

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:2019年7月16日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员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2019年7月15日复核了本报告中的财务数据，净值表现和投资组合等内容，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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金中的财务数据未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

## § 2 基金产品概况

转型型：

基金简称 万家3-5年政金债

基金主代码 519208

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2019年6月18日

报告期末基金的份额总额 293,081,261份

投资目标 在谨慎投资的前提下，本基金力争获取高于业绩比较基准的回报收益。

投资策略 基金管理人在充分研究宏观经济形势以及微观市场的基础上，采取积极主动地投资策略，通过定性与定量分析，对利率走势、信用利差、债券收益率、流动性、信用债的要素进行评估，对不同投资品种运用不同的投资策略，并充分运用市场的有效性，寻求构造流动性的最佳组合，力求在确保本金安全的前提下获取高于业绩比较基准的回报收益。

业绩比较基准 中证政策性金融债3-5指数收益率

风险收益特征 本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上要低于股票型基金、混合型基金，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 招商银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称 万家3-5年政金债A 万家3-5年政金债C

下属分级基金的交易代码 519208 519209

报告期末下属分级基金的份额总额 202,690,632份 91,200,621份

转型型：

基金简称 万家年年恒祥

基金主代码 519208

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2016年9月18日

报告期末基金的份额总额 246,094,926份

投资目标 在严控风险并保持良好流动性的基础上，本基金力争获取高于业绩比较基准的投资收益，追求基金资产的长期、稳健、持续增值。

投资策略 基金管理人在充分研究宏观经济形势以及微观市场的基础上，采取积极主动地投资策略，通过定性与定量分析，对利率走势、信用利差、债券收益率、流动性、信用债的要素进行评估，对不同投资品种运用不同的投资策略，并充分运用市场的有效性，寻求构造流动性的最佳组合，力求在确保本金安全的前提下获取高于业绩比较基准的回报收益。

业绩比较基准 中证政策性金融债3-5指数收益率

风险收益特征 本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上要低于股票型基金、混合型基金，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 招商银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称 万家3-5年政金债A 万家3-5年政金债C

下属分级基金的交易代码 519208 519209

报告期末下属分级基金的份额总额 202,760,658份 42,324,241份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标(转型后)

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 )

万家3-5年政金债A 万家3-5年政金债C

1.本期已实现收益 -490.54 -84.71

2.本期利润 577.40 236.75

3.加权平均基金份额本期利润 0.0028 0.0038

4.期末基金资产净值 208,262.34 93,329.00

5.期末基金份额净值 1.0267 1.0233

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，计价费用后实际收益水平要低于所列示数据。

2.上表中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)和相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.1 主要财务指标(转型后)

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 )

万家年年恒祥A 万家年年恒祥C

1.本期已实现收益 -242.46 -73.87

2.本期利润 50.71 -22.04

3.加权平均基金份额本期利润 0.0002 -0.0005

4.期末基金资产净值 207,787.38 43,194.33

5.期末基金份额净值 1.0248 1.0206

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，计价费用后实际收益水平要低于所列示数据。

2.上表中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)和相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.1 主要财务指标(转型后)

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 )

万家年年恒祥A 万家年年恒祥C

1.本期已实现收益 -242.46 -73.87

2.本期利润 50.71 -22.04

3.加权平均基金份额本期利润 0.0002 -0.0005

4.期末基金资产净值 207,787.38 43,194.33

5.期末基金份额净值 1.0248 1.0206

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，计价费用后实际收益水平要低于所列示数据。

2.上表中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)和相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.1 主要财务指标(转型后)

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 )

万家年年恒祥A 万家年年恒祥C

1.本期已实现收益 -242.46 -73.87

2.本期利润 50.71 -22.04

3.加权平均基金份额本期利润 0.0002 -0.0005

4.期末基金资产净值 207,787.38 43,194.33

5.期末基金份额净值 1.0248 1.0206

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，计价费用后实际收益水平要低于所列示数据。

2.上表中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)和相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.1 主要财务指标(转型后)

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 )

万家年年恒祥A 万家年年恒祥C

1.本期已实现收益 -8,940.7465 -10,988.25

2.本期利润 -3,706,182.93 -10,180.94

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0269 -0.0431

4.期末基金资产净值 153,221,142.61 219,857.62

5.期末基金份额净值 0.9331 0.9317

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，计价费用后实际收益水平要低于所列示数据。

2.上表中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)和相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.1 主要财务指标(转型后)

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 )

万家年年恒祥A 万家年年恒祥C

1.本期已实现收益 -8,940.7465 -10,988.25

2.本期利润 -3,706,182.93 -10,180.94

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0269 -0.0431

4.期末基金资产净值 153,221,142.61 219,857.62

5.期末基金份额净值 0.9331 0.9317

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，计价费用后实际收益水平要低于所列示数据。

2.上表中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)和相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.1 主要财务指标(转型后)

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 )

万家年年恒祥A 万家年年恒祥C

1.本期已实现收益 -8,940.7465 -10,988.25

2.本期利润 -3,706,182.93 -10,180.94

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0269 -0.0431

4.期末基金资产净值 153,221,142.61 219,857.62

5.期末基金份额净值 0.9331 0.9317

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，计价费用后实际收益水平要低于所列示数据。

2.上表中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)和相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.1 主要财务指标(转型后)

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 )

万家年年恒祥A 万家年年恒祥C

1.本期已实现收益 -8,940.7465 -10,988.25

2.本期利润 -3,706,182.93 -10,180.94

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0269 -0.0431

4.期末基金资产净值 153,221,142.61 219,857.62

5.期末基金份额净值 0.9331 0.9317

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，计价费用后实际收益水平要低于所列示数据。

2.上表中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)和相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.1 主要财务指标(转型后)

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 )

万家年年恒祥A 万家年年恒祥C

1.本期已实现收益 -8,940.7465 -10,988.25

2.本期利润 -3,706,182.93 -10,180.94

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0269 -0.0431

4.期末基金资产净值 153,221,142.61 219,857.62

5.期末基金份额净值 0.9331 0.9317

注:1