万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金 2018年年度报告摘要

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
送出日期:2019年3月28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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计,立信会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	万家安弘	
基金主代码	004681	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年8月18日	
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	
报告期末基金份额总额	232,315,947.48份	
下属分级基金的基金简称:	万家安弘A	万家安弘C
下属分级基金的交易代码:	004681	004682
报告期末下属分级基金的份额总额	232,307,897.60份	8,049.88份

2.2 基金产品说明

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	封闭期投资策略和开放期投资策略。封闭期投资策略包括资产配置策略、利率预期策略、期限结构配置策略、债券品种选择策略、信用债券投资的风险管理、资产支持证券等品种投资策略和中小企业私募债券投资策略。开放期投资策略为在开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资者安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种。
业绩比较基准	中债综合指数收益率(全价)
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		万家基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	李帅帅
	联系电话	021-38909626	0755-25878287
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	LISHUAISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		95538转6,4008880800	95511-3
传真		021-38909627	0755-82080387

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.wjasset.com
基金年度报告备置地点	中国(上海)自由贸易试验区浦电路360号8层(名义楼层9层)基金管理人办公场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年		2017年8月18日(基金合同生效日)-2017年12月31日		2016年	
	万家安弘A	万家安弘C	万家安弘A	万家安弘C	万家安弘A	万家安弘C
本期已实现收益	11,422,844.87	316.16	2,611,889.16	65.80	-	-
本期利润	15,587,202.67	446.70	1,477,921.09	35.56	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.0676	0.0654	0.0064	0.0058	-	-
本期基金份额净值增长率	6.80%	6.60%	0.64%	0.58%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2018年末		2017年末		2016年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0167	0.0161	0.0064	0.0058	-	-
期末基金资产净值	239,230,510.54	8,284.77	232,980,510.06	6,206.32	-	-
期末基金份额净值	1.0298	1.0292	1.0064	1.0058	-	-

注:1、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。

2、所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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

万家安弘A

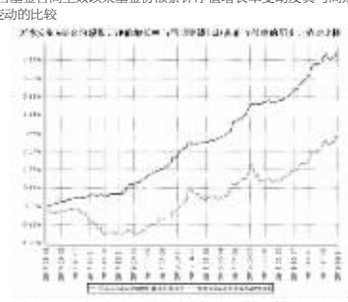
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.12%	0.05%	1.99%	0.05%	0.13%	0.00%
过去六个月	3.66%	0.04%	2.57%	0.06%	1.09%	-0.02%
过去一年	6.80%	0.04%	4.79%	0.07%	2.01%	-0.03%
自基金合同生效起至今	7.48%	0.04%	3.43%	0.07%	4.05%	-0.03%

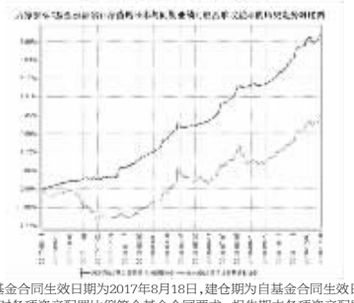
万家安弘C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	2.07%	0.05%	1.99%	0.05%	0.08%	0.00%
过去六个月	3.56%	0.04%	2.57%	0.06%	0.99%	-0.02%
过去一年	6.60%	0.04%	4.79%	0.07%	1.81%	-0.03%
自基金合同生效起至今	7.22%	0.04%	3.43%	0.07%	3.79%	-0.03%

注:基金业绩比较基准增长率=中债综合指数收益率

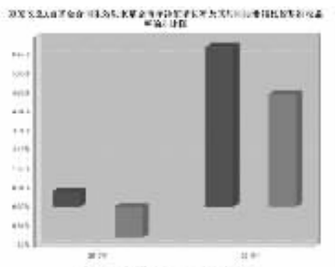
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

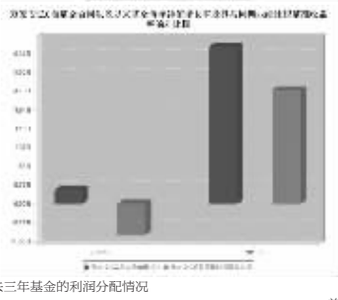




注:本基金合同生效日期为2017年8月18日,建仓期为自基金合同生效日起6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合基金合同要求。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

万家安弘A					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018	0.4400	10,186,113.99	-	10,186,113.99	
2017	-	-	-	-	
2016	-	-	-	-	
合计	0.4400	10,186,113.99	-	10,186,113.99	

单位:人民币元

万家安弘C					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018	0.4200	207.93	51.24	259.17	
2017	-	-	-	-	
2016	-	-	-	-	
合计	0.4200	207.93	51.24	259.17	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44号文批准设立。公司现股东为中泰证券股份有限公司、新疆国际实业股份有限公司和山东省国有资产投资控股有限公司,住所:中国(上海)自由贸易实验区浦电路360号8楼(名义楼层9层),办公地点:上海市浦东新区浦电路360号9楼,注册资本1亿元人民币。目前管理六十一只开放式基金,分别为万家180指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选混合型证券投资基金(LOF)、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金(LOF)、万家添利债券型证券投资基金(LOF)、万家新机遇价值驱动灵活配置混合型证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家上证50交易型开放式指数证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家双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、万家瑞丰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、万家品质生活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、万家新兴蓝筹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、万家沪深300指数增强型证券投资基金、万家家享纯债债券型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫稳纯债债券型证券投资基金、万家瑞隆混合型证券投资基金、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家现金增利货币市场基金、万家消费成长股票型证券投资基金、万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫瑞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、万家天添宝货币市场基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、万家家瑞债券型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家鑫璐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经理

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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《万家基金管理有限公司公平交易管理办法》,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,严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送,确保公平对待不同投资组合。

在投资决策上:(1)公司对不同类别的投资组合分别设定独立的投资部门,公募基金经理和特定客户资产管理投资经理不得互相兼任。(2) 公司投资管理实行分层次决策,投资决策委员会下设的公募基金投资决策小组和专户投资决策小组分别根据公募基金和专户投资组合的规模、风格特征等因素合理确定各投资组合经理的投资权限,投资组合经理在授权范围内自主决策,超过投资权限的操作需经过严格的逐级审批程序。(3)公司接受的外部研究报告、研究员撰写的研究报告等均通过统一的投研管理平台发布,确保各投资组合经理在获得投资信息、投资建议和实施决策方面享有公平的机会。

在交易执行上:(1)公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离,实行集中交易制度;(2)对于交易公开竞价交易,所有指令必须通过系统下达,公司执行交易系统中的公平交易程序;(3)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,各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量, 公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;(4)对于银行间交易,交易部按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。

在行为监控上,公司定期对不同投资组合的同向交易价差、反向交易、场外交易对手议价的价格公允性及其他异常交易情况进行监控及分析,基金经理对异常交易情况进行合理性解释并留存记录,并定期编制公平交易分析报告,由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司定期进行同向交易价差分析,即采集公司旗下管理的所有组合,连续四个季度期间内,不同时间窗下(日内、3日内、5日内)的同向交易样本,对两两组合之间的同向交易价差均值进行原假设为0,95%的置信水平下的t检验, 并对结论进行跟踪分析,分析结果显示在样本数量大于30的前提下,组合之间在同向交易方面不存在违反公平交易行为。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年上半年国内经济基本面表现出了一定的韧性,而下半年经济下行压力明显放大。制造业投资和地产投资仍在需求层面对经济形成了较强的支撑,尤其地产投资,销售增速下滑尚未对投资增速形成明显拖累,一方面与库存水平较低有关,另一方面与开发商抢开工抢回款似的新开工面积增速居高不下有关。而在严控地方政府债务和信用收缩的大环境下,地方政府融资渠道受限,基建放缓态势明显,下半年在中央政府的主导下基建增速出现回升,一定程度上对冲了总需求的下滑。欧美经济上半年表现总体稳中向好,使得外需上半年仍稳健,贸易战影响停留在预期层面,下半年在抢出口效应的影响下进出口持续超预期,但11月以来已经明显弱化。总体来看,外需和地产仍较好地对2018年的总需求形成了支撑,基建的拉动效应四季度以来有所显现。

全年货币环境总体偏松,银行间流动性持续超预期宽松。年初为对冲严监管对经济基本面的冲击,货币政策转松,后续为对冲贸易战等因素带来的基本面下行压力货币政策持续宽松,但在严监管环境下金融机构的预期和行为都受到较大影响,宽货币向宽信用的传导并不顺畅,信用收缩明显,在非标上的表现尤为明显,虽然下半年以来银行在政策指导下大力投放信贷,但其对表外信用回归的承接能力有限,且新增信贷投放的期限结构仍偏短,一方面显示银行风险厌恶,另一方面也是实体融资需求萎缩的表现。总而言之我们看到全年社融增速明显下行,而货币供给力度加大,使得银行间流动性呈现宽松状态。

但在基本面见顶回落的环境之中,国内通胀压力总体可控。供给侧改革使得工业品价格维持高位,但供应的边际增加以及需求的边际放缓使得价格向下游的传导作用有限。油价阶段性地对通胀预期形成了扰动,但并没有持续太长时间。

从市场表现上来看,2018年的债券市场在将信将疑中迎来牛市,其中十年国开自高点下行超过150bp。牛市的驱动因素主要是:1,货币政策转向使得流动性持续宽松,而在严监管的作用下信用扩张力度有限,流动性宽松惠及债券市场;2,贸易战因素贯穿全年,并在二、三季度屡次成为收益率阶段性大幅下行的驱动因素,背后是对经济基本面下滑的预期不断升温、对中国经济远期悲观预期的持续发酵;3,债券市场前期超调,绝对收益率水平较高,存在较好的配置价值。虽然三季度行情略有反复,但收益率全年大体还是呈现单边下滑态势。

信用债走势更为反复。信用收缩使得企业再融资环境边际转差,部分边缘主体现金流面临巨大考验,上半年违约事件频发,持续超预期,使得市场对信用风险的担忧与日俱增,一个具体表现就是对民企债券的集中抛售,而中低等级信用债收益率的总体水平在这一阶段也出现了明显上行。年中之后,随着CRMW发行等一系列宽信用措施的落地,企业再融资环境恶化的趋势得到遏制,市场对信用债的态度回归理性,叠加此信用利差保护仍非常充分,使得信用债在下半年迎来了一波行情,信用利差明显收窄。

本基金一季度拉长了组合久期并适当提升了杠杆水平,增配了高评级品种获取资本利得与套息收益,二季度继续维持低信用风险、短久期配置策略,并适当参与了利率债交易。三季度债券市场震荡为主,本基金进入开放期,开放期前逐渐减仓,账户保持了较好的流动性。四季度本基金进入第二个封闭期,积极建仓并维持了较高的杠杆,重点增配了中高等级中等久期信用债,获取了较好的资本利得。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家安弘A基金份额净值为1.0298元,本报告期基金份额净值增长率为6.80%;截至本报告期末万家安弘C基金份额净值为1.0292元,本报告期基金份额净值增长率为6.60%;同期业绩比较基准收益率为4.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019年宏观经济基本面下行压力较18年边际增加。相对具有确定性的是出口的边际下滑。一方面,近一段时间海外经济基本面呈现弱化态势,使得外需本身存在收缩,另一方面,18年企业为应对贸易战而进行的抢出口则部分透支了19年的需求, 同时做高了基数,使得19年的外贸形势不容乐观。其次存在较明显下行压力的是地产产业链,18年在地产企业抢开工抢销售效应的影响下,新开工增速持续维持高位,短期内对建安开支以及地产投资存在支撑,但年中以来土地市场总体降温明显,后期新开工回落预期较强,最终将传导至地产投资,而地产产业链景气度下行对总需求的影响巨大。较为确定性的对冲因素是基建回升,已经看到两会前地方债的提前发行,以基建托底经济的政策导向较为明确,但基建的产业链辐射效应弱于地产,地方政府则仍然面临债务约束,同时考虑中央不搞大水漫灌强刺激的反复表态,总体预计基建回升难以完全扭转经济基本面的下滑,但将使得斜率较为缓和。

在基本面下行压力增大、宽信用仍无明显起色的情况下,货币政策预计仍然维持宽松,银行间流动性在一段时间内仍较有保障。

由此我们预计19年债券收益率的方向仍是向下,但波动可能增加,尤其年初阶段,在信贷集中投放、专项债提前发行、债券市场净融资回暖等因素的共同作用下社融数据可能阶段性企稳回升,而地产产业链在短期内仍将表现出一定的韧性,叠加基建持续发力,经济数据和工业品价格均可能出现反复,使得收益率下行受阻。好在当前收益率曲线仍较为陡峭,长端仍有利差保护,大幅回调风险可控。而在高收益资产稀缺形成配置压力等因素的作用下,信用债19年预计仍将有较好的表现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了估值委员会,定期评价现行估值政策和程序,在发生了影响估值政策和程序有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。估值委员会由督察长、基金运营部负责人、合规稽核部负责人、权益投资部负责人、固定收益部负责人等组成。估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关从业资格,精通各自领域的理论知识,熟悉政策法规,并具有丰富的实践经验。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不介入基金日常估值业务。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中债金融估值中心有限公司签署了《中债信息产品服务协议》,本基金管理人与中证指数有限公司签署了《中证债券估值数据服务协议》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

2018年8月17日, 本基金进行了利润分配,A类每10份基金份额分红为0.44元,共计分配利润10,186,113.99元,C类每10份基金份额分红为0.42元,共计分配利润259.17元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期,本托管人复核的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

本基金2018 年年度财务会计报告已经立信会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了信会师报字[2019]第ZA30175号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资 产:		
银行存款	1,769,213.51	2,522,163.32
结算备付金	3,804,434.54	457,407.87
存出保证金	28,688.42	4,496.24
交易性金融资产	423,891,720.56	317,542,410.00
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	413,865,400.00	317,542,410.00
资产支持证券投资	10,026,320.56	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	1,946,486.87
应收利息	7,249,662.79	4,934,560.85
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	436,743,719.82	327,407,525.15
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	195,248,495.08	89,980,740.00
应付证券清算款	1,761,604.92	4,147,014.36
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	81,076.50	79,111.50
应付托管费	20,269.12	19,777.89
应付销售服务费	1.55	0.93
应付交易费用	19,889.07	9,638.65
应交税费	38,110.86	-
应付利息	130,477.41	62,025.44
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	205,000.00	122,500.00
负债合计	197,504,924.51	94,420,808.77
所有者权益:		
实收基金	232,315,947.48	231,508,759.73
未分配利润	6,922,847.83	1,477,956.65
所有者权益合计	239,238,795.31	232,986,716.38
负债和所有者权益总计	436,743,719.82	327,407,525.15

注:报告截止日2018年12月31日,万家安弘A基金份额净值1.0298元,基金份额总额232,307,897.60份;万家安弘C基金份额净值1.0292元,基金份额总额8,049.88份。万家安弘份额总额合计为232,315,947.48份。

7.2 利润表

会计主体:万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年8月18日(基金合同生效日)至2017年12月31日
一、收入	20,590,955.68	2,696,745.27
1.利息收入	14,287,103.05	4,202,333.58
其中:存款利息收入	52,665.31	523,801.27
债券利息收入	13,689,911.62	3,580,840.09
资产支持证券利息收入	374,422.56	-
买入返售金融资产收入	170,103.56	97,692.22
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	2,139,356.77	-371,590.00
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,169,465.27	-371,590.00
资产支持证券投资收益	-30,108.50	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	4,164,488.34	-1,133,998.31
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.52	-
减:二、费用	5,003,306.31	1,218,788.62
1. 管理人报酬	944,727.25	343,890.97
2. 托管费	236,181.80	85,972.74
3. 销售服务费	13.23	4.05
4. 交易费用	10,727.49	7,819.52
5. 利息支出	3,477,584.40	617,051.34
其中:卖出回购金融资产支出	3,477,584.40	617,051.34
6. 税金及附加	29,872.14	-
7. 其他费用	304,200.00	164,050.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	15,587,649.37	1,477,956.65
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	15,587,649.37	1,477,956.65

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	231,508,759.73	1,477,956.65	232,986,716.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	15,587,649.37	15,587,649.37
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	807,187.75	43,614.97	850,802.72
其中:1.基金申购款	50,698,576.73	340,962.93	51,039,539.66
2.基金赎回款	-49,891,388.98	-297,347.96	-50,188,736.94
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-10,186,373.16	-10,186,373.16
五、期末所有者权益(基金净值)	232,315,947.48	6,922,847.83	239,238,795.31
项目	上年度可比期间 2017年8月18日(基金合同生效日)至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	231,508,759.73	-	231,508,759.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,477,956.65	1,477,956.65
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	231,508,759.73	1,477,956.65	232,986,716.38

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

_____方一天_____ _____经晓云_____ _____陈广益_____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金(以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会") 证监许可[2016]2728号文《关于准予万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金注册的批复》的批准,由万家基金管理有限公司作为基金管理人于2017年5月16日至2017年8月15日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2017)验字第60778298_B17号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2017年8月18日生效,本基金为契约型、定期开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币231,505,959.29元,有效认购资金在募集期间内产生的利息为人民币2,800.44元,以上实收基金(本息)合计为人民币231,508,759.73元, 折合231,508,759.73份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为万家基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的国家债券、地方政府债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、可分离交易债券的纯债部分、资产支持证券、债券回购、同业存单和银行存款等资产以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不投资于股票、权证等资产,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;但因开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,在每个开放期前1个月、开放期及开放期结束后1个月的期间不受上述比例的限制;在开放期,本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券,不低于基金资产净值的5%,在封闭期内,本基金不受上述5%的限制。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制,以变更后的比例为准,本基金的投资比例会做相应调整。本基金的业绩比较基准为:中债综合指数收益率(全价)。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号(年度报告和半年度报告)》及其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2018年12月31日的财务状况以及2018年1月1日至2018年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致

7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1、印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自 2008 年 4 月 24 日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的 3‰调整为 1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自 2008 年 9 月 19 日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

2、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定,金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,管理人接受投资者委托或信托对受托资产提供的管理服务以及管理人发生的其他增值税应税行为,按照现行规定缴纳增值税,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为, 暂适用简易计税方法, 按照3%的征收率缴纳增值税。本通知自2018年1月1日起施行,对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

4、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对