

# 万家添利债券型证券投资基金 (LOF)

## 2024 年第 3 季度报告

2024 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：2024 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 2024 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 2024 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	300,787,225.86 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	
下属分级基金的基金简称	万家添利 A	万家添利 C
下属分级基金的场内简称	-	万家添利 LOF
下属分级基金的交易代码	019684	161908
报告期末下属分级基金的份额总额	184,743,180.72 份	116,044,045.14 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（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日）	
	万家添利 A	万家添利 C
1. 本期已实现收益	-2,587,788.42	-2,148,183.87
2. 本期利润	2,187,079.43	-183,694.06
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0117	-0.0013
4. 期末基金资产净值	203,771,398.36	127,544,560.43
5. 期末基金份额净值	1.1030	1.0991

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

万家添利 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	1.28%	0.58%	0.44%	0.13%	0.84%	0.45%
过去六个月	3.64%	0.47%	1.43%	0.11%	2.21%	0.36%
自基金合同生效起至今	3.74%	0.42%	3.65%	0.10%	0.09%	0.32%

万家添利 C

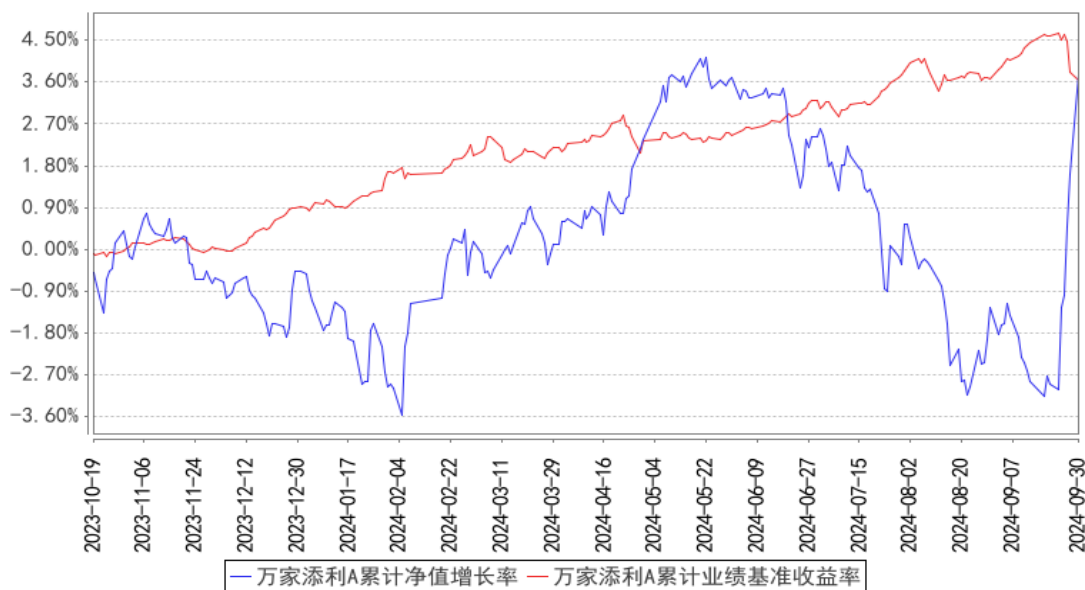
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.19%	0.58%	0.44%	0.13%	0.75%	0.45%
过去六个月	3.46%	0.47%	1.43%	0.11%	2.03%	0.36%
过去一年	2.19%	0.42%	3.54%	0.10%	-1.35%	0.32%
过去三年	8.93%	0.35%	5.41%	0.09%	3.52%	0.26%

过去五年	32.66%	0.35%	7.73%	0.10%	24.93%	0.25%
自基金合同生效起至今	132.85%	0.29%	16.37%	0.11%	116.48%	0.18%

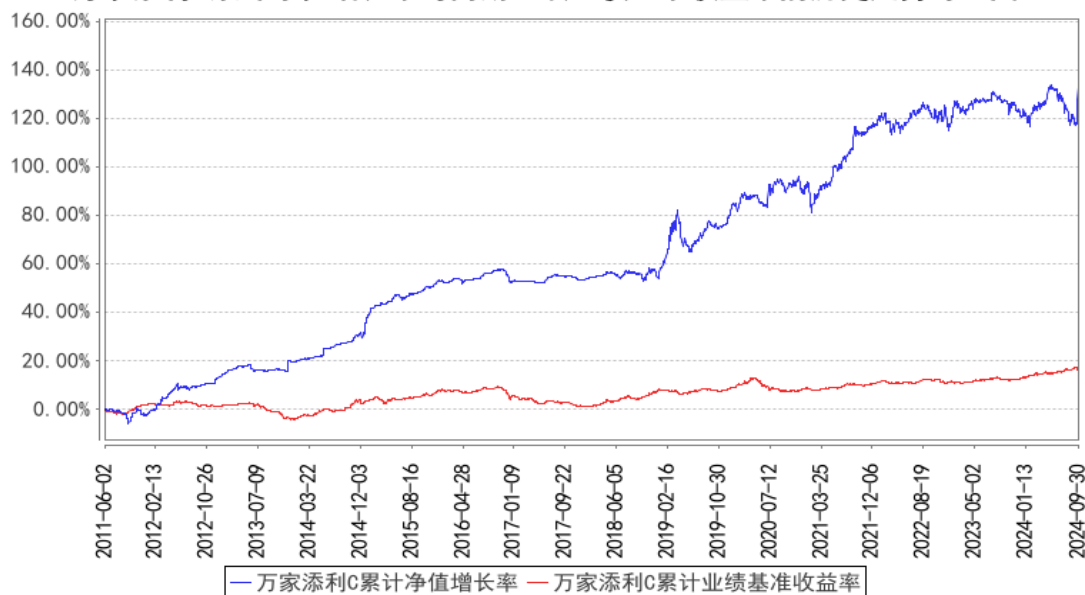
注：万家添利 A 上述“自基金合同生效起至今”实际为“自基金份额类别首次确认起至今”，下同。

### 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

万家添利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



万家添利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 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。

2、本基金自 2023 年 10 月 18 日起增设 A 类份额，2023 年 10 月 19 日起确认有 A 类基金份额登记在册。

## §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		
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、万家惠诚回报平衡一年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	-	13 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。

本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 43 次，均为指数和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

2024 年三季度，宏观经济景气度待改善。9 月末政策取向发生重大转变，房地产首付比例降

低，贷款利率显著下降，央行通过债券互换和再贷款的方式支持券商和上市公司增持股票，显示出支持实体经济的强烈意愿。市场风险偏好也从季末开始出现显著反转，股票指数从近一年低点附近开始上涨，在短短 6 个交易日内，抹去过去一年跌幅，同时伴随着成交量的急剧放大。转债市场在充斥着信用风险担忧，流动性季度紧张的环境下，跟随股票市场上涨，信用风险担忧得到了极大的缓解，在大多数转债顶着很高转股溢价率的背景下，转债价格跟随正股上涨。债券收益率反转上行，抹去了 7 月以来下行幅度，长债收益率上行幅度大于短债。

在过去一个季度内，我们看到政策重心从国计转向民生，转债价格持续下跌也提供了较好的风险收益比。个别转债在中长期内或许面临一定信用风险，短期之内被放大。我们根据基本面和市场面双重分析，左侧分批加仓可转债，在 9 月下旬组合转债仓位来到 2 月以来最高水平，组合在市场回升反转过程中获得了较好的弹性。我们相信机会是跌出来的，风险是涨出来的，当持仓转债价格到达目标区间后，我们逐步获利了结，为下一次出击腾出仓位，准备子弹。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家添利 A 的基金份额净值为 1.1030 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.28%，同期业绩比较基准收益率为 0.44%；截至本报告期末万家添利 C 的基金份额净值为 1.0991 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.19%，同期业绩比较基准收益率为 0.44%。

#### 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	329,739,996.16	98.47
	其中：债券	329,739,996.16	98.47
	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	500,000.00	0.15
	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	2,874,394.02	0.86
8	其他资产	1,734,966.76	0.52
9	合计	334,849,356.94	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	6,331,986.28	1.91
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,183,498.63	3.07
	其中：政策性金融债	10,183,498.63	3.07
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）	313,224,511.25	94.54
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	329,739,996.16	99.52

## 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	110075	南航转债	166,300	20,394,275.68	6.16
2	113049	长汽转债	160,680	18,126,011.45	5.47
3	113052	兴业转债	163,370	17,882,368.30	5.40
4	110059	浦发转债	147,000	16,289,162.63	4.92
5	110073	国投转债	127,280	14,664,800.58	4.43

## 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，中信银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，上海银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局上海监管局的处罚，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局福建监管局的处罚，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	16,609.84
2	应收证券清算款	353,953.56
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	1,364,403.36
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,734,966.76

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	110075	南航转债	20,394,275.68	6.16
2	113049	长汽转债	18,126,011.45	5.47
3	113052	兴业转债	17,882,368.30	5.40
4	110059	浦发转债	16,289,162.63	4.92
5	110073	国投转债	14,664,800.58	4.43
6	113021	中信转债	10,430,418.08	3.15
7	113042	上银转债	9,702,378.37	2.93
8	128136	立讯转债	7,896,262.47	2.38
9	110067	华安转债	5,295,141.78	1.60
10	110062	烽火转债	4,974,877.48	1.50
11	113043	财通转债	4,632,424.73	1.40
12	113616	韦尔转债	4,089,485.00	1.23
13	123107	温氏转债	3,938,928.22	1.19
14	127056	中特转债	3,326,121.74	1.00
15	113024	核建转债	3,323,352.13	1.00
16	113675	新 23 转债	3,192,081.10	0.96
17	113623	凤 21 转债	3,185,521.64	0.96
18	127090	兴瑞转债	3,161,413.56	0.95
19	127040	国泰转债	3,064,573.97	0.92
20	113045	环旭转债	3,003,031.34	0.91
21	128137	洁美转债	2,878,050.80	0.87
22	127026	超声转债	2,833,078.67	0.86
23	113056	重银转债	2,796,321.37	0.84
24	118024	冠宇转债	2,757,869.86	0.83
25	113667	春 23 转债	2,475,539.73	0.75
26	123174	精锻转债	2,450,048.88	0.74
27	113061	拓普转债	2,440,677.81	0.74
28	123133	佩蒂转债	2,425,769.89	0.73
29	113659	莱克转债	2,393,073.70	0.72
30	123115	捷捷转债	2,337,393.70	0.71
31	110090	爱迪转债	2,300,750.69	0.69
32	113673	岱美转债	2,239,045.11	0.68
33	110089	兴发转债	2,218,394.52	0.67
34	113637	华翔转债	2,062,174.52	0.62

35	127076	中宠转 2	2,023,016.16	0.61
36	113054	绿动转债	1,987,337.01	0.60
37	123212	立中转债	1,984,540.75	0.60
38	118038	金宏转债	1,959,985.89	0.59
39	128131	崇达转 2	1,906,703.22	0.58
40	127031	洋丰转债	1,864,576.85	0.56
41	127045	牧原转债	1,850,735.78	0.56
42	110082	宏发转债	1,774,573.15	0.54
43	127066	科利转债	1,766,172.88	0.53
44	127085	韵达转债	1,754,906.74	0.53
45	127032	苏行转债	1,754,092.51	0.53
46	123109	昌红转债	1,753,502.39	0.53
47	127038	国微转债	1,707,022.60	0.52
48	113050	南银转债	1,697,004.74	0.51
49	123113	仙乐转债	1,628,286.99	0.49
50	118033	华特转债	1,595,037.74	0.48
51	113633	科沃转债	1,586,077.40	0.48
52	128048	张行转债	1,556,742.47	0.47
53	111008	沿浦转债	1,552,473.97	0.47
54	113661	福 22 转债	1,549,409.22	0.47
55	123169	正海转债	1,501,129.48	0.45
56	110079	杭银转债	1,459,310.47	0.44
57	127043	川恒转债	1,390,228.22	0.42
58	118013	道通转债	1,359,600.12	0.41
59	128083	新北转债	1,348,262.42	0.41
60	123236	家联转债	1,345,248.66	0.41
61	111002	特纸转债	1,311,430.55	0.40
62	127101	豪鹏转债	1,285,654.95	0.39
63	113606	荣泰转债	1,283,798.56	0.39
64	127016	鲁泰转债	1,279,586.99	0.39
65	113051	节能转债	1,215,851.10	0.37
66	118003	华兴转债	1,146,696.16	0.35
67	123150	九强转债	1,140,138.36	0.34
68	111014	李子转债	1,139,301.64	0.34
69	123191	智尚转债	1,128,339.21	0.34
70	123158	宙邦转债	1,110,559.11	0.34
71	113579	健友转债	1,089,151.78	0.33
72	110076	华海转债	1,083,547.95	0.33
73	123235	亿田转债	1,082,958.32	0.33
74	113660	寿 22 转债	1,079,975.89	0.33
75	123179	立高转债	1,071,024.74	0.32
76	128081	海亮转债	1,063,038.55	0.32

77	113652	伟 22 转债	1,039,152.68	0.31
78	113666	爱玛转债	1,014,739.32	0.31
79	113671	武进转债	1,010,528.63	0.31
80	123217	富仕转债	995,376.08	0.30
81	127024	盈峰转债	992,416.03	0.30
82	123119	康泰转 2	983,419.73	0.30
83	113065	齐鲁转债	968,475.33	0.29
84	113664	大元转债	966,436.16	0.29
85	127064	杭氧转债	959,980.27	0.29
86	127041	弘亚转债	954,370.41	0.29
87	123210	信服转债	943,180.77	0.28
88	118043	福立转债	914,243.42	0.28
89	113618	美诺转债	903,420.75	0.27
90	128142	新乳转债	894,233.38	0.27
91	118028	会通转债	843,357.53	0.25
92	110085	通 22 转债	823,824.00	0.25
93	123091	长海转债	798,933.98	0.24
94	113532	海环转债	793,154.66	0.24
95	113681	镇洋转债	790,882.40	0.24
96	123154	火星转债	773,736.99	0.23
97	113060	浙 22 转债	737,966.71	0.22
98	123184	天阳转债	714,990.81	0.22
99	123064	万孚转债	707,059.32	0.21
100	127069	小熊转债	696,840.77	0.21
101	123114	三角转债	655,622.60	0.20
102	127102	浙建转债	643,336.44	0.19
103	118037	上声转债	606,876.71	0.18
104	123195	蓝晓转 02	606,848.08	0.18
105	128130	景兴转债	598,577.66	0.18
106	118036	力合转债	594,462.60	0.18
107	111000	起帆转债	579,936.99	0.18
108	128087	孚日转债	576,522.99	0.17
109	128135	洽洽转债	568,255.36	0.17
110	113651	松霖转债	566,865.00	0.17
111	123211	阳谷转债	566,011.64	0.17
112	123145	药石转债	547,422.53	0.17
113	127082	亚科转债	534,175.89	0.16
114	113062	常银转债	531,425.47	0.16
115	123108	乐普转 2	526,491.10	0.16
116	118009	华锐转债	514,209.53	0.16
117	113662	豪能转债	494,887.12	0.15
118	113542	好客转债	482,658.29	0.15

119	123117	健帆转债	479,779.50	0.14
120	111007	永和转债	472,276.16	0.14
121	118041	星球转债	452,017.42	0.14
122	111005	富春转债	440,116.71	0.13
123	113064	东材转债	433,998.36	0.13
124	118004	博瑞转债	427,216.23	0.13
125	127020	中金转债	426,965.00	0.13
126	113058	友发转债	422,014.18	0.13
127	123035	利德转债	379,489.23	0.11
128	113632	鹤 21 转债	356,990.96	0.11
129	113053	隆 22 转债	356,410.85	0.11
130	113655	欧 22 转债	351,301.27	0.11
131	110093	神马转债	347,130.33	0.10
132	113527	维格转债	346,379.59	0.10
133	123100	朗科转债	345,747.95	0.10
134	127095	广泰转债	331,206.37	0.10
135	113657	再 22 转债	323,528.20	0.10
136	127073	天赐转债	315,062.35	0.10
137	123176	精测转 2	314,966.85	0.10
138	123233	凯盛转债	304,662.41	0.09
139	123221	力诺转债	303,156.85	0.09
140	123226	中富转债	303,108.56	0.09
141	118025	奕瑞转债	281,824.59	0.09
142	123182	广联转债	278,478.77	0.08
143	111018	华康转债	277,556.85	0.08
144	113627	太平转债	262,891.10	0.08
145	111011	冠盛转债	261,335.18	0.08
146	113654	永 02 转债	260,217.81	0.08
147	123188	水羊转债	248,993.42	0.08
148	113650	博 22 转债	238,765.08	0.07
149	128122	兴森转债	234,533.70	0.07
150	111015	东亚转债	222,652.55	0.07
151	113682	益丰转债	221,077.48	0.07
152	127093	章鼓转债	218,002.47	0.07
153	128116	瑞达转债	214,002.90	0.06
154	128134	鸿路转债	211,410.98	0.06
155	113047	旗滨转债	208,630.02	0.06
156	113059	福莱转债	205,427.40	0.06
157	127030	盛虹转债	205,231.61	0.06
158	123183	海顺转债	193,150.93	0.06
159	127088	赫达转债	192,861.70	0.06
160	128117	道恩转债	191,879.45	0.06

161	110094	众和转债	185,603.63	0.06
162	127100	神码转债	181,210.11	0.05
163	127074	麦米转 2	180,700.27	0.05
164	118030	睿创转债	178,457.05	0.05
165	110084	贵燃转债	173,338.97	0.05
166	111003	聚合转债	173,303.84	0.05
167	123224	宇邦转债	170,100.78	0.05
168	128066	亚泰转债	168,192.12	0.05
169	113644	艾迪转债	163,620.62	0.05
170	111016	神通转债	161,354.42	0.05
171	127105	龙星转债	153,846.62	0.05
172	113069	博 23 转债	123,606.08	0.04
173	113067	燃 23 转债	121,537.86	0.04
174	127072	博实转债	120,899.73	0.04
175	128090	汽模转 2	119,386.77	0.04
176	123090	三诺转债	119,243.70	0.04
177	127018	本钢转债	119,032.90	0.04
178	123101	拓斯转债	116,593.97	0.04
179	113625	江山转债	106,878.22	0.03
180	128121	宏川转债	104,329.84	0.03
181	118005	天奈转债	100,191.37	0.03
182	111004	明新转债	95,485.48	0.03
183	113669	景 23 转债	64,758.63	0.02
184	113663	新化转债	63,788.22	0.02
185	123048	应急转债	63,698.23	0.02
186	123206	开能转债	63,655.00	0.02
187	123089	九洲转 2	63,151.85	0.02
188	123067	斯莱转债	60,823.36	0.02
189	127039	北港转债	60,549.52	0.02
190	123120	隆华转债	60,185.47	0.02
191	127087	星帅转 2	60,044.73	0.02
192	123202	祥源转债	59,249.45	0.02
193	123078	飞凯转债	58,351.30	0.02
194	123039	开润转债	58,248.23	0.02
195	123147	中辰转债	58,072.84	0.02
196	113636	甬金转债	57,131.00	0.02
197	123071	天能转债	54,954.93	0.02
198	128125	华阳转债	54,943.08	0.02
199	123122	富瀚转债	54,407.05	0.02
200	128071	合兴转债	54,000.82	0.02
201	113565	宏辉转债	53,769.52	0.02
202	111010	立昂转债	52,155.89	0.02

203	118042	奥维转债	51,217.79	0.02
204	118022	锂科转债	50,009.52	0.02
205	113647	禾丰转债	49,817.53	0.02
206	118034	晶能转债	47,251.89	0.01
207	127060	湘佳转债	46,249.66	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

项目	万家添利 A	万家添利 C
报告期期初基金份额总额	187,826,383.41	159,744,196.66
报告期期间基金总申购份额	33,272,490.31	4,157,983.49
减：报告期期间基金总赎回份额	36,355,693.00	47,858,135.01
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	184,743,180.72	116,044,045.14

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申赎及买卖本基金的情况。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申赎及买卖本基金的情况。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。

- 2、《万家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) 2024 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](http://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

2024 年 10 月 24 日