

万家家瑞债券型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 28 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 2023 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	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	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
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	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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	19
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	19
§ 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	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	22
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	25
§ 8 投资组合报告	56

8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	57
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	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
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	67
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	68
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	68
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	68
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
8.11 投资组合报告附注	68
§ 9 基金份额持有人信息	69
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
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	70
§ 10 开放式基金份额变动	70
§ 11 重大事件揭示	70
11.1 基金份额持有人大会决议	70
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	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
11.4 基金投资策略的改变	71
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
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	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
11.8 其他重大事件	74
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	74
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	74
§ 13 备查文件目录	75
13.1 备查文件目录	75
13.2 存放地点	75
13.3 查阅方式	75

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家家瑞债券型证券投资基金	
基金简称	万家家瑞债券	
基金主代码	004571	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 9 月 20 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,829,179,853.83 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	万家家瑞债券 A	万家家瑞债券 C
下属分级基金的交易代码	004571	004572
报告期末下属分级基金的份额总额	1,759,310,043.07 份	69,869,810.76 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险并保持良好流动性的基础上，力争实现超越业绩比较基准的收益。
投资策略	（一）固定收益类资产投资策略：1、资产配置策略；2、利率预期策略；3、期限结构配置策略；4、债券品种选择策略；5、信用债券投资的风险管理；6、资产支持证券等品种投资策略；7、可转换债券投资策略； （二）股票投资策略：1、仓位配置策略；2、行业配置策略；3、个股投资策略；4、存托凭证投资策略； （三）衍生工具投资策略：国债期货的投资策略。
业绩比较基准	中债总全价指数（总值）收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金，属于中低风险/收益的产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	万家基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑
	联系电话	021-38909626
	电子邮箱	lanj@wjasset.com
客户服务电话	4008880800	95588
传真	021-38909627	010-66105798
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址	中国（上海）自由贸易试验区浦 电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200122	100140
法定代表人	方一天	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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	2023 年		2022 年		2021 年	
	万家瑞债券 A	万家瑞债券 C	万家瑞债券 A	万家瑞债券 C	万家瑞债券 A	万家瑞债券 C
本期已实现收益	-27,263,416.72	-2,373,327.58	-7,890,455.83	-62,293.58	21,912,155.03	990,062.71
本期利润	-30,280,074.27	-3,343,831.98	-12,088,325.60	-132,598.40	17,658,283.59	886,350.59
加权平均基金份额本期利润	-0.0235	-0.0515	-0.0346	-0.0568	0.0324	0.0289
本期加权平均净值利润	-2.08%	-4.65%	-3.02%	-5.00%	2.64%	2.40%

率						
本期基金份额净值增长率	0.97%	0.58%	-3.20%	-3.59%	3.39%	2.95%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	203,470,581.79	6,175,850.97	51,418,601.22	230,864.84	45,044,007.09	1,145,616.53
期末可供分配基金份额利润	0.1157	0.0884	0.1084	0.0857	0.1789	0.1592
期末基金资产净值	1,968,999,912.35	76,300,939.04	525,929,384.52	2,923,233.61	300,261,038.83	8,443,482.23
期末基金份额净值	1.1192	1.0920	1.1084	1.0857	1.1929	1.1730
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	22.08%	19.09%	20.90%	18.40%	24.90%	22.81%

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

万家瑞瑞债券 A

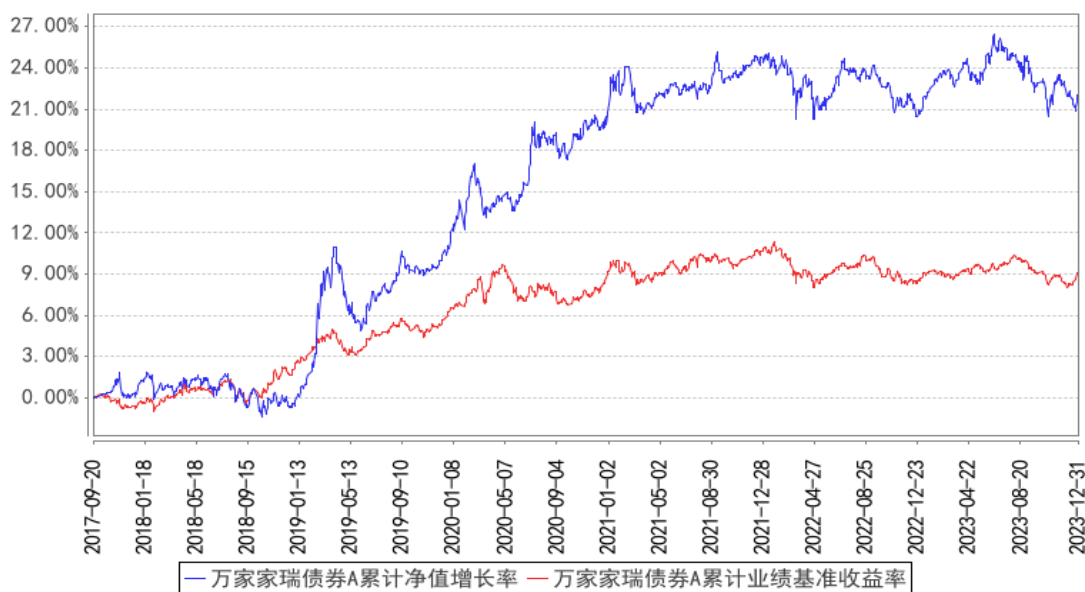
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.71%	0.26%	0.03%	0.10%	-0.74%	0.16%
过去六个月	-3.10%	0.26%	-0.38%	0.09%	-2.72%	0.17%
过去一年	0.97%	0.24%	0.36%	0.09%	0.61%	0.15%
过去三年	1.06%	0.24%	-0.07%	0.13%	1.13%	0.11%
过去五年	22.59%	0.28%	6.90%	0.13%	15.69%	0.15%
自基金合同生效起至今	22.08%	0.27%	9.12%	0.13%	12.96%	0.14%

万家瑞瑞债券 C

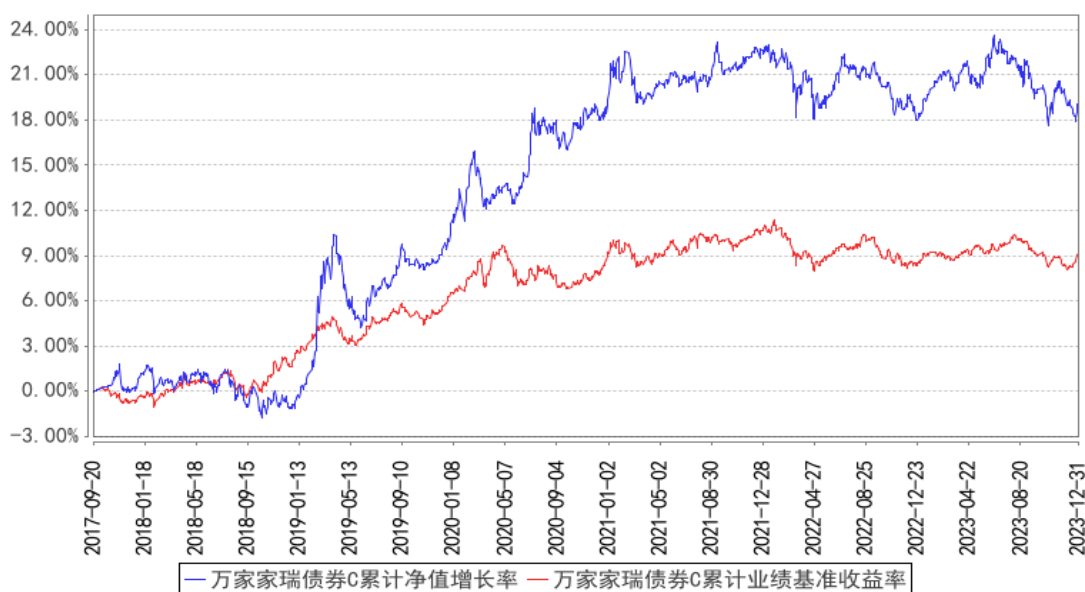
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.82%	0.26%	0.03%	0.10%	-0.85%	0.16%
过去六个月	-3.29%	0.26%	-0.38%	0.09%	-2.91%	0.17%
过去一年	0.58%	0.24%	0.36%	0.09%	0.22%	0.15%
过去三年	-0.17%	0.24%	-0.07%	0.13%	-0.10%	0.11%
过去五年	20.15%	0.28%	6.90%	0.13%	13.25%	0.15%
自基金合同生效起至今	19.09%	0.27%	9.12%	0.13%	9.97%	0.14%

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

万家瑞债券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



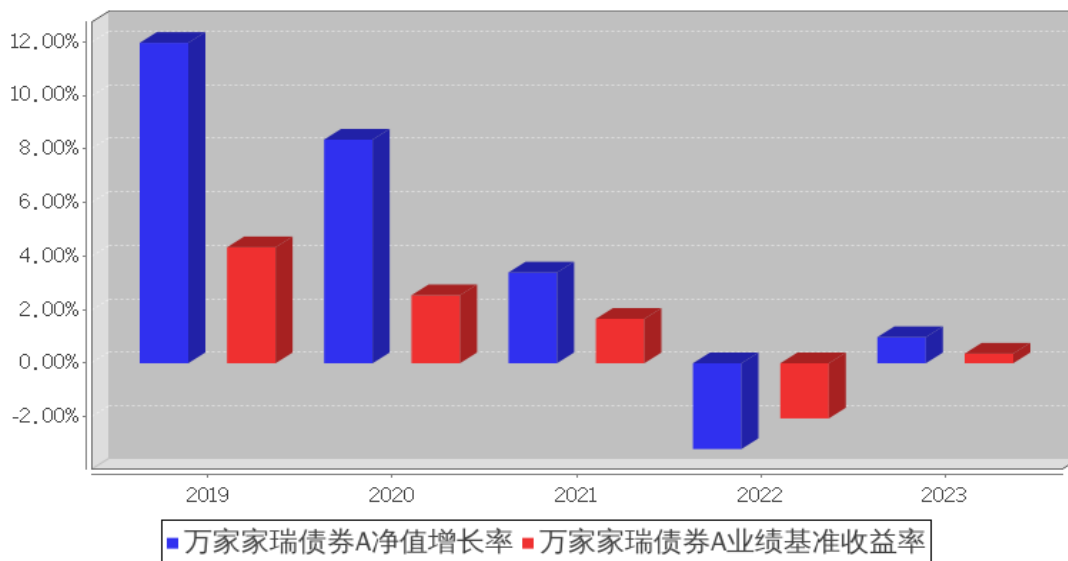
万家瑞债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



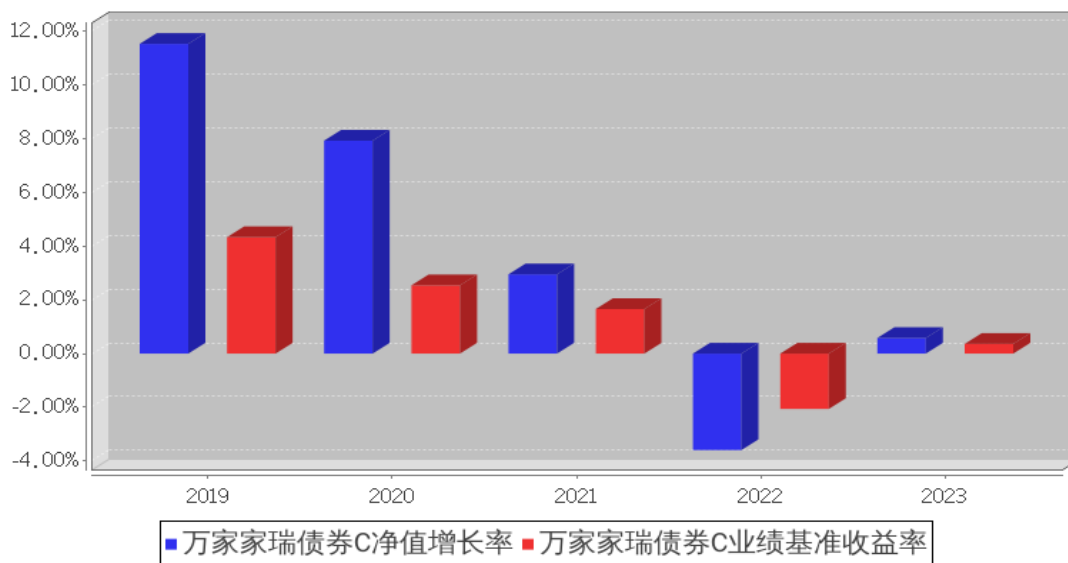
注：本基金于 2017 年 9 月 20 日成立，根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

3.2.3 过去五年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

万家家瑞债券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



万家家瑞债券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

单位：人民币元

万家家瑞债券 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	0.4700	15,327,142.09	1,300,846.89	16,627,988.98	-
2021 年	0.5600	12,894,109.02	1,615,307.05	14,509,416.07	-
合计	1.0300	28,221,251.11	2,916,153.94	31,137,405.05	-

		1		5	
万家家瑞债券 C					
年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	0.4600	68,966.75	4,971.92	73,938.67	-
2021 年	0.5500	387,155.08	8,076.28	395,231.36	-
合计	1.0100	456,121.83	13,048.20	469,170.03	-

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44 号文批准设立。截至报告期末，公司的股东为中泰证券股份有限公司、山东省新动能基金管理有限公司，住所：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层），办公地点：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层），注册资本 3 亿元人民币。截至报告期末，公司共管理一百四十只开放式基金，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）、万家沪港深蓝筹混合型证券投资基金、万家北交所慧选两年定期开放混合型证券投资基金、万家鼎鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家新机遇成长一年持有期混合型发起式证券投资基金、万家港股通精选混合型证券投资基金、万家景气驱动混合型证券投资基金、万家安恒纯债 3 个月持有期债券型发起式证券投资基金、万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫橙纯债

债券型证券投资基金、万家聚优稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、万家新能源主题混合型发起式证券投资基金、万家中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、万家匠心致远一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫融纯债债券型证券投资基金、万家颐远均衡一年持有期混合型发起式证券投资基金、万家鑫耀纯债债券型证券投资基金、万家欣远混合型证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家惠利债券型证券投资基金、万家鑫怡债券型证券投资基金、万家优享平衡混合型发起式证券投资基金、万家洞见进取混合型发起式证券投资基金、万家沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、万家中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金、万家沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家元贞量化选股股票型证券投资基金、万家 CFETS0-3 年期政策性金融债指数证券投资基金、万家中证软件服务指数型发起式证券投资基金、万家先进制造混合型发起式证券投资基金、万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金、万家颐德一年持有期混合型证券投资基金、万家北证 50 成份指数型发起式证券投资基金、万家恒生互联网科技业指数型发起式证券投资基金 (QDII)、万家中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家欣优混合型证券投资基金、万家集利债券型发起式证券投资基金、万家远见先锋一年持有期混合型证券投资基金、万家国证 2000 指数增强型证券投资基金、万家纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII)、万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金、万家稳安 60 天持有期债券型证券投资基金、万家周期驱动股票型发起式证券投资基金、万家优选积极三个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、万家养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、万家红利量化选股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		
乔亮	公司领导副总经理；万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、万家元贞量化选股股票型证券投资基金、	2022 年 12 月 6 日	-	17 年	国籍：中国；学历：美国斯坦福大学工商管理博士，2019 年 7 月入职万家基金管理有限公司，现任公司副总经理、基金经理，历任总经理助理、量化投资部总监（兼）。曾任美国巴克莱国际投资管理公司投资部基金经理，加拿大退休基金国际投资管理公司量化投资部基金经理，南方基金管理有限公司量化投资部

	万家创业板指数增强型证券投资基金、万家国证2000 指数增强型证券投资基金、万家家瑞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、万家量化睿选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的基金经理				投资经理，通联数据股份公司联合创始人、首席投资官，上海寻乾资产管理有限公司投资总监、总经理，巨杉（上海）资产管理有限公司量化投资部投资总监等职。
周慧	万家家瑞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、万家瑞丰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、万家鑫丰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、万家鑫融纯债债券型证券投资基金的基金经理	2023 年 6 月 2 日	-	11 年	国籍：中国；学历：上海交通大学工商管理硕士，2012 年 11 月入职万家基金管理有限公司，现任债券投资部基金经理，曾任交易部债券交易员、债券投资部基金经理助理等职。
莫敬敏	报告期内已离职	2022 年 12 月 6 日	2023 年 6 月 2 日	7.5 年	国籍：中国；学历：英国爱丁堡大学金融数学专业硕士，2015 年 12 月入职万家基金管理有限公司，任债券投资部基金经理，历任固定收益部债券研究员、基金经理助理，债券投资部基金经理助理。曾任上海普华永道中天会计师事务所审计部审计师等职。

					报告期内已离职。
--	--	--	--	--	----------

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内，本基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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，公司执行交易系统内的公平交易程序；(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 40 次，均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。

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

债券部分：

报告期内，本产品债券底仓部分保持着利率债和高等级信用债的高流动性组合，由于资产荒的原因，组合于一季度适当拉长了持仓信用债的久期，取得了良好的骑乘收益；并于二季度适当增加了高等级二级资本债的仓位以抬升静态收益，同时严格控制底仓久期，确保固定的票息收益。此外，组合会在潜在胜率较高的交易环境下以 10%以内的仓位适度参与中长久期利率债的波段交易机会，如在 6 月、8 月初布局了长端仓位并及时兑现降息后的收益下行过程，在 10 月下旬政府债供给压力缓和后加仓长债并于 11 月初兑现收益，并在 12 月保持了一定的久期水平。

权益部分：

从 2022 年 12 月开始，本产品股票部分的投资策略以偏股混合型基金指数作为投资希望战胜的目标，通过我们的量化选股和行业配置策略，主动适应不同的市场风格，前瞻性选股，提高选股胜率，以追求（相对于偏股混合型基金指数）能获得长期稳定的超额收益。万家瑞的股票投资在风格配置上相对均衡，行业配置偏向于行业景气度高的行业。在量化选股方面精选行业内质优个股组合，持股较为分散。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家瑞债券 A 的基金份额净值为 1.1192 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.97%，同期业绩比较基准收益率为 0.36%；截至本报告期末万家瑞债券 C 的基金份额净值为

1.0920 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.58%，同期业绩比较基准收益率为 0.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

债券部分：

利率债方面，由于 2024 年初债券市场行情异常火爆，10 年国债连续突破关键点位并创近 10 年的历史新低，收益率的进一步下行需要更加强有力的催化剂来触发（比如政策利率大幅下调超过 10bp），因此现阶段有一定盘整需要，组合对市场的看法也较为中性。后续风险偏好的继续修复，需要基本面数据给出更多定价线索，在此之前债市并无系统性风险；而若两会后基于政策端的博弈不及预期，那么债市有望蓄积新一轮做多的动力。

信用债方面，如果流动性环境保持宽松，中高评级短券仍有一定演绎空间；而弱资质区域的下沉策略面临利差保护不足的问题，进一步挖掘的性价比不高。总体上，在期限利差和等级利差都极致收敛的情况下，需要逐步提升底仓资产的流动性。

权益部分：

2024 年初 A 股市场出现了阶段性的恐慌下跌，超出了基于基本面理解的跌幅，当前主要宽基指数的估值均处于历史较低位置。随着中央汇金公司发布公告表示，充分认可当前 A 股市场配置价值，扩大 ETF 指数基金增持范围，并将持续加大增持力度、扩大增持规模，市场流动性得到改善。展望后市，1 月社融数据好于预期、春节消费数据亮点频出，此前市场对经济过于悲观的预期有望得到修复，但持续性有待进一步观察，未来经济核心需要观察地产和出口数据。近期监管召开系列座谈会，就加强资本市场监管、防范化解风险、推动资本市场高质量发展广泛听取各方面意见建议，为资本市场的健康发展凝聚信心。总体来看，当前 A 股整体估值处于较低区间，随着国内政策继续发力、海外经济需求回暖，未来 A 股指数有望开启震荡向上的行情走势。

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形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 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[2024]第 ZA30308 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	万家瑞瑞债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了万家瑞瑞债券型证券投资基金（以下简称“万家瑞瑞债券”）财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产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，公允反映了万家瑞瑞债券 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。
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。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，我们独立于万家瑞瑞债券，并履行了职业道德

	<p>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>万家家瑞债券的基金管理人万家基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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，基金管理人管理层负责评估万家家瑞债券的持续经营能力，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家瑞债券的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价基金管理人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）对基金管理人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，就可能对万家家瑞债券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家瑞债券不能持续经营。</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	2024 年 03 月 28 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：万家家瑞债券型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	445,467.17	8,877,903.91
结算备付金		30,826,179.61	1,523,521.47
存出保证金		244,686.55	49,736.78
交易性金融资产	7.4.7.2	2,245,796,829.42	529,348,117.06
其中：股票投资		379,937,676.23	94,066,758.34
基金投资		-	-
债券投资		1,865,859,153.19	435,281,358.72
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	104,009,438.28	-7,600.36
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		19,330,705.94	14,280,658.96
应收股利		-	-
应收申购款		17,146.21	44,999,299.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		2,400,670,453.18	599,071,637.74
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 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		318,296,093.61	42,032,024.62
应付清算款		19,464,015.02	27,221,648.51
应付赎回款		13,137,037.49	-
应付管理人报酬		1,261,726.46	255,317.73
应付托管费		360,493.28	72,947.94
应付销售服务费		36,278.07	775.63
应付投资顾问费		-	-
应交税费		141,596.43	7,322.79
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	2,672,361.43	628,982.39
负债合计		355,369,601.79	70,219,019.61
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	1,829,179,853.83	477,203,152.07
其他综合收益	7.4.7.8	-	-
未分配利润	7.4.7.9	216,120,997.56	51,649,466.06
净资产合计		2,045,300,851.39	528,852,618.13
负债和净资产总计		2,400,670,453.18	599,071,637.74

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 1,829,179,853.83 份，其中万家家瑞债券 A 基金份额净值 1.1192 元，基金份额总额 1,759,310,043.07 份；万家家瑞债券 C 基金份额净值 1.0920 元，基金份额总额 69,869,810.76 份。

7.2 利润表

会计主体：万家家瑞债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-14,726,892.40	-7,850,921.22
1. 利息收入		586,840.23	162,274.22
其中：存款利息收入	7.4.7.10	319,849.18	40,869.36
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		266,991.05	121,404.86
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-11,489,584.99	-3,746,195.12
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-57,300,930.54	-14,349,304.05

基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	42,677,146.17	9,202,360.22
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13	-	102,757.30
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	3,134,199.38	1,297,991.41
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	-3,987,161.95	-4,268,174.59
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	163,014.31	1,174.27
减：二、营业总支出		18,897,013.85	4,370,002.78
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	10,596,759.46	2,806,174.08
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,027,645.60	801,764.13
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	282,453.91	10,912.15
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		4,630,465.73	534,393.48
其中：卖出回购金融资产 支出		4,630,465.73	534,393.48
6. 信用减值损失	7.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		130,120.77	14,204.32
8. 其他费用	7.4.7.20	229,568.38	202,554.62
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-33,623,906.25	-12,220,924.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-33,623,906.25	-12,220,924.00
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		-33,623,906.25	-12,220,924.00

7.3 净资产变动表

会计主体：万家家瑞债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 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	477,203,152.07	-	51,649,466.06	528,852,618.13
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	477,203,152.07	-	51,649,466.06	528,852,618.13
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,351,976,701.76	-	164,471,531.50	1,516,448,233.26
(一)、综合收益总额	-	-	-33,623,906.25	-33,623,906.25
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	1,351,976,701.76	-	198,095,437.75	1,550,072,139.51
其中：1. 基金申购款	1,966,129,534.56	-	274,185,069.82	2,240,314,604.38
2. 基金赎回款	-614,152,832.80	-	-76,089,632.07	-690,242,464.87
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,829,179,853.83	-	216,120,997.56	2,045,300,851.39
项目	上年度可比期间			
	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	258,912,696.41	-	49,791,824.65	308,704,521.06

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	258,912,696.41	-	49,791,824.65	308,704,521.06
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	218,290,455.66	-	1,857,641.41	220,148,097.07
(一)、综合收益总额	-	-	-12,220,924.00	-12,220,924.00
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	218,290,455.66	-	30,780,493.06	249,070,948.72
其中：1. 基金申购款	271,226,793.80	-	39,077,988.29	310,304,782.09
2. 基金赎回款	-52,936,338.14	-	-8,297,495.23	-61,233,833.37
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-16,701,927.65	-16,701,927.65
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	477,203,152.07	-	51,649,466.06	528,852,618.13

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

万家家瑞债券型证券投资基金（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[2017]502号文《关于核准万家家瑞债券型证券投资基金募集的批复》的批准,由万家基金管理有限公司作为管理人于2017年8月21日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验资并出具安永华明(2017)验字第60778298_B03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2017年9月20日正式生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币286,881,975.30元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币39,850.15元,以上实收基金(本息)合计为人民币286,921,825.45元,折合286,921,825.45份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为万家基金管理有限公司,注册登记机构为万家基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要为国内依法发行的债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、国债期货等金融工具以及国内依法发行上市的股票(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、存托权证)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。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:本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%;每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。其中,现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准:中债总全价指数(总值)收益率*90%+沪深300指数收益率*10%。

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2023年12月31日的财

务状况以及 2023 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

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。

2、金融负债分类

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。

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

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。

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

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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别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) 在符合法律法规及基金合同约定，且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，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；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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》及中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》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；

根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	445,467.17	8,877,903.91
等于：本金	445,004.15	8,876,301.50
加：应计利息	463.02	1,602.41
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	445,467.17	8,877,903.91

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	381,704,833.86	-	379,937,676.23	-1,767,157.63
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	616,475,454.61	7,978,138.71	622,015,418.71	-2,438,174.61
交易所市场				

	银行间市场	1,231,173,630.67	14,432,334.48	1,243,843,734.48	-1,762,230.67
	合计	1,847,649,085.28	22,410,473.19	1,865,859,153.19	-4,200,405.28
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,229,353,919.14	22,410,473.19	2,245,796,829.42	-5,967,562.91
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票		94,755,269.35	-	94,066,758.34	-688,511.01
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	86,025,987.02	1,154,099.63	86,454,992.03	-725,094.62
	银行间市场	344,402,595.33	4,990,566.69	348,826,366.69	-566,795.33
	合计	430,428,582.35	6,144,666.32	435,281,358.72	-1,291,889.95
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		525,183,851.70	6,144,666.32	529,348,117.06	-1,980,400.96

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	53,999,519.02	-
银行间市场	50,009,919.26	-
合计	104,009,438.28	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-7,600.36	-
银行间市场	-	-
合计	-7,600.36	-

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未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 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。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	5,429.02	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	2,498,932.41	343,982.39
其中：交易所市场	2,491,637.45	336,729.79
银行间市场	7,294.96	7,252.60
应付利息	-	-
预提费用	168,000.00	285,000.00
合计	2,672,361.43	628,982.39

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

万家家瑞债券 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	474,510,783.30	474,510,783.30
本期申购	1,832,131,864.66	1,832,131,864.66
本期赎回（以“-”号填列）	-547,332,604.89	-547,332,604.89
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	1,759,310,043.07	1,759,310,043.07

万家家瑞债券 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,692,368.77	2,692,368.77
本期申购	133,997,669.90	133,997,669.90
本期赎回（以“-”号填列）	-66,820,227.91	-66,820,227.91
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	69,869,810.76	69,869,810.76

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

万家家瑞债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	52,166,278.90	-747,677.68	51,418,601.22
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	52,166,278.90	-747,677.68	51,418,601.22
本期利润	-27,263,416.72	-3,016,657.55	-30,280,074.27
本期基金份额交易产生的变动数	178,567,719.61	9,983,622.72	188,551,342.33
其中：基金申购款	249,931,981.71	8,456,098.37	258,388,080.08
基金赎回款	-71,364,262.10	1,527,524.35	-69,836,737.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	203,470,581.79	6,219,287.49	209,689,869.28

万家家瑞债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	234,486.14	-3,621.30	230,864.84
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	234,486.14	-3,621.30	230,864.84
本期利润	-2,373,327.58	-970,504.40	-3,343,831.98
本期基金份额交易产生的变动数	8,314,692.41	1,229,403.01	9,544,095.42
其中：基金申购款	14,916,373.22	880,616.52	15,796,989.74
基金赎回款	-6,601,680.81	348,786.49	-6,252,894.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,175,850.97	255,277.31	6,431,128.28

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	29,599.70	11,286.36
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	271,695.72	26,424.31
其他	18,553.76	3,158.69

合计	319,849.18	40,869.36
----	------------	-----------

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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-57,300,930.54	-14,349,304.05
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	-57,300,930.54	-14,349,304.05

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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	4,163,246,715.85	420,398,479.37
减：卖出股票成本总额	4,209,385,275.88	433,432,881.29
减：交易费用	11,162,370.51	1,314,902.13
买卖股票差价收入	-57,300,930.54	-14,349,304.05

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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	45,568,057.83	9,675,889.16
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收	-2,890,911.66	-473,528.94

入		
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	42,677,146.17	9,202,360.22

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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,146,807,969.48	685,728,343.92
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,119,282,793.66	676,255,363.57
减：应计利息总额	30,378,746.69	9,928,039.10
减：交易费用	37,340.79	18,470.19
买卖债券差价收入	-2,890,911.66	-473,528.94

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
资产支持证券投资收益——利息收入	-	102,757.30
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-	-
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-	102,757.30

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出资产支持证券成交总	-	10,350,400.00

额		
减：卖出资产支持证券成本总额	-	10,000,000.00
减：应计利息总额	-	350,400.00
减：交易费用	-	-
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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,134,199.38	1,297,991.41
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,134,199.38	1,297,991.41

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
1. 交易性金融资产	-3,987,161.95	-4,268,174.59
股票投资	-1,078,646.62	-2,659,341.78
债券投资	-2,908,515.33	-1,608,832.81
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	-3,987,161.95	-4,268,174.59

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	162,987.08	1,161.56
基金转换费收入	27.23	12.71
合计	163,014.31	1,174.27

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	48,000.00	45,000.00
信息披露费	120,000.00	110,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	24,518.38	10,804.62
账户维护费	37,050.00	36,750.00
合计	229,568.38	202,554.62

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

2024 年 2 月 20 日，基金管理人万家基金管理有限公司控制的上海万家朴智投资管理有限公司已办理完成工商注销手续。

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
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
中泰证券股份有限公司（“中泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
山东省新动能基金管理有限公司	基金管理人的股东
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
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
上海万家朴智投资管理有限公司（“万家”）	基金管理人控制的公司

朴智”)	
山东能源集团有限公司	基金管理人的实际控制人
齐河众鑫投资有限公司	基金管理人的股东

注：1、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。

2、2024 年 2 月 20 日，基金管理人万家基金管理有限公司控制的上海万家朴智投资管理有限公司已办理完成工商注销手续。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	1,821,486,440.27	21.03	271,618,896.99	30.38

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	2,983,427.97	0.31	105,375,820.79	24.88

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例 (%)
中泰证券	39,000,000.00	0.10	8,000,000.00	0.28

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 2023年1月1日至2023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	1,651,965.85	22.16	684,663.93	27.48
关联方名称	上年度可比期间 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 总额的比例 (%)
中泰证券	243,453.48	29.60	41,495.71	12.32

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 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	10,596,759.46
其中：应支付销售机构的客户维护 费	631,470.04	82,357.63
应支付基金管理人的净管理费	9,965,289.42	2,723,816.45

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.70%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力致使无法按时支付等，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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,027,645.60	801,764.13

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付等，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		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家家瑞债券 A	万家家瑞债券 C	合计
工商银行	-	449.79	449.79
万家基金	-	70,080.73	70,080.73
中泰证券	-	36.48	36.48
合计	-	70,567.00	70,567.00
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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		
	万家家瑞债券 A	万家家瑞债券 C	合计
万家基金	-	9,289.86	9,289.86
工商银行	-	603.01	603.01
中泰证券	-	36.44	36.44
合计	-	9,929.31	9,929.31

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据相关协议支付给各销售机构。若遇法定节假日、公休假或不可抗力致使无法按时支付等，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未与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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未与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

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

万家瑞瑞债券 A

关联方名称	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 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 (%)
万家共赢	4,512,547.39	0.2565	4,512,547.39	0.9510

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
工商银行	445,467.17	29,599.70	8,877,903.91	11,286.36

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

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（2023 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：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
118046	诺泰转债	2023 年 12 月 18 日	1-6 个月（含）	新债未上市	100.00	100.01	2,150	215,000.00	215,016.02	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000801	四川九洲	2023 年 12 月 21 日	重大事项停牌	7.70	2024 年 1 月 5 日	8.47	917,100	7,602,624.00	7,061,670.00	-

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 2023 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 2023 年 12 月 31 日止，本基金因从事证券交易所市场债券正回购交易形成的

卖出回购证券款余额为 318,296,093.61 元，将于 2024 年 1 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	56,926,293.15	111,053,088.76
合计	56,926,293.15	111,053,088.76

注：未评级债券为国债。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	1,432,640,581.20	218,497,109.43
AAA 以下	10,469,863.01	8,946,414.78
未评级	365,822,415.83	96,784,745.75
合计	1,808,932,860.04	324,228,269.96

注：未评级债券包括国债、政策性金融债、中期票据、公司债。

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（2023 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 202 3 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							
货币资金	445,467.17	-	-	-	-	-	445,467.17
结算备付金	30,826,179.61	-	-	-	-	-	30,826,179.61
存出保证金	244,686.55	-	-	-	-	-	244,686.55
交易性金融	51,647,981.37	154,496,590.60	1,039,514,770.49	519,326,641.33	100,873,169.40	379,937,676.23	2,245,796,829.42

资产							
买入返售金融资产	104,009,438.28	-	-	-	-	-	104,009,438.28
应收申购款	-	-	-	-	-	17,146.21	17,146.21
应收清算款	-	-	-	-	-	19,330,705.94	19,330,705.94
资产总计	187,173,752.98	154,496,590.60	1,039,514,770.49	519,326,641.33	100,873,169.40	399,285,528.38	2,400,670,453.18
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	13,137,037.49	13,137,037.49
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,261,726.46	1,261,726.46
应付托管费	-	-	-	-	-	360,493.28	360,493.28
应付	-	-	-	-	-	19,464,015.02	19,464,015.02

清算款							
卖出回购金融资产款	318,296,093.61	-	-	-	-	-	318,296,093.61
应付销售服务费	-	-	-	-	-	36,278.07	36,278.07
应交税费	-	-	-	-	-	141,596.43	141,596.43
其他负债	-	-	-	-	-	2,672,361.43	2,672,361.43
负债总计	318,296,093.61	-	-	-	-	37,073,508.18	355,369,601.79
利率敏感度缺口	-131,122,340.63	154,496,590.60	1,039,514,770.49	519,326,641.33	100,873,169.40	362,212,020.20	2,045,300,851.39
上年度末 2022 年	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

12月31日							
资产							
货币资金	8,877,903.91	-	-	-	-	-	8,877,903.91
结算备付金	1,523,521.47	-	-	-	-	-	1,523,521.47
存出保证金	49,736.78	-	-	-	-	-	49,736.78
交易性金融资产	10,202,095.89	75,746,265.41	174,418,803.43	174,914,193.99	-	94,066,758.34	529,348,117.06
买入返售金融资产	-7,600.36	-	-	-	-	-	-7,600.36
应收申购款	20,000,299.92	-	-	-	-	24,999,000.00	44,999,299.92
应收清算款	-	-	-	-	-	14,280,658.96	14,280,658.96

资产总计	40,645,957.61	75,746,265.41	174,418,803.43	174,914,193.99	-	133,346,417.30	599,071,637.74
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	255,317.73	255,317.73
应付托管费	-	-	-	-	-	72,947.94	72,947.94
应付清算款	-	-	-	-	-	27,221,648.51	27,221,648.51
卖出回购金融资产款	42,032,024.62	-	-	-	-	-	42,032,024.62
应付销售服务费	-	-	-	-	-	775.63	775.63
应交税费	-	-	-	-	-	7,322.79	7,322.79
其他	-	-	-	-	-	628,982.39	628,982.39

负债							
负债总计	42,032,024.62	-	-	-	-	28,186,994.99	70,219,019.61
利率敏感度缺口	-1,386,067.01	75,746,265.41	174,418,803.43	174,914,193.99	-	105,159,422.31	528,852,618.13

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

假设	除市场利率以外的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（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	市场利率下降25个基点	6,637,222.35	1,198,951.74
市场利率上升25个基点	-6,554,821.91	-1,192,040.71	

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 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	379,937,676.23	18.58	94,066,758.34	17.79
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	379,937,676.23	18.58	94,066,758.34	17.79

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		
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 (2023 年 12 月 31 日)	上年度末 (2022 年 12 月 31 日)
	股票基准指数上升 100 个基点	3,742,561.37	845,771.98
	股票基准指数下降 100 个基点	-3,742,561.37	-845,771.98

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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	372,876,006.23	111,312,412.41
第二层次	1,872,920,823.19	418,035,704.65
第三层次	-	-
合计	2,245,796,829.42	529,348,117.06

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

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。

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	379,937,676.23	15.83
	其中：股票	379,937,676.23	15.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,865,859,153.19	77.72

	其中：债券	1,865,859,153.19	77.72
	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	104,009,438.28	4.33
	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	31,271,646.78	1.30
8	其他各项资产	19,592,538.70	0.82
9	合计	2,400,670,453.18	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	2,605,276.00	0.13
C	制造业	298,100,803.47	14.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,268,610.00	0.06
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	13,197,245.09	0.65
G	交通运输、仓储和邮政业	1,234,472.00	0.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	37,688,934.89	1.84
J	金融业	3,521,355.00	0.17
K	房地产业	2,166,523.00	0.11
L	租赁和商务服务业	1,701,730.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	16,693,069.24	0.82
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	1,759,657.54	0.09
S	综合	-	-
	合计	379,937,676.23	18.58

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	600418	江淮汽车	449,200	7,254,580.00	0.35
2	000801	四川九洲	917,100	7,061,670.00	0.35
3	688259	创耀科技	84,746	5,756,795.78	0.28
4	603259	药明康德	75,900	5,522,484.00	0.27
5	688025	杰普特	58,000	5,367,900.00	0.26
6	601633	长城汽车	195,700	4,935,554.00	0.24
7	603110	东方材料	198,000	4,771,800.00	0.23
8	688234	天岳先进	70,700	4,671,149.00	0.23
9	603730	岱美股份	302,300	4,380,327.00	0.21
10	600114	东睦股份	282,000	4,368,180.00	0.21
11	300136	信维通信	183,700	4,335,320.00	0.21
12	600775	南京熊猫	324,700	4,302,275.00	0.21
13	603220	中贝通信	123,200	4,183,872.00	0.20
14	688169	石头科技	14,660	4,148,047.00	0.20
15	002050	三花智控	140,200	4,121,880.00	0.20
16	300045	华力创通	169,100	4,114,203.00	0.20
17	300595	欧普康视	180,300	4,071,174.00	0.20
18	002463	沪电股份	183,600	4,061,232.00	0.20
19	000338	潍柴动力	297,500	4,060,875.00	0.20
20	300213	佳讯飞鸿	546,400	3,934,080.00	0.19
21	300709	精研科技	124,500	3,883,155.00	0.19
22	688322	奥比中光	103,000	3,870,740.00	0.19
23	688235	百济神州	27,765	3,860,445.60	0.19
24	300308	中际旭创	34,100	3,850,231.00	0.19
25	002261	拓维信息	253,800	3,817,152.00	0.19
26	300394	天孚通信	40,700	3,724,864.00	0.18
27	000977	浪潮信息	110,500	3,668,600.00	0.18
28	300551	古鳌科技	203,900	3,547,860.00	0.17
29	688007	光峰科技	133,100	3,444,628.00	0.17
30	688170	德龙激光	88,000	3,436,400.00	0.17
31	300514	友讯达	209,500	3,414,850.00	0.17
32	603196	日播时尚	234,600	3,169,446.00	0.15
33	300432	富临精工	301,500	3,165,750.00	0.15
34	688213	思特威	56,300	3,128,028.00	0.15
35	300001	特锐德	152,200	3,059,220.00	0.15
36	300322	硕贝德	272,300	3,038,868.00	0.15
37	300279	和晶科技	464,300	3,004,021.00	0.15
38	688292	浩瀚深度	108,944	2,998,138.88	0.15
39	688223	晶科能源	332,500	2,945,950.00	0.14
40	688569	铁科轨道	105,007	2,899,243.27	0.14
41	002892	科力尔	179,400	2,886,546.00	0.14
42	600153	建发股份	299,300	2,882,259.00	0.14

43	002472	双环传动	109,500	2,849,190.00	0.14
44	301007	德迈仕	166,800	2,820,588.00	0.14
45	600066	宇通客车	212,100	2,810,325.00	0.14
46	603197	保隆科技	49,300	2,780,520.00	0.14
47	603486	科沃斯	66,800	2,768,192.00	0.14
48	688229	博睿数据	56,507	2,716,291.49	0.13
49	603516	淳中科技	117,400	2,637,978.00	0.13
50	002997	瑞鹄模具	76,000	2,532,320.00	0.12
51	688049	炬芯科技	66,211	2,520,652.77	0.12
52	688048	长光华芯	39,700	2,487,999.00	0.12
53	300272	开能健康	399,100	2,474,420.00	0.12
54	688158	优刻得	150,400	2,474,080.00	0.12
55	603677	奇精机械	164,200	2,387,468.00	0.12
56	603037	凯众股份	114,000	2,372,340.00	0.12
57	600438	通威股份	94,100	2,355,323.00	0.12
58	688095	福昕软件	33,700	2,353,945.00	0.12
59	688766	普冉股份	23,800	2,331,924.00	0.11
60	600449	宁夏建材	129,700	2,325,521.00	0.11
61	603659	璞泰来	110,700	2,316,951.00	0.11
62	301080	百普赛斯	39,000	2,298,660.00	0.11
63	300319	麦捷科技	234,000	2,255,760.00	0.11
64	300193	佳士科技	290,100	2,254,077.00	0.11
65	688076	诺泰生物	50,000	2,247,500.00	0.11
66	688159	有方科技	56,700	2,134,755.00	0.10
67	688018	乐鑫科技	20,722	2,133,329.90	0.10
68	688160	步科股份	34,700	2,018,846.00	0.10
69	688418	震有科技	106,573	2,009,966.78	0.10
70	300928	华安鑫创	39,600	1,997,424.00	0.10
71	600482	中国动力	110,800	1,995,508.00	0.10
72	603788	宁波高发	132,000	1,970,760.00	0.10
73	600710	苏美达	276,100	1,957,549.00	0.10
74	002662	京威股份	557,400	1,956,474.00	0.10
75	000625	长安汽车	115,700	1,947,231.00	0.10
76	688468	科美诊断	175,100	1,889,329.00	0.09
77	002826	易明医药	159,000	1,887,330.00	0.09
78	603195	公牛集团	19,600	1,874,740.00	0.09
79	301085	亚康股份	32,500	1,865,825.00	0.09
80	002436	兴森科技	123,000	1,811,790.00	0.09
81	300042	朗科科技	50,700	1,774,500.00	0.09
82	688208	道通科技	72,635	1,725,081.25	0.08
83	688177	百奥泰	40,836	1,684,076.64	0.08
84	300866	安克创新	18,900	1,674,540.00	0.08
85	688617	惠泰医疗	4,058	1,576,533.00	0.08

86	301052	果麦文化	34,993	1,531,993.54	0.07
87	300711	广哈通信	114,400	1,527,240.00	0.07
88	002559	亚威股份	131,500	1,516,195.00	0.07
89	300005	探路者	225,800	1,494,796.00	0.07
90	300368	汇金股份	217,700	1,484,714.00	0.07
91	002232	启明信息	87,300	1,479,735.00	0.07
92	300882	万胜智能	60,300	1,468,908.00	0.07
93	300735	光弘科技	62,400	1,468,896.00	0.07
94	000925	众合科技	169,600	1,468,736.00	0.07
95	002537	海联金汇	220,400	1,467,864.00	0.07
96	002517	恺英网络	130,000	1,452,100.00	0.07
97	688138	清溢光电	63,200	1,429,584.00	0.07
98	300161	华中数控	39,400	1,414,460.00	0.07
99	300030	阳普医疗	181,200	1,404,300.00	0.07
100	603933	睿能科技	90,000	1,399,500.00	0.07
101	300475	香农芯创	41,271	1,394,547.09	0.07
102	002609	捷顺科技	120,800	1,379,536.00	0.07
103	688071	华依科技	28,300	1,378,493.00	0.07
104	603682	锦和商管	238,900	1,371,286.00	0.07
105	002896	中大力德	37,700	1,370,395.00	0.07
106	002036	联创电子	134,100	1,369,161.00	0.07
107	300880	迦南智能	68,600	1,366,512.00	0.07
108	688733	壹石通	46,500	1,361,055.00	0.07
109	002745	木林森	155,800	1,349,228.00	0.07
110	603076	乐惠国际	50,300	1,348,040.00	0.07
111	688099	晶晨股份	21,508	1,347,046.04	0.07
112	603127	昭衍新药	56,800	1,346,728.00	0.07
113	300211	亿通科技	132,600	1,340,586.00	0.07
114	601198	东兴证券	161,100	1,325,853.00	0.06
115	603678	火炬电子	50,000	1,323,500.00	0.06
116	601577	长沙银行	193,300	1,318,306.00	0.06
117	601699	潞安环能	60,100	1,316,791.00	0.06
118	002947	恒铭达	40,700	1,309,726.00	0.06
119	300628	亿联网络	44,300	1,309,065.00	0.06
120	688222	成都先导	86,800	1,301,132.00	0.06
121	603387	基蛋生物	117,600	1,293,600.00	0.06
122	300746	汉嘉设计	128,300	1,289,415.00	0.06
123	601001	晋控煤业	104,500	1,288,485.00	0.06
124	601116	三江购物	118,600	1,287,996.00	0.06
125	002968	新大正	102,100	1,277,271.00	0.06
126	600025	华能水电	147,000	1,268,610.00	0.06
127	300951	博硕科技	19,517	1,264,311.26	0.06
128	000039	中集集团	164,400	1,257,660.00	0.06

129	603630	拉芳家化	82,100	1,256,130.00	0.06
130	300369	绿盟科技	132,400	1,248,532.00	0.06
131	603713	密尔克卫	23,200	1,234,472.00	0.06
132	300589	江龙船艇	88,600	1,229,768.00	0.06
133	603496	恒为科技	38,600	1,202,776.00	0.06
134	301015	百洋医药	33,300	1,194,138.00	0.06
135	300474	景嘉微	16,500	1,166,715.00	0.06
136	600498	烽火通信	69,500	1,156,480.00	0.06
137	603855	华荣股份	56,870	1,135,125.20	0.06
138	300231	银信科技	109,900	1,130,871.00	0.06
139	300606	金太阳	33,000	1,127,280.00	0.06
140	002687	乔治白	207,900	1,108,107.00	0.05
141	300776	帝尔激光	17,900	1,078,654.00	0.05
142	300625	三雄极光	71,000	1,052,220.00	0.05
143	603028	赛福天	92,700	1,033,605.00	0.05
144	603158	腾龙股份	106,000	1,032,440.00	0.05
145	000829	天音控股	107,500	1,025,550.00	0.05
146	300274	阳光电源	11,700	1,024,803.00	0.05
147	300450	先导智能	37,700	965,120.00	0.05
148	301201	诚达药业	36,800	935,824.00	0.05
149	300500	启迪设计	64,700	927,151.00	0.05
150	300675	建科院	60,300	913,545.00	0.04
151	300348	长亮科技	88,600	913,466.00	0.04
152	300896	爱美客	3,100	912,423.00	0.04
153	688525	佰维存储	14,500	908,570.00	0.04
154	002340	格林美	163,400	892,164.00	0.04
155	002133	广宇集团	254,800	889,252.00	0.04
156	603326	我乐家居	93,400	880,762.00	0.04
157	603108	润达医疗	42,400	862,840.00	0.04
158	002730	电光科技	90,600	858,888.00	0.04
159	688313	仕佳光子	67,100	852,841.00	0.04
160	300926	博俊科技	27,400	803,642.00	0.04
161	688131	皓元医药	15,204	791,520.24	0.04
162	300218	安利股份	57,200	775,060.00	0.04
163	300493	润欣科技	90,300	768,453.00	0.04
164	002703	浙江世宝	56,300	752,168.00	0.04
165	300679	电连技术	17,700	734,550.00	0.04
166	688699	明微电子	18,200	734,370.00	0.04
167	002396	星网锐捷	40,000	722,800.00	0.04
168	002981	朝阳科技	20,500	711,760.00	0.03
169	300707	威唐工业	35,900	667,381.00	0.03
170	002897	意华股份	17,700	657,732.00	0.03
171	002664	信质集团	36,500	606,995.00	0.03

172	688362	甬矽电子	22,900	599,751.00	0.03
173	300340	科恒股份	49,000	597,800.00	0.03
174	300620	光库科技	13,000	588,900.00	0.03
175	300112	万讯自控	48,000	552,000.00	0.03
176	300458	全志科技	23,400	530,946.00	0.03
177	688601	力芯微	9,403	492,623.17	0.02
178	002902	铭普光磁	19,600	449,232.00	0.02
179	601998	中信银行	84,300	445,947.00	0.02
180	002673	西部证券	67,700	431,249.00	0.02
181	688306	均普智能	76,800	427,776.00	0.02
182	000727	冠捷科技	156,300	418,884.00	0.02
183	688220	翱捷科技	5,921	417,075.24	0.02
184	301093	华兰股份	12,800	413,440.00	0.02
185	603997	继峰股份	29,400	396,018.00	0.02
186	688318	财富趋势	3,100	391,530.00	0.02
187	300414	中光防雷	40,500	390,015.00	0.02
188	002993	奥海科技	10,000	381,000.00	0.02
189	002007	华兰生物	16,600	367,358.00	0.02
190	300375	鹏翎股份	62,500	345,625.00	0.02
191	600113	浙江东日	40,200	330,444.00	0.02
192	301101	明月镜片	7,800	326,508.00	0.02
193	300016	北陆药业	45,600	324,672.00	0.02
194	601933	永辉超市	115,100	324,582.00	0.02
195	002833	弘亚数控	17,600	312,224.00	0.02
196	002646	天佑德酒	21,900	298,059.00	0.01
197	300081	恒信东方	25,200	291,060.00	0.01
198	300184	力源信息	44,100	262,395.00	0.01
199	603515	欧普照明	14,800	257,224.00	0.01
200	603848	好太太	16,400	253,872.00	0.01
201	601702	华峰铝业	14,100	253,095.00	0.01
202	688578	艾力斯	5,997	249,835.02	0.01
203	300502	新易盛	5,000	246,600.00	0.01
204	300857	协创数据	4,500	238,455.00	0.01
205	000921	海信家电	11,600	236,640.00	0.01
206	301191	菲菱科思	2,500	230,500.00	0.01
207	300286	安科瑞	8,800	228,184.00	0.01
208	600576	祥源文旅	30,600	227,664.00	0.01
209	300609	汇纳科技	7,300	199,290.00	0.01
210	688368	晶丰明源	1,820	196,450.80	0.01
211	002222	福晶科技	6,400	188,992.00	0.01
212	300342	天银机电	10,000	153,700.00	0.01
213	605188	国光连锁	16,400	139,564.00	0.01
214	688167	炬光科技	1,200	136,800.00	0.01

215	300660	江苏雷利	4,200	127,092.00	0.01
216	300346	南大光电	3,900	107,679.00	0.01
217	688062	迈威生物	3,211	104,967.59	0.01
218	600301	华锡有色	8,300	104,414.00	0.01
219	300260	新莱应材	3,300	100,419.00	0.00
220	002938	鹏鼎控股	3,600	80,352.00	0.00
221	688100	威胜信息	2,729	78,922.68	0.00
222	000677	恒天海龙	21,300	71,355.00	0.00
223	603266	天龙股份	2,400	68,976.00	0.00
224	002845	同兴达	2,400	42,600.00	0.00
225	002516	旷达科技	8,600	42,398.00	0.00
226	300559	佳发教育	900	13,950.00	0.00
226	688621	阳光诺和	200	13,950.00	0.00
227	605116	奥锐特	500	12,910.00	0.00
228	300582	英飞特	500	6,005.00	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	002304	洋河股份	33,113,147.00	6.26
2	000568	泸州老窖	32,946,551.24	6.23
3	600519	贵州茅台	32,068,687.00	6.06
4	000858	五粮液	30,871,092.56	5.84
5	603369	今世缘	26,495,566.00	5.01
6	300308	中际旭创	26,332,685.09	4.98
7	000596	古井贡酒	24,684,785.98	4.67
8	600809	山西汾酒	23,787,084.40	4.50
9	603198	迎驾贡酒	23,162,487.90	4.38
10	300274	阳光电源	22,555,752.00	4.27
11	300502	新易盛	21,839,562.07	4.13
12	002050	三花智控	21,713,863.00	4.11
13	000333	美的集团	19,356,717.50	3.66
14	600418	江淮汽车	18,985,282.00	3.59
15	603589	口子窖	18,908,062.00	3.58
16	002371	北方华创	18,128,996.00	3.43
17	601689	拓普集团	18,098,363.00	3.42
18	600779	水井坊	17,858,159.00	3.38
19	688234	天岳先进	17,653,780.28	3.34
20	688223	晶科能源	17,291,097.43	3.27
21	000938	紫光股份	17,085,855.00	3.23
22	688390	固德威	16,918,126.48	3.20
23	688521	芯原股份	16,901,439.13	3.20

24	002517	恺英网络	16,844,629.00	3.19
25	601633	长城汽车	16,764,682.93	3.17
26	300724	捷佳伟创	16,557,173.00	3.13
27	300136	信维通信	16,527,947.00	3.13
28	002463	沪电股份	16,518,784.00	3.12
29	300751	迈为股份	16,388,090.76	3.10
30	300394	天孚通信	16,078,648.00	3.04
31	600600	青岛啤酒	16,031,806.00	3.03
32	300161	华中数控	15,888,252.00	3.00
33	688111	金山办公	15,750,257.79	2.98
34	000021	深科技	15,302,051.44	2.89
35	300213	佳讯飞鸿	15,148,442.00	2.86
36	000063	中兴通讯	14,988,976.00	2.83
37	688025	杰普特	14,841,817.16	2.81
38	688072	拓荆科技	14,836,918.96	2.81
39	688019	安集科技	14,830,292.91	2.80
40	603019	中科曙光	14,592,913.56	2.76
41	002568	百润股份	14,566,272.80	2.75
42	300693	盛弘股份	14,469,782.97	2.74
43	300750	宁德时代	14,203,852.00	2.69
44	002594	比亚迪	14,119,286.20	2.67
45	600153	建发股份	13,949,688.00	2.64
46	688418	震有科技	13,790,888.27	2.61
47	603236	移远通信	13,740,454.85	2.60
48	300498	温氏股份	13,668,180.00	2.58
49	600132	重庆啤酒	13,661,269.00	2.58
50	300130	新国都	13,414,411.46	2.54
51	688169	石头科技	13,303,065.34	2.52
52	600309	万华化学	13,066,636.00	2.47
53	688018	乐鑫科技	13,063,126.82	2.47
54	002222	福晶科技	12,799,486.00	2.42
55	002466	天齐锂业	12,789,986.00	2.42
56	300474	景嘉微	12,785,190.00	2.42
57	002920	德赛西威	12,775,706.00	2.42
58	601699	潞安环能	12,768,983.20	2.41
59	688596	正帆科技	12,744,865.29	2.41
60	002459	晶澳科技	12,710,733.80	2.40
61	601985	中国核电	12,300,152.00	2.33
62	000821	京山轻机	12,155,027.00	2.30
63	600406	国电南瑞	12,141,488.68	2.30
64	603259	药明康德	12,036,488.00	2.28
65	000032	深桑达 A	11,946,306.40	2.26
66	601021	春秋航空	11,796,561.12	2.23

67	000729	燕京啤酒	11,722,871.00	2.22
68	688599	天合光能	11,706,441.52	2.21
69	000625	长安汽车	11,604,054.00	2.19
70	603919	金徽酒	11,590,144.00	2.19
71	600066	宇通客车	11,355,704.00	2.15
72	002555	三七互娱	11,125,985.00	2.10
73	002129	TCL 中环	11,077,822.50	2.09
74	600660	福耀玻璃	11,062,054.00	2.09
75	600559	老白干酒	11,046,106.00	2.09
76	603501	韦尔股份	11,042,672.70	2.09
77	600115	中国东航	11,011,877.00	2.08
78	688002	睿创微纳	10,848,394.67	2.05
79	688036	传音控股	10,758,113.86	2.03
80	600536	中国软件	10,612,441.10	2.01

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	002304	洋河股份	33,579,269.36	6.35
2	600519	贵州茅台	32,557,330.00	6.16
3	000568	泸州老窖	32,423,325.49	6.13
4	000858	五粮液	31,238,799.00	5.91
5	603369	今世缘	26,971,113.32	5.10
6	000596	古井贡酒	25,502,808.78	4.82
7	600809	山西汾酒	24,478,347.80	4.63
8	300274	阳光电源	23,340,166.74	4.41
9	603198	迎驾贡酒	22,482,214.10	4.25
10	300308	中际旭创	21,898,844.30	4.14
11	300502	新易盛	20,367,428.52	3.85
12	603589	口子窖	20,300,183.00	3.84
13	000333	美的集团	18,902,723.00	3.57
14	002050	三花智控	17,683,475.00	3.34
15	600779	水井坊	17,581,578.80	3.32
16	601689	拓普集团	17,262,131.00	3.26
17	688390	固德威	17,007,916.80	3.22
18	600600	青岛啤酒	16,936,305.00	3.20
19	002371	北方华创	16,798,257.58	3.18
20	300751	迈为股份	16,580,674.78	3.14
21	300724	捷佳伟创	16,313,472.00	3.08
22	000938	紫光股份	15,850,969.50	3.00
23	000021	深科技	15,257,274.64	2.88
24	688521	芯原股份	15,256,799.36	2.88

25	300693	盛弘股份	14,726,303.78	2.78
26	002594	比亚迪	14,694,600.14	2.78
27	688072	拓荆科技	14,550,952.32	2.75
28	002517	恺英网络	14,129,497.00	2.67
29	300130	新国都	13,975,453.00	2.64
30	603019	中科曙光	13,962,500.00	2.64
31	688234	天岳先进	13,950,908.96	2.64
32	600132	重庆啤酒	13,948,173.00	2.64
33	688223	晶科能源	13,933,655.98	2.63
34	300750	宁德时代	13,882,049.82	2.62
35	688019	安集科技	13,858,724.73	2.62
36	688111	金山办公	13,824,423.47	2.61
37	300161	华中数控	13,734,522.00	2.60
38	603236	移远通信	13,654,642.15	2.58
39	002568	百润股份	13,599,406.00	2.57
40	300498	温氏股份	13,454,014.00	2.54
41	000063	中兴通讯	13,440,843.00	2.54
42	002222	福晶科技	13,194,681.00	2.49
43	688418	震有科技	13,135,160.73	2.48
44	688596	正帆科技	12,974,719.94	2.45
45	002920	德赛西威	12,941,990.00	2.45
46	000821	京山轻机	12,818,241.40	2.42
47	601985	中国核电	12,696,789.76	2.40
48	002463	沪电股份	12,623,107.40	2.39
49	600559	老白干酒	12,496,246.00	2.36
50	600309	万华化学	12,492,311.00	2.36
51	002466	天齐锂业	12,369,557.21	2.34
52	000729	燕京啤酒	12,269,544.00	2.32
53	600406	国电南瑞	12,159,373.00	2.30
54	300474	景嘉微	12,029,608.00	2.27
55	601633	长城汽车	11,993,371.00	2.27
56	300394	天孚通信	11,989,614.40	2.27
57	603919	金徽酒	11,982,213.00	2.27
58	300213	佳讯飞鸿	11,978,543.00	2.27
59	600418	江淮汽车	11,859,234.00	2.24
60	601699	潞安环能	11,851,528.00	2.24
61	002459	晶澳科技	11,785,920.72	2.23
62	000032	深桑达 A	11,671,960.84	2.21
63	600153	建发股份	11,638,949.00	2.20
64	300136	信维通信	11,632,186.00	2.20
65	600115	中国东航	11,604,051.00	2.19
66	688018	乐鑫科技	11,527,466.31	2.18
67	601225	陕西煤业	11,496,829.00	2.17

68	601021	春秋航空	11,416,673.00	2.16
69	600660	福耀玻璃	11,332,635.00	2.14
70	600028	中国石化	11,322,634.00	2.14
71	000625	长安汽车	11,270,715.00	2.13
72	688599	天合光能	11,262,224.85	2.13
73	688025	杰普特	11,218,102.72	2.12
74	688002	睿创微纳	11,012,936.68	2.08
75	603501	韦尔股份	10,964,247.85	2.07
76	605499	东鹏饮料	10,814,987.00	2.04
77	688082	盛美上海	10,642,967.05	2.01
78	688036	传音控股	10,612,530.15	2.01
79	600938	中国海油	10,584,223.00	2.00

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	4,496,334,840.39
卖出股票收入（成交）总额	4,163,246,715.85

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	75,340,105.75	3.68
2	央行票据	-	-
3	金融债券	336,449,312.15	16.45
	其中：政策性金融债	131,818,087.21	6.44
4	企业债券	383,051,169.81	18.73
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	1,070,803,549.46	52.35
7	可转债（可交换债）	215,016.02	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,865,859,153.19	91.23

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	230215	23 国开 15	1,000,000	100,873,169.40	4.93
2	102101781	21 深圳资本 MTN001	800,000	81,151,475.41	3.97
3	102100523	21 山东铁发	600,000	61,908,360.66	3.03

		MTN001			
4	102103189	21 中银投资 MTN002	500,000	50,413,672.13	2.46
5	132100168	21 越秀集团 GN001(乡村振 兴)	500,000	50,203,688.52	2.45

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国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。

8.10.2 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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

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。

8.11.3 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	244,686.55
2	应收清算款	19,330,705.94
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	17,146.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	19,592,538.70

8.11.4 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。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000801	四川九洲	7,061,670.00	0.35	临时停牌

8.11.6 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。

§ 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 (%)
万家瑞瑞债券 A	1,571	1,119,866.35	1,754,956,520.88	99.75	4,353,522.19	0.25
万家瑞瑞债券 C	132	529,316.75	69,710,471.37	99.77	159,339.39	0.23
合计	1,675	1,092,047.67	1,824,666,992.25	99.75	4,512,861.58	0.25

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	万家瑞瑞债券 A	478,571.97	0.0272
	万家瑞瑞债券 C	20.00	0.0000

金			
	合计	478,591.97	0.0262

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	万家家瑞债券 A	10~50
	万家家瑞债券 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	万家家瑞债券 A	0
	万家家瑞债券 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家家瑞债券 A	万家家瑞债券 C
基金合同生效日 (2017 年 9 月 20 日) 基金份额总额	203,920,067.29	83,001,758.16
本报告期期初基金份额总额	474,510,783.30	2,692,368.77
本报告期基金总申购份额	1,832,131,864.66	133,997,669.90
减：本报告期基金总赎回份额	547,332,604.89	66,820,227.91
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,759,310,043.07	69,869,810.76

§ 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：

2023 年 11 月 22 日，公司聘任乔亮先生担任公司副总经理。

基金托管人：

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

本报告期内，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无受稽查或处罚等情况。

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	1	1,821,486,440.27	21.03	1,651,965.85	22.16	-
财通证券	3	1,459,142,902.27	16.85	1,344,315.41	18.03	-
山西证券	2	1,343,051,982.67	15.51	982,188.95	13.18	-
方正证券	2	1,171,322,136.54	13.53	873,799.10	11.72	-
广发证券	2	1,006,881,422.08	11.63	945,448.88	12.68	-
德邦证券	2	605,635,260.07	6.99	568,259.92	7.62	-
东方财富证券	1	351,230,233.54	4.06	327,103.07	4.39	-
银泰证券	1	277,300,175.60	3.20	206,835.13	2.77	-

东吴证券	1	232,503,331.81	2.68	219,924.68	2.95	-
招商证券	1	212,106,756.58	2.45	200,646.92	2.69	-
中邮证券	1	178,920,914.81	2.07	133,455.78	1.79	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
东亚前海证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	3	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	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, 本基金新增方正证券交易单元 2 个, 新增财达证券交易单元 1 个, 新增银泰证券交易单元 1 个, 新增中邮证券交易单元 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	2,983,427.97	0.31	39,000,000.00	0.10	-	-
财通证券	82,436,490.01	8.67	259,800,000.00	0.64	-	-
山西证券	130,925,702.87	13.77	12,688,130,000.00	31.20	-	-
方正证券	8,876,590.00	0.93	9,691,631,000.00	23.83	-	-
广发证券	11,279,185.31	1.19	11,049,200,000.00	27.17	-	-
德邦证券	10,495,220.00	1.10	2,376,300,000.00	5.84	-	-
东方财富证券	423,559.80	0.04	717,925,000.00	1.77	-	-
银泰证券	34,238,595.00	3.60	2,327,439,000.00	5.72	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	3,998,240.00	0.42	1,515,200,000.00	3.73	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	30,272,700.00	3.18	-	-	-	-
华宝证券	634,940,380.00	66.77	-	-	-	-
开源证	-	-	-	-	-	-

券						
平安证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-

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	万家家瑞债券型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	指定媒介	2023 年 1 月 20 日
2	万家家瑞债券型证券投资基金 2022 年年度报告	指定媒介	2023 年 3 月 30 日
3	万家家瑞债券型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	指定媒介	2023 年 4 月 21 日
4	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在华西证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 5 月 30 日
5	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在陆享基金开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 6 月 1 日
6	万家家瑞债券型证券投资基金基金经理变更公告	指定媒介	2023 年 6 月 2 日
7	万家家瑞债券型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	指定媒介	2023 年 6 月 6 日
8	万家家瑞债券型证券投资基金更新招募说明书（2023 年 1 号）	指定媒介	2023 年 6 月 6 日
9	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2023 年 6 月 13 日

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

机构	1	20230216-202 30629	-	334,621, 691.42	-	334,621,691.4 2	18.29
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。 未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

§ 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、《万家瑞瑞债券型证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家瑞瑞债券型证券投资基金托管协议》。
- 4、万家瑞瑞债券型证券投资基金 2023 年年度报告原文。
- 5、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。
- 7、本报告期内在中国证监会指定媒介公开披露的基金净值、更新招募说明书及其他临时公告。

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

2024 年 3 月 29 日