万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金

2018年第二季度报告

2018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:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2018年7月19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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月18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2018年04月01日起至06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家品质生活
基金主代码	519195
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年8月6日
报告期末基金份额总额	2,911,327,424.94份
投资目标	本基金通过投资于中国经济社会发展过程中所涌现出的能够直接或间接满足居民生活品质提升需求的上市公司,在严格控制投资风险的基础上,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	随着中国社会经济的发展,居民收入水平的提升和城镇化进程的推进,居民的各方面需求将逐步释放,尤其是对于生活品质的要求会逐步提高,由此带来对相关产品和服务的需求增加,并推动提供此类产品和服务的上市公司的快速成长。本基金将重点把握居民生活品质提升、消费结构升级的趋势,运用“自上而下”和“自下而上”相结合的方法优选行业和精选股票,并构建基金的投资组合。一方面,本基金通过“自上而下”的深入分析,在综合国内外宏观经济发展趋势、国家相关政策的基础上,优化大类资产配置,甄选受益行业;另一方面,通过“自下而上”的深入研究,精选具有核心竞争力、或长性突出且价值低估的上市公司,依靠这些公司的出色或长能力来抵御经济和行业的不确定性和各种压力,力争获得超越市场平均水平的长期回报。
业绩比较基准	50%*沪深300指数收益率+50%*上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于中高预期风险、中高预期收益的证券投资基金;其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金但低于股票型基金。
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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

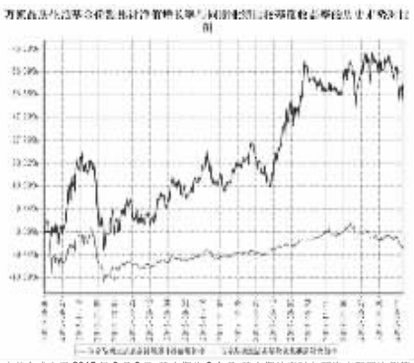
主要财务指标	报告期(2018年4月1日-2018年6月30日)
1.本期已实现收益	26,052,415.47
2.本期利润	-262,803,606.55
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0977
4.期末基金资产净值	3,721,083,079.56
5.期末基金份额净值	1.2781

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	-7.07%	1.30%	-4.28%	0.57%	-2.79%	0.73%

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2015年8月6日,建仓期为6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。本基金已于2016年3月8日召开基金持有人大会,对本基金的名称、基金投资范围等事项进行相应修改。根据基金份额持有人大会决议,原“万家品质生活股票型证券投资基金”更名为“万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金”。基金管理人已将修改后的《万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》《万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金托管协议》和《万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》报中国证监会进行变更注册,修订和更新后的文件于2016年3月8日生效。报告期末各项资产配置比例符合基金合同要求。

§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		
吴海波	本基金基金经理,万家日日套货币市场证券投资基金、万家添利债券型证券投资基金、万家稳选混合型证券投资基金、万家稳兴灵活配置混合型证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家稳健增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基金经理。	2015年8月6日	-	8年	MBA,2010年进入财富证券责任有限公司,任分析师、投资经理助理;2011年进入中银国际证券有限责任公司基金,任分析师、环保行业研究员、策略分析师、投资经理。2015年3月加入本公司,现任总经理助理、投资研究部总监。

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

地产公司和地方政府融资平台是过去几年中最主要的融资者,在严格监管的背景下,这两者的融资渠道被封堵,导致全社会融资需求显著下降。在数据上我们看到,今年前5月,社会融资规模7.9万亿元,较去年同期下滑15%,也略低于2016年同期。5月末M2同比增长8.3%,处于历史最低水平附近。

融资需求下降叠加贸易战带来的外需不确定性增强导致经济下行担忧加剧,央行货币政策态度由中性偏紧转向中性偏松。今年以来在4月和6月连续两次降准,对流动性的措辞由“合理稳定”转向“合理充裕”。货币市场利率中枢显著下行,3m国有股份行存单的高点由去年12月的5.3%,降到今年3月份的4.8%,再降低到今年6月份的4.55%。

本基金在二季度适度拉长了久期,主要配置3m-6m存单和存款。

我们预计2018年下半年,紧信用、宽货币的格局将继续延续,利率中枢将继续阶梯式下行,季末时点资金紧张的程度将逐渐弱化,市场从“负债荒”转向“资产荒”。

我们同时注意到,央行宽松货币也面临人民币贬值压力制约,短期内还看不到从数量型宽松转向价格型宽松。公开市场利率调降概率较小,市场短期利率底部仍然扎实。

在2018年下半年,我们将继续保持较长久期。在月末、季末等敏感时点分配较多资产到期,应对流动性变化。关注市场预期变化带来的交易机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期万家天添宝A的基金份额净值收益率为1.0416%,本报告期万家天添宝B的基金份额净值收益率为1.0892%,同期业绩比较基准收益率为0.0873%。

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或者基金资产净值低于五千万元情况。

§5 投资组合报告

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	固定收益投资	1,982,815,127.72	58.63
	其中:债券	1,982,811,442.94	58.04
	资产支持证券	20,003,684.78	0.59
2	买入返售金融资产	152,000,428.00	4.49
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,232,959,116.61	36.46
4	其他资产	13,997,651.27	0.41
5	合计	3,381,772,323.60	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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	47,122,902.28	1.27
B	采矿业	69,309,249.52	1.86
C	制造业	2,053,179,470.66	55.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	416,365,685.92	11.19
G	交通运输、仓储和邮政业	374,174.45	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	159,429,622.80	4.28
J	金融业	264,958.08	0.01
K	房地产业	665,394,011.07	17.88
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	79,391.50	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	83,167,502.80	2.24
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,494,839,755.07	93.92

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沪港通投资股票。

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600760	中航沈飞	5,560,137	200,387,337.48	5.39
2	300073	当升科技	5,519,208	187,984,224.48	5.05
3	002024	苏宁易购	13,226,155	186,224,262.40	5.00
4	002466	天齐锂业	3,621,091	179,569,902.69	4.83
5	600884	杉杉股份	7,251,767	160,264,050.70	4.31
6	300170	汉得信息	9,817,095	159,429,622.80	4.28
7	001979	招商蛇口	8,221,450	156,618,622.50	4.21
8	002460	赣锋锂业	3,932,428	151,713,072.24	4.08
9	002013	中航机电	19,641,416	148,685,519.12	4.00
10	600038	中直股份	3,699,153	147,929,128.47	3.98

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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投资。

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摊益明细

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

本基金将根据有关法律法规和政策的规定,在严格控制风险的前提下,本着谨慎原则,以套期保值为主要目的,参与股指期货的投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期期末未持有国债期货合约。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,711,961.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	58,153.38
5	应收申购款	15,824,536.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,594,651.52

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因,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

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,312,750,822.05
报告期期间基金总申购份额	642,432,357.61
减:报告期期间基金总赎回份额	43,855,754.72
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	2,911,327,424.94

§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动情况

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 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	2018年04月01日-2018年06月30日	998,222,762.56	0.00	0.00	998,222,762.56	34.29%
产品持有风险							

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。

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,可能对基金分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、《万家品质生活灵活配置混合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媒介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、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金2018年第二季度报告原文。

6、万家基金管理有限公司董事会决议。

7、《万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

9.2 存放地点

基金管理人的办公场所,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

2018年7月19日

万家天添宝货币市场基金

2018年第二季度报告

2018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:上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期:2018年7月19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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月18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2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家天添宝	
基金主代码	004717	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年7月28日	
报告期末基金份额总额	2,855,741,392.85份	
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的前提下,力争获得超过业绩比较基准的收益。	
投资策略	本基金在投资组合的管理中,将通过市场利率预期策略、久期管理策略、类属资产配置策略、个券选择策略、网业存单投资策略、回购策略、套利策略、现金流管理策略和资产支持证券投资策略构建投资组合,谋求在满足流动性要求、控制风险的前提下,实现基金收益的最大化。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为银行活期存款利率(税后)。	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	万家天添宝A	万家天添宝B
下属分级基金的交易代码	004717	004718
报告期末下属分级基金的份额总额	2,332,695,868.99份	523,045,523.86份

§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(2018年4月1日-2018年6月30日)	
	万家天添宝A	万家天添宝B
1.本期已实现收益	22,468,716.66	4,888,551.17
2.本期利润	22,468,716.66	4,888,551.17
3.期末基金资产净值	2,332,695,868.99	523,045,523.86

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

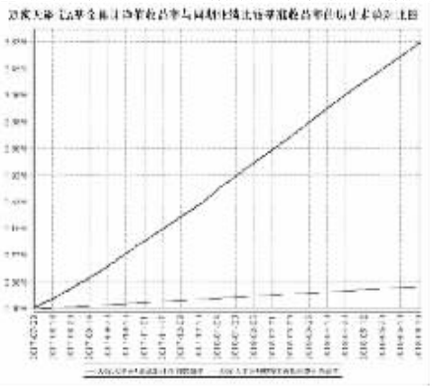
万家天添宝A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.0416%	0.0008%	0.0873%	0.0000%	0.9543%	0.0008%

万家天添宝B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.0892%	0.0008%	0.0873%	0.0000%	1.0019%	0.0008%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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2017年7月28日,建仓期为3个月建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的要求。报告期末各项资产配置比例符合基金合同要求。

§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		
陈佳昀	本基金基金经理、万家日日套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、万家现金宝货币市场证券投资基金基金经理。	2017年9月28日	-	7年	2011年7月至2015年11月在财达证券工作,先后担任固定收益部经理助理、资产管理部投资经理岗位。2015年12月至2017年4月在平安证券工作,担任资产管理部投资经理岗位。2017年4月进入我公司工作。
柳发超	本基金基金经理、万家稳兴灵活配置混合型证券投资基金、万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家稳健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、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家鑫稳纯债债券型证券投资基金、万家稳选灵活配置混合型证券投资基金、万家稳裕灵活配置混合型证券投资基金、万家稳福灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2017年7月28日	-	4年	柳发超,CFA,上海财经大学硕士。2014年3月至2016年7月任国海富兰克林基金管理有限公司债券研究员、基金经理助理,2016年加入万家基金管理有限公司。

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》《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

回顾市场,2018年上半年股市相对于2017年出现了非常显著的变化:价值蓝筹股(除食品饮料和医药外)大幅回撤,成长股全军覆没,市场风格更为极端。

从宏观上来看,年初我们对国内经济持谨慎乐观的态度,这主要是由于我们预判中央对去杠杆将会持有非常严厉和坚定的态度,这将会拖累包括地产和基建投资增速。所以在板块和个股配置中避免增加与经济相关的产业和个股配置(例如周期性板块),这点基本符合市场对全年经济的把握。但出于我们和市场意料的是,中美之间贸易摩擦在历经几轮磋商后依然无果,上半年股市走熊与此高度相关。

在上半年投资策略中,我们采取了均衡布局的策略。在蓝筹股中布局保险和航空,在成长股中持有以新能源汽车、计算机、军工和智能制造为主的板块。从实际走势上来看,相应板块波动较大,收益低于预期。

二季度经济基本面仍显示出了韧性,但信用持续收紧在金融数据上的反映日趋明显,而信用债市场的变化也与之相互印证。信用收紧对基本面的负面影响终将显现,并可能在三季度的数据中有所反应。货币政策预计维持中性操作,资金面保持平稳,有利于债券市场。近期政策层面对信用收缩表现出了高度关注,本基金将持续跟踪研判相关情况与影响,继续做好信用风险管理和流动性管理,积极关注市场机会,为持有人获取较好的投资回报。

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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	572,112.00	0.48
C	制造业	16,717,293.88	13.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,735,873.52	1.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,482,074.00	2.07
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	21,507,353.40	17.91

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603799	华友钴业	46,700	4,551,849.00	3.79
2	002384	东山精密	119,100	2,858,400.00	2.38
3	300024	机器人	118,300	2,058,420.00	1.71
4	300159	新研股份	264,761	1,874,507.88	1.56
5	603636	南威软件	211,400	1,858,206.00	1.55
6	300073	当升科技	45,400	1,546,324.00	1.29
7	002747	埃斯顿	91,700	1,281,966.00	1.07
8	600029	南方航空	108,494	916,774.30	0.76
9	600115	东方航空	123,731	819,099.22	0.68
10	000066	中国长城	113,300	805,563.00	0.67

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	11,579,166.00	9.64
2	央行票据	-	-
3	金融债券	42,920,331.00	35.74
	其中:政策性金融债	42,920,331.00	35.74
4	企业债券	20,867,647.40	17.38
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	9,833,000.00	8.19
7	可转债(可交换债)	8,561,787.80	7.13
8	同业存单	9,778,000.00	8.14
9	其他	-	-
10	合计	103,539,932.20	86.22

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(%)
1	170215	17国开15	200,000	19,884,000.00	16.56
2	122564	PR银江债	187,470	10,569,558.60	8.80
3	170208	17国开08	100,000	10,006,000.00	8.33
4	101669009	16海纳川MTN001	100,000	9,833,000.00	8.19
5	111893837	18江苏江南农村商业银行CD025	100,000	9,778,000.00	8.14

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

根据基金合同,本基金暂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中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	329,619.10
2	应收证券清算款	5,281,360.53
3	应收股利	-
4	应收利息	2,479,946.30
5	应收申购款	45,056.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,135,982.19

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	281.05
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	10,434,529.66
4	应收申购款	3,562,840.56
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	13,997,651.27

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	万家天添宝A	万家天添宝B
报告期期初基金份额总额	1,533,775,745.66	344,250,035.78
报告期期间基金总申购份额	3,668,421,642.58	588,208,595.23
报告期期间基金总赎回份额	2,869,501,519.25	409,413,107.15
报告期期末基金份额总额	2,332,695,868.99	523,045,523.86

§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动情况

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 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	20180401-20180630	39,553,832.77	0.00	0.00	39,553,832.77	35.91%
产品持有风险							

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。

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,可能对基金分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、中国证监会批准万家天添宝货币市场基金发行及募集的文件。

2、《万家天添宝货币市场基金基金合同》。

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媒介上公开披露的基金净值及其他临时公告。

5、万家天添宝货币市场基金2018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、《万家天添宝货币市场基金托管协议》。

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.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

2018年7月19日

万家增强收益债券型证券投资基金

2018年第二季度报告

2018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:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2018年7月19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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月18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2018年4月1日起至2018年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家增强收益债券
基金主代码	161902
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年9月28日
报告期末基金份额总额	110,131,895.56份
投资目标	在满足基金资产良好流动性的前提下,谋求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金在构建债券投资组合时合理评估收益性、流动性和信用风险,追求基金资产的长期稳定增值。并通过新股申购和投资于相对价值被低估的成长型股票谋取增强收益。
业绩比较基准	中证全债指数
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低于股票型和混合型基金,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	中国农业银行股份有限公司

§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(2018年4月1日-2018年6月30日)
1.本期已实现收益	-386,621.70
2.本期利润	-2,101,270.81
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0188
4.期末基金资产净值	120,092,040.32
5.期末基金份额净值	1.0904

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	-1.71%	0.