

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 报告送出日期:2017年10月26日

《1 重要提示 其全管理人的董事会及董事促证太报告所裁资料不存在虚假记载 误异性陈述或

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。 其全托管人广始组行股份有限公司根据太其全会同规定 于2017年10日26日复核 了本报告中的财务指标、净值表现和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 - 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。

本报告中的财务数据未经审计

本报告期自2017年7月1日起至2017年9月30日止。

62 其全立旦興辺

基金简称	万家鑫安纯债				
基金主代码	003329				
交易代码	003329	003329			
基金运作方式	契约型开放式	契约型开放式			
基金合同生效日	2016年9月18日				
报告期末基金份额总额	15,168,776,270.17份	15,168,776,270.176}			
投资目标	在谨慎投资的前提下,本基准的投资收益。	在谨慎投资的前提下,本基金力争获取高于业绩比较和准的投资收益。			
投资策略	体的基础上,采取积极主 与定量分析,对利率变化 向、信用利差等影响债券 投资品种运用不同的投资 效性,把握各类套利的机。 寻求组合流动性与收益的	基金管理人在充分研究发源市场形势以及吸源市场 体的基础上、采取原限主动地投资管理策略,通过定 与定量分析。对利率变化趋势、债券收益率曲线参加 向、信用规差等影响债券价格的风源进行评估。对不 效程品种运用所创始发源版,并分利用市场的时间 效性,把服各类套利的机会。在信用风险可控的前提下 该社,把服各类套利的机会。在信用风险可控的前提下 或起业地域比较起作效益。			
业绩比较基准	中债综合指数(总财富)。 利率(税后)×10%。	中债综合指数(总财富)收益率×90%+1年期定期存制 利率(税后)×10%。			
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,属于中低风险/吃			
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				
下属分级基金的基金简称	万家鑫安纯债A	万家鑫安纯债C			
下属分级基金的交易代码	003329	003330			
报告期末下属分级基金的份额总额	15,168,771,134.94 ()	5.135.23f ?			

§ 3 主要财务指标和基金净值表现 3.1 主要财务指标

	万家鑫安纯债A	万家鑫安纯债C
1. 本期已实现收益	149,738,365.10	46.78
2. 本期利润	146,078,685.88	45.61
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0096	0.0091
4. 期末基金资产净值	15,235,926,760.24	5,156.36
5. 期末基金份额净值	1.0044	1.0041

万家鑫安纯债债券型证券投资基金

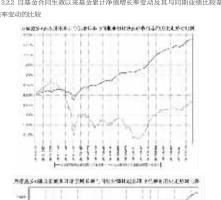
说明

职务

3.2.1 本报告期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

32 基金净值表现

力系蓋女処價A							
ľ	阶段	净值增长 率①	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	10-3	2-4
	过去三个月	0.96%	0.02%	0.75%	0.03%	0.21%	-0.01%
	万家鑫安纯债C						
	阶段	净值增长	净值增长率标	业绩比较基准	业绩比较基准收益	①-3	2-4



注:本基金成立于2016年9月18日,根据基金合同规定,基金合同生效后六个月内 为建仓期。建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。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。

3.2.1 本报告期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

万家鑫享纯债A

万家鑫享纯债C

3.2.2 自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

人**学院中产品企图90年**一份市场中学中国第二届主题大师院国本资历史主题和任何

注:1、本基金合同生效日为2017年2月9日,截至本报告期末本基金合同生效未满

2、本基金于2017年2月9日成立,根据基金合同规定,基金合同生效后六个月内为

建仓期。建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各

注:本基金成立于2017年6月7日,建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。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

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。42 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

经理,英国诺丁汉大 2009年7月加入万家基

§ 4 官均 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

:1、此处的任职日期和离任日期均以

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 基金经理(或基金经理小组)简介

投资思路。
4.5 报告期内基金的业绩表现
4.5 报告期内基金的业绩表现
截至本报告期未万家鑫安A基金份额净值为1,0044元,本报告期基金份额净值增
长率为9,90%。减程本报告期未万家鑫安公基金份额净值为1,0041元,本报告期基金份
额净值增长率为0,91%。同期业绩比较基准收益率为0.7%。
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预需说明
本报告期内,本基金没有出现连续工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情况。

	其中:股票	-	_
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	15,320,280,472.10	00.88
	其中:债券	13,943,092,672.10	80.08
	资产支持证券	1,377,187,800.00	7.91
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	_
6	买人返售金融资产	801,520,000.00	4.60
	其中: 买断式回购的买人返售金 融资产	-	_
7	银行存款和结算备付金合计	1,077,831,849.64	6.19
8	其他资产	210,007,29631	1.21
9	合计	17,409,639,618.05	100.00

5.4.2 依晉朔米按行业分类的指放理权贷股票投资组合本基金本报告期末未持有沪港通股票。 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细本基金本报告期末未持有股票。

序号	债券品种		公允价値(ラ	T)	占基金	资产净值比例(%)
1	国家债券		91,625,143.50			0.60
2	央行票据			-		-
3	金融债券		1,994	,335,000.00		13.09
	其中:政策性金融债		1,994	,335,000.00		13.09
4	企业债券		6,345	,165,528.60		41.65
5	企业短期融资券		2,523	,599,000.00		16.56
6	中期票据		1,169	1,169,655,000.00		7.68
7	可转债(可交换债)		1,818,713,000.00			-
8	同业存单					11.94
9	其他		_			-
10	合计		13,943,092,672.10 91.			91.51
.5 }	设告期末按公允	价值占基金	金资产净值比	例大小排	序的前	五名债券投资师
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	(元)	占基金资产净值比 例(%)

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值 比例(%)
1	1789013	17光盈1A	5,000,000	373,850,000.00	2.45
2	1689273	16华驭5A	1,900,000	189,620,000.00	1.24
3	1789243	17华驭7A_bc	1,500,000	150,105,000.00	0.99
4	1789174	17唯盈2优先	1,700,000	138,652,000.00	0.91
5	1789096	17速利银丰 1A	2,000,000	122,000,000.00	080
6	1789217	17融发1优先	1,500,000	120,015,000.00	0.79
7	1789077	17福元1A	1,000,000	62,210,000.00	0.41
8	1789033	17融腾1优先	1,300,000	61,139,000.00	0.40
9	1789120	17融腾2A2	500,000	50,115,000.00	0.33
10	1789199	17德宝天元	600.000	40.050.000.00	0.26

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明 本基金本报告期末未持有贵金属。 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.9.1 本期国债期货投资政策
根据基金合同,本基金投资的国债期货转仓和损益明组
根据基金合同。本基金每不可投资国债期货持仓和损益明组
根据基金合同。本基金据不可投资国债期货。
5.9.3 本期国债期货投资评价
根据基金合同,本基金指不可投资国债期货。
5.10 投资组合报告附注
5.10 投资组合报告附注
5.10 大股份期外,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的,在报告编制目前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。
5.10.2

5.10.2 本基金本报告期末未持有股票。

序号	名称	金額(元)
1	存出保证金	256,827.9
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	209,750,468.4
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	210,007,296.3

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券的本基金本报告期末末持有处于转股期的可转换债券。 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 投资组合报告附注的其他 本报告期末本基金持有短期证券 § 6 开	1,400.00元。 单位:	
项目	万家鑫安纯债A	万家鑫安纯债C
报告期期初基金份额总额	15,168,770,801.36	4,890.00
报告期期问基金总申购份额	343.52	365.23
减:报告期期问基金总赎回份额	9.94	120.00

报告期内基金管理

报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况 期初 份額 台開內本基金出现了單一段資者份關占比达到或超过20%的情况。 未果本基金如纸比與巨額經過甚至屬中線則,基金管理人可能达起及时变现基金资产,可能对基金份 這一生一定的影響。投資商的人可能與基金的成功性成果。更生哲學影响或延續更有機能激励,若个分 沒有巨額銀頭店本基金出遊這接六十个工作且基金资产种租赁于5000万元,还可能面临转换运作方式 被基金台升度增长基金合同等同样。

§ 9 备查文件目录

1 备查文件目录 中國证監会批准本基金发行及募集的文件。 《J万家鑫安吨债债券型证券投资基金基金合同》。 ... 万家基金管理有限公司批准成文文件、宣业执照、公司意程。 、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的基金净值、更新招募说明书。

他临时公告。 5、万家鑫安纯债债券型证券投资基金2017年第3季度报告原文。

6、万家基金管理有限公司董事会决议。 7、《万家鑫安纯债债券型证券投资基金托管协议》。

9.2 存放地点 基金管理人和基金托管人的住所,并登载于基金管理人网站:www.wjasset.

9.3 查阅方式 投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查

万家基金管理有限公司 2017年10月26日

单位:人民币元

报告送出日期:2017年10月26日

基金管理人:万家基金管理有限公司

基金托管人:交诵银行股份有限公司

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

直大遗漏,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。 基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月25日复核

了本报告中的财务指标、净值表现和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溃漏。 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

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。 本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年07月01日起至2017年09月30日止。 § 2 基金产品概况

基金简称	万家鑫享纯债				
基金主代码	003747				
交易代码	003747				
基金运作方式	契约型开放式	契约型开放式			
基金合同生效日	2017年2月9日				
报告期末基金份额总额	200,005,851.00份	200,005,851.00份			
投资目标	在谨慎投资的前提下,本 准的投资收益。	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	略是本基金的基本投资 金融政策、市场供需、市 定性分析与定量分析相 势的判断,并在此基础上	利率变化是影响债务价格的最重要的因素。利率预期策 整准本基金的基本投资策略。本基金通过对求现经济 金融级度,市场带票。市场等的使取需分分环,采用 定性分析与定量分析相结合的方法、形成对未来利率走 势的身断,并在基础上对债券组合的欠期结构进行有 级的复数。			
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指 (税后)×10%	中债综合全价(总值)指数×90%+银行活期存款利率 (税后)×10%			
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,属于中低风险/收益的产品。			
基金管理人	万家基金管理有限公司				
基金托管人	交通银行股份有限公司				
下属分级基金的基金简称	万家鑫享纯债A	万家鑫享纯债C			
下属分级基金的交易代码	003747	003748			
报告期末下属分级基金的份额总额	200,002,161.00份	3,690.00%			

31 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年7月1日 - 2017年9月30日)			
	万家鑫享纯债A	万家鑫享纯债C		
1. 本期已实现收益	2,150,220.11	36.98		
2. 本期利润	1,853,807.76	31.34		
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0093	0.0083		
4. 期末基金资产净值	202,093,953.69	3,725.37		
 期末基金份額净值 	1.0106	1.0096		

万家鑫享纯债债券型证券投资基金

姓名 职务

2017年第三季度报告 § 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介 任本基金的基金经理期限
证券从业

		任职日期	高任日期	年限	10073
柳发超	本基金監查於型、万期、万期、京都、京都、京都、京都、京都、京都、京都、京都、京都、京都、京都、京都、京都、	2017年2月24 日	-	341	柳发超,CPA,上海财经失 学领士。2014 年3 月至 2016 年7 月至前高芒之 林基益管理者假公司债券 2010 年加入万家基金管理 有限公司。
厨俊杰	本基金基金於理, 5年 家發用市, 7年 家發用市, 7年 數學經濟 新國市, 7年 新國市, 7年	2017年2月9日	2017年9月 30日	944	2006年7月至2011年9月在 会不证券股份有限公司团 收益总部从工作、担任投财企 投资研究工作、抵任投财企 发现的工作、担任投财企 发展的公司、 2017年9月因个人服员离 职。

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》、《公开募集 证券投资基金运作管型办法、等实体、法规和监管部门的相关规定、依照谈实信用、勃 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 金持有人规取能大对益。没有损害基金持有人利益的行为。 4.3 公平交易专项说明 4.3 公平交易与或说明 4.3 公平交易制度的执行情况。 根押中调证监会颁布的《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《公平安易管理办法》和《异常交易监控及报告管理办法》等规章制度、涵盖 了研究、提权、投资投资和实验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,并建立了第一的投资管理平台、确保公司投资 组合套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超序;对于债务一级市场申缴,非公开发行股票申购等事集中 整价交易,按照价格优先、比例分配的原则公子经济的关 切定和 通过制度抑范 溶积审批 医络风捻参数设置等进行事前均制 通过对投资 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。 4.32 异常交易行为的专项说明 4.0.4. 并用义例订为时至规划明 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 报告期内基金投资策略和运作分析 三个季度的超预期的增长动能后,经济下行的压力逐渐增大。其中向下的

动力主要来自地产投资回落及大宗商品制造业景气回落,向上的动力主要来自全球 经济回暖所带来的出口回升。通胀方面,cpi食品项仍然较为疲弱,而翘尾因素跨过6 月份掉头向下,大宗商品价格目前处于高位,而上年同期PPI基数较高,后续或将呈现弱势,通胀总体压力不大。总体来看经济基本面整体对债市相对友好,困扰收益率下行的主要是去杠杆的推进以及全球金融环境变化的扰动。 货币政策方面,央行仍然保持相对稳健,但由于银行超储率偏低,缴税等季节性

货币政策方面,央行仍然保持相对稳健,但由于银行超储率偏低,缴税等季节性因素使增银行间资金面波动较大。
二季度储券市场败益率整体波动不大,收益率曲线仍然处于相对较平的状态,短端声率变银行间资金面不稳定的影响,仍然处于相对较高的位置。我们在三季度保持着适中的众期,净值波动较小。考虑到债市去杠杆尚未完全结束,保持短久期,票息为纲精造个券,根极参与利率债波段操作,将是下一价段的主要投资思路。
45 报告期内基金的业绩表现
据宏本报告期末万家鑫享入基金份额净值为1.016元,本报告期基金份额净值增长率为0.92%;截至本报告期末万家鑫享区基金份额净值为1.0096元,本报告期基金份额净值增长率为0.81%。同期业绩比较基准收益率为—0.13%。
46 报告期内基金持有人数或基金资产单值销鉴实现
本报告期内,本基金没有出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产单值低于五千万元情况。
§ 5 投资组合报告

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

b.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 5.2.1 报告期末按行业分类的填内股票投资组合 本基金本报告期末未持有股票。 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合 本基金本报告期末转行产港通股票投资。 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细 大量全来提供班生土生产和

序号	债券品种		公允价值(元	3)	占基金	资产净值比例(%)
1	国家债券			-		-
2	央行票据			-		-
3	金融债券		9,	992,000.00		4.9
	其中:政策性金融债		9,	992,000.00		4.9
4	企业债券		165,	528,000.00		81.90
5	企业短期融资券 —					
6	中期票据		40,	205,000.00	19	
7	可转债(可交换债)			-		
8	同业存单	39,118,000.00			19.30	
9	其他			-		
10	合计	254,843,000.00		126.1		
5.5 ‡	设告期末按公允	价值占基3	企资产净值比例	列大小排	序的前	五名债券投资
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	1521006	15南昌农商债 01	200,000	20,086	,000.00	9.9
2	101576002	15义国资运 MTN001	200,000	20,028	,000.00	9.9

本基金本报告期末未持有贵金属。

中縣亚中民党則果未形得預金屬。 58 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细本基金本报告期末未持有权证。 59 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 根据基金合同,基金暂不可投资于国债期货。 5.10 投资组合报告附注

本基金本报告期末未持有资产支持证券。 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明

5.10.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查 的,在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。 5.10.2 其他资产构成

9 合计 510.3 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 5.10.3 报告增永并有0处于转股即约可转换债券。 本基金本报告期末未持有处于转股即的可转换债券。 5.10.4 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 本基金本报告期末未持有股票。 5.10.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五人的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。 § 6 开放式基金份额变动

超問期採基份類認期 20,002,161.00 (7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 7.1 基金管理人持有本基金份额变对情况 报告期内基金管理人未发生运用固有资金申赎及买卖本基金的情况。 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金等的基地重要信息 8 8 影明投资者决策的其地重要信息

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

期初 份額 持有份额

9.1 备查文件目录 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件

2、《万家鑫享纯债债券型证券投资基金基金合同》 3.万家鑫宣智理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程 4.本报告明内在中国证金产指定报纸上公开披露的基金净值及其他临时公告 5.万家鑫享知债债券型证券投资基金处17年第3季度报告原文 6.万家基金管理求据以示增数金上设

7家基金管理有限公司董事会决议 《万家鑫享纯债债券型证券投资基金托管协议》

9.2 存放地点 基金管理人和基金托管人的住所,并登载于基金管理人网站:www.wjasset.

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查

万家鑫瑞纯债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:兴业银行股份有限公司报告送出日期:2017年10月26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。 基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月25日复 核了本报告中的财务指标。净值表现和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 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

子细阅读本其全的招募说明书 本报告中财务资料未经审计。 本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。 《2 基金产品概况

业绩比较基准 基金为债券型基金,其预期风险和预期收益低于股金、混合基金,高于货币市场基金,属于中低风险/ U险收益特征

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2017年7月1日 - 2017年9月30日)			
	万家鑫瑞A	万家鑫瑞I		
1. 本期已实现收益	7.60	17,444,481.1		
2. 本期利润	7.21	17,668,471.50		
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0091	0.010		
4. 期末基金资产净值	798.68	2,002,904,713.83		
 期末基金份額净值 	1.0082	1.009		

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)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。 3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 万家鑫瑞A 业绩比较基准 收益率③

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》、《公开募集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 公平交易争项说明
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、提权、投资决算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投权制度,并建立了统一的投资管理平台。确保不同投资组合,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投权制度,并建立了统一的投资管理平台。确保不同投资组合,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投权制度,并建立了统一的投资管理平台。确保不同投资组合获得少和的投资决策机会。实行操中交易制度,对于发易所公开竞价交易,执行交易系统中的公平交易程序,对于债券一级市场申收,对全分局的公开资价交易,从保证公平交易原则的实现,通过制度规范、流程审社、系统风社会数设置等进行分配。对于银行可企实,被照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行调价并完成交易。为保证公平交易原则的实现,通过制度规范、流程审批、系统风社会数设置等进行争时,进入中区对对设定公司。

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%。 44 报告期内基金投资策略和运作分析 2017年三季度,经济基本面平稳向好,地产、基建等传统经济增长动力在减速,服 务业、高技术产业等新兴经济增长动力在加速,经济增速较上半年略有放缓,仍然处于近年来高位。供给侧改革推动大宗商品价格上涨,上游价格上涨逐步向下游传导,核心通胀继续上行。

政府保持了去杠杆和严监管的政策态势,金融体系向实体经济的融资保持较高

水平,金融体系内部空转减速,表现为全社会融资总量增速平稳,M2增速持续下行。 资金面维持紧平衡,整体利率中枢抬升。收益率曲线陡峭化,短期利率下行,长期利率 因進聞語可第一個,這中行于一個記憶 他中有升。 本基金在三季度的操作中,选择了短久期高评级的防守方向,较好地規證了长债 下跌的影响,组合净值保持平稳上行,回撤幅度小、 展望2017年四季度,我们预计会济基本面平稳向好的态势有望延续,结构性改革 的成效将逐步显现,经济增速将保持在近年来较高的水平。关注外部利率可能的上升 对国内利率的传导,美国院改的推进、美联储主席人选、原油价格上升,将会是外部风 验的来源。国内强监管措施陆续出台,也将会给资金面带来扰动。预计收益率曲线进 步陡峭化,被股交易将是获取超额收益的主要方式。 "不是"或是"经验检查"中形式等行,据述现代基金、作为组合的基本配置。消除市

一步映明化,成成文多纳大型对地处理的公面的主要力式。 四季度,我们将继续主要投资短久期高评级债券,作为组合的基本配置。追踪市场超跌机会,进行波段交易来提高组合收益。 45 报告期内基金的业绩表现

45 报告期内基金的业绩表现 截至本报告期末万家鑫瑞A基金份额净值为1,0082元,本报告期基金份额净值增 长率为0,90%。截至本报告期末万家鑫瑞E基金份额净值为1,0097元,本报告期基金份 额净值销长率为1,02%。同期业绩比较基准收益率为0,56%。 46 报告期内基金持有人数或基金资产单值预繁边明 本报告期内,本基金没有出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百 人或者基金资产净值低于五千万元情况

本基金本报告期末未持有股票。 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细 本基金本报告期末未持有股票。 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

l	10	合计		1,574,837,000.00			78.63			
5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细										
	序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)		占基金资产净值比例 (%)			
ĺ	1	111709347	17浦发银行 CD347	3,000,000	296,670	,000.00	14.81			
ĺ	2	111784149	17贵阳银行 CD118	2,000,000	199,160	,000.00	9.94			
ĺ	2	111784202	17泉州银行 CD125	2,000,000	199,160	,000.00	9.94			
	3	111717195	17光大银行 CD196	2,000,000	197,780	,000.00	9.87			
ĺ	4	111780889	17四川天府银 行CD109	2,000,000	197,760	,000.00	9.87			
	5	111784155	17九江银行 CD141	1,000,000	99,570	,000.00	4.97			

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 本基金本报告期末未持有资产支持证券。 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明

木基全木报告期末未持有贵全屋 本基金本报告期末未持有贯金属。 58 报告期末状校允允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 本基金本报告期末未持有权证。 59 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 根据基金合同,本基金都不可投资于国债期货。 5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查 的,在报告编制曰前一年内也不存在受到公开谴责,处罚的情况。

基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股 5.10.3 其他资产构成

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

《6 开放式基金份额变动

87 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 报告期内基金管理人未发生运用固有资金申赎及买卖本基金的情况。8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

期初 份额 中购 份额 赎回 份額 持有份额 在部即体基础性现了单一程含者价值估比达到或超过20%的情况。 未本本基金处理共振互继的研究在集中提问。基金管理人可能无法及时使现基金资产。可能对基金价 使产生一定的原则。 使产生一定的原则。 10年4年5周8年6日末年全世界连续的一个工作日基金资产等使用的成绩或支付据回报证。20个 10年4年5周8年6日末年全世界连续大十个工作日基金资产等低低于2000万元,还可能面临转换运作方式

投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个 与其他基金合并或者终止基金合同等情形

1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件 2、《万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金基金合同》 万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程
 本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金净值及其他临时公告

5、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金2017年第3季度报告原文 6、万家基金管理有限公司董事会决议 基金管理人和基金托管人的住所,并登载于基金管理人网站:www.wjasset

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查

万家基金管理有限公司 2017年10月26日