

万家添利债券型证券投资基金(LOF) 2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 28 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人中国邮政储蓄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、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 | 万家添利 |
| 场内简称 | 万家添利 |
| 基金主代码 | 161908 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式（LOF） |
| 基金合同生效日 | 2011 年 6 月 2 日 |
| 基金管理人 | 万家基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国邮政储蓄银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 34,233,770.04 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2014 年 6 月 16 日 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 在严格控制投资风险的基础上,追求当期较高收入和投资总回报。 |
| 投资策略 | 本基金在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上,采取积极主动地投资管理策略,通过定性与定量分析,对利率变化趋势、债券收益率曲线移动方向、信用利差等影响债券价格的因素进行评估,对不同投资品种运用不同的投资策略,并充分利用市场的非有效性,把握各类套利的机会。在风险可控的前提下,充分发挥在封闭期内基金规模稳定的优势,寻求组合流动性与收益的最佳配比,实现基金收益的最大化。此外,本基金通过对首次发行(IPO)股票和增发新股的上市公司内在价值和一级市场申购收益率的全面分析,制定相应的新股申购策略,以获得较为安全的新股申购收益。 |
| 业绩比较基准 | 中国债券总指数 |
| 风险收益特征 | 本基金是债券型证券投资基金,属于具有中低风险收益特征的基金品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。 |

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 | 中国邮政储蓄银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 兰剑 |
| | 联系电话 | 021-38909626 |
| | 电子邮箱 | lanj@wjasset.com |
| | | 田东辉 |
| | | 010-68858113 |
| | | tiandonghui@psbc.com |

| | | |
|--------|----------------------|--------------|
| 客户服务电话 | 95538 转 6、4008880800 | 95580 |
| 传真 | 021-38909627 | 010-68858120 |

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 | 2016 年 |
|---------------|---------------|---------------|----------------|
| 本期已实现收益 | 644,473.02 | 2,416,014.47 | 37,383,480.71 |
| 本期利润 | 458,733.87 | 299,502.14 | 9,707,477.17 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0118 | 0.0048 | 0.0167 |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.45% | 0.57% | -0.27% |
| 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 | 0.0998 | 0.0958 | 0.0907 |
| 期末基金资产净值 | 30,801,880.17 | 51,931,775.71 | 101,019,148.11 |
| 期末基金份额净值 | 0.8998 | 0.8958 | 0.8907 |

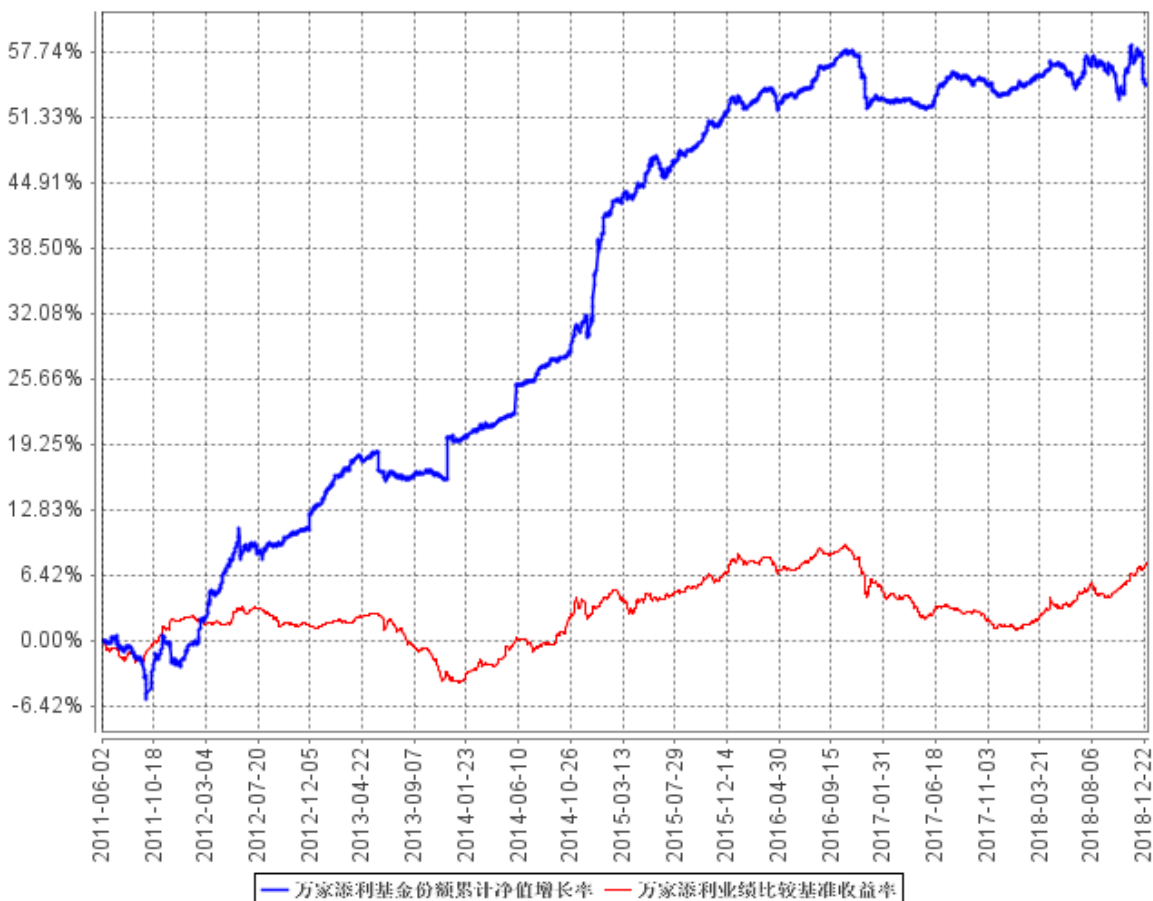
3.2 基金净值表现

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

| 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 | -1.14% | 0.29% | 2.91% | 0.09% | -4.05% | 0.20% |
| 过去六个月 | -0.23% | 0.24% | 3.08% | 0.10% | -3.31% | 0.14% |
| 过去一年 | 0.45% | 0.18% | 6.17% | 0.11% | -5.72% | 0.07% |
| 过去三年 | 0.75% | 0.12% | -0.19% | 0.11% | 0.94% | 0.01% |
| 过去五年 | 29.17% | 0.16% | 12.12% | 0.12% | 17.05% | 0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | 54.45% | 0.20% | 7.76% | 0.12% | 46.69% | 0.08% |

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

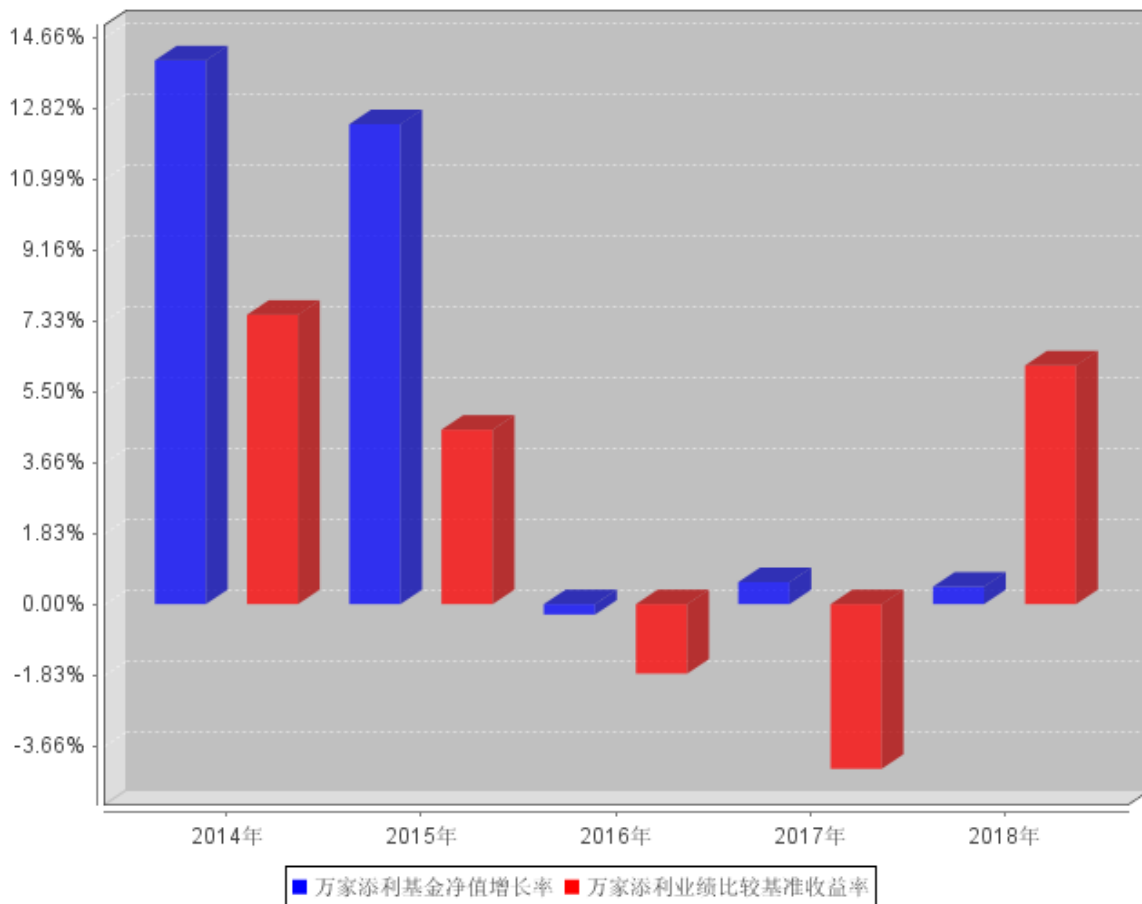
万家添利基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2011 年 6 月 2 日成立，根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。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。

3.2.3 过去五年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

万家添利过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 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 | - | - | - | - | |
| 2017 | - | - | - | - | |
| 2016 | 1.5000 | 413,452,407.91 | 1,879,907.78 | 415,332,315.69 | |
| 合计 | 1.5000 | 413,452,407.91 | 1,879,907.78 | 415,332,315.69 | |

§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、万家鑫璟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、万家中证1000指数增强型发起式证券投资基金、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、万家经济新动能混合型证券投资基金、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、万家新机遇龙头企业灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型证券投资基金、万家智造优势混合型证券投资基金以及万家稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金(FOF)。

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 | 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、万家鑫瑞纯债债券型 | 2017年6月5日 | - | 7.5年 | <p>上海财经大学金融学硕士。</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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。</p> <p>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。</p> |

| | | | | | |
|--|--------------------|--|--|--|--|
| | 证券投资 基金基金 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》、《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 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 年经济增长放缓，GDP 同比增长 6.6%，增速创下 20 年来最低水平。地产调控政策导致地产产业链熄火，地方政府化解隐性债务导致基建投资减速，贸易战导致外贸行业和高科技行业增速放缓。

消费品价格和大宗商品价格保持平稳，资产价格止涨启跌，通胀压力显著减小。央行货币政策态度趋松。通过降准、创设 TMLF、增加 MLF 投放量等多种渠道向市场投放流动性。市场资金利率水平显著下降，3m 存单高点从年初的 4.5 下降到年底的 3.5。

17 年以来的金融去杠杆，导致非标融资渠道萎缩。部分杠杆过高的企业出现经营困难，信用违约事件频发，市场风险偏好急剧下降。社会融资总量增速下滑，市场呈现宽货币紧信用局面，风险厌恶情绪上升。以利率债、高评级信用债和银行存单为代表的低风险资产价格上涨，收益率降至历史低位。以低评级信用债、股票为代表的高风险资产价格单边下降，信用利差高企，股票市盈率和市净率到达历史低位。

万家添利在 2018 年重点配置债性和平衡型可转债，采取分布加仓的策略，以较高集中度配置行业龙头个券转债，以较小集中度较多个数，配置高成长个股对应的转债，在年末达到了较高的杠杆水平。规避了信用风险和流动性风险的冲击。

4.4.2 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 0.8998 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.45%，业绩比较基准收益率为 6.17%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年，旧的增长引擎减速将继续拖累经济，地产调控政策难见松绑迹象，地方政府财政硬约束仍将持续，贸易保护主义的阴影将继续影响外贸增长。我们预计经济同步指标将继续下滑，市场对经济增长放缓的预期将逐一实现。

市场对经济增长的预期有望改善。在科创板施行注册制，将引导金融资源支持成长型企业，改变过去金融资源低效配置的局面。新一代通信技术、新能源发电和新能源汽车等一系列新技术将步入产业化应用阶段，提供新的经济增长动力。贸易战阶段性缓和将缓解资本市场对高科技行业过于悲观的预期。供给侧改革后，上游行业过剩产能化解，有助商品价格和工业企业盈利稳定。

通胀水平稳定，实际利率处于低位的情况下，央行进一步降低无风险利率的必要性下降。我们预计下一步货币政策的重点从宽货币转向宽信用。有核心竞争力、聚焦主业、诚信记录良好的实体企业融资环境将改善。社会融资总量增速将上升，信用利差将缩窄，信用债和权益类资产表现将好于利率债和高评级信用债。在见到实体经济复苏之前，无风险利率可能长期处于低位徘徊。

我们需要密切关注中美贸易谈判结果对市场预期产生的影响，如果能够达成贸易协议，将显著提升市场风险偏好情绪，为转债和股票市场带来较好交易机会。如果股票市场在短时间内出现大幅度上涨，将抬高无风险利率水平，对长久期利率债带来冲击。

在 2019 年我们将继续坚持以债性和平衡型可转债作为基本配置，加大对通信、新能源、化工、高端制造等行业成长个券的挖掘，灵活参与股性转债波段操作。

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

本报告期内本基金未进行利润分配。

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,自 1 月 3 日至 3 月 29 日基金资产净值连续 57 个工作日低于五千万元;自 4 月 10 日至 7 月 4 日基金资产净值连续 59 个工作日低于五千万元;自 7 月 10 日至 12 月 31 日基金资产净值连续 118 个工作日低于五千万元。我司已经将该基金情况向证监会报备并提出解决方案,目前我司正积极加强营销,力争扩大本基金规模。本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满两百人的情况。

§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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在万家添利债券型证券投资基金（LOF）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金本报告期内未进行利润分配。

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、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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审计，注册会计师签字出具了信会师报字[2019]第ZA30171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：万家添利债券型证券投资基金 (LOF)

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 | 71,663.11 | 443,329.09 |
| 结算备付金 | 828,259.15 | 1,192,329.64 |
| 存出保证金 | 9,802.62 | 6,297.15 |
| 交易性金融资产 | 40,946,068.57 | 30,785,622.90 |
| 其中：股票投资 | - | - |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 40,946,068.57 | 30,785,622.90 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | 13,000,124.50 |
| 应收证券清算款 | 4,046.40 | 1,008,767.12 |
| 应收利息 | 184,555.42 | 743,417.87 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | - | 7,010,513.38 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 42,044,395.27 | 54,190,401.65 |
| 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 | 9,300,000.00 | - |
| 应付证券清算款 | - | - |
| 应付赎回款 | 1,092.08 | 237,908.43 |
| 应付管理人报酬 | 18,653.37 | 28,074.28 |
| 应付托管费 | 5,329.51 | 8,021.21 |
| 应付销售服务费 | 1,332.39 | 14,037.13 |
| 应付交易费用 | 4.46 | 2,841.95 |
| 应交税费 | 1,720,469.95 | 1,719,548.02 |
| 应付利息 | 7,437.76 | - |

| | | |
|---------------|---------------|---------------|
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 188,195.58 | 248,194.92 |
| 负债合计 | 11,242,515.10 | 2,258,625.94 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 27,386,155.20 | 46,376,177.01 |
| 未分配利润 | 3,415,724.97 | 5,555,598.70 |
| 所有者权益合计 | 30,801,880.17 | 51,931,775.71 |
| 负债和所有者权益总计 | 42,044,395.27 | 54,190,401.65 |

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8998 元，基金份额总额 34,233,770.04 份。

7.2 利润表

会计主体：万家添利债券型证券投资基金 (LOF)

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 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |
|------------------------|---|--|
| 一、收入 | 1,168,992.46 | 1,321,289.05 |
| 1. 利息收入 | 1,101,319.06 | 2,556,223.15 |
| 其中：存款利息收入 | 16,385.51 | 63,439.21 |
| 债券利息收入 | 912,640.08 | 1,755,323.09 |
| 资产支持证券利息收入 | 116,917.90 | - |
| 买入返售金融资产收入 | 55,375.57 | 737,460.85 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | 233,338.16 | 874,377.11 |
| 其中：股票投资收益 | - | - |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 233,338.16 | 874,377.11 |
| 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） | -185,739.15 | -2,116,512.33 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 20,074.39 | 7,201.12 |
| 减：二、费用 | 710,258.59 | 1,021,786.91 |
| 1. 管理人报酬 | 246,616.68 | 395,037.50 |
| 2. 托管费 | 70,462.03 | 112,867.83 |
| 3. 销售服务费 | 70,166.63 | 197,518.75 |
| 4. 交易费用 | 1,693.41 | 3,486.73 |

| | | |
|---------------------|------------|------------|
| 5. 利息支出 | 99,466.11 | 5,476.10 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 99,466.11 | 5,476.10 |
| 6. 税金及附加 | 2,653.73 | - |
| 7. 其他费用 | 219,200.00 | 307,400.00 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 458,733.87 | 299,502.14 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 458,733.87 | 299,502.14 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家添利债券型证券投资基金 (LOF)

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） | 46,376,177.01 | 5,555,598.70 | 51,931,775.71 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 458,733.87 | 458,733.87 |
| 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） | -18,990,021.81 | -2,598,607.60 | -21,588,629.41 |
| 其中：1. 基金申购款 | 38,633,360.62 | 4,964,856.60 | 43,598,217.22 |
| 2. 基金赎回款 | -57,623,382.43 | -7,563,464.20 | -65,186,846.63 |
| 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） | 27,386,155.20 | 3,415,724.97 | 30,801,880.17 |
| 项目 | 上年度可比期间 2017 年 1 月 1 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 | 90,735,315.71 | 10,283,832.40 | 101,019,148.11 |

| | | | |
|--|----------------|---------------|----------------|
| 金净值) | | | |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 299,502.14 | 299,502.14 |
| 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) | -44,359,138.70 | -5,027,735.84 | -49,386,874.54 |
| 其中: 1. 基金申购款 | 39,958,184.86 | 4,881,471.49 | 44,839,656.35 |
| 2. 基金赎回款 | -84,317,323.56 | -9,909,207.33 | -94,226,530.89 |
| 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) | 46,376,177.01 | 5,555,598.70 | 51,931,775.71 |

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

万家添利债券型证券投资基金(LOF)(原“万家添利分级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[2011]242号文《关于核准万家添利分级债券型证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人万家基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行业募集,基金合同于2011年6月2日正式生效,首次设立募集规模为2,635,617,840.86份基金份额。根据《万家添利分级债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,万家添利分级债券型证券投资基金基金合同生效后3年期届满,无需召开基金份额持有人大会,即转换为上市开放式基金(LOF),基金名称变更为“万家添利债券型证券投资基金(LOF)”。万家基金管理有限公司于2014年6月5日发布《万家添利分级债券型证券投资基金基金份额转换结果公告》,投资者认购、申购或通过上市交易购买并持有到期的每一份稳健收益级基金份额(基金份额简称“万家利A”)和积极收益级基金份额(基金份额简称“万家利B”),在基金合同生效之日起3年届满日(即2014年6月3日),将按照基金合同约定的资产及收益的计算规则分别计算万家利A和万家利B的基金份额净值,并以各自的份额净值为基础,转换为万家添利债券型证券投资基金(LOF)的基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。基金份额在深圳交易所

上市交易。本基金的基金管理人为万家基金管理有限公司，基金注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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）。本基金主要投资于国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、短期融资券、资产证券化产品、可转换债券、可分离债券和回购等金融工具以及法律法规获中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种。本基金把握价值发现过程，谋求价值最优实现。以价值分析为基础，通过管理实现基金资产可持续的稳定增值。本基金的业绩比较基准为中国债券总指数。

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 年度的经营成果和净值变动情况。

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。

7.4.7 关联方关系

| 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 |
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司（“邮储银行”） | 基金托管人、基金代销机构 |

| | |
|--------------------|------------------|
| 中泰证券股份有限公司（“中泰证券”） | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 山东省国有资产投资控股有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 新疆国际实业股份有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 万家共赢资产管理有限公司 | 基金管理人的子公司 |
| 万家财富基金销售（天津）有限公司 | 基金管理人的子公司、基金销售机构 |
| 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 1、报告期后，经中国证券监督管理委员会证监许可[2019]126 号文核准，基金管理人原股东山东省国有资产投资控股有限公司将其持有的基金管理人的 11% 股权转让给齐河众鑫投资有限公司。本次股权变更的工商变更登记手续已办理完毕，基金管理人于报告期后 2019 年 2 月 13 日发布了《关于公司股权变更的公告》，公司股东由山东省国有资产投资控股有限公司变更为齐河众鑫投资有限公司。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 246,616.68 | 395,037.50 |

| | | |
|-----------------|-----------|------------|
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 85,627.43 | 108,041.10 |
|-----------------|-----------|------------|

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.70% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核无误后于次月首日起 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------------------|----------------------------------|
| | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 70,462.03 | 112,867.83 |

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核无误后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费各关联方名称 | 本期 |
|---------------|----------------------------------|
| | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |
| 万家基金管理有限公司 | 15,910.38 |
| 邮储银行股份有限公司 | 34,438.69 |

| | |
|-------------------|----------------------------------|
| 中泰证券股份有限公司 | 2,227.20 |
| 合计 | 52,576.27 |
| 获得销售服务费 各关联方名称 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日 |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |
| 万家基金管理有限公司 | 80,685.65 |
| 邮储银行股份有限公司 | 73,303.24 |
| 中泰证券股份有限公司 | 3,402.40 |
| 合计 | 157,391.29 |

注：基金销售服务费用用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.05% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日基金资产净值

基金销售服务费自基金合同生效之日起每日计提，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销售服务费划付指令，基金托管人复核无误后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人支付给各代销机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2018年12月31日 | | 上年度末 2017年12月31日 | |
|----------------------|--------------------|----------------------------------|---------------------|----------------------------------|
| | 持有的 基金份额 | 持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例 | 持有的 基金份额 | 持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例 |
| 万家 共赢 资产 管理 | 5,627,217.66 | 16.4400% | 5,627,217.66 | 9.7100% |

| | | | | |
|---------|--|--|--|--|
| 有 限 公 司 | | | | |
|---------|--|--|--|--|

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | |
|----------------|--|----------|---|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | 71,663.11 | 8,273.23 | 443,329.09 | 13,277.57 |

注：本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2018 年度获得的利息收入为人民币 7,854.63 元（2017 年度：人民币 10,986.46 元），2018 年末结算备付金余额为人民币 828,259.15 元（2017 年末：人民币 1,192,329.64 元）。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

7.4.9 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 9,300,000.00 元于 2019 年 1 月 3 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.1.2 持续的以公允价值计量的金融工具

(1) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 40,946,068.57 元，无属于第一、第三层次的余额（2017 年 12 月 31 日：属于第二层次的余额为 30,785,622.90 元，无属于第一、第三层次的余额）。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(3) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具本期末和年度末均未以第三层次公允价值计量。

7.4.14.1.3 非持续的以公允价值计量的金融工具

本基金本期及上年度可比期间未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.1.4 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.14.2 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 40,946,068.57 | 97.39 |
| | 其中：债券 | 40,946,068.57 | 97.39 |
| | 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 | 899,922.26 | 2.14 |
| 8 | 其他各项资产 | 198,404.44 | 0.47 |
| 9 | 合计 | 42,044,395.27 | 100.00 |

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

8.2.2 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股票。

8.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内无累计买入价值超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内无累计卖出价值超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内无股票交易。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 1,607,240.90 | 5.22 |
| | 其中：政策性金融债 | 1,607,240.90 | 5.22 |
| 4 | 企业债券 | 1,439,727.00 | 4.67 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 37,899,100.67 | 123.04 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 40,946,068.57 | 132.93 |

8.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1 | 132012 | 17 巨化 EB | 27,370 | 2,652,974.10 | 8.61 |
| 2 | 132006 | 16 皖新 EB | 18,000 | 1,843,380.00 | 5.98 |
| 3 | 132008 | 17 山高 EB | 16,890 | 1,661,976.00 | 5.40 |
| 4 | 132015 | 18 中油 EB | 16,790 | 1,641,558.30 | 5.33 |
| 5 | 132007 | 16 凤凰 EB | 17,000 | 1,637,100.00 | 5.31 |

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序前十名资产支持证券投资明细

本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同, 本基金暂不可投资于国债期货。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据基金合同, 本基金暂不可投资国债期货。

8.10.3 本期国债期货投资评价

根据基金合同，本基金暂不可投资国债期货。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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。

8.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 9,802.62 |
| 2 | 应收证券清算款 | 4,046.40 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 184,555.42 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 198,404.44 |

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------------|--------------|
| 1 | 132012 | 17 巨化 EB | 2,652,974.10 | 8.61 |
| 2 | 132006 | 16 皖新 EB | 1,843,380.00 | 5.98 |
| 3 | 132008 | 17 山高 EB | 1,661,976.00 | 5.40 |
| 4 | 132007 | 16 凤凰 EB | 1,637,100.00 | 5.31 |
| 5 | 113015 | 隆基转债 | 1,562,245.00 | 5.07 |
| 6 | 127006 | 敖东转债 | 1,559,054.36 | 5.06 |
| 7 | 128028 | 赣锋转债 | 1,554,695.10 | 5.05 |
| 8 | 113017 | 吉视转债 | 1,551,288.60 | 5.04 |
| 9 | 132013 | 17 宝武 EB | 1,519,596.00 | 4.93 |
| 10 | 132011 | 17 浙报 EB | 1,498,029.00 | 4.86 |
| 11 | 128019 | 久立转 2 | 1,336,666.80 | 4.34 |
| 12 | 113012 | 骆驼转债 | 1,317,540.00 | 4.28 |

| | | | | |
|----|--------|----------|--------------|------|
| 13 | 113014 | 林洋转债 | 1,283,453.60 | 4.17 |
| 14 | 110043 | 无锡转债 | 1,246,262.60 | 4.05 |
| 15 | 113019 | 玲珑转债 | 1,215,890.00 | 3.95 |
| 16 | 110040 | 生益转债 | 1,037,836.80 | 3.37 |
| 17 | 128017 | 金禾转债 | 890,855.76 | 2.89 |
| 18 | 128029 | 太阳转债 | 834,482.84 | 2.71 |
| 19 | 113009 | 广汽转债 | 826,526.40 | 2.68 |
| 20 | 128018 | 时达转债 | 618,061.60 | 2.01 |
| 21 | 132009 | 17 中油 EB | 578,534.60 | 1.88 |
| 22 | 123009 | 星源转债 | 524,282.96 | 1.70 |
| 23 | 132005 | 15 国资 EB | 475,948.00 | 1.55 |
| 24 | 128030 | 天康转债 | 345,262.83 | 1.12 |
| 25 | 128020 | 水晶转债 | 311,406.00 | 1.01 |
| 26 | 113008 | 电气转债 | 310,918.40 | 1.01 |
| 27 | 127004 | 模塑转债 | 284,638.40 | 0.92 |
| 28 | 128035 | 大族转债 | 250,107.26 | 0.81 |
| 29 | 128023 | 亚太转债 | 248,329.62 | 0.81 |
| 30 | 128027 | 崇达转债 | 157,785.00 | 0.51 |
| 31 | 128016 | 雨虹转债 | 148,500.00 | 0.48 |
| 32 | 113013 | 国君转债 | 105,080.00 | 0.34 |
| 33 | 113504 | 艾华转债 | 104,000.00 | 0.34 |
| 34 | 127005 | 长证转债 | 92,467.80 | 0.30 |
| 35 | 128033 | 迪龙转债 | 88,642.00 | 0.29 |
| 36 | 110031 | 航信转债 | 52,840.00 | 0.17 |
| 37 | 132010 | 17 桐昆 EB | 49,025.00 | 0.16 |
| 38 | 128032 | 双环转债 | 46,436.07 | 0.15 |
| 39 | 128022 | 众信转债 | 43,645.14 | 0.14 |
| 40 | 110041 | 蒙电转债 | 24,830.00 | 0.08 |
| 41 | 123007 | 道氏转债 | 6,405.20 | 0.02 |
| 42 | 128034 | 江银转债 | 979.30 | 0.00 |

8.11.5 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不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|--------------|------------|---------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
| 2,809 | 12,187.17 | 7,220,456.47 | 21.09% | 27,013,313.57 | 78.91% |

9.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额 比例 |
|----|---------------------------------------|--------------|--------------|
| 1 | 中国农业银行股份有限公司 企业年金计划—中国银行股 份有限公司 | 1,465,110.00 | 50.72% |
| 2 | 林深 | 238,835.00 | 8.27% |
| 3 | 包成栋 | 197,874.00 | 6.85% |
| 4 | 戚既中 | 166,315.00 | 5.76% |
| 5 | 山东圣德宝玉雕有限公司 | 127,862.00 | 4.43% |
| 6 | 丁存花 | 66,486.00 | 2.30% |
| 7 | 邓美丹 | 65,067.00 | 2.52% |
| 8 | 张华育 | 38,367.00 | 1.33% |
| 9 | 宋震宇 | 38,362.00 | 1.33% |
| 10 | 沈莉 | 38,356.00 | 1.33% |

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|----------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员 持有本基金 | 54,902.82 | 0.1604% |

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0~10 |

§10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2011年6月2日）基金份额总额 | 2,635,617,840.86 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 57,971,112.24 |
| 本报告期期间基金总申购份额 | 48,293,184.05 |
| 减:本报告期期间基金总赎回份额 | 72,030,526.25 |
| 本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 34,233,770.04 |

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

副总经理变更：2018 年 10 月 8 日，本公司发布公告，聘任沈芳为万家基金管理有限公司副总经理。

基金托管人：

报告期内无涉及基金托管人的重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期期为基金进行审计的会计师事务所未发生变更。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 东方证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|----------------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 东方证券 | 128,646,019.30 | 100.00% | 1,008,300,000.00 | 100.00% | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |

注：1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范, 内控制度健全, 在业内有良好的声誉;
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设施满足基金进行证券交易的需要;
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平, 包括但不限于: 有较好的研究能力和行业分析能力, 能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务; 能根据公司所管理基金的特定要求, 提供专门研究报告, 具有开发量化投资组合模型的能力; 能积极为公司投资业务的开展, 投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构;
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

3、报告期内基金租用证券公司交易单元的变更情况：

无。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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 |
| 个人 | 1 | 20180329-20180329, 20180410-20180411 | 0.00 | 11,044,842.06 | 11,044,842.06 | 0.00 | 0.00% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>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。</p> <p>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。</p> | | | | | | | |

万家基金管理有限公司

2019 年 3 月 28 日