万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年9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10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。

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10月23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07月01日起至09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
交易代码	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	3,849,739,986.19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、成长性突出且价值低估的上市公司,依靠这些公司的出色成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7月1日-2018年9月30日)
1.本期已实现收益	8,876,310.68
2.本期利润	-298,086,745.71
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0880
4.期末基金资产净值	4,513,471,616.22
5.期末基金份额净值	1.1724

注:1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购、赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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	-8.27%	1.50%	-0.45%	0.68%	-7.82%	0.82%

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
莫海波	万家和谐增长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、万家精选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、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞尧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、万家臻选混合型证券投资基金基金经理。	2015年8月6日	-	8.5年	美国圣约翰大学MBA。2010年3月至2011年2月在财富证券有限责任公司任研究员,2011年2月至2015年3月在中银国际证券有限责任公司任投资经理;2015年3月进入万家基金管理有限公司,从事投资研究工作,自2015年5月起担任基金经理职务,现任公司总经理助理、投资研究部总监、基金经理。

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

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

受国内宏观经济增速放缓预期、贸易摩擦、汇率波动等因素的影响,A股在六月份以来调整较多,股市风险偏好急剧下降,前期走势较为强势的医药、食品饮料等消费板块也持续回调。从各大指数比较来看,代表蓝筹股的上证50有明显的相对收益,而中证500、创业板指数都不断刷新15年6月以来的新低。

同时,我们看到下半年以来财政政策和货币政策均出现了向更加积极方向的转向。从之前公布的八月份工业增加值、社会零售以及社融等数据上看,宏观经济并没有显著的恶化。另外最新九月份PMI也总体延续了之前扩张的态势,非制造业甚至出现改善的迹象。总体判断A股目前点位蕴含了投资者较为悲观的预期。市场的风险偏好有望在后续逐步修复,经济悲观预期、信用风险正伴随放宽的财政政策和适度流动性释放开始好转。调控政策对于经济托底作用开始显现,国常会多次表态减费降税,投融资阶段性修复带动工业、社融等数据好转,财政政策也在蓄力过程中。

从7月初到现在,之前以消费股为代表的家电、医药、食品以及旅游等板块已经经历了较大的回调,板块估值以及盈利水平较为匹配,市场阶段性底部特征明显;军工以及新能源板块等成长板块依旧值得布局;随着中央政策更关注国内经济的自身的状况,压制金融、地产等板块的估值因素大幅缓解,在稳增长的背景下,下半年有望以银行、地产等板块有望迎来一轮估值修复行情。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.1724元;本报告期基金份额净值增长率为-8.27%,业绩比较基准收益率为-0.45%。

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不满二百或基金资产净值低于五千万的情况。

§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	权益投资	3,347,593,289.64	73.99
	其中:股票	3,347,593,289.64	73.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	1,122,296,827.49	24.81
8	其他资产	54,260,862.57	1.20
9	合计	4,524,150,979.70	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	46,939,446.97	1.04
B	采矿业	78,274,365.24	1.73
C	制造业	2,191,893,775.50	48.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	0.00	0.00
E	建筑业	68,790,806.30	1.52
F	批发和零售业	299,213,859.04	6.63
G	交通运输、仓储和邮政业	299,339.56	0.01
H	住宿和餐饮业	0.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	0.00	0.00
J	金融业	473,077.89	0.01
K	房地产业	661,708,619.14	14.66
L	租赁和商务服务业	0.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	0.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	0.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
P	教育	0.00	0.00
Q	卫生和社会工作	0.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	0.00	0.00
S	综合	0.00	0.00
	合计	3,347,593,289.64	74.17

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

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	002460	赣锋锂业	10,611,459	344,766,302.91	7.64
2	002466	天齐锂业	8,250,088	313,750,846.64	6.95
3	603799	华友钴业	5,204,519	277,348,817.51	6.14
4	600760	中航沈飞	6,433,137	245,102,519.70	5.43
5	002024	苏宁易购	14,600,555	196,815,481.40	4.36
6	001979	招商蛇口	9,079,150	169,689,313.50	3.76
7	000066	中国长城	24,010,386	157,748,236.02	3.50
8	002013	中航机电	17,917,214	150,504,597.60	3.33
9	600967	内蒙一机	10,295,264	142,486,453.76	3.16
10	600606	绿地控股	20,742,126	132,749,606.40	2.94

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	1,140,974.59
2	应收证券清算款	51,543,142.87
3	应收股利	-
4	应收利息	200,254.86
5	应收申购款	1,376,490.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	54,260,862.57

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	2,911,327,424.94
报告期期间基金总申购份额	1,236,296,310.48
减:报告期期间基金总赎回份额	297,883,749.23
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	3,849,739,986.19

§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。

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 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	2018年07月01日-2018年09月30日	998,222,762.56	-	-	998,222,762.56	25.93%
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。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10月24日

万家天添宝货币市场基金

2018年第三季度报告

2018年9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10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。

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10月23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7月1日起至9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	3,496,823,332.60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、同业存单投资策略、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	2,984,077,984.19份	512,745,348.41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7月1日-2018年9月30日)	
	万家天添宝A	万家天添宝B
1.本期已实现收益	27,506,563.69	5,708,099.13
2. 本期利润	27,506,563.69	5,708,099.13
3. 期末基金资产净值	2,984,077,984.19	512,745,348.41

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

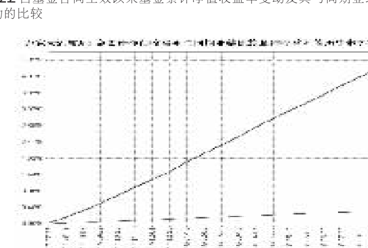
万家天添宝A

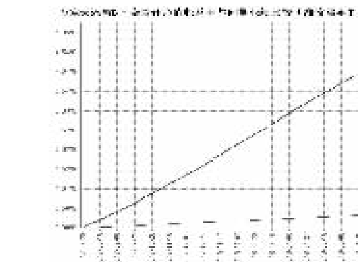
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9509%	0.0011%	0.0882%	0.0000%	0.8627%	0.0011%

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	0.9991%	0.0011%	0.0882%	0.0000%	0.9109%	0.0011%

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
陈佳昀	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、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家天添宝货币市场基金、万家添利债券型证券投资基金(LOF)、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、万家瑞纯债债券型证券投资基金基金经理	2017年9月28日	-	7年	上海财经大学金融学硕士。2010年7月至2011年3月在上海银行虹口分行工作,担任出纳岗位;2011年7月至2015年11月在财达证券有限责任公司工作,先后担任固定收益部经理助理、资产管理部投资经理职务;2015年12月至2017年4月在平安证券股份有限公司工作,担任资产管理部投资经理职务。2017年4月进入万家基金管理有限公司,从事债券研究与投资工作,自2017年5月起担任固定收益部基金经理职务。
郅元	万家天添宝货币市场基金、万家现金增利货币市场基金基金经理	2018年7月24日	-	6.5年	英国雷丁大学金融风险管理硕士。2012年3月至2013年7月在天安财产保险股份有限公司担任交易员,主要负责股票和债券交易等工作;2013年7月至2018年6月在华安基金管理有限公司工作,其中2013年7月至2016年10月担任集中交易部债券交易员,主要负责债券交易工作;2016年11月至2018年6月担任基金经理助理,主要从事关注和研究货币市场动态、债券研究以及协助基金经理进行投资管理等工作;2018年6月加入万家基金管理有限公司,2018年7月起担任固定收益部基金经理职务。
柳发超	万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫安纯债债券型证券投资基金、万家鑫丰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基金经理	2017年7月28日	2018年8月18日	4.5年	上海财经大学风险管理与保险硕士。2008年7月至2012年11月在兴业银行股份有限公司工作,担任审查员职务;2012年11月至2014年3月在平安信托有限责任公司工作,担任信用评估师职务;2014年3月至2016年7月在国海富兰克林基金管理有限公司工作,担任研究员、基金经理助理等职务;2016年7月进入万家基金管理有限公司,从事债券研究工作,自2016年8月起担任固定收益部基金经理职务。

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

2018年三季度国内经济基本面面临一定挑战,金融监管有一定程度缓和,社融数据继续回落,信托贷款和委托贷款等表外融资数据有一定程度企稳,银行表内贷款继续放量。国内信用环境没有明显改善,信用风险事件继续发酵,国家实施政策积极引导金融机构支持民营经济,央行针对国内外可能出现的风险继续采用降准和增量投放MLF等措施维持流动性稳定,财政部加快地方债发行速度,货币政策与财政政策配合力度逐渐加大。通胀有一定上行,但是总体预期可控,食品价格受到自然灾害影响有一定扰动,工业品价格高位震荡。原油价格继续冲高,贸易争端持续加剧,海外风险因素对国内经济预期产生一定负面影响。

三季度国内债券市场收益率总体表现为窄幅震荡。央行宣布降准后流动性环境宽松,但是对短端流动性锚定,经济数据左右市场预期,利率债行情整体震荡。利率债与信用债表现分化,受到信用风险事件持续影响,高评级信用债利差压缩,低评级信用债利差维持高位。由于央行采取偏宽松的货币政策稳定资金面预期,并且在严监管之下银行采取措施主动"去杠杆"减少负债压力,存款和存单利率整体中枢三季度继续下行。

预计四季度经济基本面继续面临一定下行压力,在贸易争端持续发酵影响下,经济仍然面临一定压力,为恢复机构和市场对民营经济和中小微企业的信心,对冲经济外部压力和国内信用基本面恶化的负面影响,央行预计会维持中性偏宽松的货币政策连续性。对于基本面、政策面、外部环境对国内债市可能形成的新影响,本基金将予以持续关注。本基金将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。

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0.9509%,本报告期万家天添宝B的基金份额净值收益率为0.9991%,同期业绩比较基准收益率为0.0882%。

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	1,367,598,383.20	35.05
	其中:债券	1,317,597,987.60	33.77
	资产支持证券	50,000,395.60	1.28
2	买入返售金融资产	785,601,803.40	20.13
	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	1,725,291,464.32	44.22
4	其他资产	23,324,259.28	0.60
5	合计	3,901,815,910.20	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	11.41	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	403,178,875.23	11.53
	其中:买断式回购融资	-	-

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	116
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	81

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	26.90	11.53
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	7.13	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	19.15	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	2.84	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	54.89	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	110.91	11.53

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(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	183,953,405.60	5.26
	其中:政策性金融债	183,953,405.60	5.26
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,133,644,582.00	32.42
8	其他	-	-
9	合计	1,317,597,987.60	37.68
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111885333	18中原银行CD221	1,000,000	99,871,429.47	2.86
2	111811233	18平安银行CD233	1,000,000	99,610,227.61	2.85
3	111896912	18长沙银行CD095	1,000,000	98,759,862.18	2.82
4	160208	16国开08	840,000	83,574,893.62	2.39
5	111810188	18兴业银行CD188	700,000	69,142,874.48	1.98
6	111719357	17恒丰银行CD357	500,000	49,749,461.59	1.42
7	111897920	18江苏紫金农商行CD041	500,000	49,266,311.69	1.41
8	111885287	18贵阳银行CD152	500,000	49,207,650.28	1.41
9	111893839	18珠海华润银行CD016	500,000	49,190,461.60	1.41
10	111885312	18龙江银行CD104	500,000	49,163,606.30	1.41

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.2005%
报告期内偏离度的最低值	0.0508%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1096%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内本基金负偏离度的绝对值未达到0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期内本基金正偏离度的绝对值未达到0.5%。

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十名资产支持证券投资明细

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	149787	18花呗5A	300,000.00	30,000,000.00	0.86
2	146472	花呗38A1	200,000.00	20,000,395.60	0.57

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率每日计提利息,并考虑其买入时的溢价和折价在其剩余期限内摊销,每日计提损益。

本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.00元。

5.9.2

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情况;本基金投资的前十名证券中18中原银行CD221的发行主体中原银行股份有限公司,18平安银行CD233的发行主体平安银行股份有限公司,18长沙银行CD195的发行主体长沙银行股份有限公司,18兴业银行CD188的发行主体兴业银行股份有限公司,17恒丰银行CD357的发行主体恒丰银行股份有限公司,18贵阳银行CD152的发行主体贵阳银行股份有限公司,18龙江银行CD104的发行主体龙江银行股份有限公司在报告编制日前一年内中存在受到公开谴责、处罚的情况。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	18,703,994.11
4	应收申购款	4,620,265.17
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	23,324,259.28

§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	2,332,695,868.99	523,045,523.86
报告期期间基金总申购份额	3,455,104,904.33	453,893,201.67
报告期期间基金总赎回份额	2,803,722,789.13	464,193,377.12
报告期期末基金份额总额	2,984,077,984.19	512,745,348.41

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期未发生基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金的情况。

§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

本报告期内,本基金未发生单一投资者持有份额超过20%的情况。

§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10月24日

万家增强收益债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年9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10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。

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10月23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7月1日起至2018年9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	108,382,335.09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7月1日-2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-2,298,414.17
2.本期利润	-721,386.45
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0066
4.期末基金资产净值	117,465,097.41
5.期末基金份额净值	1.0838

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	-0.61%	1.68%	1.35%	0.06%	-1.96%	1.62%

注:基金业绩比较基准中证全债指数

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2004年9月28日,于2007年9月29日转型为债券型基金,转型后建仓期为半年,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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
李文宾	万家成长优选灵活配置混合型证券投资基金、万家经济新动能混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家瑞兴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、万家双利债券型证券投资基金、万家新机遇价值驱动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、万家增强收益债券型证券投资基金、万家智造优势混合型证券投资基金基金经理。	2017年11月14日	-	8年	复旦大学工商管理硕士。2010年7月至2014年4月在中银国际证券有限责任公司工作,担任研究员职务;2014年5月至2015年11月在华泰资产管理有限公司工作,担任研究员职务;2015年11月进入万家基金管理有限公司,从事股票研究工作,自2017年1月起担任投资研究部基金经理职务。
苏谋东	万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、万家恒景18个月定期开放债券型证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家家瑞债券型证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞舜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、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、万家现金增利货币市场基金、万家鑫丰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、万家鑫悦纯债债券型证券投资基金、万家颐达保本混合型证券投资基金、万家颐和保本混合型证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金基金经理	2018年9月18日	-	10年	复旦大学世界经济硕士。2008年7月至2013年2月在宝钢集团财务有限责任公司工作,担任资金运用部投资经理,主要从事债券研究和投资工作;2013年3月进入万家基金管理有限公司,从事债券研究工作,自2013年5月起担任基金经理职务,现任固定收益部总监、基金经理。
周潜玮	万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家恒瑞18个月定期开放债券型证券投资基金、万家年年恒祥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、万家家裕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、万家瑞和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、万家双利债券型证券投资基金、万家鑫璟纯债债券型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金基金经理	2018年8月15日	-	12年	上海交通大学公共管理硕士。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;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。
孙远慧	万家潜力价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2017年4月27日	2018年8月15日	8年	南京大学经济学硕士。2010年7月至2012年9月在长城基金管理有限公司工作,担任研究员职务;2012年9月至2016年2月在中欧基金管理有限公司工作,担任研究员、投资经理等职务;2016年2月进入万家基金管理有限公司,从事投资研究工作,自2016年3月起担任基金经理职务,现任投资研究部研究副总监、基金经理。
高翰昆	-	2015年10月17日	2018年8月15日	9年	美国诺丁汉大学生物工程硕士。2009年7月进入万家基金管理有限公司,从事债券交易工作,自2014年12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》《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

1、市场回顾

三季度宏观经济保持平稳,外部环境造成的冲击有限。通胀预期有所抬头,但cpi同比增速仍保持较低水平。短期内地方政府债券供给量较大,略超市场预期,叠加流动性中性水平,债券市场走出了较为明显的波动走势,整体上表现较为弱势,各机构保持谨慎态度,市场承压迹象明显。

2、组合回顾

本组合在三季度前期保持较高的久期,中期适度降低久期。整体保持净值表现较为稳定。本组合的杠杆水平不高,季度内的资金价格波动并未对组合产生较大的影响。

3、市场展望及投资策略

关注国际环境的变化,特别是美国的对华贸易政策和货币政策,同时关注国内经济下行的压力。预计通胀不会成为主要的扰动因素,中长期来看债券市场将回归基本面的表现。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.0838元;本报告期基金份额净值增长率为-0.61%,业绩比较基准收益率为1.35%。

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	权益投资	19,824,170.70	16.09
	其中:股票	19,824,170.70	16.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	100,398,250.50	81.46
	其中:债券	100,398,250.50	81.46
	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	1,332,306.82	1.08
8	其他资产	1,690,242.01	1.37
9	合计	123,244,970.03	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	2,349,527.00	2.00
B	采矿业	1,640,652.00	1.40
C	制造业	11,522,465.70	9.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	905,380.00	0.77
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,406,146.00	2.90
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	19,824,170.70	16.88

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	65,380	3,484,100.20	2.97
2	002384	东山精密	178,650	2,188,462.50	1.86
3	600467	好当家	746,800	1,829,660.00	1.56
4	603636	南威软件	211,400	1,786,330.00	1.52
5	600583	海油工程	242,700	1,640,652.00	1.40
6	601952	苏垦农发	157,900	1,258,463.00	1.07
7	002025	航天电器	45,500	1,245,790.00	1.06
8	600498	烽火通信	40,800	1,217,472.00	1.04
9	300073	当升科技	45,400	1,148,166.00	0.98
10	300059	东方财富	100,000	1,125,000.00	0.96

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	10,571,167.60	9.00
2	央行票据	-	-
3	金融债券	52,659,320.00	44.83
	其中:政策性金融债	52,659,320.00	44.83
4	企业债券	31,193,262.90	26.56
5	企业短期融资券	5,000,500.00	4.26
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	974,000.00	0.83
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	100,398,250.50	85.47

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	180405	18农发05	200,000	20,222,000.00	17.22
2	180211	18国开11	100,000	9,920,000.00	8.45
3	160206	16国开06	100,000	9,827,000.00	8.37
4	122564	PR银江债	187,470	7,795,002.60	6.64
5	018005	国开1701	66,200	6,659,720.00	5.67

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	318,857.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,358,944.01
5	应收申购款	12,441.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,690,242.01

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002562	兄弟转债	974,000.00	0.83

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	110,131,895.56
报告期期间基金总申购份额	532,721.88
减:报告期期间基金总赎回份额	2,282,282.35
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	108,382,335.09

§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。

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 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	20180701-20180930	39,553,832.77	-	-	39,553,832.77	36.49%
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。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、《万家增强收益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、万家增强收益债券型证券投资基金2018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、《万家增强收益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.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10月24日