万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金

2017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:2017年10月26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2017年11月25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2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家瑞丰灵活配置
基金主代码	001488
交易代码	001488
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月19日
报告期末基金份额总额	206,590,981.97份
投资目标	在有效控制投资组合风险的前提下,通过积极主动的资产配置,力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	基金管理人在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上,采取积极主动的投资管理策略,通过定性与定量分析,对利率变化趋势、债券收益率曲线移动方向、信用利差等影响固定收益投资品价格的因素进行评估,对不同投资品种运用不同的投资策略,并充分利用市场的非有效性,把握各类获利的机会。在信用风险可控的前提下,寻求组合流动性与收益的最佳配比,力求持续取得达到或超过业绩比较基准的收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%
风险收益特征	本基金是混合型基金,风险高于货币市场基金和债券型基金但低于股票型基金,属于中高风险、中高预期收益的证券投资基金。
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	万家瑞丰A / 万家瑞丰C
下属分级基金的交易代码	001488 / 001489
报告期末下属分级基金的份额总额	196,294,238.26份 / 10,296,743.71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(2017年7月1日 - 2017年9月30日)	
	万家瑞丰A	万家瑞丰C
1. 本期已实现收益	6,590,315.82	318,200.10
2. 本期利润	8,049,213.29	389,578.57
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0407	0.0384
4. 期末基金资产净值	226,862,059.36	11,535,633.68
5. 期末基金份额净值	1.1557	1.1203

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

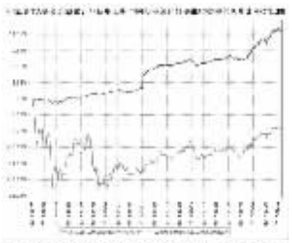
万家瑞丰A

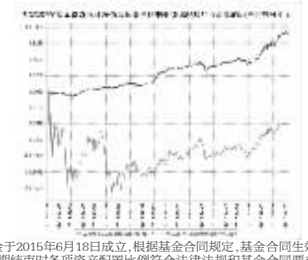
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.67%	0.24%	2.60%	0.29%	1.07%	-0.05%

万家瑞丰C

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	3.56%	0.24%	2.60%	0.29%	0.96%	-0.05%

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:本基金于2015年6月18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		
高翰昆	本基金基金经理,万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家现金宝货币型证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞和灵活配置混合型证券投资基金、万家融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、万家瑞旭灵活配置混合型证券投资基金、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、万家瑞隆灵活配置混合型证券投资基金、万家家泰债券型证券投资基金、万家永利债券型证券投资基金、万家盛鑫纯债债券型证券投资基金和万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金基金经理。	2015年6月19日	-	8年	基金经理,英国诺丁汉大学硕士,2000年7月加入万家基金管理有限公司,历任研究部助理、交易员、交易部总监助理、交易部副总监。

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

一季度市场的关键词应该是超预期。基本面上并没有出现市场此前预期的快速下行反而进出口超预期、pmi超预期、地产销售超预期、商品价格超预期,凡此总总皆显示经济自身具有较强的韧性。同时基本面的稳定也给监管及货币政策带来了较大的政策空间,于是我们看到了在货币政策及监管政策上的超预期,三会竞争性监管力度空前大超市场预期加之对流动性的担忧引发了4-5月的一轮股债双杀。但行至6月份,在强监管对市场价格反映较为充分后监管层在流动性预期管理上释放了较为温和的信号,据此股债两市均出现了一轮超跌反弹。

本基金二季度虽然预期到强监管对市场的不利影响却低估这种冲击的力度没能完全躲避开4-5月份的这轮回调,但此后在市场预期出现极度悲观及监管释放善意信号后积极右侧加大仓位参与了股债的这轮反弹,最终为客户创造了较好的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家瑞丰A基金份额净值为1.1557元,本报告期基金份额净值增长率为3.67%;截至本报告期末万家瑞丰C基金份额净值为1.1203元,本报告期基金份额净值增长率为3.56%;同期业绩比较基准收益率为2.60%。

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	权益投资	79,373,608.86	32.71
	其中:股票	79,373,608.86	32.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	141,208,315.70	58.19
	其中:债券	141,208,315.70	58.19
	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	15,200,142.50	6.26
	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	3,317,148.30	1.37
8	其他资产	3,572,654.01	1.47
9	合计	242,671,869.37	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	39,793.60	0.02
C	制造业	19,077,161.23	8.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	18,304,436.48	7.68
F	批发和零售业	26,385.45	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.01
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	30,143,884.82	12.64
K	房地产业	8,263,876.92	3.47
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	3,461,274.00	1.45
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	31,224.45	0.01
S	综合	-	-
	合计	79,373,608.86	33.29

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期无沪港通投资股票投资组合。

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

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	600340	华夏幸福	244,564	7,601,049.12	3.19
2	600745	闻泰科技	244,803	6,624,369.18	2.78
3	002310	东方园林	224,500	4,716,745.00	1.98
4	601336	新华保险	82,600	4,680,942.00	1.96
5	600491	龙元建设	410,700	4,657,338.00	1.95
6	601997	贵阳银行	264,937	3,897,223.27	1.63
7	601988	中国银行	842,362	3,470,531.44	1.46
8	601288	农业银行	902,780	3,448,619.60	1.45
9	600036	招商银行	112,837	2,882,985.35	1.21
10	600584	长电科技	153,997	2,664,148.10	1.12

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	15,079,500.00	6.33
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,996,700.00	1.26
	其中:政策性金融债	2,996,700.00	1.26
4	企业债券	23,557,337.70	9.88
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	60,176,000.00	25.24
7	可转债(可交换债)	832,778.00	0.35
8	同业存单	38,566,000.00	16.18
9	其他	-	-
10	合计	141,208,315.70	59.23

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111699222	16唐山银行CD017	300,000	29,016,000.00	12.17
2	101554069	15陇斯特旅MTN001	200,000	20,234,000.00	8.49
3	101559041	15郑州热力MTN002	200,000	20,022,000.00	8.40
4	101560057	15陕旅集MTN001	200,000	19,920,000.00	8.36
5	019557	17国债03	100,000	9,981,000.00	4.19

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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,本基金暂不可投资于国债期货。

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	85,095.83
2	应收证券清算款	500,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	2,986,438.52
5	应收申购款	1,119.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,572,654.01

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600584	长电科技	2,664,148.10	1.12	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	万家瑞丰A	万家瑞丰C
报告期期初基金份额总额	224,200,137.66	10,031,734.24
报告期期间基金总申购份额	249,187.36	518,166.59
减:报告期期间基金总赎回份额	28,155,086.76	253,157.52
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	196,294,238.26	10,296,743.71

§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

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申赎及买卖本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申赎及买卖本基金的情况。

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170701-20170930	92,446,149.58	0.00	0.00	92,446,149.58	44.75%
	2	20170701-20170930	92,548,819.99	0.00	0.00	92,548,819.99	44.80%
产品特有风险							
报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过20%的情况。未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回,基金管理人可能无法及时变现基金资产,可能对基金份额净值产生一定的影响;极端情况下可能引发基金的流动性风险,发生暂停赎回或延缓支付赎回款项;若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元,还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

§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、《万家瑞丰灵活配置混合型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及更新招募说明书及其他临时公告。

5、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金2017年第三季度报告原文。

6、万家基金管理有限公司董事会决议。

7、《万家瑞丰灵活配置混合型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
2017年10月26日

万家现金增利货币市场基金

2017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:上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月26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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月25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2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家现金增利货币
基金主代码	004169
交易代码	004169
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年2月13日
报告期末基金份额总额	10,237,525,569.00份
投资目标	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。
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、回购套利策略、息差策略、息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
下属分级基金的基金简称	万家现金增利A / 万家现金增利B
下属分级基金的交易代码	004169 / 004170
报告期末下属分级基金的份额总额	10,236,995,476.05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(2017年7月1日 - 2017年9月30日)	
	万家现金增利A	万家现金增利B
1. 本期已实现收益	4,249.72	103,779,928.51
2. 本期利润	4,249.72	103,779,928.51
3. 期末基金资产净值	530,082.96	10,236,995,476.05

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

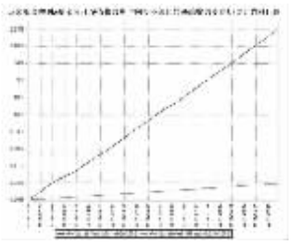
万家现金增利A

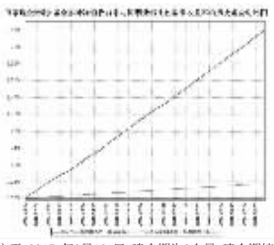
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9759%	0.0008%	0.0882%	0.0000%	0.8877%	0.0008%

万家现金增利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	1.0242%	0.0008%	0.0882%	0.0000%	0.9360%	0.0008%

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2月13 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。

§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		
苏谋东	本基金基金经理,万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家颐和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、万家年年恒祥定期开放债券型证券投资基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家年年恒享定期开放债券型证券投资基金、万家鑫通纯债债券型证券投资基金、万家鑫稳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、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、万家瑞债券型证券投资基金基金经理。	2017年2月13日	-	5年	经济学硕士,CFA,2008年7月至2013年2月在宝钢集团财务有限公司从事固定收益投资研究工作,担任投资经理助理。2013年3月加入万家基金管理有限公司。

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

2017年三季度国内经济继续保持平稳较快增长,投资、消费和进出口同比数据的波动不大,总体较为稳定。三季度国内货币政策总体中性,央行削峰填谷管理流动性,因而,整体利率水平也较为平稳,标杆性的十年国债在非常窄的空间内震荡。三季度金融对实体的支持力度仍旧不弱,信贷和社融数据如论是总量还是累计同比都处于较高水平。受供给侧改革和经济需求复苏的双向推动,国内主要商品和工业品价格继续走高,PPI同比保持高位。但是,由于食品价格低迷,CPI仍保持在较低水平。

三季度国内债市收益率窄幅波动,金融监管政策较少且较为缓和,货币政策保持中性,资金面波动不大。三季度信用利差继续保持低位,由于资金面总体不紧不松,市场杠杆水平有所提升。

预计四季度宏观经济继续延续L型走势,投资、消费和进出口都继续保持平稳。从货币政策和监管层面看,经过央行不断的窗口指导后,市场对货币政策的预期逐步稳定,对监管的力度和意图的适应程度也在提高,但是金融去杠杆仍在途中,仍需关注监管政策对债券市场的影响。预计四季度货币政策会继续保持中性,不紧不松。影响市场的主要因素将从政策转移到基本面上来,本基金将予以持续关注。本基金将继续做好信用风险管理和流动性管理,积极关注市场机会,为持有人获取较好的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期万家现金增利A的基金份额净值收益率为0.9759%,本报告期万家现金增利B的基金份额净值收益率为1.0242%,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	3,331,861,713.59	32.22
	其中:债券	3,331,861,713.59	32.22
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	856,534,478.79	8.28
	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	6,135,084,979.75	59.33
4	其他资产	17,844,354.80	0.17
5	合计	10,341,325,526.93	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	0.35	
	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	100,699,728.96	0.98
	其中:买断式回购融资	-	-

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	77
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	79
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	10

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	7.93	0.99
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	0.97	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	87.35	-
	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)	4.58	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	100.84	0.99

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	518,929,990.61	5.07
	其中:政策性金融债	518,929,990.61	5.07
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,812,931,722.98	27.48
8	其他	-	-
9	合计	3,331,861,713.59	32.55
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	111710502	17兴业银行CD502	10,000,000	989,856,868.98	9.67
2	111785862	17盛京银行CD267	5,000,000	494,811,741.80	4.83
3	170204	17国开04	3,400,000	338,670,334.89	3.31
4	111784688	17天津银行CD188	3,000,000	297,357,924.29	2.90
5	111710459	17兴业银行CD459	2,000,000	198,385,790.17	1.94
6	111711229	17平安银行CD229	2,000,000	198,374,835.60	1.94
7	111785411	17成都农商银行CD027	2,000,000	198,010,448.11	1.93
8	111714112	17江苏银行CD112	1,500,000	148,503,636.63	1.45
9	111712127	17北京银行CD127	1,000,000	99,191,185.49	0.97
10	150207	15国开07	700,000	70,200,395.04	0.69

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	0.0281%
报告期内偏离度的最低值	-0.0033%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0167%

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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,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	14,921.50
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	17,829,433.30
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	17,844,354.80

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	万家现金增利A	万家现金增利B
报告期期初基金份额总额	287,808.86	10,133,215,547.54
报告期期间基金总申购份额	483,404.98	104,222,073.77
报告期期间基金总赎回份额	241,130.89	442,145.26
报告期期末基金份额总额	530,082.96	10,236,995,476.05

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170701-20170930	10,132,011,738.85	102,467,327.70	-	10,234,479,066.55	99.99%
产品特有风险							
报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过20%的情况。未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回,基金管理人可能无法及时变现基金资产,可能对基金份额净值产生一定的影响;极端情况下可能引发基金的流动性风险,发生暂停赎回或延缓支付赎回款项;若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元,还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

§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现金增利货币市场基金发行及募集的文件。

2、《万家现金增利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媒介上公开披露的基金净值及其他临时公告。

5、万家现金增利货币市场证券投资基金2017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、《万家现金增利货币市场基金托管协议》。

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
2017年10月26日

万家玖盛纯债9个月定期开放债券型证券投资基金

2017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:广发银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月26日

§1 重要提示