

万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018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:平安银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月24日

1 重要提示

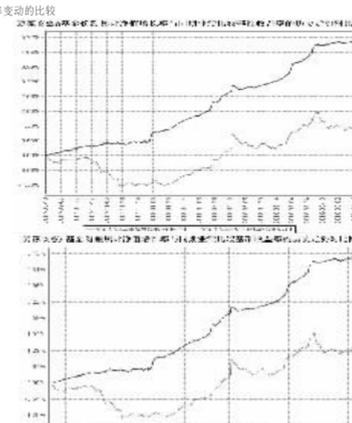
基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。
基金的过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告中财务资料未经审计。
本报告自2018年7月1日起至2018年9月30日止。

2 基金产品概况

| | |
|------------|-----------------|
| 基金名称 | 万家安弘 |
| 基金代码 | 004681 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017年8月18日 |
| 报告期基金合同生效日 | 2017年8月18日 |
| 报告期末基金总份额 | 232,307,897.60份 |

3 主要财务指标和基金净值表现

| 主要财务指标 | | 报告期 2018年7月1日—2018年9月30日 | 比较基准 |
|----------------|----------------|--------------------------|------|
| 1.本期已实现收益 | 4,919,246.84 | 130.69% | |
| 2.本期利润 | 3,364,798.80 | 95.91% | |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0156 | 0.193% | |
| 4.期末基金份额净值 | 234,257,120.18 | 8.11652% | |
| 5.期末基金资产净值 | 1,0084 | 1.0083% | |



注:本基金成立于2017年8月18日,建仓期为三个月,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。

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时间 | 证券从业年限 | 说明 |
|----|------|-------------|--------|---|
| 张俊 | 基金经理 | 2017年9月 | 10年 | 复旦大学经济学院金融学硕士,2008年7月至2013年2月在招商证券研究所担任研究员,2013年3月至2015年5月在招商证券资产管理部担任研究员,2015年5月加入万家基金管理有限公司,担任基金经理。2017年9月起担任万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。 |

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,涵盖了授权、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,执行交易所集中公平交易程序;对于非集中竞价交易,非公开竞价申购等非集中竞价交易,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

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。
报告期内无下列情况:所有投资组合参与的交易所公开竞价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%。
4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

1. 宏观回顾
三季度经济基本面仍然显现出一定的韧性,与地产投资依然稳健有关,工业品价格震荡上行,PMI等先行指标已出现企稳迹象,社融增速持续下降,社会融资需求趋于趋化,央行降准后金融市场流动性进一步改善,但信贷需求仍偏弱,央行降准后,油价与金价上探带动国内通胀预期有所升温,但前高不可持续,中美贸易摩擦不断升级,外部环境不确定性持续增加,风险偏好进一步受到压制,债市收益率整体上行,中美货币政策进一步分化使得汇率面临较大压力,形成显著风险因素。

2. 市场回顾
在通胀预期升温、美债收益率上行等风险因素的作用下,三季度国内债市收益率震荡上行,但由于市场预期分化,经济下行预期较强,收益率上行斜率并不一致,信用违约事件频发,信用债市场全面化。

3. 行业分析
三季度债券市场震荡为主,本基金进入开放期,开放期后逐渐减仓,账户保持了较好的流动性,进入封闭期后,本基金择机建仓。
管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
三季度观察到房地产市场出现了一系列走弱迹象,预计四季度房地产行业景气度出现下行,宏观经济面临一定的下行压力。由于监管环境总体仍较严格,叠加实体经济出现下行,社会融资需求偏弱,四季度或将处于宽货币向宽信用传导的过程中,资金供需总体偏宽松,有利于债券类资产的表现。风险因素主要体现在汇率层面,信用环境预计仍在偏紧水平,信用利差存在走阔风险。本基金将继续做好信用风险管理和流动性管理,积极关注市场机会,为持有人获取较好的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金A基金份额净值为1.0084元,本报告期基金份额净值增长率为151%;截至本报告期末,本基金C基金份额净值为1.0083元,本报告期基金份额净值增长率为1.46%;同期业绩比较基准收益率为0.57%。
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
报告期内,本基金没有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元的情况。

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 | - | - |
| 其中:股票 | - | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 204,301,336.00 | 87.08 |
| 其中:债券 | 204,301,336.00 | 87.08 | |
| 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 | 27,072,196.61 | 11.54 |
| 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 | 579,643.63 | 0.25 |
| 8 | 其他资产 | 2,654,241.82 | 1.13 |
| 9 | 合计 | 234,607,302.06 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

5.3 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 | 国债 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债 | 14,446,336.00 | 6.17 |
| 其中:政策性金融债 | 14,446,336.00 | 6.17 | |
| 4 | 企业债 | 79,678,000.00 | 34.14 |
| 5 | 企业短期融资券 | 17,676,000.00 | 29.96 |
| 6 | 中期票据 | 30,152,000.00 | 12.87 |
| 7 | 可转债(可交换债) | - | - |
| 8 | 同业存单 | 9,546,000.00 | 4.07 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 204,301,336.00 | 87.21 |

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 | 143533 | 18国债01 | 100,000 | 10,227,000.00 | 4.37 |
| 2 | 143526 | 18国债01 | 100,000 | 10,211,000.00 | 4.34 |
| 3 | 101570002 | 15国债01 | 100,000 | 10,158,000.00 | 4.34 |
| 4 | 011802021 | 18国债01 | 100,000 | 10,085,000.00 | 4.30 |
| 5 | 143199 | 17国开01 | 100,000 | 10,054,000.00 | 4.29 |

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
报告期内本基金未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10 报告期内,本基金投资的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。

5.10.2 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 | 7,808.20 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,646,435.62 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,654,241.82 |

5.10.4 报告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。

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。

5.6 开放式基金资产变动

| 单位:份 | | |
|---------------|----------------|----------|
| 项目 | 万家安弘 A | 万家安弘 C |
| 报告期期初基金份额总额 | 231,502,988.97 | 6,170.78 |
| 报告期基金总申购份额 | 50,696,647.61 | 1,929.12 |
| 报告期基金总赎回份额 | 49,891,338.96 | 50.00 |
| 报告期基金总申购/赎回份额 | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 232,307,897.60 | 8,049.88 |

7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购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

| 投资者序号 | 持有基金份额比例达到或超过20%的区间 | 期初份额 | 期末份额 | 期初占比 | 期末占比 |
|-------|---------------------|---------------|------|---------------|--------|
| 1 | 2018/10/1-2018/9/30 | 49,996,000.00 | - | 49,999,000.00 | 21.52% |
| 2 | 2018/10/1-2018/9/30 | 60,000,200.00 | - | 19,882,692.12 | 17.28% |

注:上述基金中出现了单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券,可能对基金净值产生一定影响,敬请投资者注意。本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券,可能对基金净值产生一定影响,敬请投资者注意。
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券,可能对基金净值产生一定影响,敬请投资者注意。

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. 《万家安弘纯债一年定期开放债券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. 万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金2018年第3季度报告正文
6. 万家基金管理有限公司董事会决议
7. 《万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金托管协议》
9.2 存放地点
基金管理人及基金托管人的住所,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
2018年10月24日

万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2018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。
基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018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。
本报告自2018年7月01日起至9月30日止。

2 基金产品概况

| | |
|------------|-----------------|
| 基金名称 | 万家宏观择时多策略混合 |
| 基金代码 | 519212 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017年3月30日 |
| 报告期基金合同生效日 | 2017年3月30日 |
| 报告期末基金总份额 | 236,387,923.68份 |

3 主要财务指标和基金净值表现

| 主要财务指标 | | 报告期 2018年7月1日—2018年9月30日 | 比较基准 |
|----------------|----------------|--------------------------|------|
| 1.本期已实现收益 | -4,487,187.19 | -1.91% | |
| 2.本期利润 | -2,411,834.91 | -1.03% | |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0011 | -0.14% | |
| 4.期末基金份额净值 | 237,071,066.60 | 0.97% | |
| 5.期末基金资产净值 | 1,0029 | 1.0029% | |



注:本基金成立于2017年03月30日,建仓期为六个月,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。

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时间 | 证券从业年限 | 说明 |
|----|------|-------------|--------|--|
| 张俊 | 基金经理 | 2017年9月 | 10年 | 复旦大学经济学院金融学硕士,2008年7月至2013年2月在招商证券研究所担任研究员,2013年3月至2015年5月在招商证券资产管理部担任研究员,2015年5月加入万家基金管理有限公司,担任基金经理。2017年9月起担任万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |

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,涵盖了授权、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,执行交易所集中公平交易程序;对于非集中竞价交易,非公开竞价申购等非集中竞价交易,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

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。
报告期内无下列情况:所有投资组合参与的交易所公开竞价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%。
4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

1. 宏观回顾
三季度经济基本面仍然显现出一定的韧性,与地产投资依然稳健有关,工业品价格震荡上行,PMI等先行指标已出现企稳迹象,社融增速持续下降,社会融资需求趋于趋化,央行降准后,油价与金价上探带动国内通胀预期有所升温,但前高不可持续,中美贸易摩擦不断升级,外部环境不确定性持续增加,风险偏好进一步受到压制,债市收益率整体上行,中美货币政策进一步分化使得汇率面临较大压力,形成显著风险因素。

2. 市场回顾
在通胀预期升温、美债收益率上行等风险因素的作用下,三季度国内债市收益率震荡上行,但由于市场预期分化,经济下行预期较强,收益率上行斜率并不一致,信用违约事件频发,信用债市场全面化。

3. 行业分析
三季度债券市场震荡为主,本基金进入开放期,开放期后逐渐减仓,账户保持了较好的流动性,进入封闭期后,本基金择机建仓。
管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
三季度观察到房地产市场出现了一系列走弱迹象,预计四季度房地产行业景气度出现下行,宏观经济面临一定的下行压力。由于监管环境总体仍较严格,叠加实体经济出现下行,社会融资需求偏弱,四季度或将处于宽货币向宽信用传导的过程中,资金供需总体偏宽松,有利于债券类资产的表现。风险因素主要体现在汇率层面,信用环境预计仍在偏紧水平,信用利差存在走阔风险。本基金将继续做好信用风险管理和流动性管理,积极关注市场机会,为持有人获取较好的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金A基金份额净值为1.0029元,本报告期基金份额净值增长率为-0.88%;截至本报告期末,本基金C基金份额净值为1.0029元,本报告期基金份额净值增长率为-1.03%;同期业绩比较基准收益率为1.18%。
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
报告期内,本基金没有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元的情况。

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 | 218,150,788.84 | 91.69 |
| 其中:股票 | 218,150,788.84 | 91.69 | |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| 其中:债券 | - | - | |
| 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 | - | - |
| 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 | 19,559,509.84 | 8.22 |
| 8 | 其他资产 | 222,723.03 | 0.09 |
| 9 | 合计 | 237,933,021.71 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------------|----------------|--------------|
| A | 农林牧渔 | - | - |
| B | 医药生物 | 18,543,964.33 | 7.82 |
| C | 有色金属 | - | - |
| D | 电力、热力、燃气及生产服务业 | - | - |
| E | 建筑业 | 5,631,909.58 | 2.46 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息技术、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 23,032,765.31 | 9.72 |
| K | 房地产业 | 170,742,126.62 | 72.02 |
| L | 制造业 | - | - |
| 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 | 农林牧渔业 | - | - |
| 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 | | 218,150,788.84 | 92.02 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有港股投资股票投资组合。

5.3 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 | 601155 | 新城控股 | 887,315 | 22,714,979.85 | 9.58 |
| 2 | 600048 | 华谊兄弟 | 1,665,000 | 20,263,415.10 | 8.55 |
| 3 | 603040 | 华夏幸福 | 719,274 | 18,219,210.42 | 7.89 |
| 4 | 002146 | 荣泰发展 | 2,248,348 | 17,941,817.04 | 7.57 |
| 5 | 001979 | 招商蛇口 | 949,529 | 17,746,697.01 | 7.49 |
| 6 | 600066 | 绿城集团 | 2,740,840 | 16,511,376.00 | 7.40 |
| 7 | 000961 | 中粮地产 | 2,687,625 | 16,609,522.50 | 7.01 |
| 8 | 000002 | 万科A | 664,043 | 16,136,244.90 | 6.81 |
| 9 | 600383 | 金地集团 | 1,618,096 | 14,166,300.72 | 6.19 |
| 10 | 601987 | 招商地产 | 667,082 | 8,158,412.86 | 3.44 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。

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
本基金本报告期末未持有债券。

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
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10 报告期内,本基金投资的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。

5.10.2 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 | 110,093.19 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 4,058.82 |
| 5 | 应收申购款 | 108,571.02 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 222,723.03 |

5.10.4 报告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。

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。

5.6 开放式基金资产变动

| 单位:份 | |
|---------------|----------------|
| 项目 | 万家宏观择时多策略混合 |
| 报告期期初基金份额总额 | 245,289,742.50 |
| 报告期基金总申购份额 | 4,452,616.73 |
| 报告期基金总赎回份额 | 13,334,439.39 |
| 报告期基金总申购/赎回份额 | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 236,387,923.68 |

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购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

| 投资者序号 | 持有基金份额比例达到或超过20%的区间 | 期初份额 | 期末份额 | 期初占比 | 期末占比 |
|-------|---------------------|---------------|------|---------------|--------|
| 1 | 2018/10/1-2018/9/30 | 49,996,000.00 | - | 49,999,000.00 | 21.52% |
| 2 | 2018/10/1-2018/9/30 | 60,000,200.00 | - | 19,882,692.12 | 17.28% |

注:上述基金中出现了单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券,可能对基金净值产生一定影响,敬请投资者注意。本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券,可能对基金净值产生一定影响,敬请投资者注意。
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券,可能对基金净值产生一定影响,敬请投资者注意。

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. 《万家宏观择时多策略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. 万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金2018年第3季度报告正文
6. 万家基金管理有限公司董事会决议
7. 《万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
9.2 存放地点
基金管理人及基金托管人的住所,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
2018年10月24日

万家享纯债债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月24日

1 重要提示

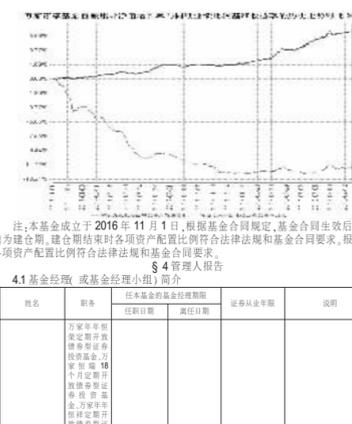
基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。
基金的过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告中财务资料未经审计。
本报告自2018年07月01日起至2018年09月30日止。

2 基金产品概况

| | |
|------------|----------------|
| 基金名称 | 万家享 |
| 基金代码 | 519199 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016年11月11日 |
| 报告期基金合同生效日 | 2016年11月11日 |
| 报告期末基金总份额 | 44,503,863.45份 |

3 主要财务指标和基金净值表现

| 主要财务指标 | | 报告期 2018年7月1日—2018年9月30日 | 比较基准 |
|----------------|---------------|--------------------------|------|
| 1.本期已实现收益 | 327,972.28 | 0.73% | |
| 2.本期利润 | 637,064.34 | 1.43% | |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0142 | 0.33% | |
| 4.期末基金份额净值 | 47,311,627.11 | 1.0617% | |
| 5.期末基金资产净值 | 10631 | 1.0631% | |



注:本基金成立于2016年11月11日,根据基金合同规定,基金合同生效后6个月内建仓,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。

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时间 |
|----|----|-------------|
|----|----|-------------|