

# 万家现金宝货币市场证券投资基金

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进行询价并完成交易。为保证公平交易制度的实现,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过程中控制,通过对异常交易的监控和分析事后控制。

4.2 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成交价格向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%。

4.4 管理人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  
今年上半年经济基本面超预期向好,整体流动性偏紧但波动性下降,期间出现了超预期的货币加宽松,这些因素导致股债和债券市场都出现了较大的波动,权益市场由于缺乏增量资金叠加供给偏紧,公募、非标、城投供给加大等因素影响出现有较大幅度的结构性行情,而债券市场在年初收益率大幅上行后基本维持高位震荡格局,较大变量由流动性过渡为监管后L型变为基本面,可谓一波三折。

本基金报告期内在预防市场流动性波动规律及监管动向的前提下,调整组合现金资产分布情况以顺应市场利率变化节奏。本产品规避了几类利率敏感资产潜在风险并基本把握住了这几次波动,在资金利率高位超长久期并选择性价比相对较高的银行间存单作为主力配置品种,为客户创造了较好的收益。  
4.4.2 报告期内基金的业绩表现  
本报告期万家现金宝A的年化综合收益率为1.6983%,本报告期万家现金宝B的年化综合收益率为1.1941%,同期业绩比较基准收益率为10.736%。  
4.5 费用管理  
报告期内,我们对宏观经济、同业利率及行业走势进行了系统的跟踪调研,并结合市场环境,我们需要在供给侧改革导致失效前储备各项资产负债,也要进行深入的改革提高国民收入,获取总资产,基于此,我们认为下半年权益市场可能出现宽幅震荡的走势,应该注重自下而上精选个股投资机会,债券市场则可开始拉长久期增加杠杆,对于长期国债应该采取积极的策略。  
本基金将在严控风险充分做好流动性管理的前提下,择机拉长久期并适时运用息差策略,灵活配置各类资产把握流动性波动规律努力为客户获取更好的收益。

4.6 管理人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。估值委员会由首席财务官兼运营部门负责人,合规稽核部门负责人,权益投资部门负责人,固定收益部门负责人组成。估值委员会的成员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,熟悉估值法规,并具有丰富的实践经验。  
2.基金估值采用公允价值的程度  
本基金估值采用公允价值的程度,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协议与程度  
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《中证估值信息服务协议》。  
4.7 管理人报告期内基金利润分配政策的说明  
本基金每日计算分配收益,按日支付。本基金报告期内本基金已分配利润84,946,663.98元,本基金报告期内本基金已分配利润4,946,563.98元。  
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金份额净值预警情况的说明  
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二百人的情况。  
本基金报告期内未发生连续二十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循诚信原则,严格履行法律法规及基金合同约定的各项职责,本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规,《万家现金宝货币市场证券投资基金托管协议》和《万家现金宝货币市场证券投资基金托管协议补充协议》的有关规定,诚实守信,勤勉尽责,不存在损害基金份额持有人利益的行为。  
5.2 托管人报告期内本基金投资运作合规、净值真实、利润分配等情况的说明  
本报告期内,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的约定,对本基金的投融资运作,基金资产净值计算,基金份额申购赎回价格的计算,基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和检查,未发现基金管理人有关基金估值业务等方面有违规行为。  
本报告期内本基金已分配利润84,946,563.98元。  
5.3 本托管人对本报告中财务数据、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合情况等内容的,认为复核内容真实、准确、完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6.1 资产负债表  
6.2 所有者权益  
6.3 半年度财务会计报告(未经审计)

项目	本报告期末	上年度末
	2018年6月30日	2017年12月31日
资产:		
银行存款	1,028,799,047.38	1,018,684,590.99
结算备付金	3,479,886.73	61,520.63
存放同业款项	17,786.32	3,794.86
买入返售金融资产	2,152,022,440.15	1,698,072,902.11
应收利息	-	-
其他流动资产	-	-
其他资产	-	-
负债:		
应付票据及应付账款	-	-
应付短期融资券	-	-
应付债券	-	-
应付利息	10,338,628.13	8,060,262.97
其他负债	-	-
其他流动负债	-	-
其他负债	-	-
所有者权益(或股东权益):		
实收资本	3,438,668,687.27	3,180,071,794.13
其他综合收益	-	-
未分配利润	1,627,491,585.87	1,867,710,729.27
所有者权益合计	5,066,160,273.14	5,047,842,523.40
资产总计	8,095,787,866.69	7,181,525,513.99
负债和所有者权益总计	8,095,787,866.69	7,181,525,513.99

注:1.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。  
2.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

3.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

4.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

5.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

6.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

7.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

8.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

9.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

10.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

11.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

12.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

13.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

14.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

15.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

16.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

17.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

18.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

19.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

20.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

21.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

22.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

23.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

24.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

25.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

26.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

27.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

28.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

29.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

30.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

31.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

32.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

33.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

34.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

35.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

36.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

37.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

38.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

39.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

40.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

41.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

42.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

43.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

44.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

45.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

46.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

47.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

48.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

49.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

50.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

51.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

52.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

53.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

54.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

55.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

56.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

57.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

58.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

59.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

60.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

61.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

62.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

63.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

64.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

65.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

66.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

67.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

68.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

69.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

70.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

71.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

72.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

73.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

74.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

75.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

76.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

77.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

78.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

79.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

80.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

81.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

82.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

83.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

84.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

85.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

86.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

87.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

88.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

89.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

90.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

91.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

92.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

93.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

94.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

95.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

96.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

97.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

98.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

99.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

100.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

101.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

102.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

103.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

104.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

105.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

106.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

107.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

108.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

109.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

110.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

111.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

112.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

113.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

114.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

115.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

116.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

117.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

118.本报告截止日2018年6月30日,本基金余额1,000元,基金份额净值3.406,669.585,97份。

1