万家天添宝货币市场基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:万家基金管理有限公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
送出日期:2018年8月28日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。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8月27日复核了本报告中的财务指标、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,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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	
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	
报告期末基金份额总额	2,855,741,392.85份	
基金合同存续期	不定期	
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

2.2 基金产品说明

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。

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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	胡坡
	联系电话	021-38909626	021-61618888
	电子邮箱	lanjj@wjasset.com	Hupo6@spdb.com.cn
客户服务电话		95618转6,4008880800	95528
传真		021-38909627	021-63602540

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.wjasset.com
基金半年度报告备置地点	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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

基金级别	万家天添宝A	万家天添宝B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	34,243,379.30	10,663,966.72
本期利润	34,243,379.30	10,663,966.72
本期净值收益率	2.1331%	2.2286%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末基金资产净值	2,332,695,868.99	523,045,523.86
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

注:1、本基金收益分配按日结转份额。

2、本基金无持有人申购、赎回的交易费用。

3、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。

4、本基金合同生效日为2017年7月28日,截止本报告期末本基金合同生效未满一年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

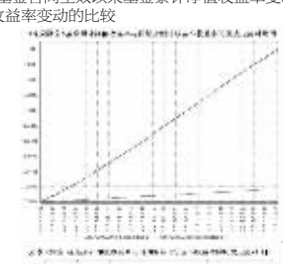
万家天添宝A

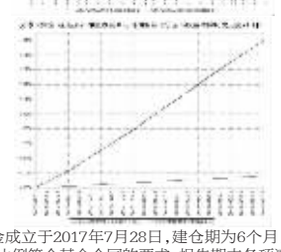
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3376%	0.0003%	0.0288%	0.0000%	0.3088%	0.0003%
过去三个月	1.0416%	0.0008%	0.0873%	0.0000%	0.9543%	0.0008%
过去六个月	2.1331%	0.0008%	0.1736%	0.0000%	1.9595%	0.0008%
自基金合同生效起至今	3.8262%	0.0014%	0.3241%	0.0000%	3.5021%	0.0014%

万家天添宝B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.3533%	0.0003%	0.0288%	0.0000%	0.3245%	0.0003%
过去三个月	1.0892%	0.0008%	0.0873%	0.0000%	1.0019%	0.0008%
过去六个月	2.2286%	0.0008%	0.1736%	0.0000%	2.0550%	0.0008%
自基金合同生效起至今	4.0083%	0.0013%	0.3241%	0.0000%	3.6842%	0.0013%

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6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,住所地址为中国(上海)自由贸易试验区浦电路360号8层(名义楼层9层),办公地址为中国(上海)自由贸易试验区浦电路360号8层(名义楼层9层),注册资本1亿元人民币。目前管理五十九只开放式基金,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)、万家中证创业成长指数分级证券投资基金、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、万家瑞旭灵活配置混合型证券投资基金、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、万家恒景18个月定期开放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、万家臻选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、万家裕债券型证券投资基金、万家成长优选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、万家家乐债券型证券投资基金、万家潜力价值灵活配置混合型证券投资基金、万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金和万家新机遇龙头企业灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)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、万家日日薪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、万家弘盛纯债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,先后担任固定收益投研助理、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、万家鑫瑞纯债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、万家鑫享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、万家瑞尧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》、《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 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年上半年国内宏观经济发展保持了稳定,上半年各项经济数据均显示经济仍然保持了平稳的增长势头。全球经济持续复苏,美国与世界各国发生贸易摩擦,对全球化和经济发展产生负面影响,对国内进出口形成一定压力,人民币汇率亦发生较大幅度波动,对贸易摩擦造成的压力形成一定缓冲,但是影响国内风险资产定价。地产销售受房地产调控政策影响,累计同比增速持续下滑,但是房地产开发投资增速仍然保持稳定。环保限产仍然贯穿2018年上半年,对以螺纹钢为首的大宗工业品价格形成支撑,企业盈利水平维持稳定。国内金融监管措施不断落地,银行表内贷款增速持续提高,信贷供给由表外非标融资转向表内信贷投放,社会融资整体变化符合监管政策引导方向。由此引发国内信用环境出现一定程度恶化,信用风险事件不断发生,叠加海外贸易摩擦对国内经济负面影响,央行采取降准和增量运作公开市场操作等措施对流动性提供支持,出台政策满足中小微企业和民营企业的融资需求,上半年国内流动性边际转松,整体好于预期。上半年国内债券收益率呈现先上后下的走势,整体利率中枢伴随短端流动性边际宽松有明显下降,但是信用债收益率水平受到信用风险时间和市场风险偏好影响表现分化,高评级信用债收益率伴随利率债下行,低评级信用债收益率保持较高水平,信用利差有所拉大。

4.4.2 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2.1331%,本报告期万家天添宝B的基金份额净值收益率为2.2286%,同期业绩比较基准收益率为0.1736%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

尽管国内经济面临一定压力,但是预计下半年宏观经济发展会继续保持稳定,国内宏观政策已经有一定程度放松迹象,对于经济发展形成强有力支撑。金融监管边际上有所缓和,政府出台宏观和微观政策支持信贷复苏和信用扩张,对金融监管和贸易争端带来的压力形成托底。未来需要关注流动性从金融机构进入实体经济的程度。监管机构对金融机构进行窗口指导,监管政策细则不断落地,对金融机构对未来如何合理合规的利用自身资源支持实体经济做出规范和指导。下半年监管和货币政策仍然在资管新规和宏观审慎框架下实施,"去杠杆"的政策主基调没有发生改变,短期内政策边际宽松的状态会持续,金融机构对于实体经济支持力度会逐步加大,影响市场的主要因素会从宏观政策逐步转向到经济基本面上来。海外各个经济体依然表现较好,世界主要经济体仍然处于货币政策回归正常化过程中,但是在贸易摩擦影响下,全球市场风险偏好会受到一定程度影响,海外市场债券收益率出现一定程度波动,对于国内市场亦会有拉动效应。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。

4.6 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

本基金每日计算分配收益,按日结转支付。本报告期内应分配利润44,907,346.02元,本报告期内本基金已分配利润44,907,346.02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

本报告期内,上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称"本托管人")在对万家天添宝货币市场基金的托管过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金监督管理办法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,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

本报告期内,本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金监督管理办法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,对万家天添宝货币市场基金的投资运作进行了监督,对基金资产净值的计算、基金收益的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内,由万家基金管理有限公司编制本托管人复核的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(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:万家天添宝货币市场基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	1,232,959,116.61	422,191,724.86
结算备付金	-	39,721.77
存出保证金	281.05	1,170.86
交易性金融资产	1,962,815,127.72	564,020,378.67
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,962,811,442.94	564,020,378.67
资产支持证券投资	20,003,684.78	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	152,000,428.00	133,986,920.98
应收证券清算款	-	-
应收利息	10,434,529.66	2,715,028.01
应收股利	-	-
应收申购款	3,562,840.56	9,764,253.90
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,381,772,323.60	1,132,719,199.05
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30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	524,558,827.92	125,893,247.08
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	577,825.80	183,946.90
应付托管费	115,565.16	36,789.36
应付销售服务费	388,252.50	107,699.44
应付交易费用	54,188.44	26,719.75
应交税费	2,260.27	-
应付利息	97,988.44	42,363.99
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	236,022.22	129,000.00
负债合计	526,030,930.75	126,419,766.52
所有者权益:		
实收基金	2,855,741,392.85	1,006,299,432.53
未分配利润	-	-
所有者权益合计	2,855,741,392.85	1,006,299,432.53
负债和所有者权益总计	3,381,772,323.60	1,132,719,199.05

注:报告截止日2018年6月30日,万家天添宝A基金份额净值1.0000元,基金份额总额2332695868.99份;万家天添宝B基金份额净值1.0000元,基金份额总额523045523.86份。万家天添宝份额总额合计为2855741392.85份。

6.2 利润表

会计主体:万家天添宝货币市场基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	52,579,422.42	-
1.利息收入	52,100,582.39	-
其中:存款利息收入	23,275,119.64	-
债券利息收入	22,487,313.19	-
资产支持证券利息收入	325,185.60	-
买入返售金融资产收入	6,012,963.96	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	478,840.03	-
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	478,840.03	-
资产支持证券投资收益	-	-
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.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-	-
减:二、费用	7,672,076.40	-
1. 管理人报酬	2,621,683.99	-
2. 托管费	524,336.79	-
3. 销售服务费	1,641,895.35	-
4. 交易费用	758.25	-
5. 利息支出	2,693,451.55	-
其中:卖出回购金融资产支出	2,693,451.55	-
6. 税金及附加	2,383.34	-
7. 其他费用	187,567.13	-
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	44,907,346.02	-
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	44,907,346.02	-

注:本基金于2017年7月28日成立,无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:万家天添宝货币市场基金

本报告期:2018年1月1日 至 2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30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)	1,006,299,432.53	-	1,006,299,432.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	44,907,346.02	44,907,346.02
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)	1,849,441,960.32	-	1,849,441,960.32
其中:1.基金申购款	7,466,032,067.67	-	7,466,032,067.67
2.基金赎回款	-5,616,590,107.35	-	-5,616,590,107.35
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)	-	-44,907,346.02	-44,907,346.02
五、期末所有者权益(基金净值)	2,855,741,392.85	-	2,855,741,392.85

注:本基金于2017年7月28日成立,无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

方一天 李杰 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

万家天添宝货币市场基金(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[2017]723号文《关于同意万家天添宝货币市场基金募集的批复》的核准,由基金管理人万家基金管理有限公司向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验资并出具验资报告,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2017年7月28日正式生效,本基金为契约型开放式,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225,009,370.00元,在募集期间未产生活期存款利息,以上实收基金(本息)合计为人民币225,009,370.00元,折合225,009,370.00份基金份额。本基金的基金管理人为万家基金管理有限公司,注册登记机构为万家基金管理有限公司,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金,期限在一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单,剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券,以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金在严格控制风险和保持资产流动性的前提下,追求基金资产的长期稳定增值,力争获得超过业绩比较基准的收益。本基金业绩比较基准:银行活期存款利率(税后)。

6.4.2 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。

6.4.3 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至2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

6.4.5 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。

6.4.6 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,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2015年9月8日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日,本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日,本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内,与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
万家共赢资产管理有限公司	基金管理人的子公司
上海万家朴智投资管理有限公司	基金管理人控制的公司

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.9.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中泰证券股份有限公司	25,066,624.05	100.00%	-	-

注:本基金于2017年7月28日成立,无上年度可比期间数据。

6.4.9.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中泰证券	12,510,000.00	100.00%	-	-

注:本基金于2017年7月28日成立,无上年度可比期间数据。

6.4.9.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金于2017年7月28日成立,无上年度可比期间数据。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。本基金于2017年7月28日成立,无上年度可比期间数据。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,621,683.99	-
其中:支付销售机构的客户维护费	765,916.03	-

注:1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。管理费的计算

方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等,支付日期顺延。

2、本基金于2017年7月28日成立,无上年度可比期间数据。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	524,336.79	-

注:1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.05%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取,若遇法定节假日、公休日或不可抗力等,支付日期顺延。

2、本基金于2017年7月28日成立,无上年度可比期间数据。

6.4.9.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家天添宝A	万家天添宝B	合计
万家基金管理有限公司	3,398.46	16,511.69	19,910.15
合计	3,398.46	16,511.69	19,910.15
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家天添宝A	万家天添宝B	合计
万家基金管理有限公司	3,398.46	16,511.69	19,910.15

注:1、本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.20%,对于由 B 类降级