

万家双利债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:万家基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月16日

重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员和基金经理等存在虚假记载、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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2019年7月15日核对了本报告书中财务报表部分的数据，确认不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

本报告期自2019年4月01日起至2019年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)

1.本期已实现收益 1,522,743,066

2.本期利润 -3,308,412,133

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0230

4.期末基金资产净值 106,743,331,324

5.期末基金份额净值 1.1726

注:1.本基金成立于2010年3月30日，建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同要求。

2.上表中基金业报酬率不包括持有交易基金的费用，计算时采用后向摊派法，因此水平低于所列数字。

3.2 基金的申购与赎回

3.2.1 本报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%)

过去一个月 -2.04% 0.43% -0.03%

过去三个月 -0.36% 0.31% -0.11%

过去六个月 -2.11% 0.32% -0.02%

过去一年 -0.26% 0.26% -0.02%

过去三年 -0.24% 0.24% -0.02%

过去五年 -0.24% 0.24% -0.02%

过去七年 -0.24% 0.24% -0.02%

过去十年 -0.24% 0.24% -0.02%

3.2.2 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

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%)

过去一年 -2.04% 0.43% -0.03%

过去三年 -0.24% 0.24% -0.02%

过去五年 -0.24% 0.24% -0.02%

过去七年 -0.24% 0.24% -0.02%

过去十年 -0.24% 0.24% -0.02%

3.3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)

1.本期已实现收益 -3,308,412,133

2.本期利润 -3,308,412,133

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0230

4.期末基金资产净值 106,743,331,324

5.期末基金份额净值 1.1726

注:1.上述基金业报酬率不包括持有交易基金的费用，计算时采用后向摊派法，因此水平低于所列数字。

2.上表中基金业报酬率即期收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)、公允价值变动收益、利息收入、手续费收入等各项收入相抵后的余额，本期利润即为本期已实现收入减去本期利润相抵后的余额。

3.2.3 基金净值表现

3.2.1 本报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%)

过去三个月 -0.24% 0.24% -0.02%

过去六个月 -0.24% 0.24% -0.02%

过去一年 -0.24% 0.24% -0.02%

过去三年 -0.24% 0.24% -0.02%

过去五年 -0.24% 0.24% -0.02%

过去七年 -0.24% 0.24% -0.02%

过去十年 -0.24% 0.24% -0.02%

3.2.2 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

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%)

过去一年 -0.24% 0.24% -0.02%

过去三年 -0.24% 0.24% -0.02%

过去五年 -0.24% 0.24% -0.02%

过去七年 -0.24% 0.24% -0.02%

过去十年 -0.24% 0.24% -0.02%

3.3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)

1.本期已实现收益 10,000,000,000.00

2.本期利润 -2,611,190,201

3.加权平均基金份额本期利润 0.00000

4.期末基金资产净值 79,329,002,021

5.期末基金份额净值 1.0000

注:1.上述基金业报酬率不包括持有交易基金的各项费用，计算时采用后向摊派法，因此水平低于所列数字。

2.上表中基金业报酬率即期收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)、公允价值变动收益、利息收入、手续费收入等各项收入相抵后的余额，本期利润即为本期已实现收入减去本期利润相抵后的余额。

3.2.3 基金净值表现

3.2.1 本报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%)

过去三个月 -0.24% 0.24% -0.02%

过去六个月 -0.24% 0.24% -0.02%

过去一年 -0.24% 0.24% -0.02%

过去三年 -0.24% 0.24% -0.02%

过去五年 -0.24% 0.24% -0.02%

过去七年 -0.24% 0.24% -0.02%

过去十年 -0.24% 0.24% -0.02%

3.2.2 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

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%)

过去一年 -0.24% 0.24% -0.02%

过去三年 -0.24% 0.24% -0.02%

过去五年 -0.24% 0.24% -0.02%

过去七年 -0.24% 0.24% -0.02%

过去十年 -0.24% 0.24% -0.02%

3.3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)

1.本期已实现收益 10,000,000,000.00

2.本期利润 -2,611,190,201

3.加权平均基金份额本期利润 0.00000

4.期末基金资产净值 79,329,002,021

5.期末基金份额净值 1.0000

注:本基金成立于2010年3月30日，根据基金合同规定，基金合同生效后六个

月内为建仓期，建仓期使用各项资产配置比例符合基金合同要求。报告期末各

项资产配置比例符合法律法规规定的各项限制。

3.4 管理人报告

3.4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 在本基金基金合同期间 任期起止 日 说明

李文国 经理 2017年2月8日 - 至今

王春雷 副理 2017年2月8日 - 2018年5月

周晓东 分析师 2018年5月 - 至今

张海峰 分析师 2018年5月 - 至今

陈晓红 分析师 2018年5月 - 至今

王春雷 分析师 2018年5月 -