

万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金

2023 年第 2 季度报告

2023 年 6 月 30 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 7 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 7 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 2023 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|-----------------|---|----------------|
| 基金简称 | 万家瑞尧灵活配置混合 | |
| 基金主代码 | 004731 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2018 年 1 月 19 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 41,753,404.45 份 | |
| 投资目标 | 本基金通过灵活运用股票资产投资策略、债券资产投资策略等多种投资策略，充分挖掘潜在的投资机会，追求基金资产长期稳定增值。 | |
| 投资策略 | 1、股票资产投资策略；2、债券资产投资策略；3、中小企业私募债券投资策略；4、股指期货投资策略；5、国债期货投资策略；6、股票期权投资策略；7、权证投资策略；8、融资交易策略；9、资产支持证券投资策略。 | |
| 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 | 本基金是一只混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，在证券投资基金中属于预期风险较高、预期收益也较高的基金产品。 | |
| 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 | 万家瑞尧灵活配置混合 A | 万家瑞尧灵活配置混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 004731 | 004732 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 36,536,975.41 份 | 5,216,429.04 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（2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|--------------|
| | 万家瑞尧灵活配置混合 A | 万家瑞尧灵活配置混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | 937,129.16 | 138,889.17 |
| 2. 本期利润 | 240,279.83 | 1,729.16 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0060 | 0.0003 |
| 4. 期末基金资产净值 | 41,088,430.26 | 5,809,546.11 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.1246 | 1.1137 |

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

万家瑞尧灵活配置混合 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 | 0.02% | 0.38% | -1.60% | 0.41% | 1.62% | -0.03% |
| 过去六个月 | 0.79% | 0.32% | 1.20% | 0.42% | -0.41% | -0.10% |
| 过去一年 | -3.95% | 0.28% | -5.05% | 0.49% | 1.10% | -0.21% |
| 过去三年 | 16.49% | 0.33% | 3.56% | 0.60% | 12.93% | -0.27% |
| 过去五年 | 16.18% | 0.79% | 20.94% | 0.63% | -4.76% | 0.16% |
| 自基金合同生效起至今 | 17.16% | 0.86% | 12.23% | 0.63% | 4.93% | 0.23% |

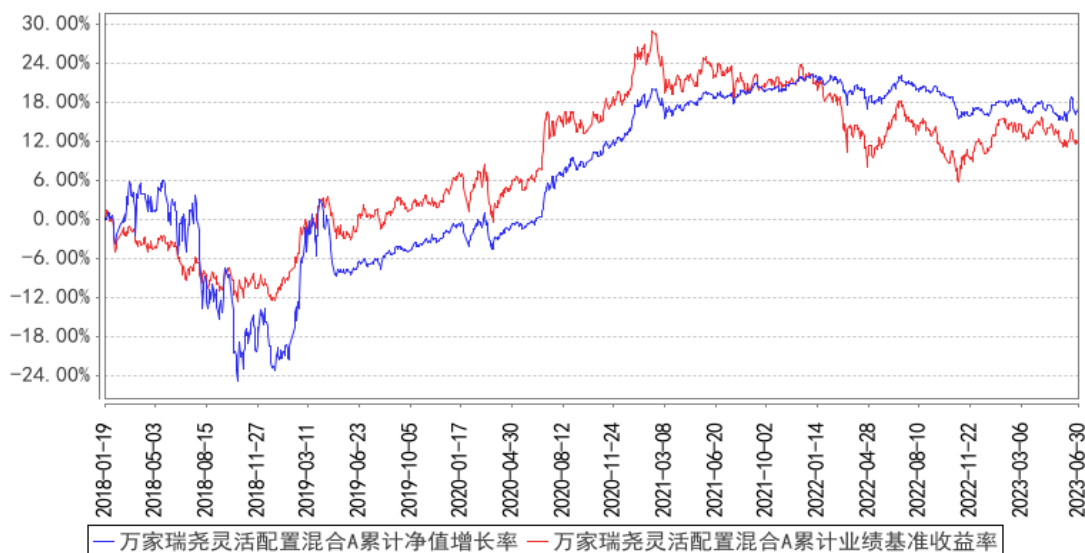
万家瑞尧灵活配置混合 C

| 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 | -0.04% | 0.38% | -1.60% | 0.41% | 1.56% | -0.03% |

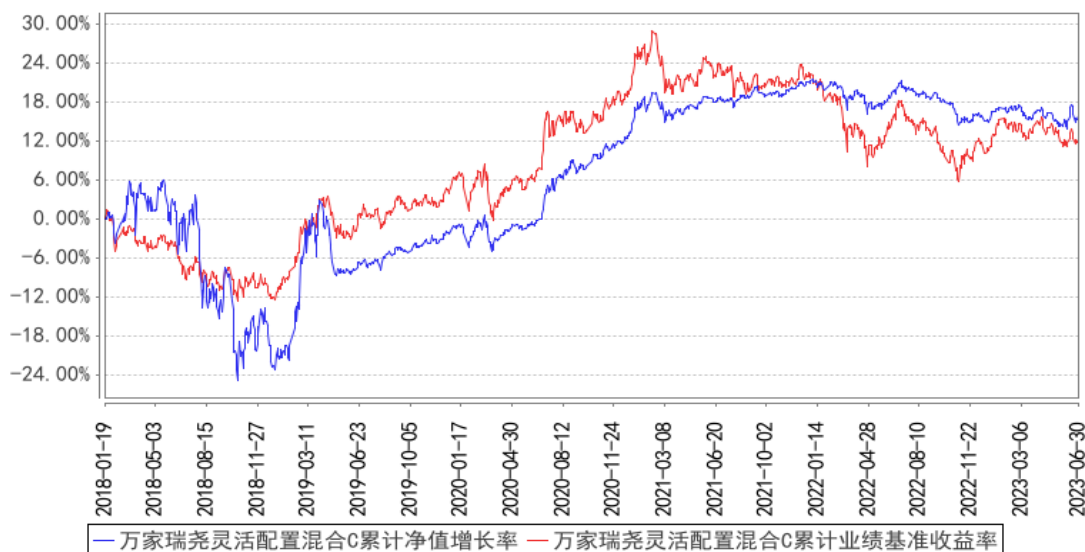
| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去六个月 | 0.69% | 0.32% | 1.20% | 0.42% | -0.51% | -0.10% |
| 过去一年 | -4.14% | 0.28% | -5.05% | 0.49% | 0.91% | -0.21% |
| 过去三年 | 15.79% | 0.33% | 3.56% | 0.60% | 12.23% | -0.27% |
| 过去五年 | 15.11% | 0.79% | 20.94% | 0.63% | -5.83% | 0.16% |
| 自基金合同生效起至今 | 16.02% | 0.86% | 12.23% | 0.63% | 3.79% | 0.23% |

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

万家瑞尧灵活配置混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



万家瑞尧灵活配置混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2018 年 1 月 19 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 | | |
| 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、万家瑞尧灵活配置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的基金经理 | 2023 年 5 月 18 日 | - | 7 年 | 国籍：中国；学历：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。 |
| 尹诚庸 | 报告期内已离职 | 2019 年 5 月 9 日 | 2023 年 5 月 18 日 | 11.5 年 | 国籍：中国；学历：美国莱斯大学统计学专业硕士，2018 年 10 月入职万家基金管理有限公司，任固定收益部总监助理、基金经理。曾任招商证券固定收益总部研究员、投资经理，中欧基金固定收益策略组基金经理等职。 |

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 8 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

宏观层面，海外经济整体韧性仍然较强，美联储整体基调偏鹰派，短期看不到海外流动性放松的可能。未来仍然需要观察联储的加息动作。明年预计欧美经济进一步衰退。国内经济方面，经济修复难言实质性提升，人民币汇率快速贬值，决策层定力较强，国内刺激政策偏弱。目前市场情绪已经反应了比较悲观的预期，未来观察 7 月份重要会议前后是否会有进一步刺激政策出台。地缘政治方面仍然会存在一些波动，但是目前整体仍然以阶段性的回暖与修复为主，短期暂时看不到大的风险。

债券层面，10 年国债从季初的 2.85% 高点之后一路下行至 2.66% 左右。驱动债市动力主要来自经济预期的进一步悲观。6 月开始政策预期持续变强。6 月 13 日央行降息后，货币政策预期兑现，但是其他方面暂无动作。流动性层面，资金面相比降息之前小幅收敛，不过仍然比较宽松。我们认为未来适当的政策出台叠加经济的自发修复，下半年整体宏观经济会有所改善，当前较差的预期不会一直维持，未来利率中枢仍然可能小幅上行，我们整体降低了对于债券的持仓占比。

权益层面，二季度的整体市场走势以震荡回落为主，上证指数小幅回落 2.16%，沪深 300 回调 5.15%，创业板指大幅回落 7.69%。TMT 等成长板块主导近期的行情走势，5 月份市场回调较多，主要由于经济超预期回落，成长板块、中特估板块冲高回落导致。本基金在二季度的持仓从消费主线切换到了 TMT、周期、新能源三条主线。目前即将进入 7 月份的业绩预告期，未来的思路是针对中报盈利稳健增长+超预期的板块以及标的进行配置。资金层面来看，贬值压力下北向流入很少，新发基金一般，需要继续等待观察。

转债层面，二季度转债市场走势比较稳健，中证转债仅微调 0.15% 左右，但是估值水平先跌后涨，目前处于历史高位，风险相对较大。不过考虑到目前流动性环境还比较宽松，权益市场位置相对不高，纯债调整风险虽然存在，但是大的趋势调整可能不会很快。我们本季度整体提升了转债的仓位，但是持仓结构偏向低溢价率转债标的。我们未来会紧密观察溢价率的压缩情况，同时针对国内经济复苏情况、各行业恢复情况进行紧密跟踪，争取自上而下选择最优板块进行配置，博取超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家瑞尧灵活配置混合 A 的基金份额净值为 1.1246 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.02%，同期业绩比较基准收益率为-1.60%；截至本报告期末万家瑞尧灵活配置混合 C 的基金份额净值为 1.1137 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.04%，同期业绩比较基准收益率为-1.60%。

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 2023 年 4 月 18 日至 2023 年 6 月 30 日，连续 49 个工作日基金资产净值低于五千万元。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 | 16,371,438.00 | 33.83 |
| | 其中：股票 | 16,371,438.00 | 33.83 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 22,345,243.71 | 46.17 |
| | 其中：债券 | 22,345,243.71 | 46.17 |
| | 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 | 6,596,988.91 | 13.63 |
| | 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 | 1,766,828.47 | 3.65 |
| 8 | 其他资产 | 1,315,637.08 | 2.72 |
| 9 | 合计 | 48,396,136.17 | 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 | - | - |
| B | 采矿业 | 422,640.00 | 0.90 |
| C | 制造业 | 10,047,513.00 | 21.42 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 1,186,520.00 | 2.53 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 118,800.00 | 0.25 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,466,169.00 | 5.26 |
| J | 金融业 | 2,129,796.00 | 4.54 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 16,371,438.00 | 34.91 |

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 | 002920 | 德赛西威 | 4,700 | 732,307.00 | 1.56 |
| 2 | 688099 | 晶晨股份 | 8,200 | 691,424.00 | 1.47 |
| 3 | 600030 | 中信证券 | 32,000 | 632,960.00 | 1.35 |
| 4 | 002941 | 新疆交建 | 40,000 | 619,200.00 | 1.32 |
| 5 | 600958 | 东方证券 | 61,000 | 591,700.00 | 1.26 |
| 6 | 601800 | 中国交建 | 52,000 | 567,320.00 | 1.21 |
| 7 | 002709 | 天赐材料 | 12,700 | 523,113.00 | 1.12 |
| 8 | 601138 | 工业富联 | 20,500 | 516,600.00 | 1.10 |
| 9 | 000333 | 美的集团 | 8,400 | 494,928.00 | 1.06 |
| 10 | 600547 | 山东黄金 | 18,000 | 422,640.00 | 0.90 |

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 | 6,620,574.39 | 14.12 |
| 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） | 15,724,669.32 | 33.53 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 22,345,243.71 | 47.65 |

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 | 30,000 | 3,070,306.03 | 6.55 |
| 2 | 019694 | 23 国债 01 | 20,000 | 2,022,192.88 | 4.31 |
| 3 | 113060 | 浙 22 转债 | 14,500 | 1,753,846.11 | 3.74 |
| 4 | 113059 | 福莱转债 | 13,000 | 1,558,908.36 | 3.32 |
| 5 | 110073 | 国投转债 | 11,000 | 1,189,977.29 | 2.54 |

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

本基金参与股指期货交易以套期保值为目的，利用股指期货剥离部分多头股票资产的系统性风险。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置。

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

本基金可基于谨慎原则，以套期保值为主要目的，运用国债期货对基本投资组合进行管理，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

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。

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

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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 88,911.05 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,226,726.03 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 1,315,637.08 |

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 | 113060 | 浙 22 转债 | 1,753,846.11 | 3.74 |
| 2 | 113059 | 福莱转债 | 1,558,908.36 | 3.32 |
| 3 | 110073 | 国投转债 | 1,189,977.29 | 2.54 |
| 4 | 110085 | 通 22 转债 | 1,108,092.08 | 2.36 |
| 5 | 110067 | 华安转债 | 933,424.36 | 1.99 |
| 6 | 113615 | 金诚转债 | 713,566.10 | 1.52 |
| 7 | 110043 | 无锡转债 | 710,187.86 | 1.51 |
| 8 | 128106 | 华统转债 | 622,014.68 | 1.33 |
| 9 | 113025 | 明泰转债 | 560,064.58 | 1.19 |
| 10 | 113043 | 财通转债 | 552,347.08 | 1.18 |
| 11 | 127032 | 苏行转债 | 535,479.04 | 1.14 |
| 12 | 123107 | 温氏转债 | 439,586.10 | 0.94 |
| 13 | 127020 | 中金转债 | 380,175.04 | 0.81 |
| 14 | 113623 | 凤 21 转债 | 339,462.33 | 0.72 |
| 15 | 113516 | 苏农转债 | 336,911.26 | 0.72 |
| 16 | 113057 | 中银转债 | 325,766.99 | 0.69 |
| 17 | 123071 | 天能转债 | 272,809.04 | 0.58 |
| 18 | 113061 | 拓普转债 | 270,048.60 | 0.58 |
| 19 | 118024 | 冠宇转债 | 260,687.64 | 0.56 |
| 20 | 127055 | 精装转债 | 255,753.01 | 0.55 |
| 21 | 127044 | 蒙娜转债 | 216,039.18 | 0.46 |
| 22 | 113662 | 豪能转债 | 190,115.01 | 0.41 |
| 23 | 111007 | 永和转债 | 187,982.10 | 0.40 |

| | | | | |
|----|--------|-------|------------|------|
| 24 | 113604 | 多伦转债 | 173,658.08 | 0.37 |
| 25 | 123098 | 一品转债 | 173,307.53 | 0.37 |
| 26 | 127059 | 永东转 2 | 172,500.70 | 0.37 |
| 27 | 113626 | 伯特转债 | 145,172.63 | 0.31 |
| 28 | 123085 | 万顺转 2 | 140,002.74 | 0.30 |
| 29 | 127054 | 双箭转债 | 129,033.42 | 0.28 |
| 30 | 111004 | 明新转债 | 127,002.30 | 0.27 |
| 31 | 128111 | 中矿转债 | 108,695.78 | 0.23 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本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 | 万家瑞尧灵活配置混合 A | 万家瑞尧灵活配置混合 C |
|---------------------------|---------------|--------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 63,278,349.80 | 7,718,789.14 |
| 报告期期间基金总申购份额 | - | - |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 26,741,374.39 | 2,502,360.10 |
| 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 | 36,536,975.41 | 5,216,429.04 |

§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 | 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 |

| 别 | | | | | | |
|--|---|-------------------|---------------|---|----------------|-------|
| 机构 | 1 | 20230620-20230630 | 8,389,126.60 | - | -8,389,126.60 | 20.09 |
| | 2 | 20230401-20230411 | 18,194,141.19 | - | -18,194,141.19 | - |
| | 3 | 20230418-20230630 | 9,228,123.16 | - | -9,228,123.16 | 22.10 |
| 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、《万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。
- 4、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 2 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 7 月 20 日