万家颐达保本混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

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9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家颐达
基金主代码	519197
交易代码	519197
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年6月2日
报告期末基金份额总额	519,267,187.04份
投资目标	本基金严格控制风险,在控制本家损失风险的前提下,力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金按照CPPI和TIPP策略对各类金融工具的投资比例进行动态调整,其中,股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于40%;债券、银行存款、资产支持证券、债券回购、现金等固定收益类资产占基金资产的比例不低于60%。每个交易日日终在除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。
业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率(税后)。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其长期平均预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金,高于货币市场基金和债券型基金。
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
基金保证人	深圳市高新投集团有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 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)
1.本期已实现收益	1,565,208.65
2.本期利润	4,302,050.25
3.加权平均基金份额本期利润	0.0079
4.期末基金资产净值	518,943,912.38
5.期末基金份额净值	0.9994

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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

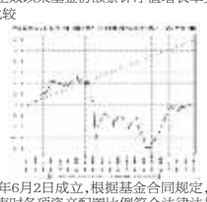
2、上表中本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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	①-③	②-④
过去三个月	0.77%	0.06%	0.69%	0.00%	0.08%	0.06%

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:本基金于2016年6月2日成立,根据基金合同规定,基金合同生效后6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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
高翰昆	本基金基金经理,万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家宝宝货币市场证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞祥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、万家瑞鑫灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞通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、万家瑞润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、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞源灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞臻灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞禧灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞福灵活配置混合型证券投资基金、万家泰债券型证券投资基金、万家和债券型证券投资基金、万家瑞丰债券型证券投资基金、万家鑫安纯债债券型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家享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、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家鑫瑞和保本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、万家瑞通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、万家瑞鑫