

## 万家现金增利货币市场基金 2018年年度报告摘要

国雷丁大学

2 管理人对报告即内本基金运作運展守信情况的的明本报告期内本基金运作運展守信情况的的明本报告期内,本基金管明人严格遵守基金合信、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理力基金资产 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。

益的行为。
43 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明
431 公平交易制度和控制方法
根则中国证据会颁和的《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《万家基金管理书限公司公平交易管理办法。涵盖子研究、授权、投资决策和交易执行等投资管理 活动的各个年代,严禁直接应通过第三方的交易按律不同投资租金之间进行和越榆选、属保

高河的各个环节,严峻重显或通过第三方的空肠安排在不同投资组合。但此行利益输送。确保公平对待不同投资组合。(1)公司对不同类则的投资组合。在投资决策上、(1)公司对不同类则的投资组合分别设定独立的投资部1、公募基金经理和按定案户营产管理现金经验理不得互租帐户、(2)公司投资管理实行分股次增,投资决定的人物投资的一个企业,是

及交易。

《在行为监狱上,公司定即对不即投税债务的间向交易价差,反向交易、场外交易对非议价的 在行为监狱上,公司定即对不即投税债务的间向交易价差,反向交易、场外交易对非议价的 多公产性及其他财常交易制或进行"监狱及分析,基金经理对异常交易情况进行合理性解释并 存运品,并定则编述公平交易分析报告。由投资组合经理、每整长、经经理申核签署。 4.32、公平交易制度的执行情况。
4.32、公平交易制度的执行情况。
4.32、公平交易制度的执行情况。
4.31、公司定即进行间交易价差分析,即采集公司建下管理的所有组合。连续四个零度期间内, 明制制额下(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 得股份为,69%的增估从平下的依赖。并对结论进行服股分分,好结果显示在样本数量大 06%的报下,组合之间在间向交易方面未发现进反公平交易的行为。

《7 年度财务报表

本期末 8年12月

2收证券清算款

上年度末 2017年12日20

529,416,496.13

529,416,496.1

7,701,767,002.6

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 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。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、收益分配情况、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

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。 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,

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况 基金简称 基金主代码 基金管理人 E金托官人 设告期末基金份额总额

投资策略	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 家基金管理有限公司 客户服务电记

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

31 主要会计数据和财务指标

报告期末下属分级基金的

22 基金产品说明

24 信息披露方式

登载基金年度报告正文的

3.1.1 期间数 据和指标		2018年	2017年2月13	3日(基金合同生效日) 7年12月31日
	万家现金增 利货币A	万家现金增利货币B	万家现金增利 货币A	万家现金增利货币B
本期已实现 收益	4,602.33	351,423,683.80	16,330.37	340,416,221.39
本期利润	4,602.33	351,423,683.80	16,330.37	340,416,221.39
本期净值收 益率	3.2009%	3.3996%	3.2826%	3.4570%
3.1.2 期末数 据和指标		2018年末	2	1017年末
期 末 基 金 资 产净值	77,029.81	10,688,696,545.66	651,436.91	10,337,272,861.86
期末基金份 額净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

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

2本基金成立于2017年2月13日,上年度可比期间为2017年2月13日至2017年12月31日。 3.本基金利润分配为按日结转份额。

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 万家现金增利货币A (A) (MITCH ) (MITCH

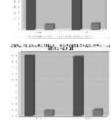
阶段	收益率①	收益率标 准差②	基准收益率3	准收益率标准差④	(1) – (3)	(2) – (4)
过去三个 月	0.6466%	0.0007%	0.0882%	0.0000%	0.5584%	0.0007%
过去六个 月	1.4371%	0.0011%	0.1764%	0.0000%	1.2607%	0.0011%
过去一年	3.2009%	0.0018%	0.3500%	0.0000%	2.8509%	0.0018%
自基金合 同生效起 至今	6.5886%	0.0018%	0.6588%	0.0000%	5.9298%	0.0018%

万家现金增利货币B

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业级比较 基准收益 率3	业领比较基 准收益率标 准差④	1) – 3)	2-4
过去三个 月	0.6946%	0.0007%	0.0882%	0.0000%	0.6064%	0.0007%
过去六个 月	1.5342%	0.0011%	0.1764%	0.0000%	1.3578%	0.0011%
过去一年	3.3996%	0.0018%	0.3500%	0.0000%	3.0496%	0.0018%
自基金合 同生效起 至今	6.9741%	0.0018%	0.6588%	0.0000%	6.3153%	0.0018%



THE REST OF THE PARTY OF THE PARTY OF THE PARTY.



3.3 过去三年基金的利润分配情况

位:人臣	单				
		iA	万家现金增利货币		
备注	年度利润 分配合计	应付利润 本年变动	直接通过应付 赎回款转出金额	已按再投资形式 转实收基金	年度
	4,602.33	_	_	4,602.33	2018
	16,330.37	-	-	16,330.37	2017
	20,932.70	_	_	20,932.70	合计
位:人[	单				

				245	业:人口
		万家现金增利的	货币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	351,423,683.80	_	-	351,423,683.80	
2017	340,416,221.39	_	-	340,416,221.39	
合计	691,839,905.19	-	-	691,839,905.19	

§ 4 管理人报告 41 其全管理人及其全经理情况

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

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 /JUIII在风心机直径百兰组形处及推查。 /J水弧红问则多州哈及心机直位在5组形处双维重。/J 家新们通花头企业灵活配置各型证券投资基金/J家客 造优势混合型证券投资基金以及万家跨维养老目标二年持有期混合型基金中基金(POF)。 4.1.2 基金短焊(或基金S壁)地组(及基金经理即期简介) 会计主体:万家现金增利货币市场基金 本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

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2月13日(基金合同 生效日)至2017年12月31 日
一、收入	377,509,128.81	363,448,859.38
1.利息收入	377,365,539.27	363,448,859.38
其中:存款利息收入	149,701,503.13	203,853,166.55
债券利息收人	110,105,034.94	71,615,249.84
资产支持证券利息收入	-	-
买人返售金融资产收入	117,559,001.20	87,980,442.99
其他利息收入	-	-
2.投资收益( 损失以 "-" 填列)	143,589.54	-
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	ı
债券投资收益	143,589.54	-
资产支持证券投资收益	-	ı
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-" 号填列)	-	-
4. 汇兑收益( 损失以 "-" 号填列)	-	-
5.其他收人( 损失以 "-" 号填列)	-	-
减:二、费用	26,080,842.68	23,016,307.62
1. 管理人报酬	15,787,309.52	14,809,688.23
2. 托管费	5,262,436.48	4,397,955.16
3. 销售服务费	1,052,742.47	880,425.23
4. 交易费用	334.00	1,201.30
5. 利息支出	3,507,352.27	2,469,561.96
其中:卖出回购金融资产支出	3,507,352.27	2,469,561.96
6. 税金及附加	12,475.84	-
7. 其他费用	458,192.10	457,475.74
三、利润总额(亏损总额以"-"号 填列)	351,428,286.13	340,432,551.76
减:所得税费用	-	_
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	351,428,286.13	340,432,551.76

項目	2018年1月1日至2018年12月31日		11 🖯
	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)	10,337,924,298.77	1	10,337,924,298.77
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数(本 期利润)	-	351,428,286.13	351,428,286.13
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)	350,849,276.70	-	350,849,276.70
其中:1.基金申购款	351,441,261.13	_	351,441,261.13
2.基金赎回款	-591,984.43	-	-591,984.43
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)	-	-351,428,286.13	-351,428,286.13
五、期末所有者权益 (基金净值)	10,688,773,575.47	ı	10,688,773,575.47
项目	上年度可比期间 2017年2月13日(基金合同生效日)至2017年12月31日		7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)	411,004,673.43	ı	411,004,673.43
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数(本 期利润)	-	340,432,551.76	340,432,551.76
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)	9,926,919,625.34	-	9,926,919,625.34
其中:1.基金申购款	15,353,166,081.10	-	15,353,166,081.10
2.基金赎回款	-5,426,246,455.76	_	-5,426,246,455.76
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)	-	-340,432,551.76	-340,432,551.76
五、期末所有者权益 (基金净值)	10,337,924,298.77	-	10,337,924,298.77
根表附注为财务报表的本报告 7.1 至 7.	4 财务报表由下列负	责人签署:	陈广益

7.41 基金基本情况 万家现金增利货币市场基金(以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会(以下 k"中国证监定")证监许可(2016)2093 号文(关于核地万家现金增利货币市场基金募集的 2)的批准,由万家基金管理有限公司作为基金管理人于 2017年 1 月 9 日至 2017年 2 9 目的社会公开募集,募集期的政党经大年明会计师事务所(特殊普通合伙)验学并出员交 时期(2017)验宁第(60778298-1905)验资报告后,由中国证金会报送基金备案材料。基金合 2017年 2 月 13 日正式生效、设立招募集的打除人购费后的实收基金(木金)为人民币 (004,671.92 元,在募集期间产生的活明存款利息为人民币1.51 元,以上实收基金(木金) 十为人民币 411,004,673.43元,折合411,004,673.43份基金份额。本基金为契约型开放式, 卖期限不定。本基金的基金管理人与注册登记机构均为万家基金管理有限公司,基金托管人

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

持操作。 本財务招表以本基金持续经营为基础列报。

不可可抗疾心心物磁性污染症息分别如可能。明 7-33 道照企业会计准则及其他有关规定的证明 本财务报金符合业会计地则的要求。据义、光整地反映了本基金于2018年12月31日的财 25以及2018年度的经常成果和基金净值变动情况。 7-44 本报告则所采用的会计改筑。会计估计与最近一明年度报告相一致的说明 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。

7-74.5 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 税到 1-印花总

1.日7起程 经国务等批准。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%。 运国务部批准。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)交易印定税税率撤纳印记税。支让分不再征收、税率不变; 根据财政部、国家院务总局财税(2005)103 号文(关于股权分置过点改革有关税收政策问 题的通知)的规定。既权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东安付对价而发生的股权 转让,暂免征收印花税。

转让、整矩改良印花院。
2.增值股份
2.增量股份
2.增值股份
2.增值股份
2.增值股份
2.增值股份
2.增值股份
2.增值股份
2.增值股份
2.增值股份
2.增量股份
2.增值股份
2.增 47 管理人对按定即归基金和购为推定制的公证明 水基金由生1 第分规定线。我已至代,本报告申用水基金应分配利润351428296.13元,本报 告期内未基金已分配利润25142296.13元。 48 报告前内管理人对本基金的有分数或基金资产净值预警情形的说明 本股份期内。基金设有出现建筑二十个工作日基金份额持有人数值不满二百人或者基金 资产净值低于五千万元情况。

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。管理人接受总资者参求还值在托对受托资产地低价管理服务以及管理人发生的其他的价值保护 每行为,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、都适用商易计核力法。按照系统的迟收率缴纳增值税。未逾加且2016年1月1日起席行,对等 管产品在2016年1月1日间访营支持中发生的增值税应属行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴 物增值税的,已纳纳税从发管产品管理人以后月份的增值税应等缓和年级。

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 观、收益分是的思、财务会计程信任。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、 本基金2018 年年度财务会计报告已经立信会计师事务所、特殊普通合伙)审计,注册会计 师签字出员了信会师报平2019第2A30168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。 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

根報財政部、国家稅务总局財稅1200478 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)干放式证券投资基金 管理人运用基金实实股票。债券的差价收入继续晚记业所得税; 根据财政部、国家稅务总局财稅12005103 号文(关于股权分置过点改革有关税收政策问题的通知)的规定。股权分置改革申非适通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、观金等收入、把免证收流通股股东应缴纳的企业所得税; 据税财政部、国家保险分品财材的200811 号文(关于企业所得税等干代惠政策的通知)的规定、对证券投资基金从证券市场中取得的股份、包括东京荣股票、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,暂不证收企业所得税。

erwx人, 智光业双流週配股东应赖纳的个人所得税; 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:

(八人) (1970年10年10年11月17年11月17年11日月9日起,对储蓄存款利息所得售免征收个人所得税; 根据财政您、国家税务总局。中国证监会财税2012185 号文(关于安施上市公司股息红利 差价化人所得税政策有关问题的通知)的规定。自 2013 年 1 月 1 日 品。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,将股期职在 1 个月以下 6 1 个月)的,其股息红利 或物防开得器,持股期限超过 1 年的 智诚安 25 1 年(6 1 年 1 的) 智诚按 50%计入 应纳防开得器 持股期限超过 1 年的 智诚安 25%计入应纳税所得额。上述所得法一适用 20%的税率计证个人所得税; 根据财政策 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列 化个人所得税改集有关问题的通知》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

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

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

748.11 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。 748.12 债券交易

			31E 1	现中世:八氏	31117
	本期 2018年1月1日至2018年	F12月31日	上年度可比期 2017年2月13日(基金台 至2017年12月	合同生效日)	
关联方名称	成交金额	占当期债 券 成交总额 的比例	成交金額	占当期债券 成交总额的 比例	
中泰证券	-	-	112,763,725.00	100.00%	
7.4.8.1.3 债券回购	交易		金	额单位:人民	一
	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期 2017年2月13日(基金会 至2017年12月;		

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权证交易。 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

		单位:人民币:
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2月13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	15,787,309.52	14,809,688.23
其中:支付销售机构的 客户维护费	-	-
注:1、本基金的管理费拉	安前一日基金资产净值的0.15%	年费率计提。管理费的计算方法如

下:
H=E×0.15%-当年天数
H 为年日应计量的对象。管理效的月季月点,以为第一级等月效。管理效的月季月点,
H 为年日应计量的基金管理费
E 为前一日的基金资产净值
基金管理费包计量。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到政治净,基金往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。咨询法定节假日、公休假或不可抗力等,支付日期顺延。
2.本基金为本报告期内合同生效的基金,无上年度可比期间数据。
74822 基金托管费
单位:人民币元

本期 2018年1月1日至2018年12月31 日 2017年2月13日(基金合同生效日 至2017年12月31日

- 日基金资产净值的C 6%的任费率计想 托管费的计管方法加

7.4.8.2.3 销售服务费 获得销售服务费的 当期发生的基金应支付的销售服务费 万家现金增利货币

万家现金增利货币A 合计 万家基金管理有限公 上年度可比期间 2017年2月13日(基金合同生效日)至2017年12月31日 获得销售服务费的 各关联方名称 万家现金增利货币A

7/8卷頭百理用吸公司 878.13 879,547.10 880,428.23 合计 879,547.10 879,457.20 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

7.48.4 各关联方投资本基金的情况 7.48.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

项目	2018年1月1日至2	2018年12月31日
	万家现金增利货币A	万家现金增利货币B
基金合同生效日(2017年2 月13日)持有的基金份額	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	_
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
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	-	-
项目	上年度可 2017年2月13日(基金合同生	『比期间 上效日)至2017年12月31日
	万家现金增利货币A	万家现金增利货币B
基金合同生效日(2017年2 月13日)持有的基金份额	-	47,000,000.00
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	7,484.99	133,583.49
期间因拆分变动份额	-	_
减:期间赎回/卖出总份额	7,484.99	47,133,583.49
期末持有的基金份额	-	_

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 万家现金增利货币A

	李明末 2018年12月31日		上年度末 2017年12月31日		
关联方名称	持有的 基金份额	持有的基金份額 占基金总份額的 比例	持有的 基金份額	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	1,563.14	0.0000%	1,513.94	0.0000%	
	万家现	金增利货币B		份额单位	Z : f
	本期末 2018年12月31日		上年度 2017年12	芝末 月31日	

1.8.5 由美国	<b></b> 庆方保管的银行存	款余额及当期产生	的利息收入	单位:人民
关联方 名称	2018年1月1日至	以期 ≦2018年12月31日	上年度で 2017年2月13日(街 2017年1	可比期间 基金合同生效日)至
	期末余額	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浦发银行	523,596,773.70	4,789,058.30	3,889,104, 490.32	8,523,231.95

注: 本基金的银行存款由基金托管人上商商东发展银行股份有限公司保管,高期存款收银 门侧业和率计思,本基金2018年1月1日至12月31日存放于托管行的定期银行存款/生的利息收 人为640,76687元(2017年2月13日(基金合同主效日)至12月31日为2,170,833-22元),本期 未存放于托管行的定停银行存款余额000元(土年度太为2,000,000,0000元)。本基金的证券 发验局贷款企通过托管银行省价金账户均存于中国证券投记前每样银度任公司。2018年1月1日 至12月31日获得的利息收人为人民币353665.78元 ( 2017年2月13日 ( 基金合同生效日 ) 至12月 31日为人民币4,888.94元 ) ,2018年12月31日结算备付金余额为人民币23,680,909.09元 ( 201 12月31日为0.00元)。 7486 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7-43.6 本種並在本時期內蒙与大阪方庫市區外印河6克 本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期內直接购人关联方所承销的证券。 7-49 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及增发而流通受限证券 7.492 期末持有的暂时停除等流通受限股票 本基金本报告期末未持有暂时停除等流通受限股票。 7.493 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至本报告期末,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

. 74.9.3.2 交易所市场债券正回购 截至本报告期末, 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金融资产

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

公允行值计国际海州市明75年八日公公公公 是任度次大定 第一层次:相同资产或负债在沿跃市场上未经则整的报价。 第二层次:解等,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。 第二层次:相关资产或负债的不可观解输入值。 2.持续的以公允价值计量的金融工具

18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

于第二层次的余额为4,079,233,518.48元,无属于第一层次和第三层次的余额。2017年 12 月 31 日 属于第二层次的余额为529,416,496.13元,无属于第一层次和第三层次的余额。) (2)2分合价值所属层次的简单大变动 未整金率限及上度可比则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的未 未发生国大变动 未发生面大变动。
(3)第三层次公允价值企额和本期变动金额
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及上年度末均未 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
本基金本期末及上年度末均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资产和负债主要包括银行存款、结算各付金、存出保证金、买人逐 经金融运定。近如不同日以名任金融价值、甘服市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

资产支持证券

序号	项目	占基金资产净值的比例(9	6)
1	报告期内债券回购融资余额		1.18
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金額	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		

1	3070019	40.29	4.00
	其中: 剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	13.09	_
	其中: 剩余存续期超过397天的浮 动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	48.21	-
	其中: 剩余存续期超过397天的浮 动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	-	-
	其中: 剩余存续期超过397天的浮 动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	2.90	-
	其中: 剩余存续期超过397天的浮		-

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	值比例(%)
1	11187063 6	18中原银 行CD330	3,000,000	298,328,502.22	2.7
2	11182137 2	18渤海银 行CD372	3,000,000	298,276,494.63	2.7
3	11187167 2	18徽商银 行CD187	3,000,000	298,090,478.29	2.
4	11188492 6	18江西银 行CD093	3,000,000	298,088,776.85	2.
5	160208	16国开08	2,700,000	269,378,833.97	2.5
6	180407	18农发07	2,100,000	210,584,736.86	1.5
7	11188386 9	18华融湘 江银行 CD148	2,000,000	198,964,307.66	1.0
8	11187060 1	18盛京银 行CD540	2,000,000	198,875,935.02	1.5
9	11180409 5	18中国银 行CD095	2,000,000	198,821,372.67	1.5
10	11181562 4	18民生银 行CD624	2,000,000	198,800,667.10	1.5

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%。 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 本基金本报告期末未持有资产支持证券。 名 经资组合报告附注 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,即计价对象以买人成本列示,按照票面利率或协议利率每日 计提利息,并考虑其买人时的溢价和折价在其剩余期限内摊销,每日计提损益。 ANA、并为这具头人们的温矿林的可作共和宗则取内强相,每日计量领 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

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 其全投资的前十名证券由18由原银行CD390的发行主体由原银行股份有限公司 18徵商银行 藤並及敦田別甲了在近季中16年原康行7.03-33的及行主体中原康行3成7何線公司,16縣阿康行 20187的发行主体厳爾縣厅股份有限公司,18江西縣行60093的发行主体江西縣行股份有限公司,18华藤湘江银行CD148的发行主体华藤湘江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

1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	22,565,061.33
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	22,565,061.33
	§ 9 基金份	)额持有人信息
.1 期	末基金份额持有人户数及持有人结	构
		fel short-bif- f

26.168.2

3,018.6 家现金增 货币B

4 期末基金管理人的 1) 人员持有本开放式基金份额总量区 项目 持有基金份额总量的数量区间(万份) 本基金基金经理持有本开 放式基金

4,673.43 411,000,000.0 报告期期间基金拆分变动份额(份额减 '--'旗別)

§ 11 重大事件揭示 11.1 基金份额持有人大会决议

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 经期. 基金经理变更,2018年7月24日,公司增聘第元为万家现金增利货币市场基金的基金经理,与基金经理系媒束;同管理域基金。 基金任告人, 本居台期,上海南东发展银行股份有限公司(以下简称"公司")根据工作需要,任金孔建 大生旺任公司学行管团经免罪,并检查不管部组关工作。孔建先生的托管人高级管理人员 证据信息已经在中国证券投资基金业协会备案。

1.2 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

1.3 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

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

16 管理人 托管人及其高级管理人员受稽查动处罚等情况 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 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

备注 券商名称 成交金额 占当期股票 成交金额 成交总额的 比例 佣金 占当期佣金 总量的比例 中泰证券

(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

(2)具有整理型(1)1/mm1)2m3/x、生1/2m1/s/m1/r、201/x(2)是1/m2/x (2)具有整理型(1)加7/x (2)用2m2/x (2)T2m2/x (2)T2m 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 是好的服务和支持。 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、基金专用交易席位的变更情况:

11.72 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

(1)经营行为稳健规范,内控制度健全,在业内有良好的声誉;

占当期权 证 成交总额 的比例 券商名科 5当期债券 艾交总额6 比例 中泰证券

本基金本报告期内无偏离度绝对值超过0.5%(含)的情况

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

金额单位:人民币元

分额占比