

万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金

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
送出日期:2019年8月24日

重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员及基金经理人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、完整性承担责任。本基金投资于中证500指数增强型发起式证券投资基金,万家科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金。

基金托管人平安银行股份有限公司根据基金合同规定,于2019年8月23日复核了本报吿中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,对本基金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。

本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及其更新。

本半年度报告摘要来自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告财务数据未经审计。

本报告期末自2019年1月1日起至同月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	万家安弘
基金代码	000691
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年1月18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
报告期末基金资产总额	Z32,315,947.48份
下属分级基金的基金名称:	万家安弘A 万家安弘C
下属分级基金的交易代码:	000691 000692
报告期末基金份额总额	232,307,897.66份 8,040,898份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,本基金力争在风险调整后收益方面超越业绩比较基准。
投资策略	本基金将通过资产配置,结合对宏观经济、利率、信用、资金面等因素的综合分析,判断各类资产的风险收益水平,在风险资产(股票、债券等)与低风险资产(货币市场工具等)之间进行动态配置,适时调整基金资产配置比例,以达到降低整体风险、提高整体收益的目的。本基金将主要通过以下途径实现投资目标:1)资产配置管理,主要是从宏观经济、利率、信用、资金面等方面出发,综合分析判断各类资产的风险收益水平,在风险资产(股票、债券等)与低风险资产(货币市场工具等)之间进行动态配置,适时调整基金资产配置比例;2)股票投资管理,主要是通过深入研究上市公司的基本面,精选具有持续增长潜力的公司,选择估值合理的股票进行投资;3)债券投资管理,主要是通过分析宏观经济、利率、信用、资金面等因素,把握利率变化趋势,精选高息债品种进行投资;4)现金类资产投资管理,主要是通过分析宏观经济、利率、信用、资金面等因素,把握利率变化趋势,精选高息债品种进行投资。
业绩比较基准	中债综合指数收益率(全价)
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金,属于较低风险的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	万家基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
姓名	兰国峰	李晓峰
联系电话	021-32000626	0755-25876207
电子邮箱	lun@jiayoufund.com	liang@pingan.com.cn
客户服务电话	95539966, 4008999090	95511-3
传真	021-3890027	0755-42600387

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告的管理人互联网址	http://www.jiayoufund.com
基金半年度报告备置地点	中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路300号8层(名称变更前)基金托管人办公场所

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

基金代码	万家安弘A	万家安弘C
3.1.1 利率期限和期间	报告期2019年1月1日 - 2019年6月30日	报告期2019年1月1日 - 2019年6月30日
本期末余额	6,021,129.63	199.24
本期末份额	6,408,476.08	215.76
平均每日每份净收益	0.0289	0.0268
本期末净值增长率	2.72%	2.60%
本期末资产净值	249,729,166.62	9,000.53
本期末份额净值	1.0576	1.0560

注:1.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)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益扣除相关费用后的余额。本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或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。

3.期初可供分配利润即采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低值为本期未余额,不是当期发生数)。

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

万家安弘A	万家安弘C				
阶段	份额净增额 增长幅度 增长差额 增长差额 差额率 差额率	业绩比较基 准收益率 收益率 差额率 差额率	业绩比较基 准收益率 收益率 差额率 差额率	①-③	②-④
过去一个月	0.30%	0.28%	0.03%	0.11%	0.00%
过去三个月	0.07%	0.06%	-0.01%	1.11%	-0.01%
过去六个月	2.22%	0.06%	0.24%	0.06%	2.48%
过去一年	6.48%	0.06%	2.02%	0.06%	3.66%
自基金合同 生效至今	10.41%	0.04%	3.68%	0.06%	6.73%

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。

3.2.2 管理人报告期内对本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理基金,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的利益。

3.2.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

3.2.3.1 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《日常关联交易及报告管理办法》等规章制度,涵盖了研究、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,防范可能导致不公平交易的情况发生。

公司已制定了明确的授权投资制度,并建立了一级的投资管理平台,确保不对投资组合获得的公平交易机会。实行集中交易制,对于交易所一级公开竞价交易,执行交易系统的中立公平交易原则;对于一级债券二级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易,按照价格优先、比例分配的规则对交易结果进行分配;对于银行间交易,按照价格优先、优先级原则的规则对成交结果进行分配;对于银行间交易,通过识别优先、优先级原则的规则对成交结果进行分配;为保证公平交易原则的实现,通过定期报告、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。

3.2.3.2 公平交易异常行为的专项说明

本基金内未发现基金可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本基金报告期内无下列情况:所有投资组合参加的所有交易所公开竞价同日反向交易成交较少的双边交易量,超过该证券当日成交量的5%。

4.4 管理人对报告期内基金的经营情况的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金报告期内严格按照基金合同约定的条款,遵循“价值投资”、“长期投资”的原则,在严格控制风险的前提下,追求资产的长期稳定增值。

4.4.2 管理人对宏观经济、行业政策、法规、市场情况的分析

4.4.3 管理人对证券市场的总体评价

4.4.4 管理人对宏观经济、行业政策、法规、市场情况的评价

4.4.5 管理人对估值方法的说明

4.4.6 管理人对报告期内基金的业绩表现的评价

4.4.7 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.8 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.9 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.10 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.11 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.12 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.13 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.14 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.15 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.16 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.17 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.18 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.19 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.20 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.21 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.22 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.23 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.24 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.25 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.26 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.27 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.28 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.29 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.30 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.31 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.32 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.33 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.34 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.35 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.36 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.37 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.38 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.39 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.40 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.41 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.42 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.43 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.44 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.45 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.46 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.47 管理人对基金组合的业绩评价

4.4.48 管理人对基金组合的业绩评价