万家货币市场证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:万家基金管理有限公司
基金托管人:华夏银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家货币	
基金主代码	519508	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年5月24日	
报告期末基金份额总额	13,574,983,945.48份	
投资目标	在力保本金稳妥和基金资产高流动性的基础上,为投资者提供资金的流动性储备,并追求高于业绩比较基准的稳定收益。	
投资策略	通过短期利率预期策略、类属资产配置策略和无风险套利操作策略构建投资组合,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	本基金实施基金份额分类前,业绩比较基准为一年期银行定期存款税后利率。自2013年8月15日起本基金实施基金份额分类,并采用银行活期存款利率(税后)为业绩比较基准。	
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中低风险、高流动性的品种,其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金。	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	华夏银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	下属分级基金的交易代码	报告期末下属分级基金的份额总额
万家货币A	519508	409,934,156.64份
万家货币B	519507	12,690,538,627.11份
万家货币R	519501	32,435.18份
万家货币E	000764	474,478,726.55份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标		1.本期已实现收益	2. 本期利润	3. 期末基金资产净值
报告期(2018年7月1日 - 2018年9月30日)	万家货币A	3,393,535.71	3,393,535.71	409,934,156.64
	万家货币B	109,237,552.76	109,237,552.76	12,690,538,627.11
	万家货币R	16,938.11	16,938.11	32,435.18
	万家货币E	4,203,674.27	4,203,674.27	474,478,726.55

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,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。

2、自2013年8月15日起,本基金实施基金份额分类,分设三类基金份额:A类基金份额、B类基金份额和R类基金份额,详情请参阅相关公告。

3、自2014年8月25日起,本基金实施基金份额分类,分设四类基金份额:A类基金份额、B类基金份额、R类基金份额和E类基金份额,详情请参阅相关公告。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

万家货币A

阶段	净值收益率①	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	0.8473%	0.0010%	0.0882%	0.0000%	0.7591%	0.0010%

万家货币B

阶段	净值收益率①	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	0.9081%	0.0010%	0.0882%	0.0000%	0.8199%	0.0010%

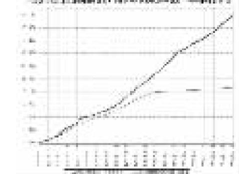
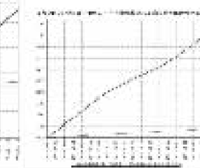
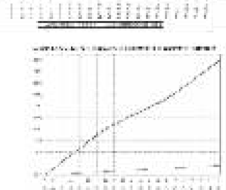
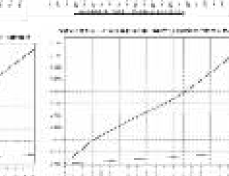
万家货币R

阶段	净值收益率①	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	0.9107%	0.0010%	0.0882%	0.0000%	0.8225%	0.0010%

万家货币E

阶段	净值收益率①	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	0.8854%	0.0010%	0.0882%	0.0000%	0.7972%	0.0010%

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:1、本基金成立于2006年5月24日,建仓期为3个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合基金合同要求。

2、自2013年8月15日起,本基金实施基金份额分类,分设三类基金份额:A类基金份额、B类基金份额和R类基金份额;其中B类和R类基金份额的指标计算自分类实施日(2013年8月15日)算起。

3、自2014年8月25日起,本基金实施基金份额分类,分设四类基金份额:A类基金份额、B类基金份额、R类基金份额和E类基金份额;其中E类基金份额的指标计算自分类实施日(2014年8月25日)算起。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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6月28日	–	7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。

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度经济增长继续放缓。内需出现显著下滑,地产销量、汽车销量、家电销量均出现不同程度负增长,为多年罕见。在贸易战影响下,出口型企业抢末班车,使得进出口仍保持较高增速,但未来可持续性存疑问。

通胀增速有所抬头,在油价和猪价推动下,8月CPI同比增速上升到2.3%,为近年来非春节月份新高。

央行在三季度采取了偏松的货币政策,继续通过降准,MLF,逆回购等方式向市场投放流动性。短期资金利率显著下降,3m存单利率较2季度下降150bp到3%以内,7天逆回购加权利率一度下降到2.3%以内。收益率曲线陡峭化下行,1年内债券收益率下降到1/4历史分位数以内;5年以上债券收益率仍然在中位数以上。信用利差走扩,信用违约事件仍然频繁发生,流动性向中低等级企业传导渠道受阻,宽信用效果不理想。

本基金在二季度末拉长了久期,在三季度主动控制规模增长,实现了较好的收益率。

我们预计在四季度,经济继续延续下滑态势。贸易战对外需的负面影响会逐步显现,进出口增速下滑,同时也会影响出口型产业的投资。经历了前几年的加杠杆后,内需继续提升的空间有限,地产减速对整体经济的拖累会愈发明显。经济下滑导致融资需求下降,使得货币政策易松难紧,央行会继续采用多种政策手段投放流动性,对冲经济下滑压力。

通胀抬头会制约央行宽松货币的速度和节奏,不会改变货币政策宽松的方向。通胀压力仍将主要来自于外生变量,如油价和猪价,以及人民币汇率贬值压力等。

贸易战的走向仍然是影响市场风险偏好的重要因素,在当前悲观的预期下,如果贸易战出现超预期的缓和,将刺激风险资产反弹,对固定收益类避险资产带来挤出效应,同时也会加大稳汇率对宽松货币的制约。

在四季度,我们将采取哑铃型投资策略,主要配置极短和极长两类资产,在规则允许范围内保持较长久期和较高收益率。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期万家货币A的基金份额净值收益率为0.8473%,本报告期万家货币B的基金份额净值收益率为0.9081%,本报告期万家货币R的基金份额净值收益率为0.9107%,本报告期万家货币E的基金份额净值收益率为0.8854%,同期业绩比较基准收益率为0.0882%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	3,474,115,161.00	25.47
	其中:债券	3,262,953,690.66	23.92
	资产支持证券	211,161,470.34	1.55
2	买入返售金融资产	5,053,100,771.21	37.04
	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	5,058,134,818.51	37.08
4	其他资产	57,166,612.41	0.42
5	合计	13,642,517,363.13	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	3.99	
	其中:买断式回购融资	–	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	–	–
	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%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	85
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	87
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	29

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。

5.3.2 报告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	40.99	0.29
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)—60天	8.03	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)—90天	18.08	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)—120天	0.02	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	120天(含)—397天(含)	32.96	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
合计		100.08	0.29

5.4 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。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	225,657,124.76	1.66
	其中:政策性金融债	225,657,124.76	1.66
4	企业债券	350,726,319.39	2.58
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	同业存单	2,686,570,246.51	19.79
8	其他	–	–
9	合计	3,262,953,690.66	24.04
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	–

5.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111819147	18恒丰银行CD147	3,000,000	294,276,886.03	2.17
2	111819337	18恒丰银行CD337	1,800,000	175,947,312.08	1.30
3	111809276	18浦发银行CD276	1,500,000	147,744,319.01	1.09
4	111719357	17恒丰银行CD357	1,200,000	119,407,978.47	0.88
5	111895707	18徽商银行CD066	1,000,000	99,776,693.68	0.74
6	111896646	18广州农村商业银行CD015	1,000,000	99,529,746.23	0.73
7	111898409	18大连银行CD092	1,000,000	99,193,037.16	0.73
8	111880113	18盛京银行CD252	1,000,000	98,958,768.12	0.73
9	111884872	18甘肃银行CD104	1,000,000	98,471,066.41	0.73
10	111806216	18交通银行CD216	1,000,000	98,401,722.54	0.72

5.7 "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	0
报告期内偏离度的最高值	0.1183%
报告期内偏离度的最低值	0.0173%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0708%

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到达0.5%。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	149448	18花呗2A	700,000	70,413,094.97	0.52
2	149127	18花01A1	500,000	50,370,603.29	0.37
3	149284	18花呗1A	400,000	40,310,210.71	0.30
4	146689	花呗50A1	200,000	20,060,587.82	0.15
5	146723	17花01A1	200,000	20,000,000.00	0.15
6	146677	花呗46A1	100,000	10,006,973.55	0.07

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

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。

5.9.2

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,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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	11,697.98
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	47,250,594.09
4	应收申购款	9,904,320.34
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	57,166,612.41

–

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	基金合同生效日(2006年5月24日)基金份额总额	报告期期初基金份额总额	报告期期间基金总申购份额	报告期期间基金总赎回份额	报告期期末基金份额总额
万家货币A	–	388,618,543.70	137,620,550.07	116,304,937.13	409,934,156.64
万家货币B	–	10,991,819,480.45	6,728,696,837.97	5,029,977,691.31	12,690,538,627.11
万家货币R	–	2,034,827.54	5,015,772.70	7,018,165.06	32,435.18
万家货币E	–	334,962,563.17	901,371,590.39	761,855,427.01	474,478,726.55

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投	2018年7月11日	62,373.91	62,373.91	–
2	红利再投	2018年8月13日	67,820.94	67,820.94	–
3	红利再投	2018年9月11日	58,501.36	58,501.36	–
合计			188,696.21	188,696.21	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

–

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准万家货币市场证券投资基金发行及募集的文件。

2、《万家货币市场证券投资基金基金合同》。

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、万家货币市场证券投资基金2018年第3季度报告原文。

6、万家基金管理有限公司董事会决议。

7、《万家货币市场证券投资基金托管协议》。

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所,并登载于基金管理人网站:www.wjasset.com

9.3 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
2018年10月24日

万家现金宝货币市场证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:万家基金管理有限公司
基金托管人:上海银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家现金宝	
基金主代码	000773	
交易代码	000773	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年9月23日	
报告期末基金份额总额	5,391,237,761.61份	
投资目标	本基金在合理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。	
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、同业存款投资策略、回购策略、套利策略和现金流管理策略构建投资组合,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	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。	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	上海银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	万家现金宝A	万家现金宝B
下属分级基金的交易代码	000773	004811
报告期末下属分级基金的份额总额	4,412,154,732.20份	979,083,029.41份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日 - 2018年9月30日)	
	万家现金宝A	万家现金宝B
1. 本期已实现收益	44,149,672.48	2,251,480.21
2. 本期利润	44,149,672.48	2,251,480.21
3. 期末基金资产净值	4,412,154,732.20	979,083,029.41

注: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 本报告期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

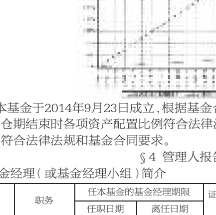
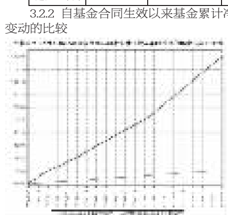
万家现金宝A

阶段	净值收益率①	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	0.8282%	0.0017%	0.0882%	0.0000%	0.7400%	0.0017%

万家现金宝B

阶段	净值收益率①	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	0.8764%	0.0017%	0.0882%	0.0000%	0.7882%	0.0017%

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:1、本基金于2014年9月23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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2018年1月30日	–	7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。

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

1、运作分析

三季度经济增长继续放缓。内需出现显著下滑,地产销量、汽车销量、家电销量均出现不同程度负增长,为多年罕见。在贸易战影响下,出口型企业抢末班车,使得进出口仍保持较高增速,但未来可持续性存疑问。

通胀增速有所抬头,在油价和猪价推动下,8月CPI同比增速上升到2.3%,为近年来非春节月份新高。

央行在三季度采取了偏松的货币政策,继续通过降准,MLF,逆回购等方式向市场投放流动性。短期资金利率显著下降,3m存单利率较2季度下降150bp到3%以内,7天逆回购加权利率一度下降到2.3%以内。收益率曲线陡峭化下行,1年内债券收益率下降到1/4历史分位数以内;5年以上债券收益率仍然在中位数以上。信用利差走扩,信用违约事件仍然频繁发生,流动性向中低等级企业传导渠道受阻,宽信用效果不理想。

本基金在二季度末拉长了久期,在三季度主动控制规模增长,实现了较好的收益率。

2、简要展望

我们预计在四季度,经济继续延续下滑态势。贸易战对外需的负面影响会逐步显现,进出口增速下滑,同时也会影响出口型产业的投资。经历了前几年的加杠杆后,内需继续提升的空间有限,地产减速对整体经济的拖累会愈发明显。经济下滑导致融资需求下降,使得货币政策易松难紧,央行会继续采用多种政策手段投放流动性,对冲经济下滑压力。

通胀抬头会制约央行宽松货币的速度和节奏,不会改变货币政策宽松的方向。通胀压力仍将主要来自于外生变量,如油价和猪价,以及人民币汇率贬值压力等。

贸易战的走向仍然是影响市场风险偏好的重要因素,在当前悲观的预期下,如果贸易战出现超预期的缓和,将刺激风险资产反弹,对固定收益类避险资产带来挤出效应,同时也会加大稳汇率对宽松货币的制约。

在四季度,我们将采取哑铃型投资策略,主要配置极短和极长两类资产,在规则允许范围内保持较长久期和较高收益率。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期万家现金宝A的基金份额净值收益率为0.8282%,本报告期万家现金宝B的基金份额净值收益率为0.8764%,同期业绩比较基准收益率为0.0882%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	2,077,365,254.82	37.84
	其中:债券	2,005,136,521.54	36.52
	资产支持证券	72,228,733.28	1.32
2	买入返售金融资产	1,358,525,397.79	24.75
	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	1,958,067,774.07	35.67
4	其他资产	95,985,149.40	1.75
5	合计	5,489,943,576.08	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	1.50	
	其中:买断式回购融资	–	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	95,999,736.00	1.78
	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

本报告期内本基金未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	93
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	95
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	41

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内未出现投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.2 报告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	24.51	1.78
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)—60天	15.97	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)—90天	23.71	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)—120天	0.37	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	120天(含)—397天(含)	35.48	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	100.04	1.78

5.4 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。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	99,513,267.91	1.85
2	央行票据	–	–
3	金融债券	224,803,059.87	4.17
	其中:政策性金融债	224,803,059.87	4.17
4	企业债券	130,612,583.10	2.42
5	企业短期融资券	820,272,357.60	15.21
6	中期票据	–	–
7	同业存单	729,935,253.06	13.54
8	其他	–	–
9	合计	2,005,136,521.54	37.19
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	–

5.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	011801634	18中车SCP004	1,000,000	100,001,070.51	1.85
2	071800037	18中信CP008	1,000,000	100,000,000.00	1.85
3	189945	18贴现国债45	1,000,000	99,513,267.91	1.85
4	111806216	18交通银行CD216	1,000,000	98,401,722.54	1.83
5	111886163	18徽商银行CD146	1,000,000	98,345,548.19	1.82
6	170211	17国开11	700,000	69,981,999.95	1.30
7	011800626	18鲁黄金SCP003	600,000	60,010,454.23	1.11
8	180207	18国开07	600,000	59,955,597.39	1.11
9	1422005	14海尔财务02	500,000	50,695,199.80	0.94
10	011800560	18华晨SCP001	500,000	50,061,994.01	0.93

5.7 "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	0
报告期内偏离度的最高值	0.1626%
报告期内偏离度的最低值	0.0537%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0999%

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到达0.5%。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	146735	17花05A1	400,000	40,216,340.49	0.75
2	149380	18花06A1	200,000	20,000,000.00	0.37
3	146686	花呗49A1	100,000	10,010,998.08	0.19
4	146677	花呗46A1	20,000	2,001,394.71	0.04

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

本基金估值采用摊余成本法计价,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提利息,并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销,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。

5.9.2

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,在报告编制日前一年内不存在受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	17,934.60
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	28,911,232.39
4	应收申购款	67,055,982.41
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	95,985,149.40

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	万家现金宝A	万家现金宝B
报告期期初基金份额总额	3,376,184,363.75	30,485,222.12
报告期期间基金总申购份额	25,074,757,604.36	1,193,053,754.86
报告期期间基金总赎回份额	24,038,787,235.91	244,455,947.57
报告期期末基金份额总额	4,412,154,732.20	979,083,029.41

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期末发生基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§9 备查文件目录

9.1 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、《万家现金宝货币市场证券投资基金基金合同》。

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媒介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、万家现金宝货币市场证券投资基金2018第三季度报告原文。

6、万家基金管理有限公司董事会决议。

7、《万家现金宝货币市场证券投资基金托管协议》。

9.2 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:http://www.wjasset.com

9.3 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
2018年10月24日

万家中证红利指数证券投资基金(LOF)

2018年第三季度报告

基金管理人:万家基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务数据未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家中证红利指数(LOF)
基金主代码	161907
交易代码	161907
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2011年3月17日
报告期末基金份额总额	28,671,236.51份
投资目标	本基金采用被动式指数化投资方法,通过严格的投资纪律约束和数量化风险控制手段,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪偏离度不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%,实现对中证红利指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为指数型基金,原则上采用完全复制法,按照成份股在中证红利指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金管理人会对实际投资组合进行适当调整,以便实现对跟踪误差的有效控制。
业绩比较基准	95%×中证红利指数收益率+5%×银行同业存款利率。
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,预期风险高于货币市场基金、债券型基金及混合型基金,属于较高风险,较高预期收益的证券投资基金品种。
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日 - 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	488,346.38
2.本期利润	-204,134.76
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0071
4.期末基金资产净值	43,709,247.09
5.期末基金份额净值	1.5245

注:1、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、上表中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。

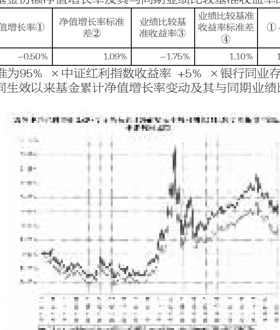
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-0.50%	1.09%	-1.75%	1.10%	1.25%	-0.01%

注:业绩比较基准为95% ×中证红利指数收益率 +5% ×银行同业存款利率

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



注:本基金成立于2011年3月17日,建仓期为六个月,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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
卞勇	万家180指数证券投资基金、万家上证50交易型开放式指数证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金(LOF)、万家瑞债券型证券投资基金、万家量化睿选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基金经理	2015年8月18日	–	10年	波士顿大学经济学硕士。2003年7月至2004年6月在香港中文大学工作,担任研究助理职务;2008年7月至2010年6月在上海双隆投资管理有限公司工作,担任金融工程师职务;2010年6月至2010年10月在上海尚雅投资管理有限公司工作,担任高级量化分析师职务;2010年10月至2014年4月在国泰基金管理有限公司工作,担任专户投资经理助理职务;2014年6月至2014年10月在广发证券股份有限公司工作,担任投资经理职务;2014年11月至2015年4月在中融基金管理有限公司工作,担任产品开发部总监职务;2015年4月进入万家基金管理有限公司,从事量化投资工作,自2015年8月起担任基金经理职务,现任量化投资部总监、基金经理。
朱小明	万家180指数证券投资基金、万家上证50交易型开放式指数证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金(LOF)	2017年4月8日	–	6年	北京大学应用数学硕士。2012年7月至2014年7月在国泰基金管理有限公司工作,担任研究员职务;2014年7月至2016年6月在德骏达隆(上海)资产管理有限公司工作,担任投资经理助理职务;2016年6月进入万家基金管理有限公司,从事量化研究工作,自2017年4月起担任量化投资部基金经理职务。

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年三季度,国内宏观经济政策实现了一定程度的宽松,基建扩张等政策降低了对于国内经济的担忧。与美国的贸易战愈演愈烈,关税征收范围不断扩大,是三季度影响市场的重要因素。反映在市场上,投资者对于贸易战的悲观预期最终落地,使得整个市场呈现一个先跌后反弹的格局。报告期本基金投资标的指数——中证红利指数收益率为-1.87%。

本基金作为被动投资的指数基金,其投资目标是通过跟踪、复制中证红利指数,为投资者获取市场长期的平均收益。报告期内我们严格按照基金合同规定,原则上采取完全复制的方法进行投资管理,努力拟合标的指数,减小跟踪误差,将基金跟踪误差控制在较低范围之内。同时,本基金采用有效的量化跟踪技术,降低管理成本。导致跟踪误差的主要原因是基金申购赎回、禁止投资成分股替代、标的指数成分股调整、成分股分红和基金费用等因素。

展望2018年四季度,流动性有望维持宽松,但实体经济融资问题仍有待解决。此外,中美贸易摩擦仍有较大的不确定性。MSCI加大A股权重和A股纳入富时罗素的预期都将进一步引领市场的价值投资潮流,以金融消费为代表的蓝筹股未来有望获得更好收益。

本基金将继续贯彻被动投资理念,恪守基金合同规定的投资目标和投资策略,一如既往地规范、勤勉运作,将本基金打造为稳定有效的指数投资工具,为基金份额持有人谋求长期、稳定回报。

4.5 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1.5245元;本报告期基金份额净值增长率为-0.50%,业绩比较基准收益率为-1.75%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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的情况。本报告期内,自7月1日至9月30日基金资产净值连续64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,目前我司市场部门正积极加强营销,力争扩大本基金规模。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	41,499,855.36	94.29
	其中:股票	41,499,855.36	94.29
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	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	2,485,229.45	5.65
8	其他资产	30,047.14	0.07
9	合计	44,015,131.95	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	2,067,711.03	4.73
C	制造业	16,037,804.60	36.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,640,825.86	15.19
E	建筑业	309,861.09	0.71
F	批发和零售业	1,081,517.21	2.47
G	交通运输、仓储和邮政业	3,674,694.60	8.41
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	8,267,562.57	18.91
K	房地产业	3,419,341.05	7.82
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	41,499,318.01	94.94

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采掘业	–	–
C	制造业	537.35	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	537.35	0.00

5.2.3 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沪港通股票。

5.3 报告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

5.3.1 报告期末指数投资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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601988	中国银行	377,174	1,403,087.28	3.21
2	601088	中国神华	54,233	1,105,810.87	2.53
3	000895	双汇发展	42,100	1,100,915.00	2.52
4	600104	上汽集团	27,654	920,325.12	2.11
5	000651	格力电器	20,492	823,778.40	1.88
6	600011	华能国际	106,439	820,644.69	1.88
7	601288	农业银行	186,495	725,465.55	1.66
8	601398	工商银行	114,547	660,936.19	1.51
9	600741	华域汽车	28,341	637,672.50	1.46
10	002372	伟星新材	42,787	634,103.34	1.45

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603477	振静股份	55	537.35	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据基金合同,本基金暂不可投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同,本基金暂不可投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,177.55
2	应收证券清算款	12,947.87
3	应收股利	–
4	应收利息	498.70
5	应收申购款	14,423.02
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	30,047.14

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	份额
报告期期初基金份额总额	28,335,348.39
报告期期间基金总申购份额	1,175,196.23
减:报告期期间基金总赎回份额	839,308.11
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–
报告期期末基金份额总额	28,671,236.51

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

项目	份额
报告期期初管理人持有的本基金份额	1,751,594.89
报告期期间买入/申购总份额	–
报告期期间卖出/赎回总份额	–
报告期期末管理人持有的本基金份额	1,751,594.89
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	6.11

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期末发生基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

本报告期内,本基金未发生单一投资者持有份额超过20%的情况。

§9 备查文件目录

9.1 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、《万家中证红利指数证券投资基金(LOF)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媒介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、万家中证红利指数证券投资基金(LOF)2018年第3季度报告原文。

6、万家基金管理有限公司董事会决议。

7、《万家中证红利指数证券投资基金(LOF)托管协议》。

9.2 存放地点

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

9.3 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
2018年10月24日