

万家科创板 2 年定期开放混合型证券投资
基金
2022 年第 2 季度报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 7 月 20 日

§ 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 07 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 04 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	万家科创板 2 年定期开放混合
场内简称	万家科创
基金主代码	506001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 8 月 3 日
报告期末基金份额总额	1,236,347,092.19 份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过主要投资科创板股票，充分挖掘科创板股票的投资机会，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、封闭期投资策略</p> <p>(1) 大类资产配置策略；(2) 股票投资策略：①科创板股票投资策略，②战略配售股票投资策略、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) 金融衍生产品投资策略 (8) 信用衍生品投资策略 (9) 融资及转融通证券出借业务投资策略</p> <p>2、开放期投资策略</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资者安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种。</p>
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率*75%+中债综合指数收益率*25%
风险收益特征	<p>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。</p> <p>本基金可投资于科创板上市的股票，除了需要承担与证券投资基金类</p>

	似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还面临投资科创板股票的特殊风险。
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2022年4月1日-2022年6月30日)
1. 本期已实现收益	-104,003,662.17
2. 本期利润	128,026,066.96
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1036
4. 期末基金资产净值	1,411,631,974.32
5. 期末基金份额净值	1.1418

注:1、上述基金业绩指标不包括持有人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。

2、上表中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。

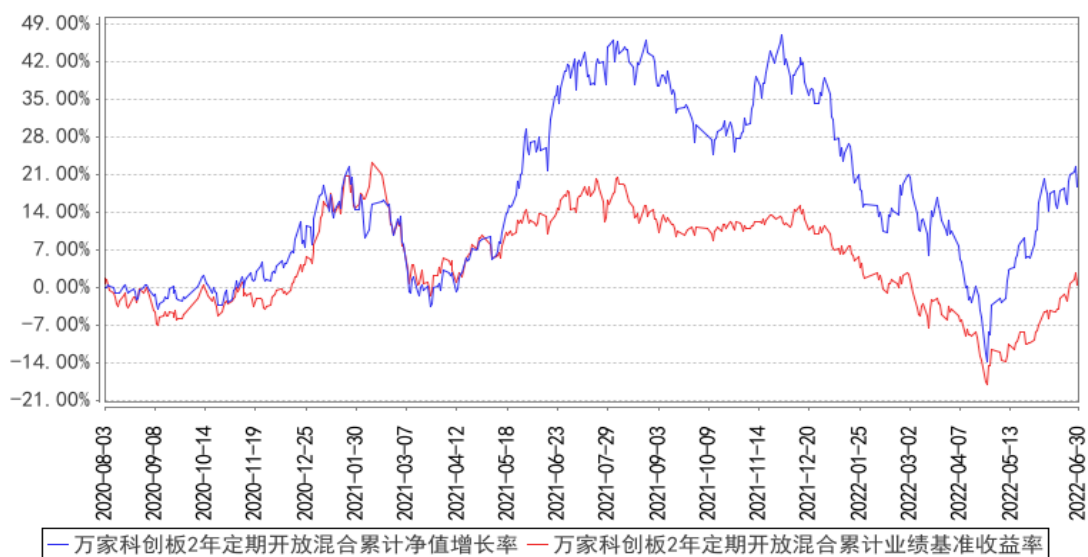
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	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	9.98%	2.40%	6.91%	1.54%	3.07%	0.86%
过去六个月	-13.05%	2.18%	-8.48%	1.44%	-4.57%	0.74%
过去一年	-14.50%	1.87%	-13.61%	1.24%	-0.89%	0.63%
自基金合同 生效起至今	20.98%	1.76%	1.96%	1.29%	19.02%	0.47%

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

万家科创板2年定期开放混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2020 年 8 月 3 日成立，根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李文宾	万家成长优选灵活配置混合型证券投资基金、万家智造优势混合型证券投资基金、万家科创板主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、万家汽车新趋势混合型证券	2020 年 08 月 03 日	-	12 年	复旦大学工商管理硕士。2010 年 7 月至 2014 年 4 月在中银国际证券有限责任公司工作，担任研究员职务；2014 年 5 月至 2015 年 11 月在华泰资产管理有限公司工作，担任研究员职务；2015 年 11 月进入万家基金管理有限公司，从事股票研究工作，自 2017 年 1 月起担任投资研究部基金经理职务。

投资基 金、 万 家 内 需 增 长 一 年 持 有 期 混 合 型 证 券 投 资 基 金、 万 家 战 略 发 展 产 业 混 合 型 证 券 投 资 基 金、 万 家 科 创 板 2 年 定 期 开 放 混 合 型 证 券 投 资 基 金 的 基 金 经 理				
--	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

公司制订了明确的投资授权制度, 并建立了统一的投资管理平台, 确保不同投资组合获得公平的投资决策机会。实行集中交易制度, 对于交易所公开竞价交易, 执行交易系统中的公平交易程序; 对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易, 原则上按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配; 对于银行间交易, 按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询

价并完成交易。为保证公平交易原则的实现,通过制度规范、流程审批、系统风控参数设置等进行事前控制,通过对投资交易系统的实时监控进行事中控制,通过对异常交易的监控和分析实现事后控制。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022 年以来,国内外宏观经济发生了非常超预期的变化:

在国内,奥密克戎病毒的突然爆发和蔓延,包括深圳、上海和吉林等省市受到严重影响,在封控措施下正常生产生活活动被打断,这对国内经济带来了不小的影响;同时国内地产销售数据大幅走低(这是在我们的预期之中的),我们从 2020 年四季度以来一直提示国内房地产行业强制去杠杆所带来的的系统性风险。6 月以后,华东地区生产经营方恢复常态。

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

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

我们在持仓上始终坚持向高景气度的方向配置,我们相信在经济全球经济疲软,通胀高企的当下,只有业绩的高增长才能抵御估值回落的压力。所以我们依然保持新能源汽车、军工、光伏、新材料等板块的配置不变。

展望 2022 年下半年,我们认为国内宏观会有些积极的变化,因而流动性会从资本市场流入实体经济,流动性不会继续边际变好。此外目前股市短期内反弹幅度较高,部分板块出现了明显的泡沫性现象。第三,科创板将会在三季度迎来部分个股的解禁高峰期。所以总的来说,我们认为三季度股市会更多呈现震荡的格局,不排除短期内有一定的回调。我们会主动调减估值较高的个股和板块占比,并将科创板相关股票占比控制在一定合理的范围。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家科创板 2 年定期开放混合基金份额净值为 1.1418 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.98%；同期业绩比较基准收益率为 6.91%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,302,552,967.53	92.08
	其中：股票	1,302,552,967.53	92.08
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	92,531,335.15	6.54
8	其他资产	19,515,764.92	1.38
9	合计	1,414,600,067.60	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	58,990,060.00	4.18
C	制造业	1,018,842,063.81	72.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,364,002.00	0.31
E	建筑业	11,654,559.00	0.83
F	批发和零售业	21,401.16	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	11,433,663.00	0.81
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	74,995,580.56	5.31

J	金融业	-	-
K	房地产业	1,634,142.00	0.12
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	120,582,507.81	8.54
N	水利、环境和公共设施管理业	18,754.05	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,234.14	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,302,552,967.53	92.27

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末本基金未持有港股通股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688122	西部超导	1,158,768	106,838,409.60	7.57
2	688187	时代电气	1,073,953	69,796,205.47	4.94
3	688179	阿拉丁	1,296,448	66,429,995.52	4.71
4	688082	盛美上海	626,114	59,336,823.78	4.20
5	002192	融捷股份	383,800	58,990,060.00	4.18
6	688167	炬光科技	305,921	45,505,748.75	3.22
7	688536	思瑞浦	76,808	43,134,604.72	3.06
8	688133	泰坦科技	242,839	42,895,080.96	3.04
9	688123	聚辰股份	381,759	40,664,968.68	2.88
10	688385	复旦微电	591,181	38,539,089.39	2.73

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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投资。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 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。

5.11 投资组合报告附注

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

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

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	177,624.33
2	应收证券清算款	19,338,140.59
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	19,515,764.92

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,236,347,092.19
报告期期间基金总申购份额	—
减：报告期期间基金总赎回份额	—
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
报告期期末基金份额总额	1,236,347,092.19

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申赎及买卖本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申赎及买卖本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

§ 9 备查文件目录

9.1 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、《万家科创板 2 年定期开放混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 4、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的基金净值、更新招募说明书及其他临时公告。

5、万家科创板 2 年定期开放混合型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告原文。

6、万家基金管理有限公司董事会决议。

7、《万家科创板 2 年定期开放混合型证券投资基金托管协议》。

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人网站：www.wjasset.com。

9.3 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 7 月 20 日