# 万家 3-5 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金
# 2019 年第 2 季度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 7 月 16 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2019 年 7 月 15 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 2019 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

# §2 基金产品概况

转型后：

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 万家 3-5 年政金债 |
| 基金主代码 | 519208 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 6 月 18 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 293,861.25 份 |
| 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，把握各类套利的机会。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 | 中证政策性金融债 3-5 年指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 |
| 基金管理人 | 万家基金管理有限公司 |

| | | |
|---|---|---|
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 万家 3-5 年政金债 A | 万家 3-5 年政金债 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 519208 | 519209 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 202,660.63 份 | 91,200.62 份 |

转型前：

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 万家年年恒祥 | |
| 基金主代码 | 519208 | |
| 基金运作方式 | 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 | 245,084.82 份 | |
| 投资目标 | 在严格控制风险并保持良好流动性的基础上，本基金力争获取高于业绩比较基准的投资收益，追求基金资产的长期、稳健、持续增值。 | |
| 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，采取积极主动的投资管理策略，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、信用利差等影响固定收益投资品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，把握各类套利的机会。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。在上述债券投资策略的基础上，本基金对个券进行定价，充分评估其到期收益率、流动性溢价、信用风险补偿、税收、含权等因素，选择那些定价合理或价值被低估的债券进行投资。 | |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价(总值)指数收益率 | |
| 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 | 招商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 万家年年恒祥 A | 万家年年恒祥 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 519208 | 519209 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 202,760.58 份 | 42,324.24 份 |

# §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（ 2019 年 6 月 18 日 － 2019 年 6 月 30 日 ） | |
|---|---|---|
| | 万家 3-5 年政金债 A | 万家 3-5 年政金债 C |
| 1.本期已实现收益 | -488.54 | -84.71 |
| 2.本期利润 | 577.40 | 236.75 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0028 | 0.0038 |
| 4.期末基金资产净值 | 208,262.34 | 93,329.00 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0276 | 1.0233 |

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。

## 3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（ 2019 年 4 月 1 日 － 2019 年 6 月 17 日 ） | |
|---|---|---|
| | 万家年年恒祥 A | 万家年年恒祥 C |
| 1.本期已实现收益 | -242.46 | -73.87 |
| 2.本期利润 | 50.71 | -22.04 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0002 | -0.0005 |
| 4.期末基金资产净值 | 207,787.38 | 43,194.33 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0248 | 1.0206 |

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（转型后）

### 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

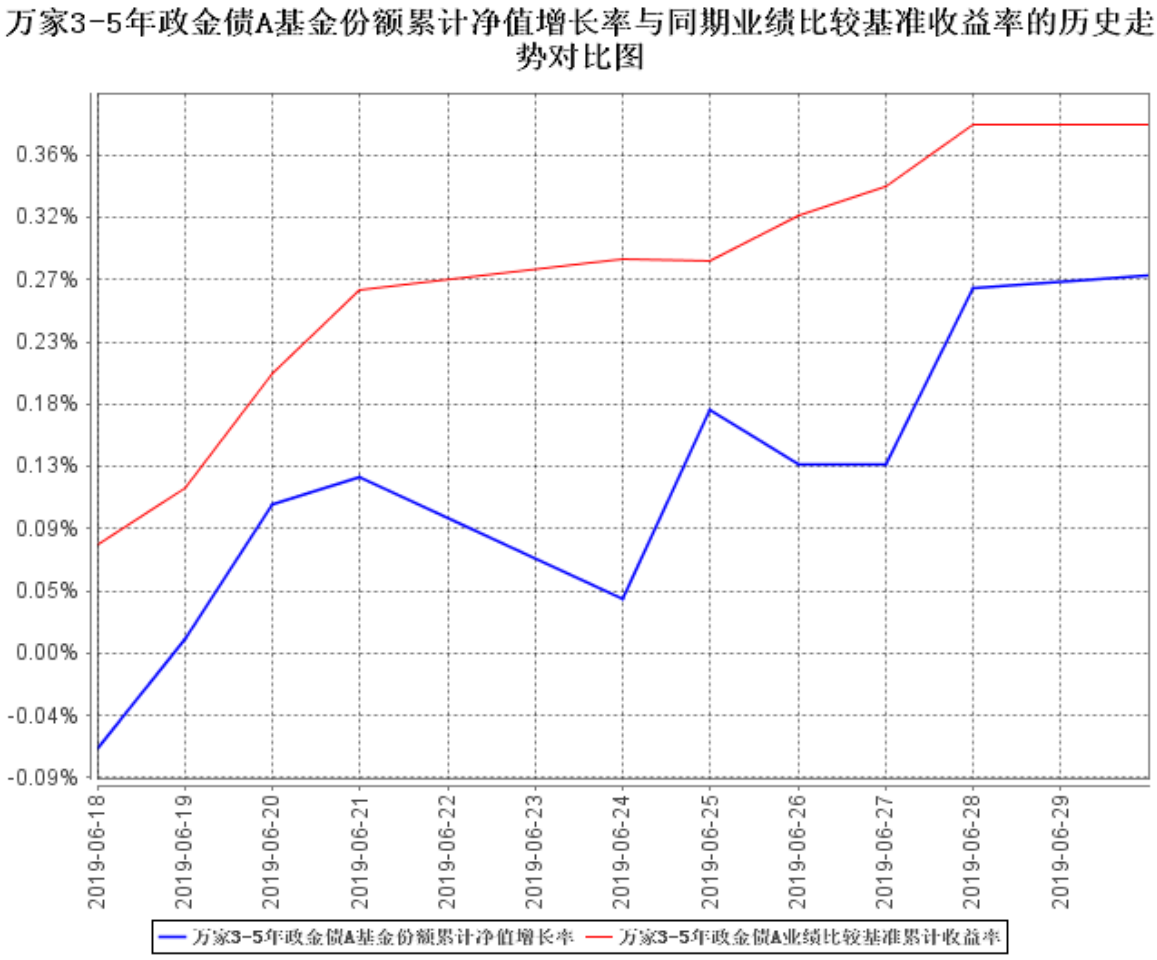
万家 3-5 年政金债 A

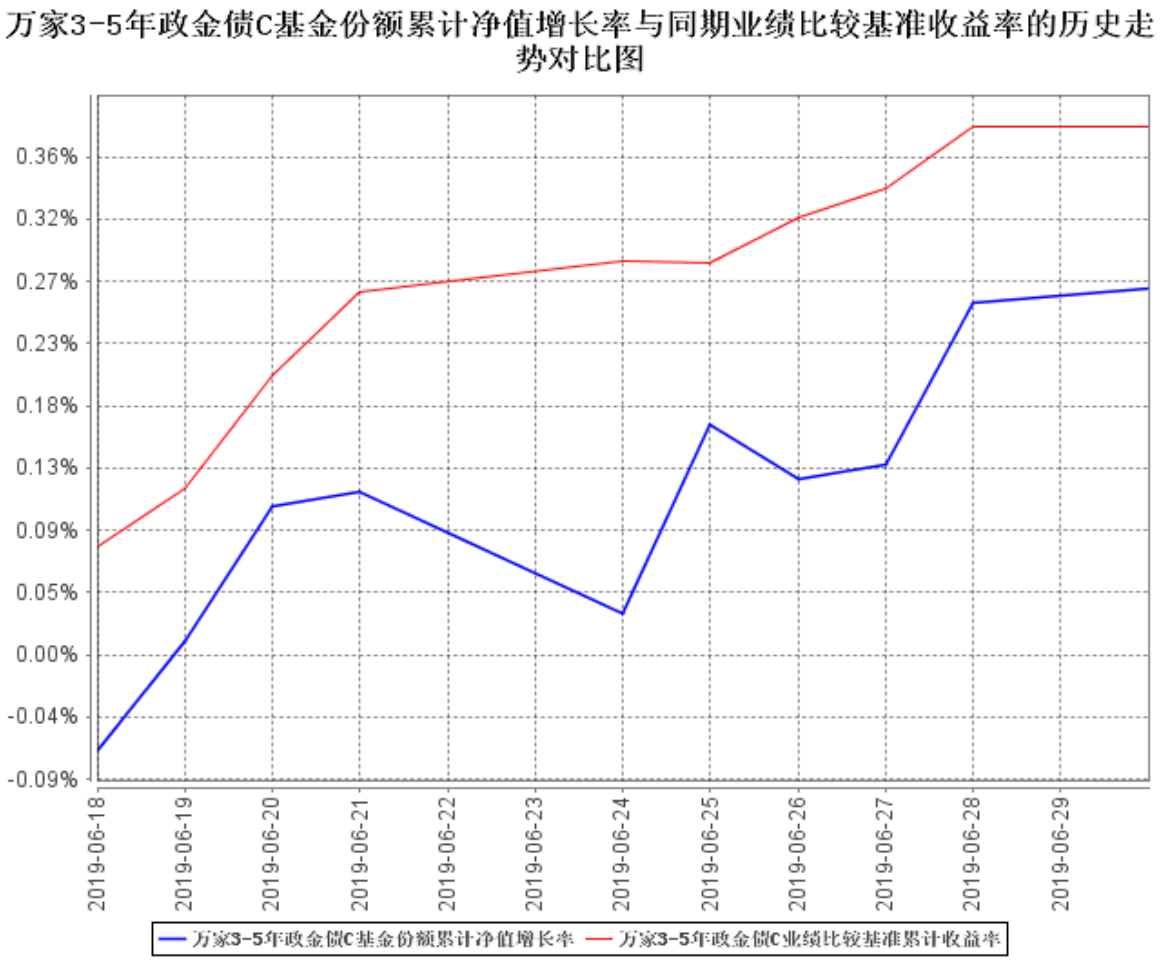
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.27% | 0.08% | 0.38% | 0.03% | -0.11% | 0.05% |

万家 3-5 年政金债 C

| 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 | 0.26% | 0.08% | 0.38% | 0.03% | -0.12% | 0.05% |

### 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收益率变动的比较






注：本基金于 2016 年 9 月 18 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。本次基金份额持有人大会于 2019 年 5 月 13 日表决通过了《关于修改万家年年恒祥定期开放债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，万家年年恒祥定期开放债券型证券投资基金更名并转型为“万家 3-5 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金”。修订和更新后的文件将于 2019 年 6 月 18 日公告并生效。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 基金净值表现（转型前）

### 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

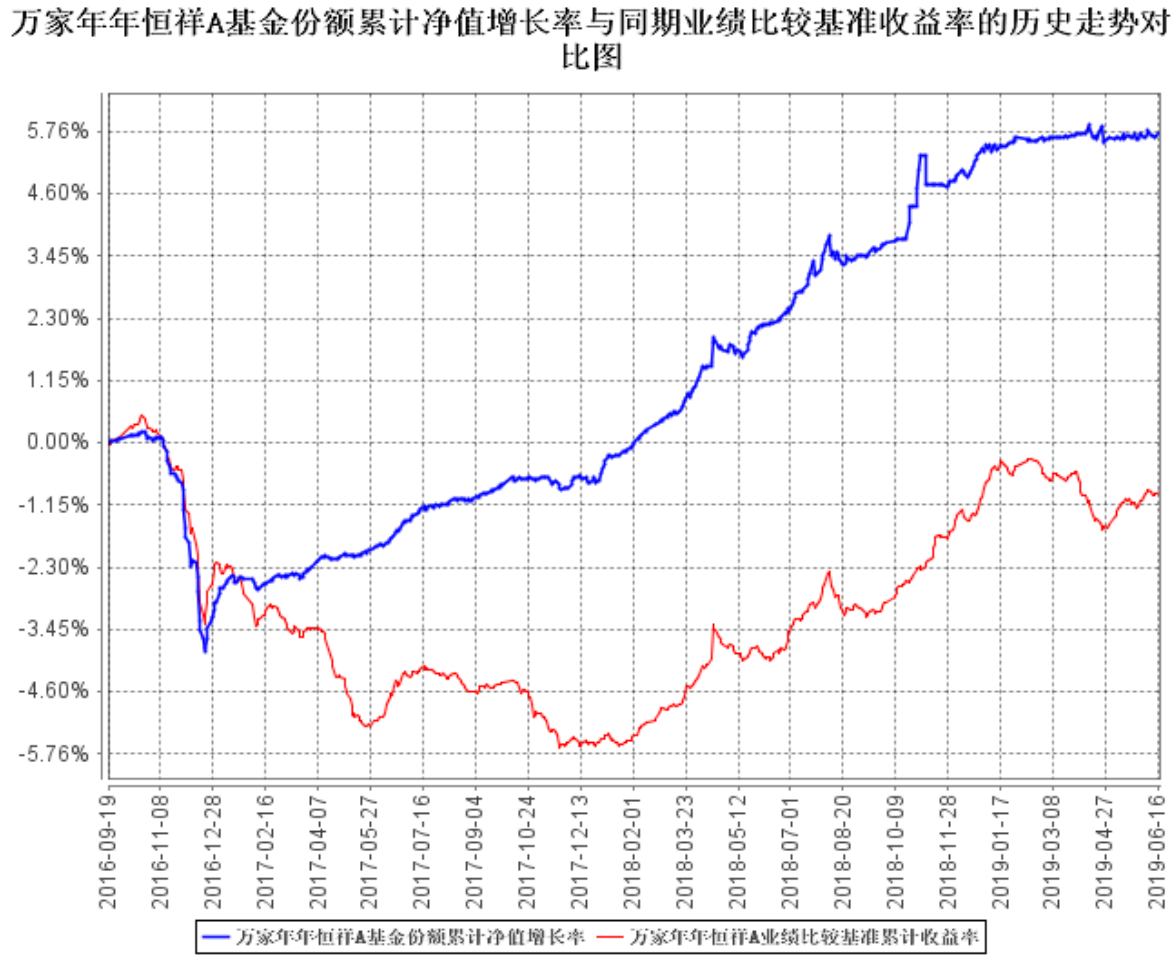
万家年年恒祥 A

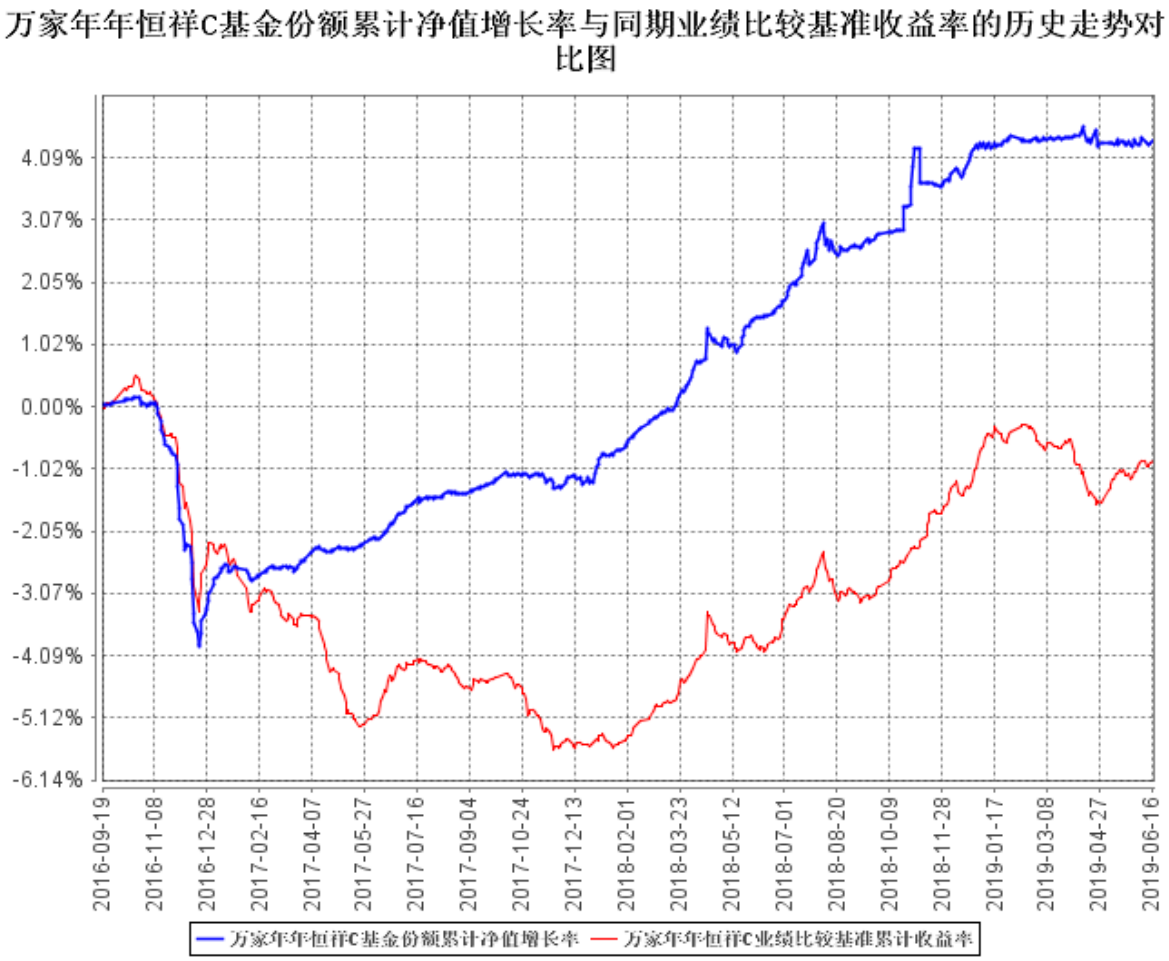
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.04% | 0.06% | -0.36% | 0.07% | 0.40% | -0.01% |

万家年年恒祥 C

| 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 | -0.04% | 0.06% | -0.36% | 0.07% | 0.32% | -0.01% |

### 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收益率变动的比较






注：本基金成立于 2016 年 9 月 18 日，建仓期为六个月，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 （转型前）

| 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 | | |
| 周潜玮 | 万家恒瑞 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 | 2018 年 3 月 1 日 | - | 12.5 年 | 上海交通大学公共管理硕士。<br>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 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 债债券型证券投资基金、万家鑫璟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、万家增强收益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 1-3 年政策性金融债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的基金经理 | | | | 主管，主要负责债券投资及交易等相关工作；<br>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、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。

## 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介 （转型后）

| 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 | | |
| 周潜玮 | 万家恒瑞 18 | 2018 年 3 月 1 | - | 12.5 年 | 上海交通大学公共管 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 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、万家鑫璟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、万家增强收益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 1-3 年政策性金融债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的基金经理 | 日 | | | 理硕士。<br>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；<br>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、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。

## 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 公平交易专项说明

### 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 报告期内基金投资策略和运作分析

国内经济二季度延续一季度形势，在总体稳定的基础上保持了相对增长，社融等货币数据显示市场已有信用扩张的趋势。不过，受到国际形势不确定的影响，国内市场各参与主体仍有一定的谨慎情绪，投资力度放缓，房地产销售数据高位回落。美联储降息预期逐步增强，包括美债在内，

各主要经济体国债收益率均大幅下行，显示各国经济均存在下行压力。相对应的，当前国内债市收益率已经处于较高位置，有利于汇率的稳定。

二季度债券市场震荡盘整，整体振幅较大，经历了较为充分的整理。主要原因是市场对于经济基本面的判断，从乐观转向中性，资金面也从偏紧预期回归中性。期间，本组合在更名以后，维持一定的久期水平。受规模的影响，杠杆水平较低。

预计下半年基本面因素有利于债市，短期可能存在一定的扰动因素，大方向上债市走强的概率较高。密切关注资金面的边际变化，以及中美贸易谈判的进展。通胀已经不是当前市场关注的重点，财政政策和货币政策的政策变化，是影响债市节奏的主要变化。本组合将根据产品本身的特点，维持中性的久期水平。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

转型前，截止 2019 年 06 月 17 日，万家恒祥 A 基金份额净值为 1.0248 元，2019 年 04 月 01 日至 2019 年 06 月 17 日期间基金份额净值增长率为 0.04%；截止 2019 年 06 月 17 日，万家恒祥 C 基金份额净值为 1.0206 元，2019 年 04 月 01 日至 2019 年 06 月 17 日期间基金份额净值增长率为-0.04%；同期业绩比较基准收益率为-0.36%。转型后，截止 06 月 30 日， 万家 3-5 年政金债 A 基金份额净值为 1.0276 元，2019 年 06 月 18 日至 2019 年 06 月 30 日期间基金份额净值增长率为 0.27%；截止 06 月 30 日，万家 3-5 年政金债 C 基金份额净值为 1.0233 元，2019 年 06 月 18 日至 2019 年 06 月 30 日期间基金份额净值增长率为 0.26%；同期业绩比较基准收益率为 0.38%。

## 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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的情况；本报告期内，自 4 月 1 日起至 6 月 17 日基金资产净值连续 51 个工作日低于五千万元。公司召开本基金的基金份额持有人大会，并于 2019 年 5 月 13 日表决通过了《关于修改万家年年恒祥定期开放债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，自《万家 3-5 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金基金合同》生效之日起，万家年年恒祥定期开放债券型证券投资基金自动转型为为万家 3-5 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金。

# §5 投资组合报告

**转型后：**

## 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 229,658.20 | 75.96 |
| | 其中：债券 | 229,658.20 | 75.96 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 64,882.95 | 21.46 |
| 8 | 其他资产 | 7,816.13 | 2.59 |
| 9 | 合计 | 302,357.28 | 100.00 |

## 5.2 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境内股票投资组合

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

本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

## 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

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 229,658.20 | 76.15 |
| | 其中：政策性金融债 | 229,658.20 | 76.15 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 229,658.20 | 76.15 |

## 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 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 018008 | 国开 1802 | 2,060 | 209,646.20 | 69.51 |
| 2 | 108603 | 国开 1804 | 200 | 20,012.00 | 6.64 |

## 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明细

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细

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 10.01 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 7,806.12 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 7,816.13 |

### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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。

**转型前：**

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 230,253.00 | 91.48 |
| | 其中：债券 | 230,253.00 | 91.48 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 15,810.56 | 6.28 |
| 8 | 其他资产 | 5,641.07 | 2.24 |
| 9 | 合计 | 251,704.63 | 100.00 |

## 5.2 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境内股票投资组合

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

本基金本报告期期末未持有港股通投资股票投资组合。

## 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

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 230,253.00 | 91.74 |
| | 其中：政策性金融债 | 230,253.00 | 91.74 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 230,253.00 | 91.74 |

## 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 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 108603 | 国开 1804 | 2,300 | 230,253.00 | 91.74 |

## 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明细

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细

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股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 10.01 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 5,631.06 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 5,641.07 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 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（转型后）

单位：份

| 项目 | 万家 3-5 年政金债 A | 万家 3-5 年政金债 C |
| --- | --- | --- |
| 基金合同生效日（ 2019 年 6 月 18 日 ）基金份额总额 | 202,760.58 | 42,324.24 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | - | 48,976.39 |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 99.95 | 100.01 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 202,660.63 | 91,200.62 |

## §6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

| 项目 | 万家年年恒祥 A | 万家年年恒祥 C |
| --- | --- | --- |
| 报告期期初基金份额总额 | 243,764.88 | 43,834.39 |
| 报告期期间基金总申购份额 | - | - |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 41,004.30 | 1,510.15 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 202,760.58 | 42,324.24 |

# §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

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 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

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 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 20190401-20190630 | 98,575.55 | 0.00 | 0.00 | 98,575.55 | 33.54% |
| | 2 | 20190401-20190630 | 98,575.55 | 0.00 | 0.00 | 98,575.55 | 33.54% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。<br>未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。 | | | | | | | |

# §9 备查文件目录

## 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 3-5 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金基金合同》。

3、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。

4、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、更新招募说明书及其他临时公告。

5、万家 3-5 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金 2019 年第 2 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 3-5 年政策性金融债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办公场所，并登载于基金管理人网站：www.wjasset.com

## 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阅。

万家基金管理有限公司
2019 年 7 月 16 日