万家玖盛纯债9个月定期开放债券型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人:万家基金管理有限公司
基金托管人:广发银行股份有限公司
送出日期:2019年8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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月23日复核了本报告中的财务指标、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,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及其更新。

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	万家玖盛	
基金主代码	004464	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年6月7日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	广发银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	396,043,025.39份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	万家玖盛A	万家玖盛C
下属分级基金的交易代码:	004464	004465
报告期末下属分级基金的份额总额	396,037,925.39份	5,100.54份

2.2 基金产品说明

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投资收益。
投资策略	基金管理人在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上,采取积极主动地投资管理策略,通过定性与定量分析,对利率变化趋势、债券收益率曲线移动方向、信用利差等影响债券价格的因素进行评估,对不同投资品种运用不同的投资策略,并充分利用市场的非有效性,把握各种新利的机会,在信用风险可控的前提下,寻求组合流动性与收益的最佳配比,力求持续取得达到或超过业绩比较基准的收益。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率*80%+一年期银行定期存款利率(税后)*20%
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。

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	广发银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	魏辉
	联系电话	021-38909626	010-66169868
	电子邮箱	lan@wjasset.com	chaihui@cgbchina.com.cn
客户服务电话		95538转4008888888	4008201003
传真		021-38909627	010-66169665

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.wjasset.com
基金半年度报告备置地点	中国(上海)自由贸易实验区浦电路360号8层(名义楼层9层)基金管理人办公场所

§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

基金级别	万家玖盛A	万家玖盛C
3.1.1 期间数据和指标	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)
本期已实现收益	7,701,611.20	93.72
本期利润	7,227,547.04	87.78
加权平均基金份额本期利润	0.0213	0.0172
本期基金份额净值增长率	1.81%	1.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0288	0.0283
期末基金资产净值	407,433,874.53	5,246.10
期末基金份额净值	1.0288	1.0283

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、期末可供分配利润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数(为期末余额,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

万家玖盛A

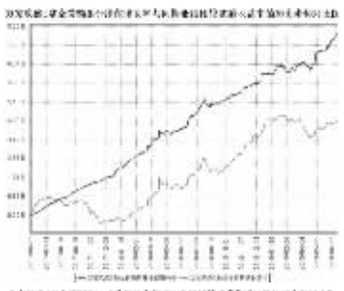
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.71%	0.06%	0.25%	0.03%	0.46%	0.03%
过去三个月	1.31%	0.07%	-0.12%	0.05%	1.43%	0.02%
过去六个月	1.81%	0.06%	0.34%	0.05%	1.47%	0.01%
过去一年	3.59%	0.06%	2.56%	0.05%	1.04%	0.00%
自基金合同生效起至今	8.26%	0.04%	4.25%	0.05%	4.01%	-0.01%
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.71%	0.06%	0.25%	0.03%	0.46%	0.03%
过去三个月	1.31%	0.07%	-0.12%	0.05%	1.43%	0.02%
过去六个月	1.81%	0.06%	0.34%	0.05%	1.47%	0.01%
过去一年	3.59%	0.05%	2.56%	0.05%	1.04%	0.00%
自基金合同生效起至今	8.26%	0.04%	4.25%	0.05%	4.01%	-0.01%

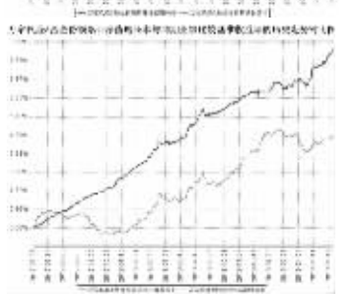
万家玖盛C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.70%	0.06%	0.25%	0.03%	0.45%	0.03%
过去三个月	1.25%	0.07%	-0.12%	0.05%	1.37%	0.02%
过去六个月	1.70%	0.06%	0.34%	0.05%	1.36%	0.01%
过去一年	3.77%	0.05%	2.56%	0.05%	1.22%	0.00%
自基金合同生效起至今	8.21%	0.04%	4.25%	0.05%	3.96%	-0.01%

注:基金业绩比较基准为中债综合指数(总财富)收益率*80%+1年期定期存款利率(税后)*20%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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





注:本基金成立日为2017年6月7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。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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44号文批准设立。公司现股东为中泰证券股份有限公司、新疆国际实业股份有限公司和齐河众鑫投资有限公司,住所:中国(上海)自由贸易实验区浦电路360号8楼(名义楼层9层),办公地点:上海市浦东新区浦电路360号9楼,注册资本1亿元人民币。目前管理六十六只开放式基金,分别为万家180指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选混合型证券投资基金(LOF)、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金(LOF)、万家添利债券型证券投资基金(LOF)、万家新机遇价值驱动灵活配置混合型证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家上证50交易型开放式指数证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞和灵活配置混合型证券投资基金、万家颐达灵活配置混合型证券投资基金、万家颐和灵活配置混合型证券投资基金、万家恒瑞18个月定期开放债券型证券投资基金、万家3-5年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家鑫安纯债债券型证券投资基金、万家瑭纯债债券型证券投资基金、万家沪深300指数增强型证券投资基金、万家家享纯债债券型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家1-3年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家瑞隆混合型证券投资基金、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家现金增利货币市场基金、万家消费成长股票型证券投资基金、万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家玖盛纯债9个月定期开放债券型证券投资基金、万家天添宝货币市场基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、万家家瑞债券型证券投资基金、万家臻选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、万家中证1000指数增强型发起式证券投资基金、万家成长优选灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金、万家经济新动能混合型证券投资基金、万家潜力价值灵活配置混合型证券投资基金、万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家新机遇龙头企业灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型证券投资基金、万家智造优势混合型证券投资基金、万家稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金(FOF)、万家人工智能混合型证券投资基金、万家社会责任18个月定期开放混合型证券投资基金(LOF)、万家平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、万家中证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。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈佳昀	万家日日薪货币市场证券投资基金、万家添利债券型证券投资基金(LOF)、万家货币市场证券投资基金、万家玖盛纯债9个月定期开放债券型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家共添宝货币市场基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2017年6月29日	-	7.5年	上海财经大学金融学硕士。2011年7月至2015年11月在财达证券有限责任公司工作。先后担任固定收益部经理助理、资产管理部投资经理职务;2015年12月至2017年4月在平安证券投资外国公司工作。担任资产管理部投资经理职务。2017年4月进入万家基金管理有限公司,从事债券研究与投资工作,自2017年6月起担任固定收益部基金经理职务。
周群玮	万家短期18个月定期开放债券型证券投资基金、万家家享纯债债券型证券投资基金、万家3-5年政策性金融债纯债债券型证券投资基金、万家鑫瑭纯债债券型证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞和灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞隆灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家现金增利货币市场基金、万家玖盛纯债9个月定期开放债券型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金、万家经济新动能混合型证券投资基金、万家潜力价值灵活配置混合型证券投资基金、万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家新机遇龙头企业灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型证券投资基金、万家智造优势混合型证券投资基金、万家稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金(FOF)、万家人工智能混合型证券投资基金、万家社会责任18个月定期开放混合型证券投资基金(LOF)、万家平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、万家中证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	2019年1月31日	-	12.5年	上海交通大学公共管理硕士。2006年7月至2016年8月在上海银行股份有限公司工作。其中2012年2月至2016年8月在总行金融市场部债券交易部工作,2012年10月起担任债券交易部副主管,主要负责债券投资及交易等相关工作。2016年9月加入万家基金管理有限公司,曾任固定收益部投资经理,主要从事债券类专户产品的投资及研究等相关工作。2018年3月起担任固定收益部基金经理职务。

注:1、任职日期以及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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》、《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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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,执行交易系统中的公平交易程序;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,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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年,国内经济稳中向好,社融数据见底企稳,市场风险偏好逐步抬升。同期,受部分食品价格上涨的影响,国内通胀数据略有抬头。海外方面,美联储改变加息立场,对于未来的经济前景持谨慎态度。受此影响,人民币汇率贬值压力逐步释放。总体来看,上半年国内债市震荡盘整,一季度收益率处于较低位置,二季度明显上行之后,五月底开始逐步回落,整体波动较大。本组合侧重于利率债的配置与交易策略,收益情况较好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家玖盛A基金份额净值为1.0288元,本报告期基金份额净值增长率为1.81%;截至本报告期末万家玖盛C基金份额净值为1.0283元,本报告期基金份额净值增长率为1.70%;同期业绩比较基准收益率为0.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计下半年国内经济将继续保持平稳,通胀压力很难影响货币政策的稳健导向。从中期来看,基本面因素使得债券市场难有大幅走弱的风险。从短期来看,防风险和稳增长将交替影响短期逻辑,可能存在一定的扰动因素。财政政策和货币政策的边际变化,可能会影响存款类金融机构的配置行为,从而在节奏上影响债市的走势。本组合将适时调整久期和杠杆水平。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了估值委员会,定期评价现行估值政策和程序,在发生了影响估值政策和程序有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。估值委员会由督察长、基金运营部负责人、合规稽核部负责人、权益投资部负责人、固定收益部负责人等组成。估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关从业资格,精通各自领域的理论知识,熟悉政策法规,并具有丰富的实践经验。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不介入基金日常估值业务。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中债金融估值中心有限公司签署了《中债信息产品服务协议》,本基金管理人与中证指数有限公司签署了《中证债券估值数据服务协议》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同规定:"本基金收益分配方案由基金管理人拟定。"报告期内,本基金未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未发生连续20个工作日基金份额持有人数量不满200人或基金资产净值低于5000万的情况。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,广发银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对万家玖盛纯债9个月定期开放债券型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作方面进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:万家玖盛纯债9个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

姓名	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产:		
银行存款	252,378.79	247,965.71
结算备付金	3,398,261.91	-
存出保证金	34,299.93	-
交易性金融资产	666,772,770.90	-
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	666,772,770.90	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	9,938,590.98	1,192.64
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	9,300.00	-
资产总计	680,405,567.51	249,158.35
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	272,724,728.94	-
应付证券清算款	61,032.33	-
应付赎回款	-	10.09
应付管理人报酬	100,073.05	10,458.12
应付托管费	33,357.69	3,623.74
应付销售服务费	0.90	0.93
应付交易费用	28,565.51	530.00
应交税费	-	-
应付利息	18,697.46	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	-	30,000.00
负债合计	272,966,447.88	44,622.88
所有者权益:		
实收基金	396,043,025.39	202,403.11
未分配利润	11,396,093.70	2,132.36
所有者权益合计	407,439,119.63	204,535.47
负债和所有者权益总计	680,405,567.51	249,158.35

注:报告截止日2019年6月30日,万家玖盛A基金份额净值1.0288元,基金份额总额396,037,925.39份;万家玖盛C基金份额净值1.0283元,基金份额总额5,100.54份。万家玖盛份额总额合计为396,043,025.93份。

6.2 利润表

会计主体:万家玖盛纯债9个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

姓名	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	10,077,653.17	4,477,227.21
1.利息收入	9,655,631.63	3,673,411.25
其中:存款利息收入	25,161.64	7,831.51
债券利息收入	9,597,265.23	3,591,744.21
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	33,204.76	73,835.53
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	885,991.64	416,431.58
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	885,991.64	416,431.58
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-463,970.10	387,384.38
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-	-
减:二、费用	2,840,018.35	601,266.63
1. 管理人报酬	519,791.90	231,519.38
2. 托管费	173,263.95	77,173.10
3. 销售服务费	5.43	5.43
4. 交易费用	24,264.15	6,589.92
5. 利息支出	2,113,392.92	90,186.52
其中:卖出回购金融资产支出	2,113,392.92	90,186.52
6. 税金及附加	-	7,160.97
7. 其他费用	9,300.00	188,631.31
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	7,237,634.82	3,875,960.58
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	7,237,634.82	3,875,960.58

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:万家玖盛纯债9个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	202,403.11	2,132.36	204,535.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	7,237,634.82	7,237,634.82
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	396,840,622.82	4,156,326.52	399,996,949.34
其中:1.基金申购款	396,840,682.82	4,156,327.18	399,997,010.00
2.基金赎回款	-60.00	-0.66	-60.66
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	396,043,025.93	11,396,093.70	407,439,119.63

项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	300,038,838.07	5,971,321.47	306,010,159.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,875,960.58	3,875,960.58
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-250,327,329.93	-1,366,925.54	-251,694,255.47
其中:1.基金申购款	49,706,729.89	293,263.85	49,999,993.74
2.基金赎回款	-300,033,069.82	-1,660,189.39	-301,693,259.21
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-7,500,970.66	-7,500,970.66
五、期末所有者权益(基金净值)	49,711,508.14	979,385.85	50,690,893.99

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

_____方一天_____ _____经晓云_____ _____陈广益____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

万家玖盛纯债 9 个月定期开放债券型证券投资基金(以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2016]2115 号文《关于核准万家玖盛纯债 9 个月定期开放债券型证券投资基金募集的批复》的批准,由万家基金管理有限公司作为基金管理人于 2017年 3 月 10日至 2017年 6 月 1 日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所 (特殊普通合伙)验资并出具安永华明(2017)验字第 60778298_B10 号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2017年 6 月7 日生效。本基金为契约型定期开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币300,002,836.44元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币36,001.63元,以上实收基金(本息)合计为人民币300,038,838.07元,折合300,038,838.07份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为万家基金管理有限公司,基金托管人为广发银行股份有限公司。

根据经批准的《万家玖盛纯债9个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《万家玖盛纯债9个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的规定,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。投资者可自行选择认购/申购的基金份额类别。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国家债券、地方政府债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、债券回购、同业存单和银行存款等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不投资于股票、权证等权益类资产,也不投资于可转换债券(可分离

交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。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投资收益。本基金业绩比较基准为中债综合全价指数收益率×80%+一年期银行定期存款利率 (税后)×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号 〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至2019年6月30日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本半年度报告所采取的会计政策、会计估计与上年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1、印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自 2008 年 4 月 24 日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的 3‰调整为 1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自 2008 年 9 月 19 日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

2、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定,金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,管理人接受投资者委托或信托对受托资产提供的管理服务以及管理人发生的其他增值税应税行为,按照现行规定缴纳增值税,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。本通知自2018年1月1日起施行,对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

4、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自 2013 年 1 月 1 日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自 2015 年 9 月 8 日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过 1 年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日,本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

报告期内,经中国证券监督管理委员会证监许可[2019]126 号文核准,基金管理人原股东山东省国有资产投资控股有限公司将其持有的基金管理人的11%股权转让给齐河众鑫投资有限公司。本次股权变更的工商变更登记手续已办理完毕,基金管理人于2019年2月13日发布了《关于公司股权变更的公告》,公司股东由山东省国有资产投资控股有限公司变更为齐河众鑫投资有限公司。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
广发银行股份有限公司("广发银行")	基金托管人
万家共赢资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

本报