

基金管理人:万家基金管理有限公司
基金托管人:平安银行股份有限公司
报告送出日期:2019年1月22日

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。
基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年1月21日复核了本报吿中的财务指标、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基金的招募说明书。

本报吿书告期自2018年10月1日起至2018年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称	万家安弘
基金代码	000491
基金上市方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年9月1日
报告期末基金份额总额	232,310,947.00份
投资目标	在严格控制风险的前提下，本基金力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

本基金在充分分析宏观经济形势以及政策导向的基础上，通过深入研究与分析，对影响证券价格的因素，结合对宏观经济、金融运行、行业政策、公司治理、市场情绪等的综合分析，精选具有投资价值的股票，同时辅以适当的债券投资，以期在有效控制风险的前提下，获得超越市场的超额收益。

本基金的投资策略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基金的招募说明书。

本报吿书告期自2018年10月1日起至2018年12月31日止。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标		报告期(2018年10月1日-2018年12月31日)			
万万家安弘	万家安弘C	1.本期已实现收益	2,096,050.31	0.07%	
2.本期利润	4,073,200.36	100.2%			
3.加权平均基金份额本期利润	0.0183	0.01%			
4.期末基金份额净值	239,230,515.64	0.28477			
5.期末可供分配基金份额利润	10.000	0.0000			

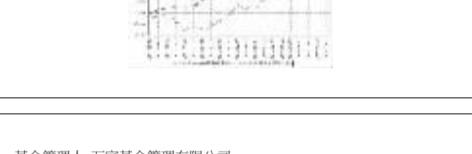
注:1.上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所示数字。

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 本报吿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		单位:人民币元			
阶段	净值增长率为1%时的基金收益	净值增长率为2%时的基金收益	净值增长率为3%时的基金收益	①-③	②-④
过去三个月	2.12%	0.01%	-1.9%	0.0%	-0.01%
	万家安弘C				
阶段	净值增长率为1%时的基金收益	净值增长率为2%时的基金收益	净值增长率为3%时的基金收益	①-③	②-④
过去三个月	2.07%	0.01%	-1.9%	0.0%	-0.01%
	万家安弘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收益率变动的比较



万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金

2018年第四季度报告

集合资投资基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》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，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人的利益的行为。

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，确保不同投资组合使用公平的定价决策机制，对于交易所公开竞价交易，执行交易系统的公平交易程序；对于银行间交易，按照时间优先、价格优先的原则对交易结果进行分配；对于非集中竞价交易，按价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；对于大宗交易，通过对手方选择、交易金额限制、交易对手信用评估等手段进行控制，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

本报吿期内未发现本基金可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报吿期内无不利的情况：所持有的投资组合与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 报告期内基金投资组合运作情况

四季度国内经济基本面下探幅度加深，权益市场持续调整，油价压力缓解，商品期货和债券市场表现较好，但仍然面临地方政府债务问题，社融增速继续放缓，政府债券收益率偏高，经济偏弱，总体下行，油价呈现大幅回落，通胀预期大幅缓和，债券市场面临的外部环境总体改善，美欧经济基本面仍面临不确定性，美联储加息预期弱化，美股收益率大幅走低，对国内市场货币政策的制约明显减弱。

在国内基本面下探、经济增长放缓、资金面持续宽松、外围压力减轻等因素的共同作用下，四季度收益大幅下降；随着美联储降息，我们预计四季度信用风险事件有所减少，信用风险边际改善。

本基金进入封闭期，四季度积极建仓，维持了较高的杠杆，重点增配了中高等级中长期信用债，获得了较好的投资回报。

近期增长减速政策落地步伐有加快，基建增速回升，疏通货币政策传导渠道成为重中之重，财政增支稳增长的政策效果显现，而在全球经济基本面趋弱叠加贸易战实际影响的作用下，外贸对经济的拖累作用将更为明显，总而言之近期国内经济基本面呈现阶段性底部但仍相对短期呈现边际改善的格局，这一阶段，流动性环境仍将保持宽松，通过年初年的峰值再次得到确认，我们认为债市仍无实质性风险，并存在结构性机会，本基金将继续做好信用风险管理及流动性管理，积极关注市场机会，为持有人创造较好的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报吿期末，万家安弘C基金份额净值为1.0292元，本报告期基金份额净值增长率增长率为2.02%，即期绩效比基准收益率为1.9%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值情况说明

本报吿期内，本基金没有出现连续二十个工作日基金持有人数不满二百人或者基金资产净值低于五十万元的情况。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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五名债券投资

5.4 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

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权证及衍生品投资

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

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

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及衍生品投资

5.9 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

5.10 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权证及衍生品投资

5.11 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贵金属投资

5.12 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权证及衍生品投资

5.13 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贵金属投资

5.14 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权证及衍生品投资

5.15 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贵金属投资

5.16 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权证及衍生品投资

5.17 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贵金属投资

5.18 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权证及衍生品投资

5.19 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贵金属投资

5.20 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权证及衍生品投资

5.21 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贵金属投资

5.22 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权证及衍生品投资

5.23 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贵金属投资

5.24 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权证及衍生品投资

5.25 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贵金属投资

5.26 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权证及衍生品投资

5.27 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贵金属投资

5.28 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权证及衍生品投资

5.29 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贵金属投资

5.30 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权证及衍生品投资

5.31 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贵金属投资

5.32 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权证及衍生品投资

5.33 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贵金属投资

5.34 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权证及衍生品投资

5.35 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贵金属投资

5.36 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权证及衍生品投资

5.37 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贵金属投资

5.38 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权证及衍生品投资

5.39 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贵金属投资

5.40 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权证及衍生品投资

5.41 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贵金属投资

5.42 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权证及衍生品投资

5.43 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贵金属投资

5.44 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权证及衍生品投资

5.45 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贵金属投资

5.46 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权证及衍生品投资

5.47 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贵金属投资

5.48 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权证及衍生品投资

5.49 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贵金属投资

5.50 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权证及衍生品投资

5.51 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贵金属投资

5.52 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权证及衍生品投资

5.53 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贵金属投资

5.54 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权证及衍生品投资

5.55 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贵金属投资

5.56 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权证及衍生品投资

5.57 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贵金属投资

5.58 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证及衍生品投资</p