

万家人工智能混合型证券投资基金 2022 年年度报告

2022 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：2023 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 2023 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无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人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	17
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	18
§ 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	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§ 7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 净资产（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	26
§ 8 投资组合报告	58

8.1 期末基金资产组合情况	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
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	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
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	66
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	66
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	66
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	67
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
8.12 投资组合报告附注	67
§ 9 基金份额持有人信息	68
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
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情况	68
§ 10 开放式基金份额变动	69
§ 11 重大事件揭示	69
11.1 基金份额持有人大会决议	69
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	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
11.4 基金投资策略的改变	69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
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	70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
11.8 其他重大事件	71
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	73
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	73
§ 13 备查文件目录	74
13.1 备查文件目录	74
13.2 存放地点	74
13.3 查阅方式	74

§ 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	118,543,943.63 份	
基金合同存续期	不定期	
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	112,745,839.69 份	5,798,103.94 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	王小飞
	联系电话	021-60637103
	电子邮箱	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	4008880800	021-60637228
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	2022 年		2021 年	2021 年 11 月 19 日-2021 年 12 月 31 日	2020 年
	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
本期已实现收 益	-149,386,784.95	-4,736,908.31	49,021,011.70	-78,827.66	15,055,464.56
本期利润	-158,915,538.54	-5,528,128.12	34,150,120.55	-182,372.46	38,115,762.57
加权平均基金 份额本期利润	-1.3448	-1.7318	0.3556	-0.0939	0.9507
本期加权平均 净值利润率	-61.73%	-80.43%	12.51%	-3.11%	56.81%
本期基金份额 净值增长率	-42.03%	-42.50%	32.42%	-6.45%	85.83%
3.1.2 期末数 据和指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末
期末可供分配 利润	22,482,205.98	4,124,098.99	186,951,908.96	12,081,773.69	35,078,510.51
期末可供分配 基金份额利润	0.1994	0.7113	1.3730	1.9760	0.6152
期末基金资产 净值	194,583,656.44	9,922,202.93	405,413,410.89	18,196,033.33	128,193,039.45

期末基金份额净值	1.7259	1.7113	2.9773	2.9760	2.2484
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末
基金份额累计净值增长率	72.59%	-46.20%	197.73%	-6.45%	124.84%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家人工智能混合 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	-7.22%	1.20%	1.49%	0.77%	-8.71%	0.43%
过去六个月	-24.30%	1.85%	-7.74%	0.69%	-16.56%	1.16%
过去一年	-42.03%	1.79%	-12.97%	0.82%	-29.06%	0.97%
过去三年	42.65%	1.94%	4.26%	0.83%	38.39%	1.11%
自基金合同生效起至今	72.59%	1.80%	24.37%	0.83%	48.22%	0.97%

万家人工智能混合 C

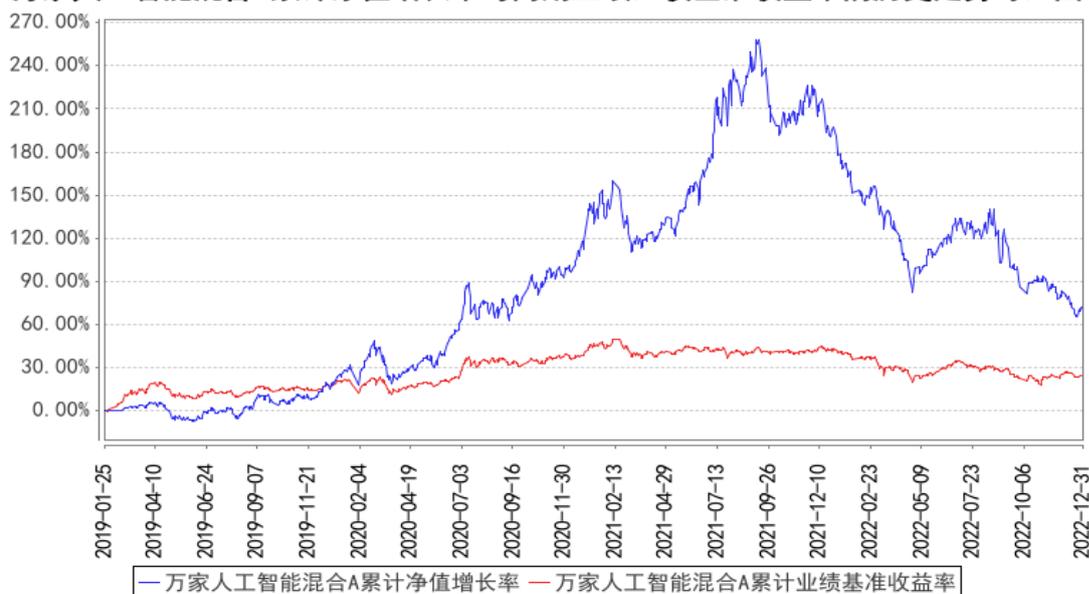
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-7.41%	1.20%	1.49%	0.77%	-8.90%	0.43%
过去六个月	-24.61%	1.85%	-7.74%	0.69%	-16.87%	1.16%
过去一年	-42.50%	1.79%	-12.97%	0.82%	-29.53%	0.97%
自基金合同生效	-46.20%	1.78%	-11.33%	0.79%	-34.87%	0.99%

起至今						
-----	--	--	--	--	--	--

注：万家人工智能混合 C 上述“自基金合同生效起至今”实际为“自基金份额类别首次确认起至今”，下同。

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



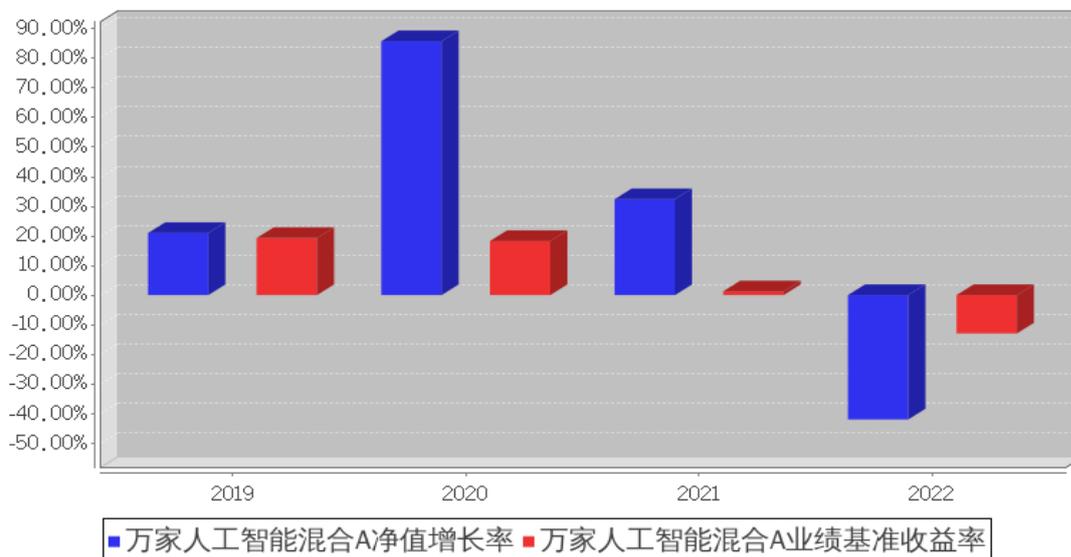
注：1、本基金于 2019 年 1 月 25 日成立规定，根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

2、自 2021 年 11 月 19 日起，增设本基金 C 类份额，2021 年 11 月 20 日起确认有 C 类基金份

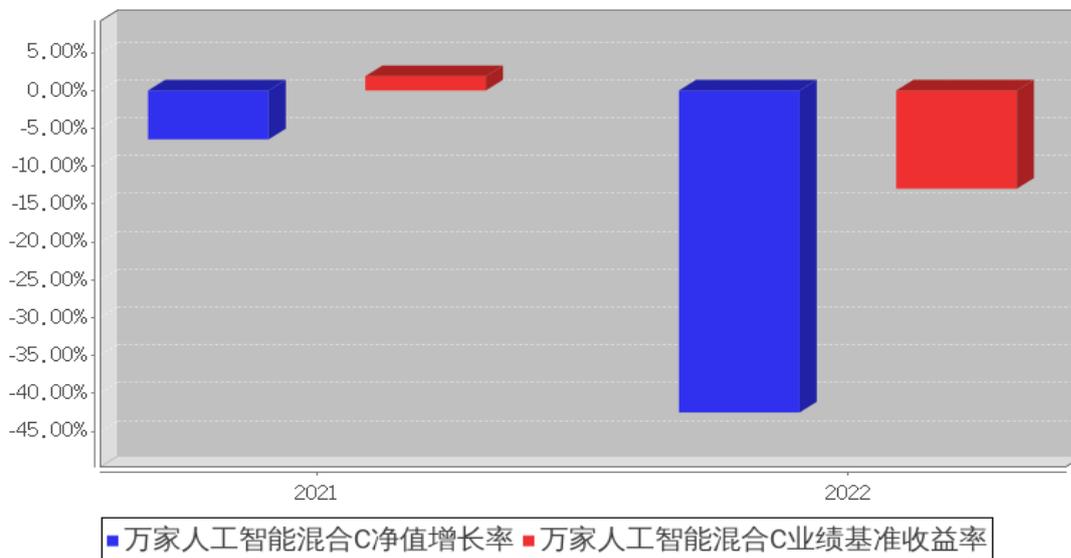
额登记在册。

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基金每年净值增长率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基金每年净值增长率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

本基金过去三年未分配利润。

§ 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。截至报告期末，公司的股东为中泰证券股份有限公司、山东省新动能基金管理有限公司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。截至报告期末，公司共管理一百二十只开放式基金，分别为万家 180 指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金（LOF）、万家添利债券型证券投资基金（LOF）、万家新机遇价值驱动灵活配置混合型证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家上证 50 交易型开放式指数证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞和灵活配置混合型证券投资基金、万家颐达灵活配置混合型证券投资基金、万家颐和灵活配置混合型证券投资基金、万家恒瑞 18 个月定期开放债券型证券投资基金、万家 3-5 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家鑫安纯债债券型证券投资基金、万家鑫璟纯债债券型证券投资基金、万家沪深 300 指数增强型证券投资基金、万家家享中短债债券型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家 1-3 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家瑞隆混合型证券投资基金、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家现金增利货币市场基金、万家消费成长股票型证券投资基金、万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家玖盛纯债 9 个月定期开放债券型证券投资基金、万家天添宝货币市场基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、万家家瑞债券型证券投资基金、万家臻选混合型证券投资基金、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金、万家成长优选灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金、万家经济新动能混合型证券投资基金、万家潜力价值灵活配

置混合型证券投资基金、万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家新机遇龙头企业灵活配置混合型证券投资基金、万家智造优势混合型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型证券投资基金、万家人工智能混合型证券投资基金、万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金 (LOF)、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、万家平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、万家科创主题灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、万家鑫盛纯债债券型证券投资基金、万家民安增利 12 个月定期开放债券型证券投资基金、万家汽车新趋势混合型证券投资基金、万家惠享 39 个月定期开放债券型证券投资基金、万家科技创新混合型证券投资基金、万家自主创新混合型证券投资基金、万家民丰回报一年持有期混合型证券投资基金、万家可转债债券型证券投资基金、万家民瑞祥和 6 个月持有期债券型证券投资基金、万家价值优势一年持有期混合型证券投资基金、万家养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、万家鑫动力月月购一年滚动持有混合型证券投资基金、万家科创板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家创业板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家周期优势企业混合型证券投资基金、万家健康产业混合型证券投资基金、万家互联互通中国优势量化策略混合型证券投资基金、万家战略发展产业混合型证券投资基金、万家创业板指数增强型证券投资基金、万家陆家嘴金融城金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家内需增长一年持有期混合型证券投资基金、万家互联互通核心资产量化策略混合型证券投资基金、万家民瑞祥明 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家瑞泽回报一年持有期混合型证券投资基金、万家惠裕回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家悦兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金、万家稳鑫 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、万家全球成长一年持有期混合型证券投资基金 (QDII)、万家瑞泰混合型证券投资基金、万家沪港深蓝筹混合型证券投资基金、万家北交所慧选两年定期开放混合型证券投资基金、万家鼎鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家新机遇成长一年持有期混合型发起式证券投资基金、万家港股通精选混合型证券投资基金、万家景气驱动混合型证券投资基金、万家安恒纯债 3 个月持有期债券型发起式证券投资基金、万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫橙纯债债券型证券投资基金、万家聚优稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、万家新能源主题混合型发起式证券投资基金、万家中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、万家匠心致远一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫融纯债债券型证券投资基金、万家颐远均衡一年持有期混合型发起式证券投资基金、万家鑫耀纯债债券型证券投资基金、万家欣远混合型证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接

基金、万家惠利债券型证券投资基金、万家鑫怡债券型证券投资基金、万家优享平衡混合型发起式证券投资基金、万家洞见进取混合型发起式证券投资基金、万家沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金。

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	-	10.5 年	国籍：中国；学历：北京大学摄影测量与遥感专业硕士；相关业务资格：证券投资基金从业资格；过往从业经历：2012 年 7 月入职万家基金管理有限公司，现任权益投资部基金经理，历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。

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 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13次,为量化投资组合或不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易,有关基金经理按规定履行了审批程序。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022年是极不寻常的一年,在这一年中:变异毒株传入国内导致疫情多点散发、给经济生产和人民生活带来了极大挑战,美国对我国半导体行业进一步收紧了限制,俄乌冲突爆发导致全球能源价格经历了近二十年未见的过山车,美国经济数据持续超预期进而导致美联储货币收紧政策一再超出市场预期。在2022年这样一个中美库存周期共振向下的背景下,诸多外部突发事件对市场而言更是雪上加霜,全年上证录得-15.13%的跌幅,在近十年中该跌幅仅次于2018年。

至2022年10月中旬,随着党的二十大胜利召开,国内一系列政策随后展开适时调整,对国内经济发展的最大不确定因素随着新冠转为“乙类乙管”正式消除;房地产调控方面已取得显著成果、房价持续上涨预期消除、房地产行业回归服务人民居住需求的朴素定位,随后地产政策转向、房地产行业作为具有系统重要性的需求拉动行业再次回到政策视野中;互联网行业监管转向常态化,内部政策正在多角度发力、经济建设的重要性再次回到首位。外部环境方面,随着美联储持续收紧货币政策,工资和通胀的死亡螺旋正在被破解,进入2023年后,虽然2月披露数据令

投资者感到不安，但熟悉美国经济数据编制规则的分析师指出，这主要是由一过性的季调和编制规则调整造成，预计从 3 月开始美国经济数据将重新回到 2022 年底以来的下行趋势中，对于通胀的过度担忧是不必要的。以上种种，都指向一个趋势：对于权益资产而言，风险和不确定性显著消退、2023 年的投资环境较 2022 年显著好转。

回顾本基金 2022 年度配置情况，在 2022 年度本基金按照主题基金合同要求，主要配置于与人工智能主题相关的科技、智能制造等方向。受自身周期下行影响，半导体设计和制造普遍表现不佳；由于全年疫情反复，计算机软件行业的项目招标和实施受到显著拖累；由于互联网和游戏相关政策持续收紧、C 端用户支出意愿下行，互联网和媒体行业同样受到较大挑战；整体而言，在 2022 年各项经济增长受到普遍挑战的大背景下，整个科技行业基本面均乏善可陈，由于计算机、传媒等行业对于各自客户均具有一定“可选支出”特征，下行周期下这些行业受冲击尤为严重。基于前述考虑，本基金在 2022 年在满足基金合同主题要求的前提下，尽量向军工电子、智能电网、半导体设备等景气度受挫较小的方向倾斜，但美国对我国半导体行业的不公正禁运和不当制裁对于半导体、尤其是半导体设备行业冲击较大，仍给基金持仓带来较大损失。

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 的基金份额净值为 1.7259 元，本报告期基金份额净值增长率为-42.03%，同期业绩比较基准收益率为-12.97%，截至本报告期末万家人工智能混合 C 的基金份额净值为 1.7113 元，本报告期基金份额净值增长率为-42.50%，同期业绩比较基准收益率为-12.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在 2022 年四季报中，我们对于一季度行情已经有过展望，在基金经理编写本报告展望部分的 2 月底时点，四季报的分析和预判基本都已验证、并没有太多需要调整的地方，本基金在 2023 年前 2 个月继续维持了较高比例的计算机软件配置、用低位半导体设计标的替代了半导体设备类标的、逐步减持了行业增速下行的军工电子类资产，另外配置了一些机构关注度较低、估值安全边际较高的通信和传媒类资产，非主题仓位部分以新能源中的新技术标的为主，整体仓位保持在较高水平，主因随着春节日历效应消退后、相对偏爱成长的内资重新夺回市场定价权，市场优势风格从大市值消费品向科技成长向切换，与本基金主题契合度较高。

展望 2023 年，我们对于全年市场保持乐观，认为全年市场主要指数可以实现双位数的收益率，投资环境较 2022 年将有显著改善，这些之前已有论述，下面我们仍然从政策、经济基本面、流动性和资金面、外部环境等几个方面展开讨论：

国内政策方面，从 2022 年底以来已有多个迹象表明政策制定层对于经济发展的重视程度显著

提升，在多个领域预计仍将保持友好的政策环境，年初以来国家对于关键基础学科、卡脖子技术等已多次强调，海外以 ChatGPT 为代表的新技术也对国内触动颇深，从近期多次政策表态来看，国内将继续在科技方面寻求突破进而提升全社会要素生产率，对关键技术和国产产业链的支持已经在市场参与者中形成强一致预期，并可能陆续兑现强现实。房地产方面目前政策支持力度依然在持续加码，目前主要矛盾点在于消费者信心不足，我们倾向于认为，新的领导集体对于房地产发展会有更高的容忍度，在基本面好转之前仍然会保持友好。基建方面目前市场预期较低，我们也倾向于认为走老路的概率较小，但在新技术新方向上会做适度超前投资和准备，对于新兴行业构成需求支撑。

经济基本面方面，预计国内库存周期下行会持续至年中，而美国的库存周期下行预计持续到年底或 2024 年初，上半年仍处于强预期弱现实的状态，下半年的不确定性主要来自于美国经济是否硬着陆的尾部风险，上半年由于基数因素和经济内生韧性大概率体现为弱复苏，对于成长方向资产比较友好（如果转向强复苏预期甚至过热预期则对强周期类资产更为友好），下半年如果美国经济风险暴露加剧，可能市场仍会面临一定外部压力，但整体而言不会比 2022 年更加艰难，随着美国库存周期触底回升、2023 年底开始市场可能会对中美周期上行共振进行定价，届时无论是从盈利预期还是风险偏好而言，市场大概率都会随之显著回升。

流动性和资金面方面，2023 年预计利率政策保持稳健、整体流动性环境较 2022 年有所收紧，但对于权益类资产而言影响不会太大。资金面方面，随着权益市场上涨、理财类资产收益不理想，基金发行和申购开始回暖，全年内资的资金增量预计还是比较可观，外资经历 2022 年底至 2023 年春节前的快速持续流入后重新回归到常态化水平，下半年如果美国风险暴露加剧则外资不排除有再次流出可能，整体而言 2023 年接下来的时间中，资金面对于内资偏好的成长类和高弹性标的更为友好，大市值蓝筹预计以稳步上行为主，中小市值和成长风格预计有持续轮动的赚钱效应。

外部环境方面，俄乌冲突的关注度持续降低、并可能继续拖延下去，欧洲逐步摆脱俄罗斯能源桎梏后经济增长前景在主要经济体中仍然最不乐观，美国的主要风险和争议点在于本轮周期是硬着陆还是软着陆，日本则主要关注安倍经济学是否随着黑田行长的卸任退出，各主要经济体的基本面展望来看，最重要的因素仍然是美国、并预计将于下半年逐渐分晓、市场波动预计会随之加大。对华政策方面仍然形式严峻，对于军工、信创和半导体等资产构成持续的情绪扰动，结合各个行业的基本面，我们倾向于认为 2023 年持续兑现政策和订单的信创具有相对优势，而军工 2023 年仍面临行业降速和牛鞭效应的问题，对于上游环节相对不利，半导体上半年仍然面临行业下行压力，下半年预计基本面可能回升（力度和时间点取决于美欧等主要经济体的表现）。

综上，我们会维持此前的判断和配置计划，在 2023 年维持较高比例的计算机配置、根据估值

比较阶段性调增通信和传媒行业的配置比例、并逐步提升半导体设计的配置比例，科技方向主要围绕自主可控和 AI 产业链进行配置；在非主题持仓方面会择机配置困境反转的风电和光伏新技术领域。

最后，在当前时点我们还想谈一下对于以 ChatGPT 为代表的技术进展，我们认为 LLM 在 NLP 方面取得的重大突破是一个可以类比 iPhone 发明、将互联网平台从 PC 端向移动端前移的浪潮开端的技术进展，人类总是会高估技术进步带来的短期变化、但同样会低估技术进步带来的远期变化，站在当前时点，诚然资本市场的短期反应可能过于乐观，但 AI 的进展对于科技行业的需求拉动、甚至全社会要素生产率的提升仍然可能是被严重低估的——毕竟，算力是越来越便宜的、而人工则是越来越贵的，当技术的奇点来临后，在算力与人工成本交叉后，AI 相对人工的性价比优势将越来越显著。

和过去几年市场热炒过的元宇宙、区块链、自动驾驶、人形机器人等概念相比，我们认为以 ChatGPT 为代表的 AI 在 NLP 领域取得的突破具有显著不同——NLP 作为 AI 诸多方向中最困难的一个碉堡被突破后，AI 作为底层技术将深远而迅速地改变科技行业甚至全社会全行业的业态。与元宇宙、自动驾驶、人形机器人相比，LLM 在 NLP 方面取得的突破性进展令人惊艳，其落地进度会显著快于前述其他方向，在 2023 年年内我们就会看到在文本编辑、会议助手、基础资料搜集整理、人类服务替代等多方面的商业化落地。过往智能音箱、服务机器人等产品面临的普遍问题是在 NLP 方面的能力匮乏导致交互困难、用户满意度低，随着 NLP 领域的突破性进展，终端产品体验显著提升，无论是付费意愿还是机器替人可行性都取得长足进步，无论是对终端消费还是对前端 AI 基础设施的投资需求都会有不亚于智能手机当年的拉动力。这是一把可能给人类带来未来 10 年经济增长动力的金钥匙，现在，它为我们打开了第一扇大门，经历过 10 年前移动互联网带来的那一波汹涌机会的投资者，站在当前时点或许在心底都会有类似的悸动。AI 的落地远不是一个类似于区块链或者元宇宙那般虚无缥缈的短期炒作主题，而是一个生产要素新时代的开篇，在未来几年里还会有类似 10 年前那样迭出的投资机会，并且最终将深远的改变你我每一个人的日常生活。

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

本基金本报告期内未实施利润分配，符合基金合同的规定。

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

§ 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，本基金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，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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[2023]第 ZA30302 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	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 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度的利润表、净资产(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。 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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	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。

	<p>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>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<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> <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>
<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</p>

	<p>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，就可能导致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（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治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>
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	朱颖 杨利敏
会计师事务所的地址	中国 上海
审计报告日期	2023 年 03 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：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	59,926,130.61	45,475,443.83
结算备付金		1,115,963.85	2,281,376.91
存出保证金		306,399.38	221,114.24
交易性金融资产	7.4.7.2	155,449,677.62	382,642,320.67
其中：股票投资		155,449,677.62	382,642,320.67
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		180,673.78	761,896.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	6,062.39
资产总计		216,978,845.24	431,388,214.86
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021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		-	-
应付清算款		10,258,272.33	4,109,649.94
应付赎回款		1,042,394.55	1,561,925.80
应付管理人报酬		262,017.83	539,607.98
应付托管费		43,669.66	89,934.66
应付销售服务费		6,551.16	4,955.68
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	860,080.34	1,472,696.58
负债合计		12,472,985.87	7,778,770.64
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	118,543,943.63	142,280,496.43
其他综合收益	7.4.7.8	-	-
未分配利润	7.4.7.9	85,961,915.74	281,328,947.79
净资产合计		204,505,859.37	423,609,444.22
负债和净资产总计		216,978,845.24	431,388,214.86

注：1、报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 118,543,943.63 份，其中万家人工智能混合 A 基金份额净值 1.7259 元，基金份额总额 112,745,839.69 份；万家人工智能混合 C 基金份额净值 1.7113 元，基金份额总额 5,798,103.94 份。

2、比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的

“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-159,549,612.45	44,452,784.08
1. 利息收入		143,011.05	118,907.16
其中：存款利息收入	7.4.7.10	143,011.05	118,331.44
债券利息收入		-	575.72
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）		-149,786,911.93	56,962,510.00
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-150,857,405.47	55,100,172.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	-	1,040,152.40
资产支持证券投资	7.4.7.13	-	-
收益			
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	1,070,493.54	822,185.21
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-10,319,973.40	-14,974,435.95
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	414,261.83	2,345,802.87
减：二、营业总支出		4,894,054.21	10,485,035.99

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,987,712.82	4,098,909.64
2. 托管费	7.4.10.2.2	664,618.78	683,151.61
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	55,650.79	5,082.90
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		-	1.54
8. 其他费用	7.4.7.20	186,071.82	5,697,890.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-164,443,666.66	33,967,748.09
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-164,443,666.66	33,967,748.09
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-164,443,666.66	33,967,748.09

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

7.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	142,280,496.43	-	281,328,947.79	423,609,444.22
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期	142,280,496.43	-	281,328,947.79	423,609,444.22

期初净资产(基金净值)				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-23,736,552.80	-	-195,367,032.05	-219,103,584.85
(一)、综合收益总额	-	-	-164,443,666.66	-164,443,666.66
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-23,736,552.80	-	-30,923,365.39	-54,659,918.19
其中:1.基金申购款	71,743,147.06	-	84,390,240.90	156,133,387.96
2.基金赎回款	-95,479,699.86	-	-115,313,606.29	-210,793,306.15
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-

四、本期末净资产(基金净值)	118,543,943.63	-	85,961,915.74	204,505,859.37
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	57,016,140.22	-	71,176,899.23	128,193,039.45
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期初净资产(基金净值)	57,016,140.22	-	71,176,899.23	128,193,039.45
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	85,264,356.21	-	210,152,048.56	295,416,404.77
(一)、综合收益总额	-	-	33,967,748.09	33,967,748.09
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	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
(三)、 本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、 其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	142,280,496.43	-	281,328,947.79	423,609,444.22

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”）证监许可[2018]1198 号文《关于准予万家人工智能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 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 220,455,070.79 元，折合 220,455,070.79 份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为万家基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《万家人工智能混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，经与本基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，2021 年 11 月 19 日起，本基金增设 C 类基金份额。

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 2022 年 12 月 31 日的财

务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。

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

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

1、金融资产分类

自 2022 年 1 月 1 日起适用

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

本基金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。

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

2022 年 1 月 1 日前适用

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

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

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

2、金融负债分类

自 2022 年 1 月 1 日起适用

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

2022 年 1 月 1 日前适用

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

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

自 2022 年 1 月 1 日起适用

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于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，确认为应计利息，包含在债券投资的账面价值中。对于其他金融资产和以摊余成本计量的金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，按照未来 12 个月内（若预期存续期少于 12 个月，则为预期存续期内）的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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。

2022 年 1 月 1 日前适用

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

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，按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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，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，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。

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

自 2022 年 1 月 1 日起适用

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率或者合同利率计算的

利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

2022 年 1 月 1 日前适用

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

自 2022 年 1 月 1 日起适用

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

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

2022 年 1 月 1 日前适用

- (1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率逐日计提；
- (2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；
- (3) 本基金 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 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为

人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 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

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

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：以公允价

值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。本基金需考虑自身业务模式以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

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

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

金融资产/ 负债类别	修订前的金融工具确认计量准则		修订后的金融工具确认计量准则	
	计量类别	账面价值	计量类别	账面价值
金融资产				
银行存款	摊余成本（应收款项）	45,475,443.83	摊余成本	45,480,062.20
结算备付金	摊余成本（应收款项）	2,281,376.91	摊余成本	2,282,506.17
存出保证金	摊余成本（应收款项）	221,114.24	摊余成本	221,223.69
交易性金融资产	以公允价值计量且其变动计入当期损益	382,642,320.67	以公允价值计量且其变动计入当期损益	382,642,320.67
应收利息	摊余成本（应收款项）	6,062.39	—	—
应收申购款	摊余成本（应收款项）	761,896.82	摊余成本	762,102.13
金融负债				
应付清算款	摊余成本	4,109,649.94	摊余成本	4,109,649.94
应付赎回款	摊余成本	1,561,925.80	摊余成本	1,561,925.80
应付管理人报酬	摊余成本	539,607.98	摊余成本	539,607.98
应付托管费	摊余成本	89,934.66	摊余成本	89,934.66
应付销售服务费	摊余成本	4,955.68	摊余成本	4,955.68
应付交易费用	摊余成本	1,305,544.87	—	—
其他负债	摊余成本	167,151.71	摊余成本	1,472,696.58

于 2021 年 12 月 31 日，“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

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；

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

（三）企业所得税

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

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

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

（四）个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息

所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

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

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

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

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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	59,926,130.61	45,475,443.83
等于：本金	59,919,739.82	45,475,443.83
加：应计利息	6,390.79	-
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-

加：应计利息		-
减：坏账准备		-
合计	59,926,130.61	45,475,443.83

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	151,635,859.93	-	155,449,677.62	3,813,817.69
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	151,635,859.93	-	155,449,677.62	3,813,817.69
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	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

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

本基金本报告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 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	-
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
应计利息	-	6,062.39
合计	-	6,062.39

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	392.38	2,151.71
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	574,687.96	1,305,544.87
其中：交易所市场	574,687.96	1,305,544.87
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	285,000.00	165,000.00
合计	860,080.34	1,472,696.58

7.4.7.7 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	136,166,236.79	136,166,236.79
本期申购	59,997,950.36	59,997,950.36
本期赎回（以“-”号填列）	-83,418,347.46	-83,418,347.46
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	112,745,839.69	112,745,839.69

万家人工智能混合 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,114,259.64	6,114,259.64
本期申购	11,745,196.70	11,745,196.70

本期赎回（以“-”号填列）	-12,061,352.40	-12,061,352.40
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	5,798,103.94	5,798,103.94

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额

7.4.7.8 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

7.4.7.9 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
本期期初	186,951,908.96	82,295,265.14	269,247,174.10
本期利润	-149,386,784.95	-9,528,753.59	-158,915,538.54
本期基金份额交易产生的变动数	-15,082,918.03	-13,410,900.78	-28,493,818.81
其中：基金申购款	36,620,873.11	35,804,876.11	72,425,749.22
基金赎回款	-51,703,791.14	-49,215,776.89	-100,919,568.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,482,205.98	59,355,610.77	81,837,816.75

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
本期期初	13,290,700.92	-1,208,927.23	12,081,773.69
本期利润	-4,736,908.31	-791,219.81	-5,528,128.12
本期基金份额交易产生的变动数	-2,834,877.46	405,330.88	-2,429,546.58
其中：基金申购款	14,299,645.99	-2,335,154.31	11,964,491.68
基金赎回款	-17,134,523.45	2,740,485.19	-14,394,038.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,718,915.15	-1,594,816.16	4,124,098.99

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	109,339.14	92,919.57
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	28,373.51	21,932.11
其他	5,298.40	3,479.76

合计	143,011.05	118,331.44
----	------------	------------

7.4.7.11 股票投资收益

7.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-150,857,405.47	55,100,172.39
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-150,857,405.47	55,100,172.39

7.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	2,416,724,045.80	1,728,382,019.93
减：卖出股票成本总额	2,560,327,909.48	1,673,281,847.54
减：交易费用	7,253,541.79	-
买卖股票差价收入	-150,857,405.47	55,100,172.39

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	-	-
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

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

7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1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	-	9,292,704.54
减：卖出债券（债转股及 债券到期兑付）成本总额	-	8,238,799.64
减：应计利息总额	-	13,752.50
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-	1,040,152.40

7.4.7.13 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 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月 31日
股票投资产生的股利 收益	1,070,493.54	822,185.21
其中：证券出借权益补 偿收入	-	-
基金投资产生的股利 收益	-	-
合计	1,070,493.54	822,185.21

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
------	----	---------

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-10,319,973.40	-14,974,435.95
股票投资	-10,319,973.40	-14,974,435.95
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	-10,319,973.40	-14,974,435.95

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	393,131.64	2,285,101.61
基金转换费收入	21,130.19	60,701.26
合计	414,261.83	2,345,802.87

7.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	45,000.00	45,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	3,071.82	18,052.33
账户维护费	9,000.00	18,000.00
其他	9,000.00	360.00
交易费用	-	5,496,477.97
合计	186,071.82	5,697,890.30

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

根据中国证券监督管理委员会《关于核准万家基金管理有限公司变更实际控制人的批复》（证监许可[2023]215号），齐河众鑫投资有限公司将其持有的万家基金 11%股权转让给中泰证券股份有限公司，股权变更后，中泰证券股份有限公司持股比例变更为 60%，山东能源集团有限公司为万家基金实际控制人。

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（“万家基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	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
齐河众鑫投资有限公司	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
山东省新动能基金管理有限公司	基金管理人的股东
万家共赢资产管理有限公司（“万家共赢”）	基金管理人的子公司
万家财富基金销售（天津）有限公司（“万家财富”）	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（“万家朴智”）	基金管理人控制的公司

注：1、2022 年 4 月，中国证监会下发《关于核准万家基金管理有限公司变更股权的批复》（证监许可[2022]795号），核准新疆国际实业股份有限公司将持有的万家基金 40%股权转让给山东省新动能基金管理有限公司。2022 年 6 月，万家基金完成工商变更登记手续，万家基金股东变更为中泰证券、山东省新动能基金管理有限公司、齐河众鑫投资有限公司。

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

3、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	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 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	1,668,313,019.37	35.10	1,954,236,038.77	53.37

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	-	-	14,154,584.70	87.22

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 2022年1月1日至2022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	占期末应付佣金总量的比例 (%)
中泰证券	1,553,699.43	35.12	326,489.21	56.81
关联方名称	上年度可比期间 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	占期末应付佣金总量的比例 (%)
中泰证券	1,819,967.11	53.37	443,334.10	33.96

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 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,987,712.82	4,098,909.64
其中：支付销售机构的客户维护费	1,361,164.37	1,409,303.94

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	664,618.78	683,151.61

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		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 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	-	13,098.22	13,098.22
中泰证券	-	13,400.45	13,400.45
合计	-	26,498.67	26,498.67
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 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	-	968.92	968.92

中泰证券	-	1,889.95	1,889.95
合计	-	2,858.87	2,858.87

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

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均为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均为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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
		万家人工智能混合 A
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	-	-
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	-	-
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 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2021年11月19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	0.0000%	-

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 2022年12月31日		上年度末 2021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	3,204,704.98	2.8424	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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
建设银行	59,926,130.61	109,339.14	45,475,443.83	92,919.57

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所承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间没有需作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

7.4.12 期末（2022 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	受限期	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
301161	唯万密封	2022 年 9 月 6 日	6 个月	新股流通受限	18.66	21.73	329	6,139.14	7,149.17	-
301176	逸豪新材	2022 年 9 月 21 日	6 个月	新股流通受限	23.88	16.89	272	6,495.36	4,594.08	-
301230	泓博医药	2022 年 10 月 21 日	6 个月	新股流通受限	40.00	48.32	171	6,840.00	8,262.72	-
301233	盛帮股份	2022 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40	-
301265	华新环保	2022 年 12 月 8 日	6 个月	新股流通受限	13.28	11.40	305	4,050.40	3,477.00	-
301269	华大九天	2022 年 7 月 21 日	6 个月	新股流通受限	32.69	87.94	222	7,257.18	19,522.68	-
301296	新巨丰	2022 年 8 月 26 日	6 个月	新股流通受限	18.19	14.90	434	7,894.46	6,466.60	-
301297	富乐德	2022 年 12 月 23 日	6 个月	新股流通受限	8.48	12.99	795	6,741.60	10,327.05	-
301300	远翔新材	2022 年 8 月 9 日	6 个月	新股流通受限	36.15	29.37	190	6,868.50	5,580.30	-
301306	西测	2022 年	6 个月	新股流	43.23	42.29	175	7,565.25	7,400.75	-

	测试	7月19日		通受限							
301316	慧博云通	2022年9月29日	6个月	新股流通受限	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88		-
301319	唯特偶	2022年9月22日	6个月	新股流通受限	47.75	53.27	97	4,631.75	5,167.19		-
301328	维峰电子	2022年8月30日	6个月	新股流通受限	78.80	76.96	87	6,855.60	6,695.52		-
301349	信德新材	2022年8月30日	6个月	新股流通受限	138.88	103.52	33	4,583.04	3,416.16		-
301367	怡和嘉业	2022年10月21日	6个月	新股流通受限	119.88	175.78	42	5,034.96	7,382.76		-
301368	丰立智能	2022年12月7日	6个月	新股流通受限	22.33	18.52	236	5,269.88	4,370.72		-
688053	思科瑞	2022年7月1日	6个月	新股流通受限	55.53	60.92	2,367	131,439.51	144,197.64		-
688353	华盛锂电	2022年7月6日	6个月	新股流通受限	98.35	63.86	926	91,072.10	59,134.36		-
688380	中微半导体	2022年7月29日	6个月	新股流通受限	30.86	26.44	3,399	104,893.14	89,869.56		-
688382	益方生物	2022年7月18日	6个月	新股流通受限	18.12	12.89	11,081	200,787.72	142,834.09		-
688498	源杰科技	2022年12月14日	6个月	新股流通受限	100.66	113.13	422	42,478.52	47,740.86		-

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 2022 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 2022 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。

7.4.12.4 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。

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资。(2021 年 12 月 31 日：同)

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。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。因此，除在附注 7.4.12 中列示的本基金期末持有的流通受限证券外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖

出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

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

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（2022 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	59,926,130.61	-	-	-	-	-	59,926,130.61
结算备付金	1,115,963.85	-	-	-	-	-	1,115,963.85

存出保证金	306,399.38	-	-	-	-	-	306,399.38
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-155,449,677.62	155,449,677.62
应收申购款	165.50	-	-	-	-	180,508.28	180,673.78
资产总计	61,348,659.34	-	-	-	-	-155,630,185.90	216,978,845.24
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,042,394.55	1,042,394.55
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	262,017.83	262,017.83
应付托管费	-	-	-	-	-	43,669.66	43,669.66
应付清算款	-	-	-	-	-	10,258,272.33	10,258,272.33
应付销售服务费	-	-	-	-	-	6,551.16	6,551.16
其他负债	-	-	-	-	-	860,080.34	860,080.34
负债总计	-	-	-	-	-	12,472,985.87	12,472,985.87
利率敏感度缺口	61,348,659.34	-	-	-	-	-143,157,200.03	204,505,859.37
上年度末 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
应收申购款	6,115.00	-	-	-	-	755,781.82	761,896.82
其他资产	-	-	-	-	-	6,062.39	6,062.39
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
其他负债	-	-	-	-	-	1,472,696.58	1,472,696.58
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

注：该表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2021 年 12 月 31 日：同），银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2021 年 12 月 31 日：同）。

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

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

本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券,所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险,并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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 2022年12月31日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例(%)	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
交易性金融资产—股票投资	155,449,677.62	76.01	382,642,320.67	90.33
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	155,449,677.62	76.01	382,642,320.67	90.33

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除股票基准指数以外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)		
	本期末(2022年12月31日)	上年度末(2021年12月31日)	
分析	1. 股票基准指数下降100个基点	-1,371,524.41	-3,513,762.10
	2. 股票基准指数上升100个基点	1,371,524.41	3,513,762.10

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	154,855,528.13	377,248,556.81
第二层次	-	5,393,763.86
第三层次	594,149.49	-
合计	155,449,677.62	382,642,320.67

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	666,186.67	666,186.67
当期出售/结算	-	-	-

转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-72,037.18	-72,037.18
其中：计入损益的利得或损失	-	-72,037.18	-72,037.18
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	594,149.49	594,149.49
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-72,037.18	-72,037.18
项目	上年度可比同期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	594,149.49	亚式期权模型	预期波动率	0.2063-2.4756	预期波动率越大公允价值越低

项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本期末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。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	155,449,677.62	71.64
	其中：股票	155,449,677.62	71.64
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	61,042,094.46	28.13
8	其他各项资产	487,073.16	0.22
9	合计	216,978,845.24	100.00

8.2 报告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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采矿业	3,921,295.00	1.92
C	制造业	64,558,090.01	31.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,306,634.00	4.06
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	77,414,650.45	37.85
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,078,820.00	0.53
M	科学研究和技术服务业	170,188.16	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	155,449,677.62	76.01

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600536	中国软件	201,300	11,741,829.00	5.74
2	688111	金山办公	43,637	11,541,550.13	5.64
3	600570	恒生电子	277,380	11,222,794.80	5.49
4	000733	振华科技	87,400	9,983,702.00	4.88
5	002049	紫光国微	62,140	8,191,294.80	4.01
6	002475	立讯精密	238,449	7,570,755.75	3.70
7	688083	中望软件	38,745	7,539,002.10	3.69
8	300253	卫宁健康	724,300	7,445,804.00	3.64
9	688369	致远互联	105,633	7,272,832.05	3.56
10	300847	中船汉光	457,350	7,226,130.00	3.53
11	002063	远光软件	566,600	4,300,494.00	2.10
12	601800	中国交建	521,700	4,199,685.00	2.05
13	600760	中航沈飞	70,800	4,151,004.00	2.03
14	601186	中国铁建	531,300	4,106,949.00	2.01
15	300101	振芯科技	165,500	4,054,750.00	1.98

16	000768	中航西飞	151,600	3,858,220.00	1.89
17	300274	阳光电源	34,000	3,801,200.00	1.86
18	603138	海量数据	164,900	3,388,695.00	1.66
19	603212	赛伍技术	100,500	3,185,850.00	1.56
20	002179	中航光电	52,600	3,038,176.00	1.49
21	002555	三七互娱	114,200	2,067,020.00	1.01
22	601958	金钼股份	175,700	2,029,335.00	0.99
23	301302	华如科技	30,985	1,983,969.55	0.97
24	688023	安恒信息	9,819	1,944,162.00	0.95
25	002912	中新赛克	61,300	1,939,532.00	0.95
26	603606	东方电缆	28,400	1,926,372.00	0.94
27	002368	太极股份	67,700	1,904,401.00	0.93
28	000983	山西焦煤	162,400	1,891,960.00	0.93
29	600096	云天化	88,700	1,866,248.00	0.91
30	603636	南威软件	135,599	1,863,130.26	0.91
31	002027	分众传媒	161,500	1,078,820.00	0.53
32	002153	石基信息	68,900	1,032,811.00	0.51
33	603688	石英股份	7,700	1,011,164.00	0.49
34	003022	联泓新科	33,000	1,001,550.00	0.49
35	603496	恒为科技	65,500	996,255.00	0.49
36	002895	川恒股份	37,200	969,804.00	0.47
37	600141	兴发集团	32,000	928,000.00	0.45
38	300525	博思软件	10,200	201,960.00	0.10
39	688053	思科瑞	2,367	144,197.64	0.07
40	688382	益方生物	11,081	142,834.09	0.07
41	688392	骄成超声	961	139,066.31	0.07
42	688141	杰华特	2,287	108,632.50	0.05
43	688380	中微半导	3,399	89,869.56	0.04
44	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.03
45	688353	华盛锂电	926	59,134.36	0.03
46	688147	微导纳米	2,349	58,912.92	0.03
47	688498	源杰科技	422	47,740.86	0.02
48	301266	宇邦新材	304	22,982.40	0.01
49	301269	华大九天	222	19,522.68	0.01
50	301297	富乐德	795	10,327.05	0.01
51	301230	泓博医药	171	8,262.72	0.00
52	301306	西测测试	175	7,400.75	0.00
53	301367	怡和嘉业	42	7,382.76	0.00
54	301161	唯万密封	329	7,149.17	0.00
55	301328	维峰电子	87	6,695.52	0.00
56	301296	新巨丰	434	6,466.60	0.00
57	301300	远翔新材	190	5,580.30	0.00
58	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00

59	301319	唯特偶	97	5,167.19	0.00
60	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00
61	301176	逸豪新材	272	4,594.08	0.00
62	301368	丰立智能	236	4,370.72	0.00
63	301265	华新环保	305	3,477.00	0.00
64	301349	信德新材	33	3,416.16	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	002466	天齐锂业	41,145,018.91	9.71
2	603260	合盛硅业	35,763,029.00	8.44
3	300666	江丰电子	35,239,698.93	8.32
4	603612	索通发展	34,913,941.00	8.24
5	002371	北方华创	29,741,139.00	7.02
6	603985	恒润股份	28,864,526.28	6.81
7	300565	科信技术	28,064,732.00	6.63
8	002487	大金重工	26,297,402.00	6.21
9	002068	黑猫股份	26,107,802.00	6.16
10	002459	晶澳科技	24,597,357.80	5.81
11	603606	东方电缆	24,564,480.00	5.80
12	601908	京运通	24,272,264.00	5.73
13	688037	芯源微	23,053,254.33	5.44
14	000768	中航西飞	22,501,808.00	5.31
15	002013	中航机电	22,409,409.82	5.29
16	002865	钧达股份	22,355,523.65	5.28
17	300769	德方纳米	20,610,686.00	4.87
18	600570	恒生电子	20,581,308.72	4.86
19	688063	派能科技	20,168,941.36	4.76
20	605117	德业股份	19,635,840.90	4.64
21	600690	海尔智家	18,916,754.09	4.47
22	688599	天合光能	18,685,296.41	4.41
23	601800	中国交建	18,461,508.10	4.36
24	600036	招商银行	18,315,850.98	4.32
25	000333	美的集团	17,778,175.00	4.20
26	000792	盐湖股份	17,040,871.00	4.02
27	003022	联泓新科	15,872,986.00	3.75
28	600418	江淮汽车	15,691,883.20	3.70
29	600325	华发股份	15,324,245.00	3.62
30	603688	石英股份	15,094,259.00	3.56
31	600383	金地集团	15,022,859.00	3.55
32	300438	鹏辉能源	14,986,489.91	3.54

33	300026	红日药业	14,886,372.11	3.51
34	002240	盛新锂能	14,812,804.20	3.50
35	000537	广宇发展	14,785,693.00	3.49
36	002460	赣锋锂业	14,761,893.60	3.48
37	300481	濮阳惠成	14,708,681.65	3.47
38	300059	东方财富	14,486,689.44	3.42
39	603566	普莱柯	14,450,622.55	3.41
40	601168	西部矿业	13,879,744.00	3.28
41	601669	中国电建	13,751,178.00	3.25
42	000933	神火股份	13,619,676.00	3.22
43	300763	锦浪科技	13,498,821.50	3.19
44	600026	中远海能	13,490,887.40	3.18
45	688733	壹石通	13,401,346.40	3.16
46	300320	海达股份	13,357,881.20	3.15
47	600941	中国移动	13,331,379.89	3.15
48	002738	中矿资源	12,880,711.76	3.04
49	002555	三七互娱	12,758,940.92	3.01
50	001205	盛航股份	12,723,046.16	3.00
51	000625	长安汽车	12,686,071.27	2.99
52	601888	中国中免	12,480,607.00	2.95
53	000858	五粮液	12,447,891.00	2.94
54	688012	中微公司	12,406,897.39	2.93
55	300327	中颖电子	12,218,288.70	2.88
56	000915	华特达因	12,066,808.28	2.85
57	300661	圣邦股份	11,992,719.60	2.83
58	301268	铭利达	11,869,007.70	2.80
59	300274	阳光电源	11,784,250.00	2.78
60	603613	国联股份	11,771,305.58	2.78
61	002444	巨星科技	11,658,125.00	2.75
62	603185	上机数控	11,546,702.20	2.73
63	002384	东山精密	11,410,485.76	2.69
64	002312	川发龙蟒	11,393,647.50	2.69
65	002714	牧原股份	11,251,013.24	2.66
66	002121	科陆电子	10,871,185.00	2.57
67	002993	奥海科技	10,820,809.40	2.55
68	000069	华侨城 A	10,817,157.99	2.55
69	301099	雅创电子	10,810,448.33	2.55
70	301030	仕净科技	10,791,620.00	2.55
71	002709	天赐材料	10,743,157.00	2.54
72	002518	科士达	10,672,800.39	2.52
73	300842	帝科股份	10,600,345.28	2.50
74	600438	通威股份	10,500,468.89	2.48
75	688778	厦钨新能	10,382,423.21	2.45

76	000301	东方盛虹	10,374,691.00	2.45
77	300068	南都电源	10,347,617.17	2.44
78	600884	杉杉股份	10,285,096.74	2.43
79	300125	聆达股份	10,261,151.00	2.42
80	002166	莱茵生物	10,253,389.00	2.42
81	600048	保利发展	10,252,867.97	2.42
82	601111	中国国航	10,213,323.00	2.41
83	600256	广汇能源	10,184,491.00	2.40
84	301349	信德新材	10,020,134.00	2.37
85	002594	比亚迪	10,010,165.00	2.36
86	002745	木林森	9,986,666.00	2.36
87	000420	吉林化纤	9,943,756.00	2.35
88	300443	金雷股份	9,869,684.00	2.33
89	600746	江苏索普	9,818,952.00	2.32
90	002006	精功科技	9,767,863.50	2.31
91	002192	融捷股份	9,693,453.00	2.29
92	603218	日月股份	9,582,398.30	2.26
93	688111	金山办公	9,547,623.80	2.25
94	600623	华谊集团	9,530,612.72	2.25
95	688385	复旦微电	9,352,161.10	2.21
96	002603	以岭药业	9,322,847.00	2.20
97	600938	中国海油	9,211,573.98	2.17
98	601012	隆基绿能	9,167,321.52	2.16
99	600536	中国软件	9,163,978.50	2.16
100	002335	科华数据	9,152,126.00	2.16
101	600152	维科技术	9,106,268.10	2.15
102	600153	建发股份	8,915,213.46	2.10
103	002291	遥望科技	8,902,177.00	2.10
104	300750	宁德时代	8,865,798.00	2.09
105	601231	环旭电子	8,810,300.18	2.08
106	601225	陕西煤业	8,728,915.00	2.06
107	002179	中航光电	8,722,138.03	2.06
108	002244	滨江集团	8,579,064.00	2.03

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002466	天齐锂业	49,349,506.75	11.65
2	603606	东方电缆	41,896,031.80	9.89
3	002371	北方华创	41,310,549.48	9.75
4	603612	索通发展	38,194,700.60	9.02
5	300565	科信技术	34,974,929.70	8.26

6	603260	合盛硅业	33,159,303.24	7.83
7	300666	江丰电子	33,044,000.40	7.80
8	688037	芯源微	31,882,352.08	7.53
9	002865	钧达股份	27,540,607.50	6.50
10	002487	大金重工	26,455,246.79	6.25
11	000420	吉林化纤	25,242,927.18	5.96
12	603985	恒润股份	25,006,711.18	5.90
13	002068	黑猫股份	24,882,744.10	5.87
14	002459	晶澳科技	24,766,076.24	5.85
15	000792	盐湖股份	23,625,032.74	5.58
16	300443	金雷股份	22,772,712.00	5.38
17	601908	京运通	21,694,190.56	5.12
18	605117	德业股份	21,587,469.08	5.10
19	002013	中航机电	19,020,812.00	4.49
20	688599	天合光能	18,725,903.70	4.42
21	688063	派能科技	18,466,729.02	4.36
22	600690	海尔智家	18,190,376.00	4.29
23	600941	中国移动	17,135,069.70	4.05
24	002594	比亚迪	16,927,367.25	4.00
25	002475	立讯精密	16,662,349.00	3.93
26	002192	融捷股份	16,532,960.00	3.90
27	000333	美的集团	16,524,176.38	3.90
28	300769	德方纳米	16,244,230.00	3.83
29	600745	闻泰科技	15,928,822.67	3.76
30	600460	士兰微	15,885,631.00	3.75
31	002483	润邦股份	15,751,654.08	3.72
32	600418	江淮汽车	15,707,248.00	3.71
33	603290	斯达半导	15,643,090.00	3.69
34	600989	宝丰能源	15,223,446.33	3.59
35	300750	宁德时代	15,067,880.00	3.56
36	000625	长安汽车	14,686,134.10	3.47
37	600036	招商银行	14,676,453.00	3.46
38	600038	中直股份	14,638,064.00	3.46
39	600383	金地集团	14,463,471.84	3.41
40	002240	盛新锂能	14,261,987.00	3.37
41	300438	鹏辉能源	14,183,981.02	3.35
42	300763	锦浪科技	14,175,012.58	3.35
43	600325	华发股份	13,921,221.14	3.29
44	300014	亿纬锂能	13,912,909.96	3.28
45	000768	中航西飞	13,635,536.21	3.22
46	600141	兴发集团	13,437,354.00	3.17
47	300026	红日药业	13,121,388.00	3.10
48	002460	赣锋锂业	13,110,030.45	3.09

49	300059	东方财富	13,088,014.00	3.09
50	603688	石英股份	13,017,298.60	3.07
51	300604	长川科技	12,999,679.00	3.07
52	603566	普莱柯	12,917,400.00	3.05
53	300842	帝科股份	12,838,126.76	3.03
54	601800	中国交建	12,724,662.10	3.00
55	002166	莱茵生物	12,647,453.20	2.99
56	300481	濮阳惠成	12,640,012.00	2.98
57	601888	中国中免	12,541,505.00	2.96
58	003022	联泓新科	12,494,220.00	2.95
59	001205	盛航股份	12,484,108.65	2.95
60	601669	中国电建	12,434,381.00	2.94
61	600026	中远海能	12,424,029.10	2.93
62	601168	西部矿业	12,116,070.00	2.86
63	688733	壹石通	12,068,444.77	2.85
64	002245	蔚蓝锂芯	11,991,718.00	2.83
65	000915	华特达因	11,921,058.00	2.81
66	688261	东微半导	11,856,812.53	2.80
67	000858	五粮液	11,856,470.00	2.80
68	600884	杉杉股份	11,671,294.00	2.76
69	300320	海达股份	11,613,663.32	2.74
70	600152	维科技术	11,613,342.84	2.74
71	601012	隆基绿能	11,612,941.20	2.74
72	002738	中矿资源	11,553,518.00	2.73
73	301268	铭利达	11,377,445.13	2.69
74	002993	奥海科技	11,316,146.10	2.67
75	300327	中颖电子	11,230,937.07	2.65
76	688012	中微公司	11,144,170.64	2.63
77	600570	恒生电子	11,043,714.12	2.61
78	002518	科士达	10,838,682.78	2.56
79	002531	天顺风能	10,778,516.00	2.54
80	600256	广汇能源	10,691,256.00	2.52
81	000733	振华科技	10,685,995.90	2.52
82	002384	东山精密	10,646,469.00	2.51
83	002714	牧原股份	10,610,401.78	2.50
84	002444	巨星科技	10,506,091.22	2.48
85	002312	川发龙蟒	10,500,793.00	2.48
86	002006	精功科技	10,467,879.00	2.47
87	603185	上机数控	10,433,573.80	2.46
88	300068	南都电源	10,380,278.04	2.45
89	000933	神火股份	10,202,527.00	2.41
90	301030	仕净科技	10,188,379.14	2.41
91	002121	科陆电子	10,070,355.00	2.38

92	600746	江苏索普	10,026,638.00	2.37
93	000069	华侨城 A	9,988,196.00	2.36
94	600938	中国海油	9,961,796.21	2.35
95	601231	环旭电子	9,785,073.44	2.31
96	601225	陕西煤业	9,712,983.00	2.29
97	301099	雅创电子	9,685,477.43	2.29
98	688778	厦钨新能	9,649,160.42	2.28
99	002555	三七互娱	9,581,792.00	2.26
100	002745	木林森	9,573,037.00	2.26
101	002291	遥望科技	9,511,089.00	2.25
102	603613	国联股份	9,429,929.40	2.23
103	002709	天赐材料	9,393,893.00	2.22
104	002335	科华数据	9,312,522.00	2.20
105	300661	圣邦股份	9,271,345.00	2.19
106	300125	聆达股份	9,218,828.00	2.18
107	600623	华谊集团	9,058,020.88	2.14
108	601111	中国国航	9,000,284.00	2.12
109	000301	东方盛虹	8,898,822.00	2.10
110	600438	通威股份	8,852,118.00	2.09
111	000778	新兴铸管	8,830,803.00	2.08
112	688680	海优新材	8,769,765.67	2.07
113	002603	以岭药业	8,591,747.40	2.03
114	600048	保利发展	8,566,305.00	2.02

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

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	2,343,455,239.83
卖出股票收入（成交）总额	2,416,724,045.80

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 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 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

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	306,399.38
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	180,673.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	487,073.16

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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 (%)
万家人工智能混合 A	38,805	2,905.45	3,417,507.77	3.03	109,328,331.92	96.97
万家人工智能混合 C	2,111	2,746.61	-	-	5,798,103.94	100.00
合计	40,617	2,918.58	3,417,507.77	2.88	115,126,435.86	97.12

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	万家人工智能混合 A	947,025.23	0.8400
	万家人工智能混合 C	36,870.64	0.6359
	合计	983,895.87	0.8300

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、基金投资和研究人员持有本开放式基金	万家人工智能混合 A	10~50
	万家人工智能混合 C	0

	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	万家人工智能混合 A	10~50
	万家人工智能混合 C	0
	合计	10~50

§ 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	136,166,236.79	6,114,259.64
本报告期基金总申购份额	59,997,950.36	11,745,196.70
减：本报告期基金总赎回份额	83,418,347.46	12,061,352.40
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	112,745,839.69	5,798,103.94

§ 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：

2022 年 8 月 24 日，公司聘任莫海波先生担任公司副总经理。

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

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

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	1,668,313,019.37	35.10	1,553,699.43	35.12	-
天风证券	2	1,351,741,296.82	28.44	1,258,882.69	28.45	-
海通证券	1	534,232,294.92	11.24	497,540.12	11.25	-
华创证券	2	521,686,506.38	10.98	485,846.35	10.98	-
民生证券	1	406,521,109.82	8.55	378,592.24	8.56	-
东方财富证券	2	265,290,202.49	5.58	247,065.27	5.58	-
兴业证券	3	5,109,146.97	0.11	2,554.60	0.06	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

广州证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
中银国际 证券	3	-	-	-	-	-

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：

无

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

本基金本报告期内未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	万家基金管理有限公司关于旗下万家人工智能基金在民生证券开通申购、	指定媒介	2022-01-18

	转换、定投及参与其费率优惠活动的公告		
2	万家人工智能混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	指定媒介	2022-01-21
3	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在泰信财富开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-03-07
4	万家基金管理有限公司关于旗下基金新增招商银行为销售机构并开通转换、基金定投业务的公告	指定媒介	2022-03-16
5	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金调整最低申购金额的公告	指定媒介	2022-03-22
6	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宜信普泽为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-03-24
7	万家人工智能混合型证券投资基金 2021 年年度报告	指定媒介	2022-03-30
8	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增攀赢基金为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-04-12
9	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商银行股份有限公司招赢通平台为销售机构并开通相关业务的公告	指定媒介	2022-04-15
10	万家人工智能混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	指定媒介	2022-04-21
11	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中欧财富为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-05-26
12	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宁波银行为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-06-17
13	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增苏宁基金为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-07-12
14	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增新兰德为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-07-14

15	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增万得基金为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-07-15
16	万家人工智能混合型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	指定媒介	2022-07-20
17	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在九州证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-08-02
18	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在东莞证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-08-29
19	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江苏银行为销售机构并开通转换、基金定投业务的公告	指定媒介	2022-08-29
20	万家人工智能混合型证券投资基金 2022 年中期报告	指定媒介	2022-08-30
21	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在招商证券开通申购、转换、定投及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-08-30
22	万家人工智能混合型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	指定媒介	2022-10-25
23	万家人工智能混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	指定媒介	2022-11-08
24	万家人工智能混合型证券投资基金招募说明书（2022 年第 1 号）	指定媒介	2022-11-08
25	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在海通证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-11-11
26	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增新浪仓石为销售机构并开通转换、基金定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-12-03
27	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增贵州银行为销售机构并开通转换、基金定投业务及参加费率优惠活动的公告	指定媒介	2022-12-06

§ 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、万家人工智能混合型证券投资基金 2022 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住所，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

2023 年 3 月 30 日