万家天添宝货币市场基金
2018 年年度报告

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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 28 日

§1 重要提示及目录

1.1 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 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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....2
1.1 重要提示.....2
1.2 目录.....3
§2 基金简介.....5
2.1 基金基本情况.....5
2.2 基金产品说明.....5
2.3 基金管理人和基金托管人.....5
2.4 信息披露方式.....6
2.5 其他相关资料.....6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....7
3.1 主要会计数据和财务指标.....7
3.2 基金净值表现.....7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....11
§4 管理人报告.....12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....14
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.....15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....18
4.9 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.....18
§5 托管人报告.....19
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....19
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.....19
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.....19
§6 审计报告.....20
6.1 审计报告基本信息.....20
6.2 审计报告的基本内容.....20
§7 年度财务报表.....23
7.1 资产负债表.....23
7.2 利润表.....24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....25
7.4 报表附注.....26
§8 投资组合报告.....53
8.1 期末基金资产组合情况.....53
8.2 债券回购融资情况.....53
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....53
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....54
8.6 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.....55
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....55

8.8 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.....56
8.9 投资组合报告附注.....56
§9 基金份额持有人信息.....57
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....57
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....57
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....57
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.....58
§10 开放式基金份额变动.....59
§11 重大事件揭示.....60
11.1 基金份额持有人大会决议.....60
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.....60
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....60
11.4 基金投资策略的改变.....60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....60
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.....60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....61
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....61
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....62
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.....62
§13 备查文件目录.....63
13.1 备查文件目录.....63
13.2 存放地点.....63
13.3 查阅方式.....63

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家天添宝货币市场基金	
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	3,617,177,636.09 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	3,075,159,987.36 份	542,017,648.73 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	胡波
	联系电话	021-38909626	021-61618888
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		95538 转 6、4008880800	95528
传真		021-38909627	021-63602540
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	上海市中山东一路 12 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义	上海市北京东路 689 号

	楼层 9 层）	
邮政编码	200122	200001
法定代表人	方一天	高国富

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市南京东路 61 号新黄浦金融大厦 4 楼
注册登记机构	万家基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）

§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 7 月 28 日(基金合同生效日)-2017 年 12 月 31 日	
	万家天添宝 A	万家天添宝 B	万家天添宝 A	万家天添宝 B
本期已实现收益	85,396,760.36	20,819,819.47	4,908,136.06	4,426,585.70
本期利润	85,396,760.36	20,819,819.47	4,908,136.06	4,426,585.70
本期净值收益率	3.9277%	4.1244%	1.6577%	1.7409%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末		2017 年末	
期末基金资产净值	3,075,159,987.36	542,017,648.73	545,329,830.64	460,969,601.89
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2018 年末		2017 年末	
累计净值收益率	5.6506%	5.9372%	1.6577%	1.7409%

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。

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

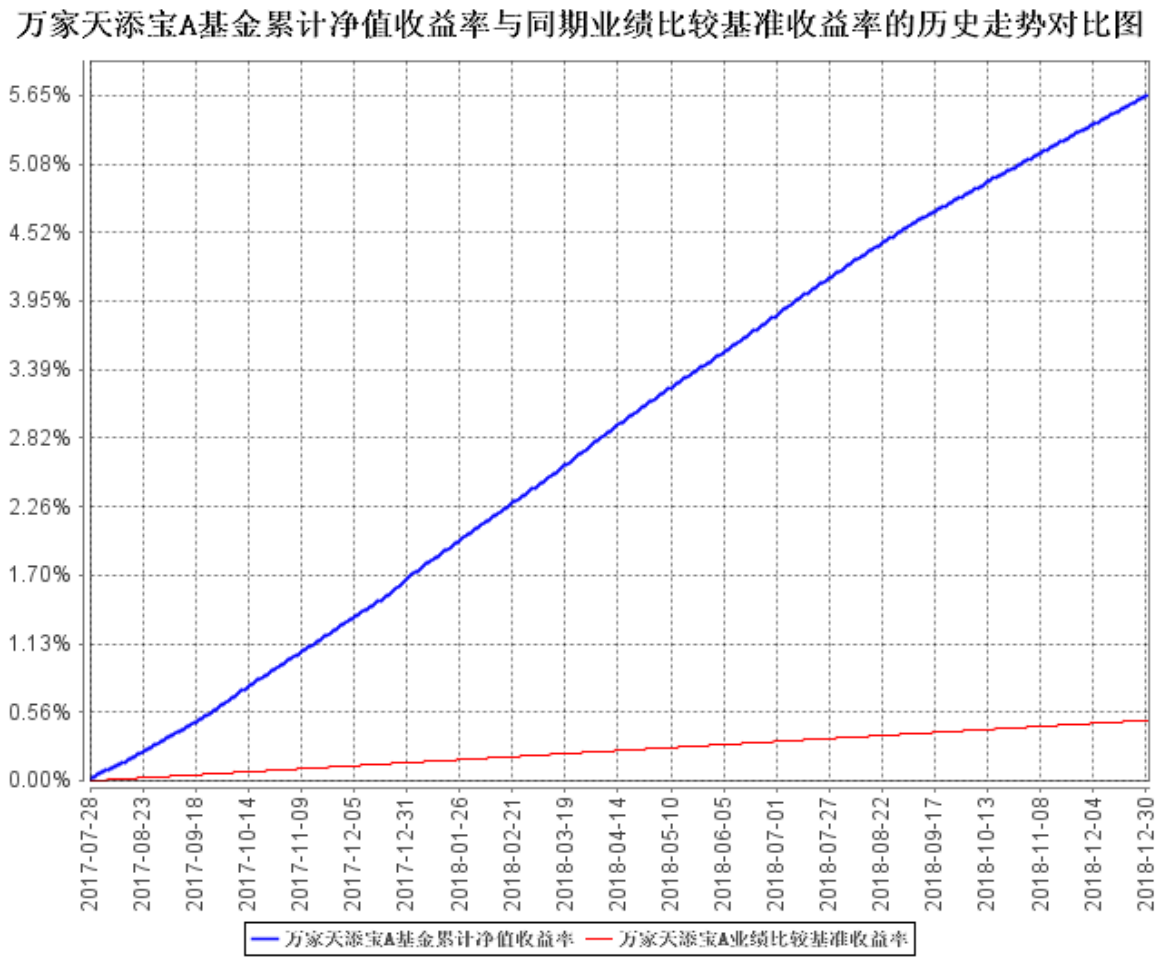
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.7987%	0.0008%	0.0882%	0.0000%	0.7105%	0.0008%

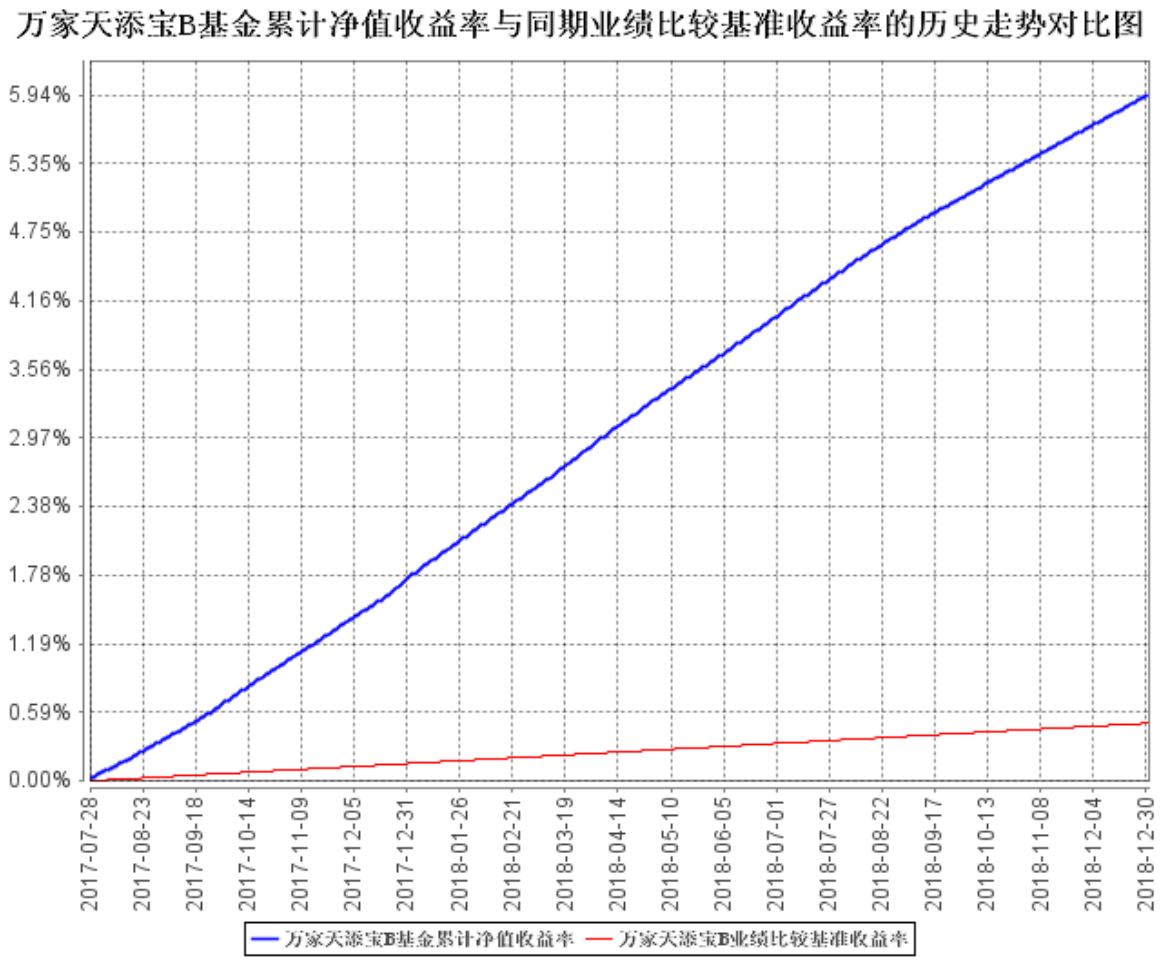
过去六个月	1.7571%	0.0013%	0.1764%	0.0000%	1.5807%	0.0013%
过去一年	3.9277%	0.0015%	0.3500%	0.0000%	3.5777%	0.0015%
自基金合同生效起至今	5.6506%	0.0015%	0.5005%	0.0000%	5.1501%	0.0015%

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
过去三个月	0.8469%	0.0008%	0.0882%	0.0000%	0.7587%	0.0008%
过去六个月	1.8545%	0.0013%	0.1764%	0.0000%	1.6781%	0.0013%
过去一年	4.1244%	0.0015%	0.3500%	0.0000%	3.7744%	0.0015%
自基金合同生效起至今	5.9372%	0.0015%	0.5005%	0.0000%	5.4367%	0.0015%

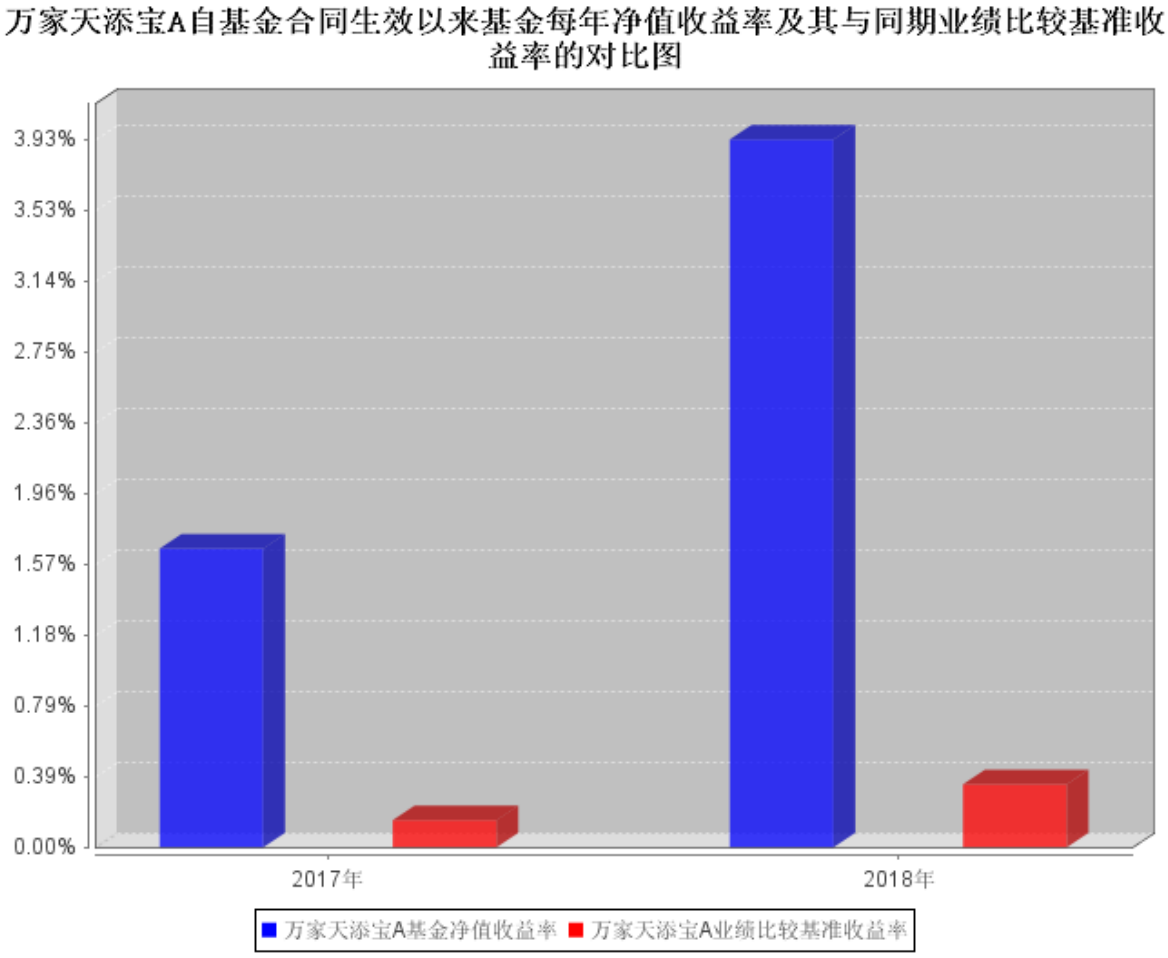
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

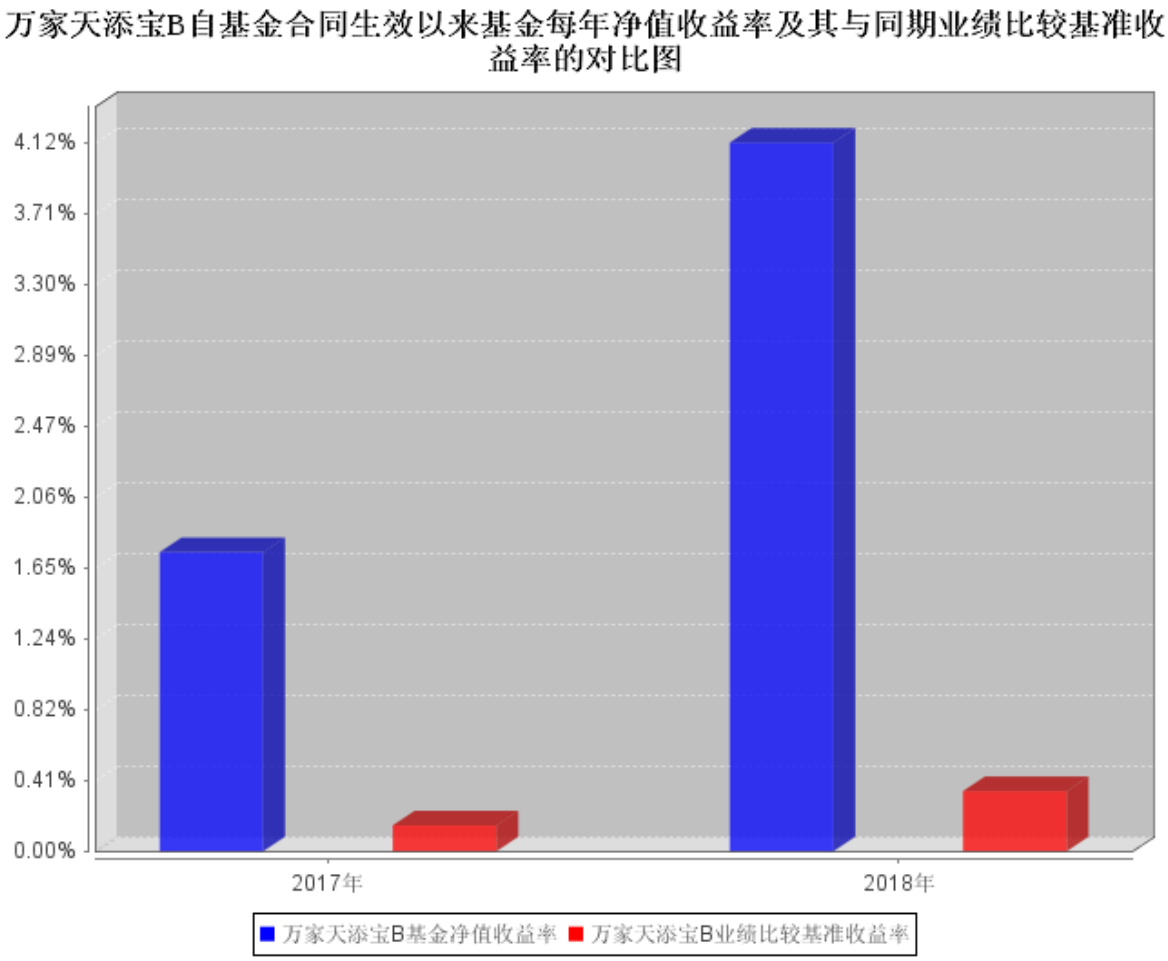




注：本基金成立于 2017 年 7 月 28 日，建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的要求。报告期末各项资产配置比例符合基金合同要求。

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

万家天添宝 A					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2018	85,396,760.36	-	-	85,396,760.36	
2017	4,908,136.06	-	-	4,908,136.06	
合计	90,304,896.42	-	-	90,304,896.42	

单位：人民币元

万家天添宝 B					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2018	20,819,819.47	-	-	20,819,819.47	
2017	4,426,585.70	-	-	4,426,585.70	
合计	25,246,405.17	-	-	25,246,405.17	

§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证券投资基金基金经理	2017 年 9 月 28 日	-	7.5 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	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。

注：1、任职日期以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券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未发现违反公平交易的行为。

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依然表现出一定程度的韧性，总体好于预期，但是整体来说较 2017 年有一定程度下滑，因此央行在年初逐渐转变稳健中性的货币政策向偏宽松的货币政策，并

且采取定向降准、全面降准等措施稳定流动性预期支持实体经济。2018 年美国经济依然向好，美股有良好表现，美联储连续加息，美国发动的贸易争端贯穿全年并且持续发酵。受到贸易摩擦预期影响，PMI 有一定程度下行，进出口行业受到明显影响，民营企业风险事件频发，社会融资规模下行较为明显，非标融资规模受制于监管政策影响持续下行，企业投资意愿减弱，信用市场受到破坏，社会消费增速亦有一定程度下滑，2018 年下半年市场和实体经济对未来宏观经济预期均明显悲观。宏观政策为支持实体经济发展在三、四季度有明显掉头迹象，去杠杆政策由紧转松，中央多部委出台民营企业支持政策，央行继续降准支持实体经济流动性，降低企业融资成本，银保监会亦指引银行类金融机构对民营企业提供支持，信用基本面在下半年有一定程度好转。2018 年货币市场收益率呈现明显的趋势性下降，整体货币市场资产收益率下行幅度明显，季度末关键时点呈现结构性紧张，但是流动性整体偏宽松，货币基金收益率亦呈现趋势性下行。因此本基金在组合投资上首先是重视关键时间点到期资产的配置，提高组合到期收益率的同时，增加组合在关键时点能够提供的流动性，同时可以获得较好的再投资收益。其次重视杠杆收益，2018 年货币市场资产期限利差较大，因此本基金更加注重杠杆策略，将杠杆保持在一个中性偏高的水平。最后结合宏观政策判断，2018 年经济下滑压力较大，央行货币政策转向明显，因此组合尽量保持一个中性偏高的剩余期限，利用陡峭化的收益率曲线获得较好的收益，利用骑乘效应积累一定的偏离度。

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 3.9277%，本报告期万家天添宝 B 的基金份额净值收益率为 4.1244%，同期业绩比较基准收益率为 0.3500%。

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 年是建国 70 周年，对于中国经济发展是非常关键的一年。从内部来看，去杠杆防风险仍然有指导意义，但是整体来说宏观杠杆率已经被资管新规、流动性新规等监管制度束缚，整体来说去杠杆已经取得阶段性成功。特朗普很快面临连任选举，中美双方在贯穿 2018 年全年的中美贸易摩擦这一事件中均有动机敲定协议，2019 年会有令双方满意的谈判成果。央行继续维持稳健偏宽松的货币政策，配合财政部增量发行地方债，2019 年是中央政府加杠杆的一年，预计基建等行业会作为支持经济的政策有明显起色。在吸取前次教训之后，中央不再实施大水漫灌的政策，中央采取滴灌措施，对不同行业实行不同的支持政策。房地产限购限贷依然继续进行，汽车和家电行业销量下滑，中央预计会出台补贴支持相关需求。除此以外，科创板亦是 2019 年资本市场的重头戏，推进科创板、试点注册制是金融企业支持实体经济和科技创新的重要推手。整体来说，债券市场收益率经过 2018 年一年的下行，目前绝对水平已经位于历史较低水平，需要关注未来贸

易摩擦结束后国内经济企稳回升和通胀企稳为债券市场带来的压力。流动性方面，预计 2019 年整体流动性会继续维持宽松状态，但是要持续观察信贷、经济增长数据和金融套利情况，今年有可能是央行货币政策转向的一年。本基金将持续密切关注市场变动，捕捉市场机会，同时做好流动性管理和信用风险防范，为持有人获取较好的投资回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内,基金管理人为防范和化解经营风险,确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整,主要做了以下工作:

（一）加强风控文化建设

不断梳理和优化制度流程、防范操作风险、加强对员工的合规培训和加深员工对合规风控工作的理解，确保公司各项业务合法合规。

（二）制度流程建设

为加强内控管理，保证公司各项制度流程的有效性、及时性、完备性，本年度对投资、销售、专户业务相关的制度流程及后台部门相关制度进行了修订；

（三）定期和临时稽核工作

报告期内，监察稽核部门按计划完成了各项定期稽核和专项稽核，检查内容覆盖公司各业务部门和业务环节，检查完成后出具监察稽核报告和建议书，并对整改情况进行跟踪。

（四）绩效评估和风险管理工作

报告期内,进一步完善了每日风险监控工作;改进基金业绩评价工作,辅助基金经理投资决策,提供风险评估意见等；针对由于市场流动性紧张的情况，加大了对固定收益产品的风险管理，防范资金交收风险。

（五）员工行为管理与防控内幕交易

报告期内，公司进一步完善防控内幕交易制度和从业人员投资申报等制度，强化员工行为管理工作，防范内幕交易和利益输送。

4.7 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》。

4.8 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 106,216,579.83 元，本报告期内本基金已分配利润 106,216,579.83 元。

4.9 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

本基金本报告期内未发生连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万的情况。

§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，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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	信会师报字[2019]第 ZA30174 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	万家天添宝货币市场基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了万家天添宝货币市场基金（以下简称“万家天添宝”）财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、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编制，公允反映了万家天添宝 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。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于万家天添宝，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
管理层和治理层对财务报表的责任	万家天添宝的基金管理人万家基金管理有限公司管理层（以下简称管理层）负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")、中国证券投资基金业协会(以下简称"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编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估万家天添宝的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保

	证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对万家天添宝持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致万家天添宝不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与管理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	王斌	徐冬
会计师事务所的地址	中国 上海	

审计报告日期	2019 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	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	7.4.7.1	2,297,321,716.88	422,191,724.86
结算备付金		4,020,040.91	39,721.77
存出保证金		-	1,170.86
交易性金融资产	7.4.7.2	1,638,996,477.02	564,020,378.67
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,608,996,477.02	564,020,378.67
资产支持证券投资		30,000,000.00	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	300,000,350.00	133,986,920.98
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	24,282,263.47	2,715,028.01
应收股利		-	-
应收申购款		11,008,595.63	9,764,253.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		4,275,629,443.91	1,132,719,199.05
负债和所有者权益	**附注号**	**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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		656,022,295.96	125,893,247.08
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		799,089.76	183,946.90
应付托管费		159,817.94	36,789.36
应付销售服务费		550,950.22	107,699.44
应付交易费用	7.4.7.7	47,636.98	26,719.75
应交税费		3,064.22	-
应付利息		679,952.74	42,363.99

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	189,000.00	129,000.00
负债合计		658,451,807.82	126,419,766.52
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	3,617,177,636.09	1,006,299,432.53
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		3,617,177,636.09	1,006,299,432.53
负债和所有者权益总计		4,275,629,443.91	1,132,719,199.05

注：1、报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 3,617,177,636.09 份，其中下属 A 类基金的 3,075,159,987.36 份；下属 B 类基金的份额总额 542,017,648.73 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 7 月 28 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		127,296,182.47	10,727,439.79
1.利息收入		126,330,033.43	10,700,551.38
其中：存款利息收入	7.4.7.11	58,460,132.13	3,832,369.93
债券利息收入		54,101,102.29	3,890,516.10
资产支持证券利息收入		1,159,203.04	-
买入返售金融资产收入		12,609,595.97	2,977,665.35
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		966,149.04	26,888.41
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	966,149.04	26,888.41
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
减：二、费用		21,079,602.64	1,392,718.03
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	7,031,724.70	571,771.15

2．托管费	7.4.10.2.2	1,406,344.96	114,354.24
3．销售服务费	7.4.10.2.3	4,642,369.52	249,795.09
4．交易费用	7.4.7.19	1,322.38	-
5．利息支出		7,631,709.74	247,718.34
其中：卖出回购金融资产支出		7,631,709.74	247,718.34
6．税金及附加		5,135.54	-
7．其他费用	7.4.7.20	360,995.80	209,079.21
三、利润总额 （亏损总额以“-”号填列）		106,216,579.83	9,334,721.76
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		106,216,579.83	9,334,721.76

7.3 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 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）	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）	-	106,216,579.83	106,216,579.83
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）	2,610,878,203.56	-	2,610,878,203.56
其中：1.基金申购款	14,685,694,486.50	-	14,685,694,486.50
2.基金赎回款	-12,074,816,282.94	-	-12,074,816,282.94
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）	-	-106,216,579.83	-106,216,579.83
五、期末所有者权益（基金净值）	3,617,177,636.09	-	3,617,177,636.09
项目	**上年度可比期间 2017 年 7 月 28 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）	225,009,370.00	-	225,009,370.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,334,721.76	9,334,721.76
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）	781,290,062.53	-	781,290,062.53
其中：1.基金申购款	2,722,525,075.16	-	2,722,525,075.16
2.基金赎回款	-1,941,235,012.63	-	-1,941,235,012.63
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）	-	-9,334,721.76	-9,334,721.76
五、期末所有者权益（基金净值）	1,006,299,432.53	-	1,006,299,432.53

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后，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）。

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《关于进一步规范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至 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 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

本基金的金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债的分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为：以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资按票面利率或协议利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内

摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者（3）该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允

地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（2）不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

（3）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1）具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2）交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与帐面已确认的利息收入的差额确认利息收入损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列

示。另外，根据中国证监会基金部通知(2006)22 号文《关于货币市场基金提前支取定期存款有关问题的通知》的规定，因提前支取导致的利息损失由基金管理公司承担；

(2) 债券利息收入按实际持有期内逐日计提。附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

(3) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(4) 债券投资收益于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账；

(5) 资产支持证券投资收益于卖出资产支持证券成交日确认，并按卖出资产支持证券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账；

(6) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.9 费用的确认和计量

(1)基金管理费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提；

(2)基金托管费按前一日基金资产净值的 0.05%的年费率逐日计提；

(3) 基金销售服务费按前一日的基金资产净值的年费率逐日计提；其中 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.20%，B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%。

(4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响每万份基金净收益小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

(1)本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；

(2)本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

(3)“每日分配、按日支付”。本基金根据每日基金收益情况，以各类基金份额的每万份基金已实现收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。投资者当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止；

(4)本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资者

记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资者记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资者不记收益；

(5)本基金每日进行收益计算并分配时，每日收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，投资者可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资者在每日收益支付时，其当日已实现收益大于零时，则为投资者增加相应的基金份额；若当日已实现收益等于零时，则保持投资者基金份额不变；若当日已实现收益小于零时，相应缩减投资者相应的基金份额；

(6)基金份额持有人在全部赎回其持有的本基金某类基金份额余额时，基金管理人自动将该基金份额持有人的该类基金份额未付收益一并结算并与赎回款一起支付给该基金份额持有人；基金份额持有人部分赎回其持有的某类基金份额时，当该类基金份额未付收益大于零时，未付收益不进行支付；当该类基金份额未付收益小于零时，其剩余的该类基金份额需足以弥补其当前未付收益小于零时的损益，否则将自动按比例结转当前未付收益，再进行赎回款项结算；

(7)当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的分配权益；当日赎回的基金份额自下一个交易日起不享有基金的分配权益；

(8)在不违反法律法规且不影响基金份额持有人实质利益的前提下，基金管理人可在中国证监会允许的条件下调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会；

(9)法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更事项。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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

(一)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。

(二)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。

(三)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。

(四)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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末

	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
活期存款	7,321,716.88	2,191,724.86
定期存款	2,290,000,000.00	420,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	-	223,000,000.00
存款期限 1-3 个月	550,000,000.00	-
存款期限 3 个月以上	1,740,000,000.00	197,000,000.00
其他存款	-	-
合计：	2,297,321,716.88	422,191,724.86

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2018 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	1,608,996,477.02	1,610,855,600.00	1,859,122.98	0.0514%
	合计	1,608,996,477.02	1,610,855,600.00	1,859,122.98	0.0514%
资产支持证券		30,000,000.00	30,030,000.00	30,000.00	0.0008%
合计		1,638,996,477.02	1,640,885,600.00	1,889,122.98	0.0522%
项目		上年度末 2017 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	99.68	99.78	0.10	0.0000%
	银行间市场	564,020,278.99	563,605,000.00	-415,278.99	-0.0413%
	合计	564,020,378.67	563,605,099.78	-415,278.89	-0.0413%
资产支持证券		-	-	-	-
合计		564,020,378.67	563,605,099.78	-415,278.89	-0.0413%

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	200,000,000.00	-
银行间市场	100,000,350.00	-
合计	300,000,350.00	-
项目	上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	133,986,920.98	-
合计	133,986,920.98	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,994.13	1,178.89
应收定期存款利息	17,630,109.70	1,453,520.03
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	1,990.01	19.69
应收债券利息	5,907,384.10	1,024,194.22
应收资产支持证券利息	385,249.31	-
应收买入返售证券利息	355,536.22	236,114.63
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	0.55
合计	24,282,263.47	2,715,028.01

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	47,636.98	26,719.75
合计	47,636.98	26,719.75

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	189,000.00	129,000.00
合计	189,000.00	129,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

万家天添宝 A		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	545,329,830.64	545,329,830.64
本期申购	12,958,356,989.82	12,958,356,989.82
本期赎回(以"-"号填列)	-10,428,526,833.10	-10,428,526,833.10
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以"-"号填列)	-	-
本期末	3,075,159,987.36	3,075,159,987.36

金额单位：人民币元

万家天添宝 B		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	460,969,601.89	460,969,601.89

本期申购	1,727,337,496.68	1,727,337,496.68
本期赎回(以"-"号填列)	-1,646,289,449.84	-1,646,289,449.84
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以"-"号填列)	-	-
本期末	542,017,648.73	542,017,648.73

注：申购含红利再投、转换入份额,赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

万家天添宝 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	85,396,760.36	-	85,396,760.36
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-85,396,760.36	-	-85,396,760.36
本期末	-	-	-

单位：人民币元

万家天添宝 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	20,819,819.47	-	20,819,819.47
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-20,819,819.47	-	-20,819,819.47
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

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 7 月 28 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	116,428.33	53,562.24

定期存款利息收入	58,326,057.74	3,778,756.16
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	17,635.80	50.08
其他	10.26	1.45
合计	58,460,132.13	3,832,369.93

7.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

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7月28日(基金合同生效日)至2017年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	966,149.04	26,888.41
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	966,149.04	26,888.41

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

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7月28日(基金合同生效日)至2017年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,991,943,392.36	287,496,198.55
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,978,398,017.16	286,983,900.56
减：应收利息总额	12,579,226.16	485,409.58
买卖债券差价收入	966,149.04	26,888.41

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期及上年度可比期间无公允价值变动收益。

7.4.7.18 其他收入

本基金本报告期末及上年度可比期间无其他收入。

7.4.7.19 交易费用

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 7 月 28 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	-	-
银行间市场交易费用	1,322.38	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	1,322.38	-

7.4.7.20 其他费用

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 7 月 28 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00	20,000.00
信息披露费	210,000.00	150,000.00
其他	2,100.00	-
银行汇划费用	71,695.80	26,579.21
银行间账户维护费	37,200.00	12,100.00
开户费	-	400.00

合计	360,995.80	209,079.21

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 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
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人
中泰证券股份有限公司	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
山东省国有资产投资控股有限公司	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
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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

7.4.10.1.2 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2017年7月28日(基金合同生效日)至2017年12月31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	25,300,558.30	100.00%	17,158,693.55	100.00%

7.4.10.1.3 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2017年7月28日(基金合同生效日)至2017年12月31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	3,731,919,000.00	100.00%	-	-

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 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 7 月 28 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,031,724.70	571,771.15
其中：支付销售机构的客户维护费	2,198,477.01	108,013.47

注：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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 7 月 28 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,406,344.96	114,354.24

注：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。

7.4.10.2.3 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 12 月 31 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	12,017.92	34,852.44	46,870.36
合计	12,017.92	34,852.44	46,870.36
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017 年 7 月 28 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家天添宝 A	万家天添宝 B	合计
万家基金	1,747.26	9,876.98	11,624.24
合计	1,747.26	9,876.98	11,624.24

注：本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.20%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后的下一个自然日起适用 A 类基金份额的费率。B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级后的下一个自然日起享受 B 类基金份额的费率。

A、B 两类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

H＝E×该类基金份额的年销售服务费率÷当年天数

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，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销售服务费划款指令，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登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	万家天添宝 A	万家天添宝 B
基金合同生效日（ 2017 年 7 月 28 日 ）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	1,205.46	51,124,630.47
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	1,205.46	15,083,460.96
期末持有的基金份额	-	36,041,169.51
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.9967%

项目	上年度可比期间 2017 年 7 月 28 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	
	万家天添宝 A	万家天添宝 B

基金合同生效日（ 2017 年 7 月 28 日 ）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	2,818,105.40	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	2,818,105.40	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

7.4.10.4.2 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

万家天添宝 A

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
上海万家朴智投资管理有限公司	915,976.80	0.0298%	-	-

万家天添宝 B

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
万家共赢资产管理有限公司	30,887,354.43	5.7004%	-	-
上海万家朴智投资管理有限公司	-	-	3,903,664.26	0.3879%

7.4.10.5 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 7 月 28 日(基金合同生效日)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
浦发银行	7,321,716.88	116,428.33	2,191,724.86	53,562.24

注：本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司保管，活期存款按银行同业利率计息。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 1 月 1 日至 12 月 31 日获得的利息收入为人民币 17,635.8 元（2017 年 7 月 28 日至 12 月 31 日获得的利息收入为人民币 50.08 元），2018 年 12 月 31 日结算备付金余额为人民币 4,020,040.91 元（2017 年 12 月 31 日结算备付金余额为人民币 39,721.77 元）。

7.4.10.6 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所承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期没有需作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

万家天添宝A

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
85,396,760.36	-	-	85,396,760.36	-

万家天添宝B

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
20,819,819.47	-	-	20,819,819.47	-

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

7.4.12.1 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/增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 656,022,295.96 元,是以如下债券作为质押:

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
111814054	18 江苏银行 CD054	2019 年 1 月 2 日	98.89	500,000	49,445,951.63
111880038	18 杭州银行 CD051	2019 年 1 月 2 日	98.32	70,000	6,882,316.09
111880121	18 贵阳银行 CD116	2019 年 1 月 2 日	98.34	500,000	49,167,680.52
111808220	18 中信银行 CD220	2019 年 1 月 2 日	98.45	300,000	29,536,003.35
111820082	18 广发银行 CD082	2019 年 1 月 2 日	98.74	400,000	39,496,699.95
111811104	18 平安银行 CD104	2019 年 1 月 2 日	98.72	35,000	3,455,127.83
111885312	18 龙江银行 CD104	2019 年 1 月 3 日	99.24	500,000	49,619,883.30
111894365	18 桂林银行 CD047	2019 年 1 月 3 日	99.21	500,000	49,605,283.48
111897920	18 江苏紫金农商行 CD041	2019 年 1 月 3 日	99.45	278,000	27,646,666.45
111896912	18 长沙银行 CD095	2019 年 1 月 4 日	99.62	1,000,000	99,616,050.54
111899405	18 重庆农村商行 CD058	2019 年 1 月 4 日	99.29	50,000	4,964,586.06
111811253	18 平安银行 CD253	2019 年 1 月 4 日	98.57	500,000	49,285,032.31
111811265	18 平安银行 CD265	2019 年 1 月 4 日	98.41	500,000	49,205,079.02
111821226	18 渤海银行 CD226	2019 年 1 月 4 日	99.26	200,000	19,851,866.42
180404	18 农发 04	2019 年 1 月 4 日	100.19	200,000	20,038,427.56
180407	18 农发 07	2019 年 1 月 4	99.97	300,000	29,990,427.37

		日			
160208	16 国开 08	2019 年 1 月 8 日	99.80	800,000	79,837,782.61
180404	18 农发 04	2019 年 1 月 8 日	100.19	200,000	20,038,427.56
合计				6,833,000	677,683,292.05

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理融入各业务层面，建立了三道防线：以各岗位目标责任制为基础，形成第一道防线；通过相关部门、相关岗位之间相互监督制衡，形成第二道防线；由监察稽核部门、督察长对各岗位、各部门、各机构、各项业务实施监督反馈，形成第三道防线。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险，本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末	上年度末

	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
A-1	60,010,932.59	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,425,122,910.67	544,035,080.32
合计	1,485,133,843.26	544,035,080.32

注：未评级债券为政策性金融债、国开债及同业存单。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	123,862,633.76	19,985,298.35
合计	123,862,633.76	19,985,298.35

注：未评级债券为政策性金融债。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分的证券在银行间同业市场交易，其余亦可在证券交易所上市，因此，本期末本基金的资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金所持有的金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金资产的流动性风险进行管理，基金管理人建立了健全的流动性风险管理的内部控制体系，在申购赎回确认、投资交易、估值和信息披露等运作过程中专业审慎、勤勉尽责地管控基金的流动性风险，维护投资者的合法权益，公平对待投资者。本基金运作期间管理人对组合持仓集中度、短期变现能力、流动性受限资产比例、存款和存单集中度等流动性指标进行持续的监测和分析，结合持有人集中度，对高流动性资产和平均剩余期限进行持续监控，通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，

对交易对手进行必要的尽职调查和准入，加强逆回购的流动性风险和交易对手风险的管理，并建全了逆回购交易质押品管理制度。

本报告期内本基金未出现因投资品种变现困难或投资集中而无法以合理价格及时变现基金资产以支付赎回款的情况。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，以摊余成本计价，并通过“影子定价”机制使按摊余成本确认的基金资产净值能近似反映基金资产的公允价值，因此本基金的运作仍然存在相应的利率风险。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感度缺口进行监控。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	7,321,716.88	1,250,000,000.00	1,040,000,000.00	-	-	-	2,297,321,716.88
结算备付金	4,020,040.91	-	-	-	-	-	4,020,040.91
交易性金融资产	79,894,593.49	670,765,488.46	888,336,395.07	-	-	-	1,638,996,477.02
买入返售金融资产	200,000,350.00	100,000,000.00	-	-	-	-	300,000,350.00
应收利息	-	-	-	-	-	24,282,263.47	24,282,263.47
应收申购款	-	-	-	-	-	11,008,595.63	11,008,595.63
资产总计	291,236,701.28	2,020,765,488.46	1,928,336,395.07	-	-	35,290,859.10	4,275,629,443.91
负债							
卖出回购金融资产款	656,022,295.96	-	-	-	-	-	656,022,295.96
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	799,089.76	799,089.76

应付托管费	-	-	-	-	-	159,817.94	159,817.94
应付销售服务费	-	-	-	-	-	550,950.22	550,950.22
应付交易费用	-	-	-	-	-	47,636.98	47,636.98
应付利息	-	-	-	-	-	679,952.74	679,952.74
应交税费	-	-	-	-	-	3,064.22	3,064.22
其他负债	-	-	-	-	-	189,000.00	189,000.00
负债总计	656,022,295.96	-	-	-	-	2,429,511.86	658,451,807.82
利率敏感度缺口	-364,785,594.68	2,020,765,488.46	1,928,336,395.07	-	-	32,861,347.24	3,617,177,636.09
上年度末 2017 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	22,191,724.86	400,000,000.00	-	-	-	-	422,191,724.86
结算备付金	39,721.77	-	-	-	-	-	39,721.77
存出保证金	1,170.86	-	-	-	-	-	1,170.86
交易性金融资产	39,922,384.32	346,720,919.86	177,377,074.49	-	-	-	564,020,378.67
买入返售金融资产	133,986,920.98	-	-	-	-	-	133,986,920.98
应收利息	-	-	-	-	-	2,715,028.01	2,715,028.01
应收申购款	-	-	-	-	-	9,764,253.90	9,764,253.90
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	196,141,922.79	746,720,919.86	177,377,074.49	-	-	12,479,281.91	1,132,719,199.05
负债							
卖出回购金融资产款	125,893,247.08	-	-	-	-	-	125,893,247.08
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	183,946.90	183,946.90
应付托管费	-	-	-	-	-	36,789.36	36,789.36
应付销售服务费	-	-	-	-	-	107,699.44	107,699.44
应付交易费用	-	-	-	-	-	26,719.75	26,719.75
应付利息	-	-	-	-	-	42,363.99	42,363.99

其他负债	-	-	-	-	-	129,000.00	129,000.00
负债总计	125,893,247.08	-	-	-	-	526,519.44	126,419,766.52
利率敏感度缺口	70,248,675.71	746,720,919.86	177,377,074.49	-	-	-11,952,762.47	1,006,299,432.53

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况		
	该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变		
	该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动		
	银行存款及结算备付金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；买入返售金融资产的利息收益在交易时已确定，不受利率变化影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2018 年 12 月 31 日 ）	上年度末（ 2017 年 12 月 31 日 ）
	市场利率下降 25 个基点	1,217,351.64	359,212.54
	市场利率上升 25 个基点	-1,213,333.29	-358,057.60

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所及银行间同业市场交易的证券，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大市场价格风险。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(一)公允价值

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。

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 2017 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 1,638,996,477.02 元，无属于第一层次和第三层次的余额。

（2）公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期末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未以第三层次公允价值计量。

3、非持续的以公允价值计量的金融工具

本基金本期末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

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。

(二)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	固定收益投资	1,638,996,477.02	38.33
	其中：债券	1,608,996,477.02	37.63
	资产支持证券	30,000,000.00	0.70
2	买入返售金融资产	300,000,350.00	7.02
	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	2,301,341,757.79	53.82
4	其他各项资产	35,290,859.10	0.83
5	合计	4,275,629,443.91	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

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	9.24	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	656,022,295.96	18.14
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

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%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	111
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	37

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。

8.3.2 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	6.67	18.14
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	5.78	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	51.46	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	8.76	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天（含）	44.55	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		117.23	18.14

8.4 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。

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	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	193,929,916.24	5.36
	其中：政策性金融债	193,929,916.24	5.36
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	60,010,932.59	1.66
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,355,055,628.19	37.46
8	其他	-	-
9	合计	1,608,996,477.02	44.48

10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	111896912	18 长沙银行 CD095	1,000,000	99,616,050.54	2.75
2	111872114	18 徽商银行 CD200	1,000,000	98,396,885.11	2.72
3	160208	16 国开 08	840,000	83,829,671.74	2.32
4	071800057	18 国元证券 CP004	500,000	50,010,932.59	1.38
5	111891136	18 东莞银行 CD010	500,000	49,868,546.83	1.38
6	111897920	18 江苏紫金农商行 CD041	500,000	49,724,220.23	1.37
7	111899405	18 重庆农村商行 CD058	500,000	49,645,860.58	1.37
8	111893839	18 珠海华润银行 CD016	500,000	49,640,210.20	1.37
9	111885287	18 贵阳银行 CD152	500,000	49,639,987.94	1.37
10	111821226	18 渤海银行 CD226	500,000	49,629,666.05	1.37

8.7 “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.2005%
报告期内偏离度的最低值	-0.0198%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0545%

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到达 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%。

8.8 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	149787	18 花呗 5A(总价)	300,000	30,000,000.00	0.83

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 基金计价方法说明

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。

8.9.2 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情况;本基金投资的前十名证券中 18 长沙银行 CD095 的发行主体长沙银行股份有限公司，18 徽商银行 CD200 的发行主体徽商银行股份有限公司，18 国元证券 CP004 的发行主体国元证券股份有限公司，18 重庆农村商行 CD058 的发行主体重庆农村商业银行股份有限公司，18 贵阳银行 CD152 的发行主体贵阳银行股份有限公司在报告编制日前一年内中存在受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	24,282,263.47
4	应收申购款	11,008,595.63
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	35,290,859.10

§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

份额级别	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
万家天添宝 A	273,198	11,256.16	3,744,496.80	0.12%	3,071,415,490.56	99.88%
万家天添宝 B	30	18,067,254.96	407,977,616.36	75.27%	134,040,032.37	24.73%
合计	273,228	13,238.68	411,722,113.16	11.38%	3,205,455,522.93	88.62%

9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	银行类机构	203,742,880.87	5.63%
2	银行类机构	101,290,582.32	2.80%
3	基金类机构	36,041,169.51	1.00%
4	其他机构	30,887,354.43	0.85%
5	其他机构	23,835,264.63	0.66%
6	个人	19,589,600.29	0.54%
7	个人	13,307,139.74	0.37%
8	其他机构	12,051,340.04	0.33%
9	个人	7,348,406.02	0.20%
10	个人	7,283,260.91	0.20%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	万家天添宝 A	1,501,104.90	0.0488%
	万家天添宝 B	-	-
	合计	1,501,104.90	0.0415%

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	份额级别	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	万家天添宝 A	50~100
	万家天添宝 B	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	万家天添宝 A	0~10
	万家天添宝 B	0
	合计	0~10

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	万家天添宝 A	万家天添宝 B
基金合同生效日（2017 年 7 月 28 日）基金份额总额	9,370.00	225,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	545,329,830.64	460,969,601.89
本报告期期间基金总申购份额	12,958,356,989.82	1,727,337,496.68
减:本报告期期间基金总赎回份额	10,428,526,833.10	1,646,289,449.84
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	3,075,159,987.36	542,017,648.73

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§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。

2018 年 3 月 15 日，公司增聘郅元为万家天添宝货币市场基金的基金经理，与基金经理柳发超共同管理该基金。2018 年 8 月 18 日，柳发超因工作安排，不再担任该基金的基金经理。

基金托管人：

本报告期，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“公司”）根据工作需要，任命孔建先生担任公司资产托管部总经理，主持资产托管部相关工作。孔建先生的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。

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

报告期期内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	
中泰证券	2	-	-	-	-	-

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、个股分析的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。

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
中泰证券	5,057,845.97	100.00%	3,731,919,000.00	100.00%	-	-

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内无偏离度绝对值超过 0.5%（含）的情况。

§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

注：本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§13 备查文件目录

13.1 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报纸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、万家天添宝货币市场基金 2018 年年度报告原文

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》

13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人网站：www.wjasset.com

13.3 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

2019 年 3 月 28 日