万家货币市场证券投资基金

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:华夏银行股份有限公司
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。

基金托管人华夏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	万家货币	
基金主代码	519508	
交易代码	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	10,424,936,330.95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	470,887,664.51份
万家货币B	519507	9,725,405,994.93份
万家货币R	519501	34,048,782.27份
万家货币E	000764	194,593,889.24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(2017年7月1日 - 2017年9月30日)	万家货币A	4,458,136.63	4,458,136.63	470,887,664.51
	万家货币B	92,980,533.46	92,980,533.46	9,725,405,994.93
	万家货币R	341,893.42	341,893.42	34,048,782.27
	万家货币E	1,824,984.30	1,824,984.30	194,593,889.24

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	0.9317%	0.0007%	0.0882%	0.0000%	0.8435%	0.0007%

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	0.9926%	0.0007%	0.0882%	0.0000%	0.9044%	0.0007%

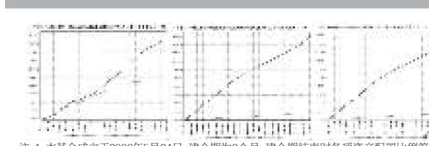
万家货币R

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	0.9952%	0.0007%	0.0882%	0.0000%	0.9070%	0.0007%

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	0.9698%	0.0007%	0.0882%	0.0000%	0.8816%	0.0007%

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		
唐俊杰	本基金基金经理,万家稳健增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、万家鑫安纯债债券型基金、万家鑫璟纯债债券型基金、万家家享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基金经理。	2011年11月5日	2017年9月30日	9年	基金经理,硕士。2008年7月至2011年9月在金元证券股份有限公司固定收益总部从事固定收益投资研究工作,担任投资经理职务。2011年9月加入万家基金管理有限公司,2017年9月因个人原因离职。
陈佳昀	本基金基金经理、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家家盛债券型证券投资基金、万家家泰债券型证券投资基金、万家添利债券型证券投资基金(LOF)、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、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家天添宝货币市场基金基金经理。	2017年6月28日	-	6	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月在财达证券工作,先后担任固定收益部经理助理、资产管理部投资经理岗位。2015年12月至2017年4月在平安证券工作,担任资产管理部投资经理岗位。2017年4月进入我公司工作。

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

2017年三季度,经济基本面平稳向好,地产、基建等传统经济增长动力在减速,服务业、高技术产业等新兴经济增长动力在加速。经济增速较上半年略有放缓,仍然处于近年来高位。供给侧改革推动大宗商品价格上涨,上游价格上涨逐步向下游传导,核心通胀继续上行。

政府保持了去杠杆和严监管的政策态势,金融体系向实体经济的融资保持较高水平,金融体系内部空转减速,表现为全社会融资总量增速平稳,M2增速持续下行。资金面保持紧平衡,整体利率中枢抬升。

本基金在三季度的操作中,较好地保持了组合的流动性,组合收益随市场资金利率起落正向波动,整体组合久期保持偏短。在资金紧张时点,通过配置存单、逆回购、存款等,提高了组合整体收益率。

展望2017年四季度,我们预计经济基本面平稳向好的态势有望延续,结构性改革的成效将逐步显现,经济增速将保持在近年来较高的水平。关注外部利率可能的上升对国内利率的传导,美国税改的推进、美联储主席人选、原油价格上升,将会是外部风险的来源。国内强监管措施陆续出台,也将会给资金面带来扰动。

四季度,我们将继续投资高评级高流动性资产,把保持组合流动性摆在第一位。在保证能够应对流动性风险的基础上,择机参与存单和利率债的波段交易,进一步提高投资者回报。

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0.9317%,本报告期万家货币B的基金份额净值收益率为0.9926%,本报告期万家货币R的基金份额净值收益率为0.9952%,本报告期万家货币E的基金份额净值收益率为0.9698%,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	2,747,354,996.92	26.30
	其中:债券	2,747,354,996.92	26.30
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	4,605,705,277.27	44.09
	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	3,057,606,695.44	29.27
4	其他资产	36,290,080.77	0.35
5	合计	10,446,957,050.40	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	0.82	
	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	52
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	63
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	43

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	55.80	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	17.17	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	14.92	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	2.76	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	9.21	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.86	-

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	8,485,504.53	0.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	536,210,216.05	5.14
	其中:政策性金融债	536,210,216.05	5.14
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,202,659,276.34	21.13
8	其他	-	-
9	合计	2,747,354,996.92	26.35
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	111795119	17杭州银行CD090	2,000,000	199,839,885.45	1.92
2	111719290	17恒丰银行CD290	2,000,000	198,301,547.52	1.90
3	111784795	17宁波银行CD174	2,000,000	198,202,501.85	1.90
4	111681045	16杭州银行CD192	1,500,000	149,070,082.84	1.43
5	130238	13国开38	1,330,000	133,887,808.47	1.28
6	111698940	16徽商银行CD100	1,000,000	99,679,818.34	0.96
7	111680787	16合肥科技农村商行CD034	1,000,000	99,480,962.90	0.95
8	111783351	17厦门国际银行CD144	1,000,000	99,378,834.60	0.95
9	111719276	17恒丰银行CD276	1,000,000	99,283,644.45	0.95
10	111793091	17广州农村商业银行CD032	1,000,000	98,040,656.46	0.94

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	0.0087%
报告期内偏离度的最低值	-0.0115%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0048%

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	24,413.94
2	应收证券清算款	15,827.41
3	应收利息	28,155,984.15
4	应收申购款	8,093,855.27
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	36,290,080.77

§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	-	492,490,624.81	116,787,466.77	138,390,427.07	470,887,664.51
万家货币B	-	10,134,607,265.58	12,566,148,891.36	12,975,350,162.01	9,725,405,994.93
万家货币R	-	21,772,799.24	22,280,035.54	10,004,052.51	34,048,782.27
万家货币E	-	174,725,781.46	309,546,242.00	289,678,134.22	194,593,889.24

§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及其他临时公告。

5、万家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
2017年10月26日

万家中证红利指数证券投资基金(LOF)

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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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。

本报告中的财务数据未经审计。

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	60,140,871.52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,在正常市场情况下,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(2017年7月1日 - 2017年9月30日)
1.本期已实现收益	1,504,489.74
2.本期利润	4,651,994.80
3.加权平均基金份额本期利润	0.0778
4.期末基金资产净值	100,380,742.96
5.期末基金份额净值	1.6691

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。

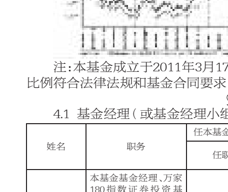
2、上表中本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	4.90%	0.50%	3.05%	0.49%	1.85%	0.01%

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	本基金基金经理、万家180指数证券投资基金、万家中证创业成长指数分级证券投资基金、万家上证50交易型开放式指数证券投资基金、万家瑞旭灵活配置混合型证券投资基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞债券型证券投资基金的基金经理、量化投资部总监。	2015年8月18日	-	7	硕士研究生。2008年进入上海双隆投资管理有限公司,任金融工程师;2010年进入上海尚雅投资管理有限公司,从事高级量化分析师工作;2010年10月进入国泰基金管理有限公司,历任产品开发、专户投资经理助理等职务;2014年4月进入广发证券担任投资经理职务;2014年11月进入中融基金管理有限公司担任产品开发部总监职务;2015年4月加入本公司,现任量化投资部总监
朱小明	本基金基金经理、万家180指数证券投资基金、万家中证创业成长指数分级证券投资基金、万家上证50交易型开放式指数证券投资基金基金经理。	2017年4月8日	-	5	硕士研究生,2012年7月至2014年7月在国泰基金管理有限公司担任研究员职务。2014年7月至2016年6月在德骏达隆(上海)资产管理有限公司担任投资经理助理职务。2016年6月进入我公司,先后担任投资经理助理、基金经理助理职务。

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

2017年第三季度,尽管经济数据尚未完全公布,但从已有数据来看,前三季度经济表现优于年初预期,反映当前经济韧性较强。大盘虽偶有回调,但在钢铁、有色、煤炭、化工等强周期板块以及锂电池、混改等热点概念的轮番带领下,市场延续了5月下旬以来的上涨趋势。风格方面,受益于业绩改善以及改革红利,价值蓝筹股依旧强势,而中小创也在短期探底后伴随着市场情绪修复和风险偏好提升取得明显反弹。展望第四季度,海外市场总体处于通胀偏弱经济向好时期,国内经济温和放缓,以稳为主。经济表现超预期,"积极财政+货币中性+防风险+促改革"仍是基本政策取向,供给侧改革、国企改革、地产调控和长效机制建设等仍会继续推进,符合改革目标、基本面和盈利均有改善的标的有望获得较好的市场表现。

本基金作为被动投资型的指数基金,其投资目标是通过跟踪、复制中证红利指数,为投资者获取股票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,采取了完全复制方法进行投资管理,努力拟合标的指数,减小跟踪误差。

报告期内,本基金采用有效的量化跟踪技术,将基金跟踪误差控制在较低范围内。跟踪误差主要是由于基金申购赎回、成分股分红、各类费用等因素所造成。

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1.6691元;本报告期基金份额净值增长率为4.90%,业绩比较基准收益率为3.05%。

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	95,447,224.30	94.46
	其中:股票	95,447,224.30	94.46
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	5,564,541.22	5.51
8	其他资产	31,337.59	0.03
9	合计	101,043,103.11	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	2,869,754.76	2.86
C	制造业	42,928,414.36	42.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,039,345.97	12.99
E	建筑业	1,496,746.61	1.49
F	批发和零售业	916,014.11	0.91
G	交通运输、仓储和邮政业	7,910,599.45	7.88
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	20,747,175.91	20.67
K	房地产业	4,932,829.04	4.91
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	94,840,880.21	94.48

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	27,199.83	0.03
C	制造业	351,315.42	0.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	24,362.61	0.02
F	批发和零售业	26,385.45	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	0.02
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	115,299.99	0.11
R	文化、体育和娱乐业	18,740.85	0.02
S	综合	-	-
	合计	606,344.09	0.60

5.2.3 报告期末按行业分类的沪港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	797,674	3,286,416.88	3.27
2	000651	格力电器	76,192	2,887,676.80	2.88
3	000895	双汇发展	91,000	2,265,900.00	2.26
4	600104	上汽集团	73,154	2,208,519.26	2.20
5	600660	福耀玻璃	79,349	2,022,606.01	2.01
6	600741	华域汽车	87,741	1,978,559.55	1.97
7	601398	工商银行	325,447	1,952,682.00	1.95
8	601006	大秦铁路	206,039	1,802,841.25	1.80
9	600066	宇通客车	71,597	1,761,286.20	1.75
10	601288	农业银行	450,995	1,722,800.90	1.72

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	603882	金域医学	2,763	115,299.99	0.11
2	603106	恒银金融	2,786	84,025.76	0.08
3	603055	台华新材	2,658	62,489.58	0.06
4	603321	梅轮电梯	2,725	54,309.25	0.05
5	603386	广东骏亚	1,644	41,823.36	0.04

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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	9,828.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,141.33
5	应收申购款	20,367.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,337.59

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

5.11.6 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。

5.11.7 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

报告期期初基金份额总额	57,998,873.33
报告期期间基金总申购份额	4,688,947.93
减:报告期期间基金总赎回份额	2,546,949.74
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	60,140,871.52

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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

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	28,797,041.69	1,227,201.06	-	30,024,242.75	49.92%
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)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
2017年10月26日

万家现金宝货币市场证券投资基金

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	2,780,446,275.66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	2,258,512,493.62份	521,933,782.04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)	
	万家现金宝A	万家现金宝B
1. 本期已实现收益	29,205,279.27	5,187,216.77
2. 本期利润	29,205,279.27	5,187,216.77
3. 期末基金资产净值	2,258,512,493.62	521,933,782.04

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

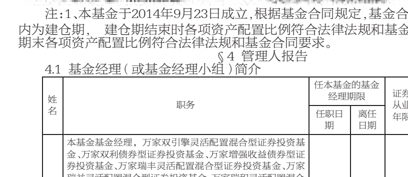
万家现金宝A

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	0.9633%	0.0006%	0.0882%	0.0000%	0.8751%	0.0006%

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	0.7412%	0.0004%	0.0652%	0.0000%	0.6760%	0.0004%

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		
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、万家瑞丰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和、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、万家家盛债券型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金基金经理。	2015年10月17日	-	8年	基金经理,英国诺丁汉大学硕士,2009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

三季度债市整体表现较为平稳则收益率以高位震荡为主。前期压制债市的流动性及监管问题边际上有所改善,监管政策在二季度密集出台后并未在三季度继续加强市场开始出现监管放松的预期,资金面上因为央行干预频次的增加预期管理的运用并未造成流动性危机,但时紧时松的紧平衡状态加之市场预期的不稳反而导致波动加剧。基本面上则显得波澜不惊边际上对市场的影响并未放大。

本基金本季度在预判市场流动性波动规律的前提下,调整组合现金流分布情况以适应市场利率变化节奏。本产品规避了几轮资金利率趋紧带来的潜在风险并基本把握住了这几次波动,在资金利率高位拉长久期并选择性价比相对较高的银行同业存单作为主力配置品种,为客户创造了较好的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本本报告期万家现金宝A的基金份额净值收益率为0.9633%,本报告期万家现金宝B的基金份额净值收益率为0.7412%,同期业绩比较基准收益率万家现金宝A为0.0882%,万家现金宝B为0.0652%。

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	1,356,988,913.43	40.27
	其中:债券	1,356,988,913.43	40.27
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	690,501,915.75	20.49
	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	1,309,862,183.36	38.88
4	其他资产	11,997,167.61	0.36
5	合计	3,369,350,180.15	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	3.58	
	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	586,891,159.66	21.11
	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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
1	2017年7月1日	20.61	-	-
2	2017年7月2日	20.60	-	-
3	2017年9月29日	21.11	-	-
4	2017年9月30日	21.11	-	-

注: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	103
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	107
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	32

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限	原因	调整期

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	31.01	21.11
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	29.44	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	23.98	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	1.08	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	35.23	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		120.74	21.11

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	21,264,696.73	0.76
2	央行票据	-	-
3	金融债券	185,697,096.35	6.68
	其中:政策性金融债	185,697,096.35	6.68
4	企业债券	19,857,995.69	0.71
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,130,169,124.66	40.65
8	其他	-	-
9	合计	1,356,988,913.43	48.80
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	111719297	17恒丰银行CD297	2,800,000	267,741,963.12	9.63
2	111719296	17恒丰银行CD296	2,000,000	193,542,121.24	6.96
3	170207	17国开07	1,010,000	100,848,583.02	3.63
4	111785624	17天津农村商业银行CD227	1,000,000	97,785,161.28	3.52
5	111784711	17盛京银行CD241	600,000	59,457,116.31	2.14
6	111799264	17中原银行CD118	500,000	49,537,596.08	1.78
7	111785445	17天津银行CD196	500,000	49,511,345.57	1.78
8	111780378	17广东南粤银行CD093	500,000	49,448,934.72	1.78
9	111785686	17桂林银行CD136	500,000	48,892,580.66	1.76
9	111785660	17锦州银行CD273	500,000	48,892,580.66	1.76
10	170204	17国开04	350,000	34,869,998.07	1.25

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	0.0380%
报告期内偏离度的最低值	-0.0078%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0162%

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。

5.8.1

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。

5.8.2

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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,116.70
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	11,992,050.91
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	11,997,167.61

§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	1,962,797,449.38	-
报告期期间基金总申购份额	21,479,512,720.72	1,366,147,445.61
报告期期间基金总赎回份额	21,183,797,676.48	844,213,663.57
报告期期末基金份额总额	2,258,512,493.62	521,933,782.04

§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	申购	2017年7月25日	3,000,000.00	3,000,000.00	0.00%
2	红利发放	2017年7月26日	329.57	329.57	0.00%
3	红利发放	2017年7月27日	332.11	332.11	0.00%
4	红利发放	2017年7月28日	336.21	336.21	0.00%
5	红利发放	2017年7月31日	1,023.36	1,023.36	0.00%
6	红利发放	2017年8月1日	342.84	342.84	0.00%
7	红利发放	2017年8月2日	332.13	332.13	0.00%
8	红利发放	2017年8月3日	341.23	341.23	0.00%
9	红利发放	2017年8月4日	329.93	329.93	0.00%
10	红利发放	2017年8月7日	968.05	968.05	0.00%
11	红利发放	2017年8月8日	318.40	318.40	0.00%
12	红利发放	2017年8月9日	319.45	319.45	0.00%
13	红利发放	2017年8月10日	312.36	312.36	0.00%
14	红利发放	2017年8月11日	311.57	311.57	0.00%
15	红利发放	2017年8月14日	929.11	929.11	0.00%
16	红利发放	2017年8月15日	342.22	342.22	0.00%
17	赎回	2017年8月16日	-3,006,526.32	-3,006,526.32	0.00%
18	赎回	2017年8月16日	-342.22	-342.22	0.00%
合计			0.00	0.00	

§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

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。

-

§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及其他临时公告。

5、万家现金宝货币市场证券投资基金2017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
2017年10月26日