

万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告

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：上海银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 1 月 20 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 1 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 10 月 1 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | | |
|-----------------|--|-----------------|
| 基金简称 | 万家瑞富 | |
| 基金主代码 | 001530 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016 年 11 月 25 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 32,224,925.64 份 | |
| 投资目标 | 本基金投资于具有持续竞争优势的企业，分享其在中国经济持续增长背景下的长期优异业绩，为基金份额持有人谋求长期稳定的投资回报。 | |
| 投资策略 | 1、资产配置策略；2、股票投资策略（（1）定性方面、（2）定量方面、（3）存托凭证投资策略）；3、权证投资策略；4、普通债券投资策略；5、中小企业私募债券投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、证券公司短期公司债券投资策略；8、股指期货投资策略 | |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50% | |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金，风险高于货币市场基金和债券型基金但低于股票型基金，属于中高风险、中高预期收益的证券投资基金。 | |
| 基金管理人 | 万家基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 上海银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 万家瑞富 A | 万家瑞富 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 001530 | 012007 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 21,021,939.89 份 | 11,202,985.75 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2022 年 10 月 1 日-2022 年 12 月 31 日） | |
|-----------------|---------------------------------------|---------------|
| | 万家瑞富 A | 万家瑞富 C |
| 1. 本期已实现收益 | -4,764,253.54 | -1,076,767.16 |
| 2. 本期利润 | -3,220,100.67 | -887,741.48 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0765 | -0.0715 |
| 4. 期末基金资产净值 | 20,547,987.99 | 10,537,223.58 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.9775 | 0.9406 |

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

万家瑞富 A

| 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 | -7.00% | 0.46% | 0.94% | 0.64% | -7.94% | -0.18% |
| 过去六个月 | -12.73% | 0.38% | -6.18% | 0.55% | -6.55% | -0.17% |
| 过去一年 | -13.25% | 0.32% | -9.48% | 0.64% | -3.77% | -0.32% |
| 过去三年 | 3.95% | 0.26% | 4.84% | 0.64% | -0.89% | -0.38% |
| 过去五年 | 13.27% | 0.25% | 14.18% | 0.64% | -0.91% | -0.39% |
| 自基金合同生效起至今 | 17.51% | 0.23% | 21.62% | 0.60% | -4.11% | -0.37% |

万家瑞富 C

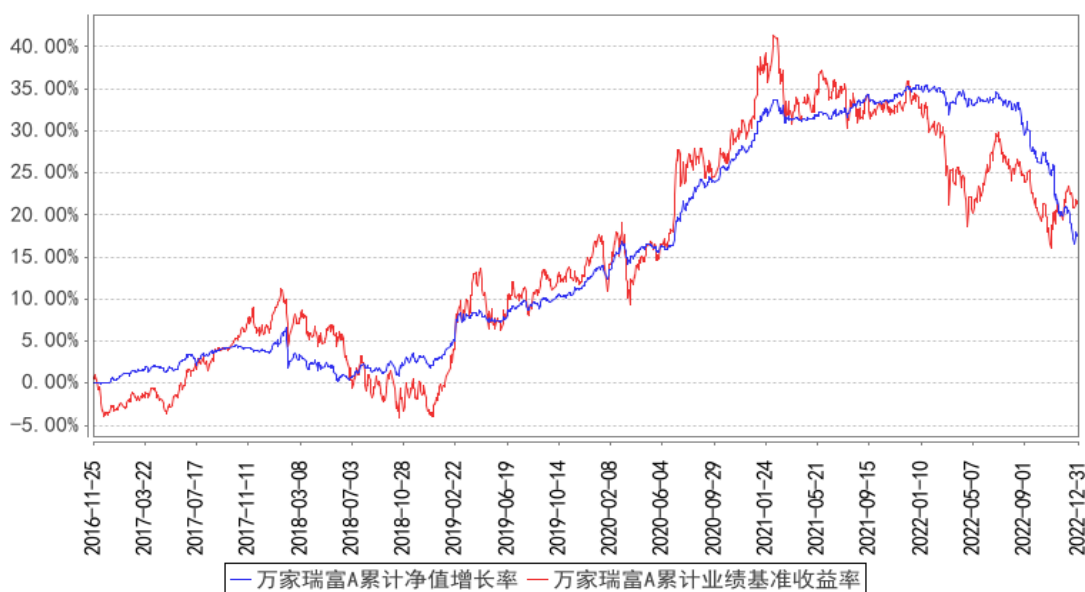
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | -7.09% | 0.46% | 0.94% | 0.64% | -8.03% | -0.18% |

| | | | | | | |
|------------|---------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去六个月 | -12.88% | 0.38% | -6.18% | 0.55% | -6.70% | -0.17% |
| 过去一年 | -13.52% | 0.32% | -9.48% | 0.64% | -4.04% | -0.32% |
| 自基金合同生效起至今 | -10.91% | 0.26% | -7.62% | 0.59% | -3.29% | -0.33% |

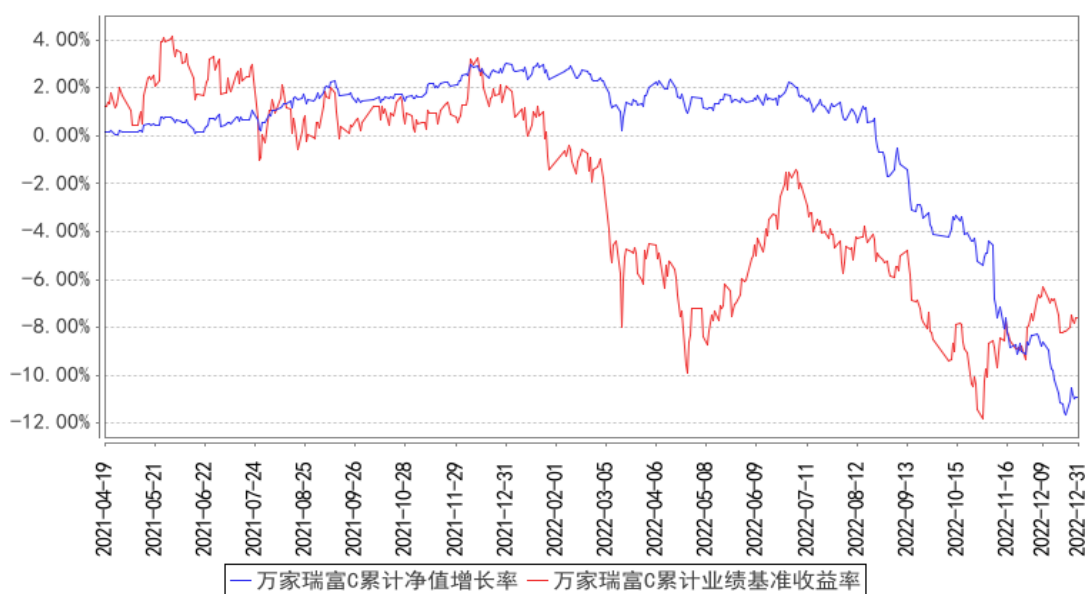
注：万家瑞富 C 上述“自基金合同生效起至今”实际为“自基金份额类别首次确认起至今”，下同。

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

万家瑞富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



万家瑞富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 2016 年 11 月 25 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。

2、本基金自 2021 年 4 月 19 日起增设 C 类份额，2021 年 4 月 20 日起确认有 C 类份额登记在册。

§ 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 | | |
| 苏谋东 | 万家信用恒利债券型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置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、万家瑞和灵活配置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、万家兴恒回报一年持有期混合型 | 2018 年 7 月 11 日 | - | 14 年 | 复旦大学经济学硕士，2013 年 3 月入职万家基金管理有限公司，现任公司总经理助理、基金经理，历任固定收益部副总监、固定收益部总监、现金管理部总监。曾任宝钢集团财务有限责任公司资金运用部投资经理等职。 |

| | | | | | |
|-----|---|-----------------|---|-------|--|
| | 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的基金经理 | | | | |
| 董一平 | 万家可转债债券型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金的基金经理 | 2022 年 7 月 20 日 | - | 6.5 年 | 复旦大学金融专业硕士，2019 年 11 月入职万家基金管理有限公司，现任固定收益部基金经理，历任固定收益部研究员、基金经理助理。曾任鹏华基金管理有限公司稳定收益投资部研究员等职。 |

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。

4.2 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 5 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

宏观经济方面,疫情肆虐下四季度经济进一步探底,经济景气度一定程度回落,主要受国内新冠感染人数攀升、工业企业高库存、下游低需求的影响,尤其是服务业受到影响较大。海外方面,欧美通胀初步见顶,美联储 12 月份加息 50BP 后通胀初步控制,但是经济受损风险提升,而欧洲同样面临经济活动放缓的衰退风险。预计美联储逐步转鸽将成为未来一段时间后的重要主线。俄乌冲突仍然存在一定不确定性,地缘局势仍然相对复杂。预计 23 年外贸对国内经济拉动作用减弱,主要依靠内需发力。

债券市场方面,债券收益率区间内先上后下,十年期国债从三季度末的 2.76%一度上行至 2.92%,随后又回落至四季末的 2.83%。11 月份“金融支持地产 16 条”出台,“三支箭”陆续发出,叠加疫情开启逐渐放松模式,12 月份中央经济工作会议召开提振市场信心,债券整体走势偏弱,但是地产销售数据仍然不景气、疫情放开后短期造成一定冲击,经济活动进一步“冰冻”,整体呈现弱现实、强预期格局。除此之外,债券还面临理财子赎回的冲击,短端一度大幅调整,随后被央行通过及时降准、OMO、MLF 操作平抑。未来流动性整体偏松、疫情扰动减弱之后,认为经济逐步回归内生逻辑,政策进入稳增长发力窗口,需要进一步关注未来相关政策影响。整体认为长债维持震荡,短债受益于央行呵护流动性环境。四季度本基金继续增加了短久期利率债的配置和交易,减少了信用债的配置,整体杠杆水平较低。

四季度权益市场先上后下,整体呈现震荡上行趋势。上证指数从 3024 点微幅上涨至 3089 点。11 月份开始地产融资端政策持续释放,疫情放开开始主导市场,预期修复带动股市整体回暖。12

月份消费走强，但是受制于数据较差以及疫情初轮冲击，地产、煤炭、成长等板块整体走弱，大盘整体下行。我们在四季度继续提升地产链以及消费链的股票占比，继续小幅调降新能源为代表的成长赛道持仓。目前三条主线均衡配置。不过我们认为在经历海内外淡季冲击以及存货减值风波之后，以光伏为代表的新能源板块明年轻装上阵，不改增长的长期趋势，中期仍然相对看好。未来大概率会是成长与国内消费复苏双主线并行的格局。整体对于权益市场继续维持中性偏多观点。

转债市场方面，四季度受到理财赎回冲击，叠加较高的溢价率水平，转债表现相对较差，11-12月转债走势估值驱动为主，转债溢价率主动压缩，未能体现防御属性。本基金在四季度继续降低对于高溢价率转债的配置，主要配置平衡性转债以及基本面稳健的偏股型转债，同时降低总体仓位，尽力平滑转债压缩溢价带来的大幅波动。后续会继续关注债券收益率、溢价率水平、权益市场景气程度等各项指标，在溢价回撤到合理水平时进行加仓。我们认为权益与转债的回撤大概率已经接近底部。未来会继续严格择券并进行精细化配置。重点关注经营良好、业绩稳健增长的产业链龙头公司。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家瑞富 A 的基金份额净值为 0.9775 元，本报告期基金份额净值增长率为 -7.00%，同期业绩比较基准收益率为 0.94%，截至本报告期末万家瑞富 C 的基金份额净值为 0.9406 元，本报告期基金份额净值增长率为 -7.09%，同期业绩比较基准收益率为 0.94%。

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，本基金自 2022 年 11 月 9 日至 2022 年 12 月 30 日，连续 38 个工作日基金资产净值低于五千万元。我司已经将该基金情况向监管部门报告并提出解决方案，目前我司正积极加强营销，力争扩大本基金规模。

本报告期内，本基金基金份额持有人数量不存在低于二百人的情况。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|--------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 7,356,293.72 | 23.37 |
| | 其中：股票 | 7,356,293.72 | 23.37 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 17,797,491.93 | 56.53 |
| | 其中：债券 | 17,797,491.93 | 56.53 |

| | | | |
|---|-------------------|---------------|--------|
| | 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 | 2,999,048.77 | 9.53 |
| | 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 | 3,281,797.78 | 10.42 |
| 8 | 其他资产 | 48,887.66 | 0.16 |
| 9 | 合计 | 31,483,519.86 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 123,188.00 | 0.40 |
| B | 采矿业 | 268,172.00 | 0.86 |
| C | 制造业 | 3,716,239.72 | 11.96 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 730,797.00 | 2.35 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 324,270.00 | 1.04 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 503,242.00 | 1.62 |
| J | 金融业 | 259,840.00 | 0.84 |
| K | 房地产业 | 1,011,031.00 | 3.25 |
| L | 租赁和商务服务业 | 172,824.00 | 0.56 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 81,450.00 | 0.26 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 165,240.00 | 0.53 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 7,356,293.72 | 23.66 |

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

| 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 | 600690 | 海尔智家 | 13,000 | 317,980.00 | 1.02 |
| 2 | 600536 | 中国软件 | 5,000 | 291,650.00 | 0.94 |
| 3 | 000069 | 华侨城 A | 50,000 | 266,500.00 | 0.86 |
| 4 | 601628 | 中国人寿 | 7,000 | 259,840.00 | 0.84 |
| 5 | 000034 | 神州数码 | 10,500 | 230,370.00 | 0.74 |
| 6 | 001215 | 千味央厨 | 3,500 | 229,460.00 | 0.74 |
| 7 | 603368 | 柳药集团 | 11,700 | 218,439.00 | 0.70 |
| 8 | 300568 | 星源材质 | 10,000 | 212,600.00 | 0.68 |
| 9 | 688111 | 金山办公 | 800 | 211,592.00 | 0.68 |
| 10 | 600933 | 爱柯迪 | 11,500 | 209,415.00 | 0.67 |

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 | 9,718,838.11 | 31.27 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 8,078,653.82 | 25.99 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 17,797,491.93 | 57.25 |

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 | 019638 | 20 国债 09 | 45,000 | 4,558,195.48 | 14.66 |
| 2 | 019674 | 22 国债 09 | 34,000 | 3,443,658.79 | 11.08 |
| 3 | 019679 | 22 国债 14 | 12,000 | 1,208,227.40 | 3.89 |
| 4 | 019656 | 21 国债 08 | 5,000 | 508,756.44 | 1.64 |
| 5 | 113055 | 成银转债 | 4,200 | 504,055.69 | 1.62 |

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股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

在股指期货投资上，本基金以避险保值和有效管理为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中，将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约，通过研究现货和期货市场的发展趋势，运用定价模型对其进行合理估值，谨慎利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，及时调整投资组合仓位，以降低组合风险、提高组合的运作效率。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，成都银行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成都分行的处罚，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。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | 48,837.85 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 49.81 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 48,887.66 |

5.11.4 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 | 113055 | 成银转债 | 504,055.69 | 1.62 |
| 2 | 113647 | 禾丰转债 | 494,508.05 | 1.59 |
| 3 | 113013 | 国君转债 | 441,463.15 | 1.42 |
| 4 | 113057 | 中银转债 | 375,692.98 | 1.21 |
| 5 | 127005 | 长证转债 | 348,268.27 | 1.12 |
| 6 | 110043 | 无锡转债 | 332,932.11 | 1.07 |
| 7 | 113048 | 晶科转债 | 304,568.15 | 0.98 |
| 8 | 110085 | 通 22 转债 | 299,157.69 | 0.96 |
| 9 | 113634 | 珀莱转债 | 289,750.23 | 0.93 |
| 10 | 113044 | 大秦转债 | 274,523.63 | 0.88 |
| 11 | 110087 | 天业转债 | 251,767.58 | 0.81 |
| 12 | 127032 | 苏行转债 | 237,902.90 | 0.77 |
| 13 | 113588 | 润达转债 | 223,007.95 | 0.72 |
| 14 | 113050 | 南银转债 | 199,691.08 | 0.64 |
| 15 | 123114 | 三角转债 | 197,372.88 | 0.63 |
| 16 | 128078 | 太极转债 | 186,428.73 | 0.60 |
| 17 | 113516 | 苏农转债 | 171,374.51 | 0.55 |
| 18 | 110076 | 华海转债 | 165,797.26 | 0.53 |
| 19 | 123113 | 仙乐转债 | 159,566.96 | 0.51 |
| 20 | 127037 | 银轮转债 | 154,657.74 | 0.50 |
| 21 | 113052 | 兴业转债 | 152,721.58 | 0.49 |
| 22 | 113632 | 鹤 21 转债 | 137,279.25 | 0.44 |
| 23 | 110045 | 海澜转债 | 131,316.10 | 0.42 |
| 24 | 110053 | 苏银转债 | 123,717.04 | 0.40 |
| 25 | 113025 | 明泰转债 | 122,117.26 | 0.39 |
| 26 | 127027 | 靖远转债 | 116,088.22 | 0.37 |
| 27 | 128048 | 张行转债 | 114,357.26 | 0.37 |
| 28 | 113046 | 金田转债 | 113,984.56 | 0.37 |

| | | | | |
|----|--------|-------|------------|------|
| 29 | 113563 | 柳药转债 | 112,477.12 | 0.36 |
| 30 | 111002 | 特纸转债 | 94,476.41 | 0.30 |
| 31 | 123109 | 昌红转债 | 91,193.32 | 0.29 |
| 32 | 110068 | 龙净转债 | 73,090.14 | 0.24 |
| 33 | 127043 | 川恒转债 | 68,698.37 | 0.22 |
| 34 | 123105 | 拓尔转债 | 66,049.37 | 0.21 |
| 35 | 110074 | 精达转债 | 60,355.47 | 0.19 |
| 36 | 123119 | 康泰转 2 | 59,508.15 | 0.19 |
| 37 | 111004 | 明新转债 | 59,437.28 | 0.19 |
| 38 | 113625 | 江山转债 | 57,069.14 | 0.18 |
| 39 | 123098 | 一品转债 | 35,236.12 | 0.11 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 万家瑞富 A | 万家瑞富 C |
|---------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 76,321,180.64 | 13,549,701.10 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 3,025,213.86 | 49,549.82 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 58,324,454.61 | 2,396,265.17 |
| 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 | 21,021,939.89 | 11,202,985.75 |

§ 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 | 报告期内持有基金份额变化情况 | 报告期末持有基金情况 |
|---|----------------|------------|

| 投资者类别 | 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 | 20221001 - 20221108 | 47,631,704.30 | 0.00 | 47,631,704.30 | 0.00 | 0.00 |
| 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、《万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 4、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的基金净值、更新招募说明书及其他临时公告。
- 5、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告原文。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。
- 7、《万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。

9.2 存放地点

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

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司

2023 年 1 月 20 日