

万家添利债券型证券投资基金 (LOF)

2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 24 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家添利
场内简称	万家添利 LOF
基金主代码	161908
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2011 年 6 月 2 日
报告期末基金份额总额	362,293,056.19 份
投资目标	在严格控制投资风险的基础上，追求当期较高收入和投资总回报。
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、属类配置策略；5、债券品种选择策略；6、可转换债券投资策略；7、股票等权益类资产投资策略；8、信用债券投资的风险管理。
业绩比较基准	中国债券总指数
风险收益特征	本基金是债券型证券投资基金，属于具有中低风险收益特征的基金品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	-90,381.59

2. 本期利润	-743,457.66
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0021
4. 期末基金资产净值	389,655,949.01
5. 期末基金份额净值	1.0755

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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。

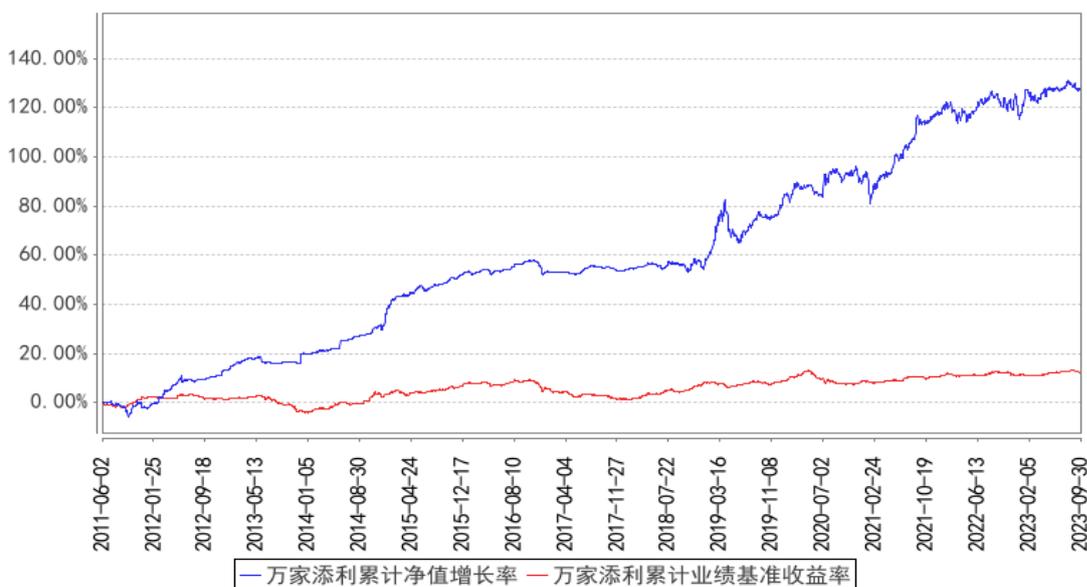
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.20%	0.19%	-0.03%	0.07%	0.23%	0.12%
过去六个月	1.69%	0.21%	0.99%	0.07%	0.70%	0.14%
过去一年	3.24%	0.32%	0.45%	0.08%	2.79%	0.24%
过去三年	19.36%	0.34%	4.40%	0.08%	14.96%	0.26%
过去五年	45.84%	0.37%	7.33%	0.10%	38.51%	0.27%
自基金合同 生效起至今	127.85%	0.28%	12.39%	0.11%	115.46%	0.17%

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

万家添利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 2011 年 6 月 2 日成立，根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈佳昀	万家惠享 39 个月定期开放债券型证券投资基金、万家惠裕回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家民瑞祥明 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家添利债券型证券投资基金 (LOF)、万家稳健增利债券型证券投资基金的基金经理	2017 年 6 月 5 日	-	12.5 年	国籍：中国；学历：上海财经大学金融学专业硕士，2017 年 4 月入职万家基金管理有限公司，现任固定收益部基金经理，历任固定收益部基金经理助理。曾任上海银行虹口分行职员，财达证券有限责任公司固定收益部经理助理、资产管理部投资经理，平安证券股份有限公司资产管理部投资经理等职。

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

公司制订了明确的投资授权制度，并建立了统一的投资管理平台，确保不同投资组合获得公平的投资决策机会。实行集中交易制度，对于交易所公开竞价交易，执行交易系统内的公平交易程序；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，原则上按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；对于银行间交易，按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。为保证公平交易原则的实现，通过制度规范、流程审批、系统风控参数设置等进行事前控制，通过对投资交易系统的实时监控进行事中控制，通过对异常交易的监控和分析实现事后控制。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 13 次，均为量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年三季度，宏观经济增长势头平稳，但居民和企业对经济前景信心不足，投资和消费意愿低迷。政府出台了一系列刺激经济的政策，从增加个人所得税扣除到放松房地产限购限贷政策等，不过政策效果仍然需要时间观察。外需持续放缓，进出口总额同比负增长，拖累出口产业链景气度。

股票市场各指数均出现下跌，深市跌幅大于沪市，前期表现较强的 TMT 行业个股补跌，前期

表现较弱的医药股反弹，券商股冲高回落，消费板块持续低迷。中证转债指数小幅下跌，转股溢价率被动抬升。债券市场收益率先下后上，整个季度来看变化不大。信用债利差收窄，信用债表现好于利率债。期限利差变化不大，各期限收益率与上个季度相比均变化不大。

本季度，我们保持转债持仓稳定，行业方面，减持了券商转债和银行转债，逢高获利了结传媒和电子转债，增持了新能源和汽车转债，纯债部分保持短久期高评级策略。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家添利的基金份额净值为 1.0755 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.20%，同期业绩比较基准收益率为-0.03%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	360,786,283.48	92.02
	其中：债券	360,786,283.48	92.02
	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	27,810,193.32	7.09
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,429,681.42	0.87
8	其他资产	29,717.69	0.01
9	合计	392,055,875.91	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	9,630,746.03	2.47
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,260,483.27	10.33
	其中：政策性金融债	10,071,606.56	2.58
4	企业债券	4,056,844.49	1.04
5	企业短期融资券	67,245,918.69	17.26
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	239,592,291.00	61.49
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	360,786,283.48	92.59

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	115366	23 中证 S6	300,000	30,188,876.71	7.75
2	012382534	23 上海机场 SCP007	240,000	24,111,160.66	6.19
3	012383079	23 福州地铁 SCP003	200,000	20,013,049.18	5.14
4	113052	兴业转债	139,500	14,395,524.78	3.69
5	110073	国投转债	125,000	14,006,373.29	3.59

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会上海监管局的处罚，中信证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚，本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	20,990.09
2	应收证券清算款	2,520.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,207.60
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	29,717.69

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113052	兴业转债	14,395,524.78	3.69
2	110073	国投转债	14,006,373.29	3.59

3	127005	长证转债	11,169,911.17	2.87
4	113021	中信转债	10,076,375.52	2.59
5	110043	无锡转债	8,134,697.26	2.09
6	110067	华安转债	7,362,567.52	1.89
7	113042	上银转债	7,170,171.75	1.84
8	113049	长汽转债	6,782,316.16	1.74
9	113043	财通转债	5,752,695.21	1.48
10	113053	隆 22 转债	5,461,875.53	1.40
11	113060	浙 22 转债	4,565,623.00	1.17
12	113602	景 20 转债	3,662,247.95	0.94
13	113024	核建转债	3,503,071.04	0.90
14	127012	招路转债	3,319,386.15	0.85
15	113056	重银转债	3,269,962.36	0.84
16	110082	宏发转债	3,247,301.71	0.83
17	113641	华友转债	3,178,860.00	0.82
18	128142	新乳转债	3,167,242.39	0.81
19	110062	烽火转债	3,150,172.19	0.81
20	127040	国泰转债	3,133,710.14	0.80
21	113059	福莱转债	3,118,534.12	0.80
22	132026	G 三峡 EB2	3,052,728.66	0.78
23	127073	天赐转债	2,861,518.15	0.73
24	128136	立讯转债	2,835,556.68	0.73
25	127056	中特转债	2,481,110.31	0.64
26	113516	苏农转债	2,477,154.88	0.64
27	110075	南航转债	2,462,880.99	0.63
28	111010	立昂转债	2,358,741.64	0.61
29	127026	超声转债	2,311,159.14	0.59
30	127016	鲁泰转债	2,266,507.86	0.58
31	113625	江山转债	2,163,142.27	0.56
32	127030	盛虹转债	2,155,016.64	0.55
33	113623	凤 21 转债	2,120,143.56	0.54
34	127045	牧原转债	2,055,436.30	0.53
35	113619	世运转债	1,997,387.40	0.51
36	128034	江银转债	1,990,385.60	0.51
37	113651	松霖转债	1,887,637.50	0.48
38	123179	立高转债	1,857,228.27	0.48
39	123154	火星转债	1,795,945.02	0.46
40	113636	甬金转债	1,718,395.00	0.44
41	113662	豪能转债	1,620,186.78	0.42
42	127015	希望转债	1,587,878.32	0.41
43	118031	天 23 转债	1,579,818.49	0.41
44	127032	苏行转债	1,576,314.50	0.40

45	113065	齐鲁转债	1,491,384.99	0.38
46	113046	金田转债	1,463,918.55	0.38
47	127066	科利转债	1,429,428.32	0.37
48	110086	精工转债	1,409,469.18	0.36
49	113644	艾迪转债	1,311,289.86	0.34
50	118008	海优转债	1,294,892.05	0.33
51	113054	绿动转债	1,246,612.92	0.32
52	123115	捷捷转债	1,223,445.01	0.31
53	113616	韦尔转债	1,191,381.25	0.31
54	113657	再 22 转债	1,177,703.01	0.30
55	110079	杭银转债	1,163,961.37	0.30
56	127041	弘亚转债	1,119,171.58	0.29
57	110081	闻泰转债	1,076,927.40	0.28
58	132020	19 蓝星 EB	1,033,348.48	0.27
59	113654	永 02 转债	1,023,646.05	0.26
60	118023	广大转债	1,003,980.04	0.26
61	113632	鹤 21 转债	987,107.95	0.25
62	128116	瑞达转债	970,731.37	0.25
63	128131	崇达转 2	959,725.68	0.25
64	127022	恒逸转债	953,589.92	0.24
65	113606	荣泰转债	920,665.09	0.24
66	110092	三房转债	920,049.75	0.24
67	118025	奕瑞转债	883,274.38	0.23
68	110059	浦发转债	879,231.07	0.23
69	123149	通裕转债	859,480.14	0.22
70	113050	南银转债	852,867.74	0.22
71	118000	嘉元转债	848,017.53	0.22
72	123109	昌红转债	847,283.22	0.22
73	110076	华海转债	830,998.97	0.21
74	110085	通 22 转债	829,514.00	0.21
75	111009	盛泰转债	826,092.53	0.21
76	127062	垒知转债	808,530.49	0.21
77	113633	科沃转债	762,119.73	0.20
78	118013	道通转债	743,478.90	0.19
79	128135	洽洽转债	741,351.85	0.19
80	128125	华阳转债	729,382.22	0.19
81	123113	仙乐转债	680,991.81	0.17
82	113048	晶科转债	675,137.26	0.17
83	113661	福 22 转债	672,035.87	0.17
84	123132	回盛转债	654,601.63	0.17
85	113650	博 22 转债	646,024.93	0.17
86	128048	张行转债	643,523.66	0.17

87	127076	中宠转 2	602,447.40	0.15
88	127067	恒逸转 2	598,473.38	0.15
89	113062	常银转债	588,520.14	0.15
90	127049	希望转 2	584,765.41	0.15
91	128035	大族转债	573,148.97	0.15
92	113658	密卫转债	555,782.19	0.14
93	113655	欧 22 转债	539,156.10	0.14
94	128117	道恩转债	531,192.15	0.14
95	127006	敖东转债	504,021.92	0.13
96	123107	温氏转债	496,710.68	0.13
97	113667	春 23 转债	483,560.77	0.12
98	123100	朗科转债	475,091.51	0.12
99	113045	环旭转债	467,629.92	0.12
100	113638	台 21 转债	458,249.86	0.12
101	128119	龙大转债	443,572.05	0.11
102	110087	天业转债	442,430.68	0.11
103	127068	顺博转债	439,775.11	0.11
104	127075	百川转 2	433,432.66	0.11
105	113037	紫银转债	423,424.66	0.11
106	118004	博瑞转债	416,902.74	0.11
107	113044	大秦转债	396,776.41	0.10
108	123108	乐普转 2	393,069.18	0.10
109	123035	利德转债	383,506.03	0.10
110	127024	盈峰转债	376,601.34	0.10
111	113652	伟 22 转债	371,322.86	0.10
112	123161	强联转债	353,800.27	0.09
113	123144	裕兴转债	343,288.77	0.09
114	127031	洋丰转债	333,559.32	0.09
115	128101	联创转债	313,060.62	0.08
116	128134	鸿路转债	310,381.16	0.08
117	123119	康泰转 2	307,227.40	0.08
118	113051	节能转债	303,760.34	0.08
119	113047	旗滨转债	299,500.34	0.08
120	118024	冠宇转债	299,487.19	0.08
121	123180	浙矿转债	287,125.75	0.07
122	127017	万青转债	282,436.30	0.07
123	110089	兴发转债	279,499.66	0.07
124	113637	华翔转债	278,833.98	0.07
125	123170	南电转债	259,068.99	0.07
126	113618	美诺转债	227,339.73	0.06
127	113629	泉峰转债	226,314.52	0.06
128	123133	佩蒂转债	176,635.77	0.05

129	128066	亚泰转债	176,148.08	0.05
130	123168	惠云转债	175,220.30	0.04
131	113579	健友转债	169,378.97	0.04
132	118032	建龙转债	168,279.16	0.04
133	128023	亚太转债	166,034.18	0.04
134	123056	雪榕转债	132,215.52	0.03
135	128141	旺能转债	128,452.57	0.03
136	123121	帝尔转债	127,814.93	0.03
137	127082	亚科转债	126,155.45	0.03
138	118028	会通转债	125,416.60	0.03
139	118033	华特转债	125,237.56	0.03
140	113639	华正转债	123,559.18	0.03
141	128123	国光转债	120,446.99	0.03
142	113656	嘉诚转债	115,176.30	0.03
143	128033	迪龙转债	114,106.77	0.03
144	127051	博杰转债	113,178.19	0.03
145	113653	永 22 转债	77,720.75	0.02
146	128109	楚江转债	74,233.68	0.02
147	128137	洁美转债	65,622.74	0.02
148	127074	麦米转 2	64,781.05	0.02
149	123172	漱玉转债	60,900.34	0.02
150	123090	三诺转债	59,816.23	0.02
151	128074	游族转债	59,345.78	0.02
152	113659	莱克转债	58,780.73	0.02
153	123117	健帆转债	52,319.61	0.01
154	123146	中环转 2	28,738.66	0.01

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	299,672,007.32
报告期期间基金总申购份额	157,656,289.65
减：报告期期间基金总赎回份额	95,035,240.78
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	362,293,056.19

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申赎及买卖本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申赎及买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20230701-20230930	125,554,532.52	-	-	125,554,532.52	34.66
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。</p> <p>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>							

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《万家添利债券型证券投资基金(LOF)基金合同》。
- 3、《万家添利债券型证券投资基金(LOF)托管协议》。
- 4、万家添利债券型证券投资基金(LOF) 2023 年第 3 季度报告原文。
- 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。

9.2 存放地点

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

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司

2023 年 10 月 24 日