

# 万家强化收益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：华夏银行股份有限公司  
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。本基金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。

基金托管人华夏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、利润分配情况、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，应阅读年度报告全文。

本报告书关于财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。

### § 2 基金简介

#### 2.1 基金基本情况

基金名称：万家强化收益定期开放债券基金  
场内简称：万家债基  
基金主代码：161911

基金运作方式：契约型开放式，本基金自基金合同生效后，每三年开放一次，每次开放期最长不超过两个工作日，期间，不得少于三个工作日。

基金合同生效日：2013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：华夏银行股份有限公司

报告期末基金份额总额：346,667,22941份

基金合同的存续期：不定期

基金上市的证券交易所：深圳证券交易所

上市日期：2013年6月1日

2.2 基金产品说明

投资目标：在严格控制风险的基础上，追求全年稳定的长期回报。

本基金在充分研究宏观经济形势以及微观市场主体的金融市场上，通过对利率变化趋势、债券收益率曲线变动方向、信用利差变化趋势等的综合分析，精选具有投资价值的债券品种进行投资。

投资策略：本基金将通过深入研究宏观经济形势，充分运用量化分析方法，把握各类型债券的定价规律，选择定价合理的债券品种进行投资。

业绩比较基准：三年期银行定期存款利率+0.5%

风险收益特征：本基金为债券型基金，主要投资于固定收益类金融工具，风险低于股票型基金，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 华夏银行股份有限公司

姓名 兰刚 郑巍

信息披露负责人 赵晓云 010-85289062

电子邮箱 lanwang@wjasset.com zhengweng@hx.com.cn

客户服务电话 95537999 4008800000

传真 010-38900027

2.4 基金的披露方式

基金半年度报告正文将在互联网上披露：<http://www.wjasset.com>

基金半年度报告备查文件点：中国（上海）自由贸易试验区浦电路360号18层（名义楼层）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

3.1.1 利润数据和指标 报告期/2019年1月1日至2019年6月30日

本期末实现收益 16,709,073.84

加权平均基金份额本期利润 0.0262

本期基金份额净值增长率 2.47%

3.1.2 利润和利润增长 率 报告期/2019年6月30日

期初至报告期末利润 0.0262

期末基金资产净值 365,761,524.22

期末基金份额净值 1.0262

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. 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计人费用后对本期收益水平可能产生不利影响。  
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之和除以期末净资产的孰低数。  
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

阶段 增幅比例% 增长率% 基准收益率% 变动比例% 基准收益率% ①-③ ②-④

过去一个月 0.15% 0.03% 0.23% 0.00% -0.08% 0.01%

过去二个月 0.22% 0.02% 0.09% 0.00% -0.47% 0.02%

过去六个月 2.47% 0.06% 0.76% 0.00% 1.11% 0.06%

过去一年 8.76% 0.06% 2.76% 0.00% 6.01% 0.06%

过去三年 14.46% 0.06% 8.26% 0.00% 6.21% 0.06%

自基合同以来 49.62% 0.13% 19.09% 0.00% 26.03% 0.13%

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. 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计人费用后对本期收益水平可能产生不利影响。  
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之和除以期末净资产的孰低数。  
3.2.2 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

阶段 增幅比例% 增长率% 基准收益率% 变动比例% 基准收益率% ①-③ ②-④

过去一个月 0.15% 0.03% 0.23% 0.00% -0.08% 0.01%

过去二个月 0.22% 0.02% 0.09% 0.00% -0.47% 0.02%

过去六个月 2.47% 0.06% 0.76% 0.00% 1.11% 0.06%

过去一年 8.76% 0.06% 2.76% 0.00% 6.01% 0.06%

过去三年 14.46% 0.06% 8.26% 0.00% 6.21% 0.06%

自基合同以来 49.62% 0.13% 19.09% 0.00% 26.03% 0.13%

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. 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计人费用后对本期收益水平可能产生不利影响。  
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之和除以期末净资产的孰低数。  
3.2.3 基金净值表现

3.2.4 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

阶段 增幅比例% 增长率% 基准收益率% 变动比例% 基准收益率% ①-③ ②-④

过去一个月 0.15% 0.03% 0.23% 0.00% -0.08% 0.01%

过去二个月 0.22% 0.02% 0.09% 0.00% -0.47% 0.02%

过去六个月 2.47% 0.06% 0.76% 0.00% 1.11% 0.06%

过去一年 8.76% 0.06% 2.76% 0.00% 6.01% 0.06%

过去三年 14.46% 0.06% 8.26% 0.00% 6.21% 0.06%

自基合同以来 49.62% 0.13% 19.09% 0.00% 26.03% 0.13%

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. 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计人费用后对本期收益水平可能产生不利影响。  
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之和除以期末净资产的孰低数。  
3.2.5 基金净值表现

3.2.6 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

阶段 增幅比例% 增长率% 基准收益率% 变动比例% 基准收益率% ①-③ ②-④

过去一个月 0.15% 0.03% 0.23% 0.00% -0.08% 0.01%

过去二个月 0.22% 0.02% 0.09% 0.00% -0.47% 0.02%

过去六个月 2.47% 0.06% 0.76% 0.00% 1.11% 0.06%

过去一年 8.76% 0.06% 2.76% 0.00% 6.01% 0.06%

过去三年 14.46% 0.06% 8.26% 0.00% 6.21% 0.06%

自基合同以来 49.62% 0.13% 19.09% 0.00% 26.03% 0.13%

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. 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计人费用后对本期收益水平可能产生不利影响。  
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之和除以期末净资产的孰低数。  
3.2.7 基金净值表现

3.2.8 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

阶段 增幅比例% 增长率% 基准收益率% 变动比例% 基准收益率% ①-③ ②-④

过去一个月 0.15% 0.03% 0.23% 0.00% -0.08% 0.01%

过去二个月 0.22% 0.02% 0.09% 0.00% -0.47% 0.02%

过去六个月 2.47% 0.06% 0.76% 0.00% 1.11% 0.06%

过去一年 8.76% 0.06% 2.76% 0.00% 6.01% 0.06%

过去三年 14.46% 0.06% 8.26% 0.00% 6.21% 0.06%

自基合同以来 49.62% 0.13% 19.09% 0.00% 26.03% 0.13%

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. 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计人费用后对本期收益水平可能产生不利影响。  
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之和除以期末净资产的孰低数。  
3.2.9 基金净值表现

3.2.10 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

阶段 增幅比例% 增长率% 基准收益率% 变动比例% 基准收益率% ①-③ ②-④

过去一个月 0.15% 0.03% 0.23% 0.00% -0.08% 0.01%

过去二个月 0.22% 0.02% 0.09% 0.00% -0.47% 0.02%

过去六个月 2.47% 0.06% 0.76% 0.00% 1.11% 0.06%

过去一年 8.76% 0.06% 2.76% 0.00% 6.01% 0.06%

过去三年 14.46% 0.06% 8.26% 0.00% 6.21% 0.06%

自基合同以来 49.62% 0.13% 19.09% 0.00% 26.03% 0.13%

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. 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计人费用后对本期收益水平可能产生不利影响。  
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之和除以期末净资产的孰低数。  
3.2.10 基金净值表现

3.2.11 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

阶段 增幅比例% 增长率% 基准收益率% 变动比例% 基准收益率% ①-③ ②-④

过去一个月 0.15% 0.03% 0.23% 0.00% -0.08% 0.01%

过去二个月 0.22% 0.02% 0.09% 0.00% -0.47% 0.02%

过去六个月 2.47% 0.06% 0.76% 0.00% 1.11% 0.06%

过去一年 8.76% 0.06% 2.76% 0.00% 6.01% 0.06%

过去三年 14.46% 0.06% 8.26% 0.00% 6.21% 0.06%