.08	9,044.73	-
301040	中环海陆	2021年7月26日	2022年2月7日	创业板股票受限	业股流受	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301041	金百泽	2021年8月2日	2022年2月11日	创业板股票受限	业股流受	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301046	能辉科技	2021年8月10日	2022年2月17日	创业板股票受限	业股流受	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰重工	2021年8月11日	2022年2月28日	创业板股票受限	业股流受	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-

301049	超越科技	2021年8月17日	2022年2月24日	创业板股票受限	业股流受	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301050	雷电微力	2021年8月17日	2022年2月24日	创业板股票受限	业股流受	60.64	234.74	124	7,519.36	29,107.76	-
301052	果麦文化	2021年8月23日	2022年2月28日	创业板股票受限	业股流受	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	-
301053	远信工业	2021年8月25日	2022年3月1日	创业板股票受限	业股流受	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301055	张小泉	2021年8月26日	2022年3月7日	创业板股票受限	业股流受	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301056	森赫股份	2021年8月27日	2022年3月7日	创业板股票受限	业股流受	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301057	汇隆新材	2021年8月31日	2022年3月9日	创业板股票受限	业股流受	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301059	金三江	2021年9月3日	2022年3月14日	创业板股票受限	业股流受	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301060	兰卫医学	2021年9月6日	2022年3月14日	创业板股票	业股流	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-

			日	通 受							
301062	上海艾录	2021年9月7日	2022年3月14日	创业板股票受限	业股流受	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅股份	2021年9月9日	2022年3月24日	创业板股票受限	业股流受	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301066	万事利	2021年9月13日	2022年3月22日	创业板股票受限	业股流受	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
301068	大地海洋	2021年9月16日	2022年3月28日	创业板股票受限	业股流受	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021年9月16日	2022年3月28日	创业板股票受限	业股流受	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	创业板股票受限	业股流受	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	创业板股票受限	业股流受	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301078	孩子王	2021年9月30日	2022年4月14日	创业板股票受限	业股流受	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301079	邵阳液压	2021年10月	2022年4月	创业板	业股	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-

		11日	月19日	票流 通受 限						
301081	严牌 股份	2021年 10月 13日	2022 年4 月20 日	创业 板股 票流 通受 限	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301083	百胜 智能	2021年 10月 13日	2022 年4 月21 日	创业 板股 票流 通受 限	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301087	可孚 医疗	2021年 10月 15日	2022 年4 月25 日	创业 板股 票流 通受 限	93.09	75.34	189	17,594.01	14,239.26	-
301088	戎美 股份	2021年 10月 19日	2022 年4 月28 日	创业 板股 票流 通受 限	33.16	24.67	313	10,379.08	7,721.71	-
301089	拓新 药业	2021年 10月 20日	2022 年4 月27 日	创业 板股 票流 通受 限	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301090	华润 材料	2021年 10月 19日	2022 年4 月26 日	创业 板股 票流 通受 限	10.45	11.22	1,204	12,581.80	13,508.88	-
301091	深城 交	2021年 10月 20日	2022 年4 月29 日	创业 板股 票流 通受 限	36.50	31.31	372	13,578.00	11,647.32	-
301092	争光 股份	2021年 10月 21日	2022 年5 月5 日	创业 板股 票流 通受 限	36.31	35.52	235	8,532.85	8,347.20	-
301093	华兰	2021年	2022	创业	58.08	49.85	164	9,525.12	8,175.40	-

	股份	10月21日	年月日	55	板票通限	股流受							
301096	百诚医药	2021年12月13日	2022年月日	620	创板票通限	业股流受	79.60	78.53	119	9,472.40	9,345.07	-	
301098	金埔园林	2021年11月4日	2022年月日	512	创板票通限	业股流受	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-	
301099	雅创电子	2021年11月10日	2022年月日	523	创板票通限	业股流受	21.99	71.36	351	7,718.49	25,047.36	-	
301100	风光股份	2021年12月10日	2022年月日	617	创板票通限	业股流受	27.81	31.14	479	13,320.99	14,916.06	-	
301101	明月镜片	2021年12月9日	2022年月日	616	创板票通限	业股流受	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-	
301108	洁雅股份	2021年11月25日	2022年月日	66	创板票通限	业股流受	57.27	53.71	168	9,621.36	9,023.28	-	
301111	粤万年青	2021年11月30日	2022年月日	67	创板票通限	业股流受	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-	
301118	恒光股份	2021年11月9日	2022年月日	518	创板票通限	业股流受	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-	

301126	达嘉维康	2021年11月30日	2022年6月7日	创业板股票受限	业股流受	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-
301127	天源环保	2021年12月23日	2022年6月30日	创业板股票受限	业股流受	12.03	17.12	1,492	17,948.76	25,543.04	-
301136	招标股份	2021年12月31日	2022年1月11日	新上市	股上	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
301138	华研精机	2021年12月8日	2022年6月15日	创业板股票受限	业股流受	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301149	隆华新材	2021年11月3日	2022年5月10日	创业板股票受限	业股流受	10.07	16.76	1,020	10,271.40	17,095.20	-
301168	通灵股份	2021年12月2日	2022年6月10日	创业板股票受限	业股流受	39.08	52.13	289	11,294.12	15,065.57	-
301177	迪阿股份	2021年12月8日	2022年6月15日	创业板股票受限	业股流受	116.88	116.08	172	20,103.36	19,965.76	-
301179	泽宇智能	2021年12月1日	2022年6月8日	创业板股票受限	业股流受	43.99	50.77	194	8,534.06	9,849.38	-
301180	万祥科技	2021年11月9日	2022年5月16日	创业板股票受限	业股流受	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-

301182	凯旺科技	2021年12月16日	2022年6月23日	创业板股票受限	业股流受	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年6月24日	创业板股票受限	业股流受	27.85	27.46	389	10,833.65	10,681.94	-
301193	家联科技	2021年12月2日	2022年6月9日	创业板股票受限	业股流受	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年6月2日	创业板股票受限	业股流受	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301211	亨迪药业	2021年12月14日	2022年6月22日	创业板股票受限	业股流受	25.80	33.65	701	18,085.80	23,588.65	-
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年6月22日	创业板股票受限	业股流受	69.89	88.72	188	13,139.32	16,679.36	-
600941	中国移动	2021年12月24日	2022年1月5日	新股上市		57.58	57.58	18,720	1,077,897.60	1,077,897.60	-
600941	中国移动	2021年12月24日	2022年7月5日	主板股票受限	票流受限	57.58	57.58	43,681	2,515,151.98	2,515,151.98	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2022年1月10日	科创板股票受限	创股流受	21.96	93.40	1,703	37,397.88	159,060.20	-
688262	国芯	2021年	2022年	新股		41.98	41.98	3,484	146,258.32	146,258.32	-

	科技	12 月 28 日	年 月 日	1 未上市						
688280	精进电动-UW	2021 年 10 月 19 日	2022 年 4 月 27 日	科创板股票受限	13.78	13.63	7,954	109,606.12	108,413.02	-
688711	宏微科技	2021 年 8 月 25 日	2022 年 3 月 1 日	科创板股票受限	27.51	116.52	1,865	51,306.15	217,309.80	-
688789	宏华数科	2021 年 7 月 1 日	2022 年 1 月 10 日	科创板股票受限	30.28	258.86	1,120	33,913.60	289,923.20	-

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, 本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

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。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资。

7.4.13.3 流动性风险

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

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的同业存单及超短期融资券等，均在银行间同业市场交易。因此，本期末本基金的资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

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

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、存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	45,475,443.83	-	-	-	-	-	45,475,443.83
结算备付金	2,281,376.91	-	-	-	-	-	2,281,376.91
存出保证金	221,114.24	-	-	-	-	-	221,114.24
交易性金融资产	-	-	-	-	-	382,642,320.67	382,642,320.67
应收利息	-	-	-	-	-	6,062.39	6,062.39
应收申购款	6,115.00	-	-	-	-	755,781.82	761,896.82
资产总计	47,984,049.98	-	-	-	-	383,404,164.88	431,388,214.86
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	4,109,649.94	4,109,649.94
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,561,925.80	1,561,925.80
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	539,607.98	539,607.98
应付托管费	-	-	-	-	-	89,934.66	89,934.66
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,955.68	4,955.68

应付交易费用	-	-	-	-	-	1,305,544.87	1,305,544.87
其他负债	-	-	-	-	-	167,151.71	167,151.71
负债总计	-	-	-	-	-	7,778,770.64	7,778,770.64
利率敏感度缺口	47,984,049.98	-	-	-	-	-375,625,394.24	423,609,444.22
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	8,853,370.64	-	-	-	-	-	8,853,370.64
结算备付金	306,082.12	-	-	-	-	-	306,082.12
存出保证金	66,628.59	-	-	-	-	-	66,628.59
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-119,970,609.50	119,970,609.50
应收利息	-	-	-	-	-	1,173.01	1,173.01
应收申购款	-	-	-	-	-	848,266.34	848,266.34
资产总计	9,226,081.35	-	-	-	-	-120,820,048.85	130,046,130.20
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	967,723.79	967,723.79
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	142,374.20	142,374.20
应付托管费	-	-	-	-	-	44,090.64	44,090.64
应付交易费用	-	-	-	-	-	537,871.93	537,871.93
其他负债	-	-	-	-	-	161,030.19	161,030.19
负债总计	-	-	-	-	-	1,853,090.75	1,853,090.75
利率敏感度缺口	9,226,081.35	-	-	-	-	-118,966,958.10	128,193,039.45

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资。银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金主要投资于证券交易所上市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		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	382,642,320.67	90.33	119,970,609.50	93.59
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	382,642,320.67	90.33	119,970,609.50	93.59

注：股票资产占基金资产的 0%-95%；权证投资占基金资产净值的 0-3%；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保证金以后，本基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上表。

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	若股票基准指数发生变动而其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1. 股票基准指数下降 100 个基点	-3,513,762.10	-1,527,758.56
2. 股票基准指数上升 100 个基点	3,513,762.10	1,527,758.56	

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

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(一) 公允价值

1、金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

2、持续的以公允价值计量的金融工具

(1) 各层次金融工具公允价值

于 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 377,248,556.81 元，属于第二层次的余额为 5,393,763.86 元，无属于第三层次的余额。（2020 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为 117,839,032.79 元，属于第二层次的余额为 2,131,576.71 元，无属于第三层次的余额。）

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(3) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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

3、非持续的以公允价值计量的金融工具

本基金本期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

4、不以公允价值计量的金融工具

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

(二)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	382,642,320.67	88.70
	其中：股票	382,642,320.67	88.70
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	47,756,820.74	11.07
8	其他各项资产	989,073.45	0.23
9	合计	431,388,214.86	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	8,251,510.00	1.95
C	制造业	362,049,870.70	85.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,519.99	0.00
F	批发和零售业	74,642.93	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,765,836.64	0.89
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	8,372,892.16	1.98

N	水利、环境和公共设施管理业	46,894.75	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	46,383.72	0.01
S	综合	-	-
	合计	382,642,320.67	90.33

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资组合。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600745	闻泰科技	226,100	29,234,730.00	6.90
2	000733	振华科技	176,300	21,910,564.00	5.17
3	600038	中直股份	238,108	19,120,072.40	4.51
4	002371	北方华创	51,700	17,940,934.00	4.24
5	002049	紫光国微	79,100	17,797,500.00	4.20
6	300604	长川科技	308,200	17,721,500.00	4.18
7	002475	立讯精密	354,800	17,456,160.00	4.12
8	688037	芯源微	102,081	17,231,272.80	4.07
9	603290	斯达半导	45,000	17,145,000.00	4.05
10	600460	士兰微	314,900	17,067,580.00	4.03
11	600989	宝丰能源	938,900	16,299,304.00	3.85
12	002483	润邦股份	2,016,520	16,293,481.60	3.85
13	603606	东方电缆	312,100	15,967,036.00	3.77
14	300443	金雷股份	252,400	14,578,624.00	3.44
15	600141	兴发集团	384,500	14,564,860.00	3.44
16	000420	吉林化纤	2,752,300	14,504,621.00	3.42
17	002245	蔚蓝锂芯	513,900	14,137,389.00	3.34
18	002466	天齐锂业	119,300	12,765,100.00	3.01
19	300014	亿纬锂能	83,700	9,891,666.00	2.34
20	000792	盐湖股份	248,400	8,790,876.00	2.08
21	688265	南模生物	117,803	8,252,100.15	1.95
22	002192	融捷股份	63,400	8,251,510.00	1.95
23	688112	鼎阳科技	76,277	7,473,620.46	1.76
24	300750	宁德时代	12,400	7,291,200.00	1.72

25	002594	比亚迪	25,600	6,863,872.00	1.62
26	002318	久立特材	242,400	4,334,112.00	1.02
27	002531	天顺风能	211,300	4,097,107.00	0.97
28	600941	中国移动	62,401	3,593,049.58	0.85
29	688789	宏华数科	1,120	289,923.20	0.07
30	688711	宏微科技	1,865	217,309.80	0.05
31	688167	炬光科技	978	214,182.00	0.05
32	688087	英科再生	1,703	159,060.20	0.04
33	688262	国芯科技	3,484	146,258.32	0.03
34	688280	精进电动	7,954	108,413.02	0.03
35	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.02
36	301029	怡合达	352	31,634.24	0.01
37	603230	内蒙新华	1,140	29,491.80	0.01
38	301050	雷电微力	124	29,107.76	0.01
39	301127	天源环保	1,492	25,543.04	0.01
40	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.01
41	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.01
42	301211	亨迪药业	701	23,588.65	0.01
43	301177	迪阿股份	172	19,965.76	0.00
44	300994	久祺股份	409	18,589.05	0.00
45	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
46	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
47	301149	隆华新材	1,020	17,095.20	0.00
48	301221	光庭信息	188	16,679.36	0.00
49	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
50	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
51	301168	通灵股份	289	15,065.57	0.00
52	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
53	301100	风光股份	479	14,916.06	0.00
54	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
55	301087	可孚医疗	189	14,239.26	0.00
56	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
57	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
58	301090	华润材料	1,204	13,508.88	0.00
59	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
60	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
61	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
62	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
63	301035	润丰股份	217	12,212.76	0.00

64	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
65	301091	深城交	372	11,647.32	0.00
66	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
67	301190	善水科技	389	10,681.94	0.00
68	301179	泽宇智能	194	9,849.38	0.00
69	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
70	301096	百诚医药	119	9,345.07	0.00
71	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
72	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
73	301039	中集车辆	723	9,044.73	0.00
74	301108	洁雅股份	168	9,023.28	0.00
75	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
76	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
77	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
78	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
79	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
80	301092	争光股份	235	8,347.20	0.00
81	301093	华兰股份	164	8,175.40	0.00
82	301028	东亚机械	605	8,167.50	0.00
83	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
84	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
85	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
86	301088	戎美股份	313	7,721.71	0.00
87	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
88	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
89	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
90	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
91	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
92	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
93	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
94	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
95	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
96	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
97	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
98	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
99	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
100	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
101	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
102	301059	金三江	259	4,998.70	0.00

103	301036	双乐股份	167	4,998.31	0.00
104	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
105	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
106	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
107	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
108	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
109	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
110	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
111	301079	邵阳液压	140	3,474.80	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	002192	融捷股份	34,003,998.40	26.53
2	002371	北方华创	33,238,880.45	25.93
3	301177	迪阿股份	31,707,446.51	24.73
4	603613	国联股份	28,899,295.95	22.54
5	000762	西藏矿业	23,557,275.20	18.38
6	601127	小康股份	22,847,220.00	17.82
7	300750	宁德时代	22,807,228.00	17.79
8	600745	闻泰科技	22,693,683.16	17.70
9	600499	科达制造	22,616,467.00	17.64
10	600399	抚顺特钢	20,300,311.00	15.84
11	002714	牧原股份	19,237,503.13	15.01
12	688037	芯源微	19,187,737.47	14.97
13	600460	士兰微	18,560,002.02	14.48
14	300443	金雷股份	18,326,382.00	14.30
15	002837	英维克	18,201,196.82	14.20
16	300604	长川科技	18,122,628.00	14.14
17	603290	斯达半导	17,944,079.00	14.00
18	000672	上峰水泥	17,912,433.55	13.97
19	600801	华新水泥	17,863,467.27	13.93
20	603267	鸿远电子	17,775,001.00	13.87
21	600141	兴发集团	17,567,401.46	13.70

22	002240	盛新锂能	17,550,584.00	13.69
23	002475	立讯精密	17,297,326.30	13.49
24	600989	宝丰能源	17,157,954.00	13.38
25	000420	吉林化纤	16,915,595.00	13.20
26	601877	正泰电器	16,831,185.00	13.13
27	603606	东方电缆	16,711,984.37	13.04
28	600036	招商银行	16,537,599.00	12.90
29	600038	中直股份	16,475,428.64	12.85
30	603893	瑞芯微	16,421,734.09	12.81
31	000155	川能动力	16,306,101.62	12.72
32	300346	南大光电	16,235,841.00	12.67
33	002049	紫光国微	16,205,027.00	12.64
34	002006	精功科技	16,186,300.10	12.63
35	300648	星云股份	16,090,874.20	12.55
36	002483	润邦股份	15,883,753.28	12.39
37	000422	湖北宜化	15,758,131.10	12.29
38	600063	皖维高新	15,674,144.35	12.23
39	002074	国轩高科	15,672,327.48	12.23
40	688162	巨一科技	15,123,902.68	11.80
41	601155	新城控股	15,026,570.18	11.72
42	603690	至纯科技	14,810,367.00	11.55
43	601600	中国铝业	14,711,666.00	11.48
44	002459	晶澳科技	14,691,769.22	11.46
45	000983	山西焦煤	14,621,110.72	11.41
46	300850	新强联	14,208,079.93	11.08
47	600808	马钢股份	13,764,799.00	10.74
48	002460	赣锋锂业	13,739,551.74	10.72
49	603218	日月股份	13,541,182.76	10.56
50	600031	三一重工	13,538,515.00	10.56
51	601699	潞安环能	13,502,901.00	10.53
52	000301	东方盛虹	13,464,008.00	10.50
53	300193	佳士科技	13,105,578.38	10.22
54	002466	天齐锂业	12,688,615.00	9.90
55	002453	华软科技	12,550,992.00	9.79
56	002498	汉缆股份	12,498,654.80	9.75
57	002756	永兴材料	12,031,150.00	9.39

58	300014	亿纬锂能	11,973,774.00	9.34
59	002245	蔚蓝锂芯	11,871,575.00	9.26
60	300510	金冠股份	11,849,998.00	9.24
61	300035	中科电气	11,736,596.15	9.16
62	600438	通威股份	11,679,579.00	9.11
63	600418	江淮汽车	11,584,944.00	9.04
64	600985	淮北矿业	11,542,214.94	9.00
65	002176	江特电机	10,819,643.24	8.44
66	603938	三孚股份	10,795,093.00	8.42
67	300712	永福股份	10,625,330.50	8.29
68	300610	晨化股份	10,478,527.40	8.17
69	600888	新疆众和	10,342,241.34	8.07
70	300454	深信服	10,299,809.00	8.03
71	002795	永和智控	9,746,402.00	7.60
72	600519	贵州茅台	9,694,425.78	7.56
73	600096	云天化	9,323,754.00	7.27
74	300390	天华超净	8,900,232.00	6.94
75	002738	中矿资源	8,861,204.00	6.91
76	688005	容百科技	8,762,468.15	6.84
77	003022	联泓新科	8,664,852.00	6.76
78	688099	晶晨股份	8,605,929.00	6.71
79	688265	南模生物	8,573,440.44	6.69
80	688087	英科再生	8,498,101.89	6.63
81	688112	鼎阳科技	8,470,598.50	6.61
82	000792	盐湖股份	8,377,541.00	6.54
83	000789	万年青	8,316,198.50	6.49
84	600691	阳煤化工	8,249,124.88	6.43
85	300690	双一科技	8,166,913.50	6.37
86	002594	比亚迪	8,101,028.00	6.32
87	300073	当升科技	8,025,341.00	6.26
88	605222	起帆电缆	8,016,039.00	6.25
89	000001	平安银行	8,015,630.00	6.25
90	600782	新钢股份	8,013,400.56	6.25
91	300772	运达股份	7,903,425.00	6.17
92	601166	兴业银行	7,877,621.00	6.15
93	000858	五粮液	7,834,267.00	6.11

94	603501	韦尔股份	7,801,979.00	6.09
95	688680	海优新材	7,763,869.72	6.06
96	002108	沧州明珠	7,759,369.95	6.05
97	002304	洋河股份	7,759,323.00	6.05
98	688408	中信博	7,699,419.73	6.01
99	600926	杭州银行	7,694,747.82	6.00
100	688608	恒玄科技	7,694,339.44	6.00
101	600298	安琪酵母	7,638,906.00	5.96
102	002142	宁波银行	7,626,892.54	5.95
103	688131	皓元医药	7,601,205.13	5.93
104	603477	巨星农牧	7,509,894.13	5.86
105	603363	傲农生物	7,497,389.00	5.85
106	002340	格林美	7,458,575.00	5.82
107	603260	合盛硅业	7,457,270.00	5.82
108	300568	星源材质	7,432,665.60	5.80
109	000519	中兵红箭	7,425,181.00	5.79
110	002034	旺能环境	7,389,588.00	5.76
111	600577	精达股份	7,344,444.00	5.73
112	688599	天合光能	7,321,712.59	5.71
113	688550	瑞联新材	7,305,546.17	5.70
114	000776	广发证券	7,286,279.00	5.68
115	002028	思源电气	7,207,818.00	5.62
116	000933	神火股份	7,197,468.00	5.61
117	000656	金科股份	7,189,029.00	5.61
118	600753	东方银星	7,172,935.00	5.60
119	300365	恒华科技	7,049,759.00	5.50
120	000002	万科 A	7,021,743.00	5.48
121	300601	康泰生物	7,015,261.08	5.47
122	000807	云铝股份	7,008,675.40	5.47
123	002110	三钢闽光	7,003,382.00	5.46
124	000825	太钢不锈	7,000,568.00	5.46
125	000932	华菱钢铁	6,980,076.20	5.44
126	000959	首钢股份	6,973,361.60	5.44
127	002532	天山铝业	6,963,178.00	5.43
128	603916	苏博特	6,914,042.80	5.39
129	688696	极米科技	6,758,553.39	5.27

130	002128	电投能源	6,405,761.00	5.00
131	601985	中国核电	6,255,362.00	4.88
132	003816	中国广核	6,248,073.00	4.87
133	002185	华天科技	6,046,586.00	4.72
134	603005	晶方科技	6,027,078.20	4.70
135	688595	芯海科技	5,896,112.09	4.60
136	300059	东方财富	5,804,210.60	4.53
137	002409	雅克科技	5,631,194.00	4.39
138	603799	华友钴业	5,484,737.95	4.28
139	688025	杰普特	5,191,494.90	4.05
140	300236	上海新阳	5,055,681.00	3.94
141	603650	彤程新材	5,011,235.00	3.91
142	688012	中微公司	4,828,079.33	3.77
143	002407	多氟多	4,807,749.00	3.75
144	300233	金城医药	4,575,780.50	3.57
145	688023	安恒信息	4,566,169.81	3.56
146	605090	九丰能源	4,372,466.81	3.41
147	000938	紫光股份	4,355,219.25	3.40
148	603358	华达科技	4,326,072.58	3.37
149	603396	金辰股份	4,324,622.00	3.37
150	002386	天原股份	4,303,108.00	3.36
151	600110	诺德股份	4,287,508.43	3.34
152	300802	矩子科技	4,286,865.00	3.34
153	000723	美锦能源	4,281,420.24	3.34
154	688529	豪森股份	4,275,707.19	3.34
155	002531	天顺风能	4,260,966.00	3.32
156	300093	金刚玻璃	4,246,280.00	3.31
157	688798	艾为电子	4,244,190.56	3.31
158	002056	横店东磁	4,237,251.00	3.31
159	300502	新易盛	4,198,993.99	3.28
160	002092	中泰化学	4,190,170.00	3.27
161	603085	天成自控	4,188,788.00	3.27
162	002318	久立特材	4,175,862.00	3.26
163	301166	优宁维	4,160,000.00	3.25
164	601611	中国核建	4,155,058.16	3.24
165	601678	滨化股份	4,148,741.24	3.24

166	002555	三七互娱	4,141,785.00	3.23
167	002624	完美世界	4,140,974.00	3.23
168	002454	松芝股份	4,107,593.00	3.20
169	688022	瀚川智能	4,104,306.25	3.20
170	605589	圣泉集团	4,101,911.00	3.20
171	600285	羚锐制药	4,088,572.00	3.19
172	300438	鹏辉能源	4,039,787.00	3.15
173	601001	晋控煤业	4,038,240.95	3.15
174	300033	同花顺	3,992,780.00	3.11
175	300274	阳光电源	3,951,156.00	3.08
176	002169	智光电气	3,937,524.00	3.07
177	600188	兖矿能源	3,897,928.00	3.04
178	600546	山煤国际	3,882,238.89	3.03
179	601615	明阳智能	3,847,157.00	3.00
180	000683	远兴能源	3,846,013.94	3.00
181	000650	仁和药业	3,840,540.00	3.00
182	688277	天智航	3,753,823.69	2.93
183	300809	华辰装备	3,622,112.00	2.83
184	601238	广汽集团	3,597,879.44	2.81
185	600941	中国移动	3,593,049.58	2.80
186	300587	天铁股份	3,520,367.40	2.75
187	002046	国机精工	3,507,787.00	2.74
188	605016	百龙创园	3,490,291.53	2.72
189	603986	兆易创新	3,485,750.00	2.72
190	300223	北京君正	3,476,800.02	2.71
191	002353	杰瑞股份	3,463,156.00	2.70
192	601808	中海油服	3,462,562.00	2.70
193	300271	华宇软件	3,390,004.00	2.64
194	000875	吉电股份	3,353,983.00	2.62
195	688386	泛亚微透	3,270,450.73	2.55
196	603013	亚普股份	3,264,230.00	2.55
197	300887	谱尼测试	3,146,887.00	2.45
198	300642	透景生命	3,046,422.00	2.38
199	688071	华依科技	2,740,603.76	2.14
200	000596	古井贡酒	2,693,322.00	2.10

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603613	国联股份	42,299,056.03	33.00
2	002006	精功科技	28,010,045.00	21.85
3	301177	迪阿股份	27,206,980.26	21.22
4	600499	科达制造	25,376,100.43	19.80
5	603267	鸿远电子	24,727,201.46	19.29
6	002240	盛新锂能	24,262,596.00	18.93
7	002192	融捷股份	22,948,257.50	17.90
8	601877	正泰电器	22,187,095.00	17.31
9	601127	小康股份	21,008,267.00	16.39
10	000762	西藏矿业	20,729,288.59	16.17
11	600399	抚顺特钢	19,602,854.00	15.29
12	688162	巨一科技	19,249,600.87	15.02
13	000155	川能动力	18,977,177.72	14.80
14	002460	赣锋锂业	18,713,396.50	14.60
15	300648	星云股份	18,079,035.00	14.10
16	002459	晶澳科技	17,906,490.00	13.97
17	000672	上峰水泥	17,734,372.00	13.83
18	603893	瑞芯微	17,694,946.50	13.80
19	002714	牧原股份	17,106,800.48	13.34
20	300193	佳士科技	16,866,879.78	13.16
21	002837	英维克	16,687,778.21	13.02
22	002371	北方华创	16,438,503.00	12.82
23	300896	爱美客	16,366,290.00	12.77
24	600036	招商银行	16,334,495.00	12.74
25	600801	华新水泥	16,308,250.85	12.72
26	300750	宁德时代	15,455,487.00	12.06
27	000983	山西焦煤	15,035,226.59	11.73
28	002756	永兴材料	14,923,812.36	11.64
29	002709	天赐材料	14,851,238.80	11.59
30	002176	江特电机	14,804,409.80	11.55
31	600577	精达股份	14,423,995.84	11.25
32	002074	国轩高科	14,362,586.84	11.20
33	601600	中国铝业	14,051,822.00	10.96
34	300850	新强联	13,723,479.00	10.71

35	300454	深信服	13,606,864.00	10.61
36	601155	新城控股	13,185,213.00	10.29
37	603690	至纯科技	13,182,785.00	10.28
38	601699	潞安环能	13,026,514.00	10.16
39	600438	通威股份	12,848,254.28	10.02
40	300346	南大光电	12,821,387.91	10.00
41	600031	三一重工	12,566,026.58	9.80
42	603218	日月股份	12,550,528.72	9.79
43	600808	马钢股份	12,530,599.00	9.77
44	600985	淮北矿业	12,502,900.78	9.75
45	002453	华软科技	12,470,403.00	9.73
46	688087	英科再生	12,446,053.93	9.71
47	600063	皖维高新	12,422,336.00	9.69
48	603799	华友钴业	12,270,378.00	9.57
49	000422	湖北宜化	12,253,618.61	9.56
50	000301	东方盛虹	12,217,276.00	9.53
51	002498	汉缆股份	11,631,114.54	9.07
52	600753	东方银星	11,262,482.40	8.79
53	603938	三孚股份	11,225,396.80	8.76
54	300073	当升科技	11,017,905.00	8.59
55	600888	新疆众和	10,851,040.50	8.46
56	300035	中科电气	10,473,702.00	8.17
57	600418	江淮汽车	10,458,684.00	8.16
58	300568	星源材质	10,407,826.54	8.12
59	002594	比亚迪	10,044,805.00	7.84
60	300510	金冠股份	10,019,758.00	7.82
61	688005	容百科技	9,883,173.50	7.71
62	688696	极米科技	9,500,422.16	7.41
63	688408	中信博	9,196,607.22	7.17
64	002738	中矿资源	8,938,192.00	6.97
65	300610	晨化股份	8,601,482.50	6.71
66	688599	天合光能	8,553,236.87	6.67
67	002142	宁波银行	8,475,645.12	6.61
68	600519	贵州茅台	8,438,270.00	6.58
69	002795	永和智控	8,305,572.00	6.48
70	688608	恒玄科技	8,242,773.67	6.43
71	600298	安琪酵母	8,241,002.30	6.43
72	300390	天华超净	8,234,369.00	6.42

73	600926	杭州银行	8,218,249.00	6.41
74	605222	起帆电缆	8,139,398.00	6.35
75	300690	双一科技	7,980,652.50	6.23
76	600096	云天化	7,937,372.00	6.19
77	002028	思源电气	7,835,745.68	6.11
78	000333	美的集团	7,778,503.00	6.07
79	002108	沧州明珠	7,726,178.00	6.03
80	688099	晶晨股份	7,653,901.25	5.97
81	600690	海尔智家	7,539,885.00	5.88
82	003022	联泓新科	7,539,649.10	5.88
83	000519	中兵红箭	7,532,910.00	5.88
84	300712	永福股份	7,427,546.00	5.79
85	603477	巨星农牧	7,328,206.00	5.72
86	603501	韦尔股份	7,323,415.00	5.71
87	002304	洋河股份	7,310,800.00	5.70
88	688550	瑞联新材	7,244,416.65	5.65
89	002110	三钢闽光	7,221,720.00	5.63
90	688131	皓元医药	7,167,390.98	5.59
91	002034	旺能环境	7,039,797.65	5.49
92	603916	苏博特	6,893,057.49	5.38
93	601166	兴业银行	6,811,199.00	5.31
94	000001	平安银行	6,799,939.96	5.30
95	000776	广发证券	6,660,967.00	5.20
96	002759	天际股份	6,607,563.55	5.15
97	600691	阳煤化工	6,591,594.12	5.14
98	688025	杰普特	6,538,147.05	5.10
99	000002	万科 A	6,502,700.00	5.07
100	300365	恒华科技	6,443,278.00	5.03
101	688122	西部超导	6,389,552.64	4.98
102	000656	金科股份	6,360,395.00	4.96
103	603260	合盛硅业	6,338,558.10	4.94
104	002532	天山铝业	6,322,591.00	4.93
105	000807	云铝股份	6,312,078.00	4.92
106	603363	傲农生物	6,306,390.66	4.92
107	002340	格林美	6,296,333.94	4.91
108	600782	新钢股份	6,255,996.00	4.88
109	300772	运达股份	6,244,602.47	4.87
110	000825	太钢不锈	6,223,532.00	4.85

111	000789	万年青	6,209,636.05	4.84
112	003816	中国广核	6,132,305.00	4.78
113	601985	中国核电	6,066,280.00	4.73
114	688680	海优新材	6,036,235.70	4.71
115	002128	电投能源	5,905,998.00	4.61
116	000959	首钢股份	5,880,710.20	4.59
117	000933	神火股份	5,862,770.00	4.57
118	688022	瀚川智能	5,831,266.04	4.55
119	300059	东方财富	5,782,902.40	4.51
120	000858	五粮液	5,660,081.00	4.42
121	000723	美锦能源	5,556,581.42	4.33
122	300601	康泰生物	5,547,552.00	4.33
123	301166	优宁维	5,411,244.80	4.22
124	002409	雅克科技	5,353,104.92	4.18
125	002185	华天科技	5,299,075.00	4.13
126	000932	华菱钢铁	5,286,556.00	4.12
127	600110	诺德股份	5,182,934.00	4.04
128	002407	多氟多	5,100,886.00	3.98
129	605090	九丰能源	4,994,861.00	3.90
130	300236	上海新阳	4,942,280.00	3.86
131	688595	芯海科技	4,929,068.73	3.85
132	603650	彤程新材	4,904,685.57	3.83
133	688012	中微公司	4,831,934.65	3.77
134	603005	晶方科技	4,824,132.00	3.76
135	002475	立讯精密	4,645,931.00	3.62
136	300233	金城医药	4,635,610.82	3.62
137	002508	老板电器	4,502,852.01	3.51
138	002454	松芝股份	4,394,045.50	3.43
139	600285	羚锐制药	4,391,607.00	3.43
140	300587	天铁股份	4,379,445.54	3.42
141	000938	紫光股份	4,360,341.00	3.40
142	605589	圣泉集团	4,353,238.00	3.40
143	300093	金刚玻璃	4,266,815.00	3.33
144	603085	天成自控	4,213,573.00	3.29
145	603396	金辰股份	4,198,484.10	3.28
146	002169	智光电气	4,161,786.00	3.25
147	688023	安恒信息	4,159,868.95	3.25
148	002386	天原股份	4,109,117.20	3.21

149	688798	艾为电子	4,043,543.82	3.15
150	000651	格力电器	4,039,951.00	3.15
151	300438	鹏辉能源	4,022,977.00	3.14
152	002555	三七互娱	3,977,264.00	3.10
153	002624	完美世界	3,966,768.00	3.09
154	002056	横店东磁	3,948,116.00	3.08
155	300502	新易盛	3,927,232.46	3.06
156	603358	华达科技	3,921,864.00	3.06
157	688388	嘉元科技	3,906,881.51	3.05
158	300802	矩子科技	3,887,714.00	3.03
159	688529	豪森股份	3,881,622.87	3.03
160	002046	国机精工	3,871,411.00	3.02
161	601611	中国核建	3,860,351.00	3.01
162	601615	明阳智能	3,745,857.00	2.92
163	688277	天智航	3,592,406.33	2.80
164	300274	阳光电源	3,571,992.64	2.79
165	603013	亚普股份	3,541,001.00	2.76
166	002353	杰瑞股份	3,539,212.00	2.76
167	688386	泛亚微透	3,516,473.80	2.74
168	601808	中海油服	3,487,931.00	2.72
169	000875	吉电股份	3,448,678.00	2.69
170	601001	晋控煤业	3,438,140.00	2.68
171	600188	兖矿能源	3,434,366.00	2.68
172	601238	广汽集团	3,424,378.00	2.67
173	300223	北京君正	3,403,840.00	2.66
174	000683	远兴能源	3,393,248.40	2.65
175	603986	兆易创新	3,326,198.00	2.59
176	605016	百龙创园	3,325,956.31	2.59
177	000650	仁和药业	3,300,960.00	2.57
178	300809	华辰装备	3,283,471.00	2.56
179	300033	同花顺	3,232,570.96	2.52
180	300887	谱尼测试	3,203,280.68	2.50
181	300271	华宇软件	3,178,217.00	2.48
182	300642	透景生命	3,147,248.00	2.46
183	601678	滨化股份	2,954,227.00	2.30
184	002092	中泰化学	2,890,237.00	2.25
185	600546	山煤国际	2,849,779.00	2.22
186	688071	华依科技	2,821,331.95	2.20

187	000596	古井贡酒	2,695,337.00	2.10
-----	--------	------	--------------	------

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	1,950,927,994.66
卖出股票收入（成交）总额	1,728,382,019.93

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

8.5 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。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告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持仓。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的，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	221,114.24
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,062.39
5	应收申购款	761,896.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	989,073.45

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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。

§ 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
万家人工智能混合 A	50,705	2,685.46	24,292,597.70	17.84%	111,873,639.09	82.16%
万家人工智能混合 C	480	12,738.04	3,744,388.00	61.24%	2,369,871.64	38.76%
合计	51,064	2,786.32	28,036,985.70	19.71%	114,243,510.73	80.29%

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	万家人工智能混合 A	254,420.52	0.1868%
	万家人工智能混合 C	3.14	0.0001%
	合计	254,423.66	0.1788%

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	万家人工智能混合 A	0~10
	万家人工智能混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	万家人工智能混合 A	0
	万家人工智能混合 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家人工智能混合 A	万家人工智能混合 C
基金合同生效日（2019年1月25日）基金份额总额	220,455,070.79	-
本报告期期初基金份额总额	57,016,140.22	-
本报告期基金总申购份额	271,398,012.78	6,291,023.62
减：本报告期基金总赎回份额	192,247,916.21	176,763.98
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	136,166,236.79	6,114,259.64

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

公司高级管理人员：

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：

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况未发生改变。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

中泰证券	2	1,954,236,038.77	53.37%	1,819,967.11	53.37%	-
华西证券	2	882,607,058.14	24.10%	821,974.53	24.10%	-
天风证券	2	382,029,302.54	10.43%	355,783.19	10.43%	-
西藏东方财富证券	2	234,344,811.04	6.40%	218,244.23	6.40%	-
方正证券	1	135,561,712.29	3.70%	126,250.41	3.70%	-
中信证券	4	72,898,940.64	1.99%	67,890.99	1.99%	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	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:

本报告期内, 本基金新增兴业证券交易单元 1 个、海通证券交易单元 1 个、国盛证券交易单元 1 个、东吴证券交易单元 1 个。

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
中泰证券	14,154,584.70	87.22%	-	-	-	-
华西证券	117,010.48	0.72%	-	-	-	-
天风证券	1,957,073.04	12.06%	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

§ 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

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准万家人工智能混合型证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《万家人工智能混合型证券投资基金基金合同》
- 3、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程
- 4、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的基金净值、季度报告、更新招募说明书及其他临时公告
- 5、万家人工智能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、《万家人工智能混合型证券投资基金托管协议》

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司

2022 年 3 月 30 日