

# 万家日日薪货币市场证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本半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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 28 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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>6</b>
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
<b>§4 管理人报告</b>	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
<b>§5 托管人报告</b>	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>18</b>
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	20

6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 债券回购融资情况.....	41
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	42
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
7.6 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.....	43
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	44
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	44
7.9 投资组合报告附注.....	44
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>46</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	46
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>48</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
10.2 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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	50
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>51</b>
11.1 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.....	51
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>52</b>
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52

12.3 查阅方式.....52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	万家日日薪货币市场证券投资基金		
基金简称	万家日日薪		
基金主代码	519511		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013 年 1 月 15 日		
基金管理人	万家基金管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	213,997,880.53 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称:	万家日日薪 A	万家日日薪 B	万家日日薪 R
下属分级基金的交易代码:	519511	519512	519513
报告期末下属分级基金的份额总额	40,754,649.08 份	173,243,231.45 份	0.00 份

注：2014 年 5 月 16 日，本基金转型为货币市场基金，转型后本基金设三类基金份额：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。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在力保本金安全性和基金资产流动性的基础上，追求超过业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金主要为投资者提供短期现金管理工具，因此本基金最主要的投资策略是在保持安全性和流动性的前提下尽可能提升组合的收益。基金管理人根据对宏观经济走势、国家货币政策、资金供求、利率期限结构变动趋势等的研究与判断，预测货币市场利率水平，确定投资组合的平均剩余期限。本基金控制整个投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天。
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，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		万家基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	林葛
	联系电话	021-38909626	010-66060069
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	tgxxpl@abchina.com

客户服务电话	95538 转 6、4008880800	95599
传真	021-38909627	010-68121816
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	200122	100031
法定代表人	方一天	周慕冰

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.wjasset.com">http://www.wjasset.com</a>
基金半年度报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）基金管理人办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区太平桥大街 17 号

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	万家日日薪 A	万家日日薪 B	万家日日薪 R
3.1.1 期间数据和指标	报告期( 2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日 )	报告期( 2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)	报告期( 2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,076,816.38	3,374,956.52	-
本期利润	1,076,816.38	3,374,956.52	-
本期净值收益率	1.6213%	1.7433%	0.0000%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2017 年 6 月 30 日 )		
期末基金资产净值	40,754,649.08	173,243,231.45	-
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	-
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2017 年 6 月 30 日 )		
累计净值收益率	15.1979%	11.0885%	0.0000%

注：1、本基金收益分配按月结转份额。

2、本基金无持有人申购、赎回的交易费用。

3、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。

4、2014 年 5 月 16 日，本基金转型为货币市场基金，转型后本基金设三类基金份额：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。

5、自 2014 年 5 月 16 日转型以来，万家日日薪 R 类基金份额始终为 0，因此无累计收益数据。

#### 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

万家日日薪 A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.3074%	0.0007%	0.0288%	0.0000%	0.2786%	0.0007%
过去三个月	0.8859%	0.0008%	0.0873%	0.0000%	0.7986%	0.0008%
过去六个月	1.6213%	0.0014%	0.1736%	0.0000%	1.4477%	0.0014%



过去一年	2.9199%	0.0030%	0.3500%	0.0000%	2.5699%	0.0030%
过去三年	10.0508%	0.0075%	1.0510%	0.0000%	8.9998%	0.0075%
自基金合同生效起至今	15.1979%	0.0068%	2.8899%	0.0013%	12.3080%	0.0055%

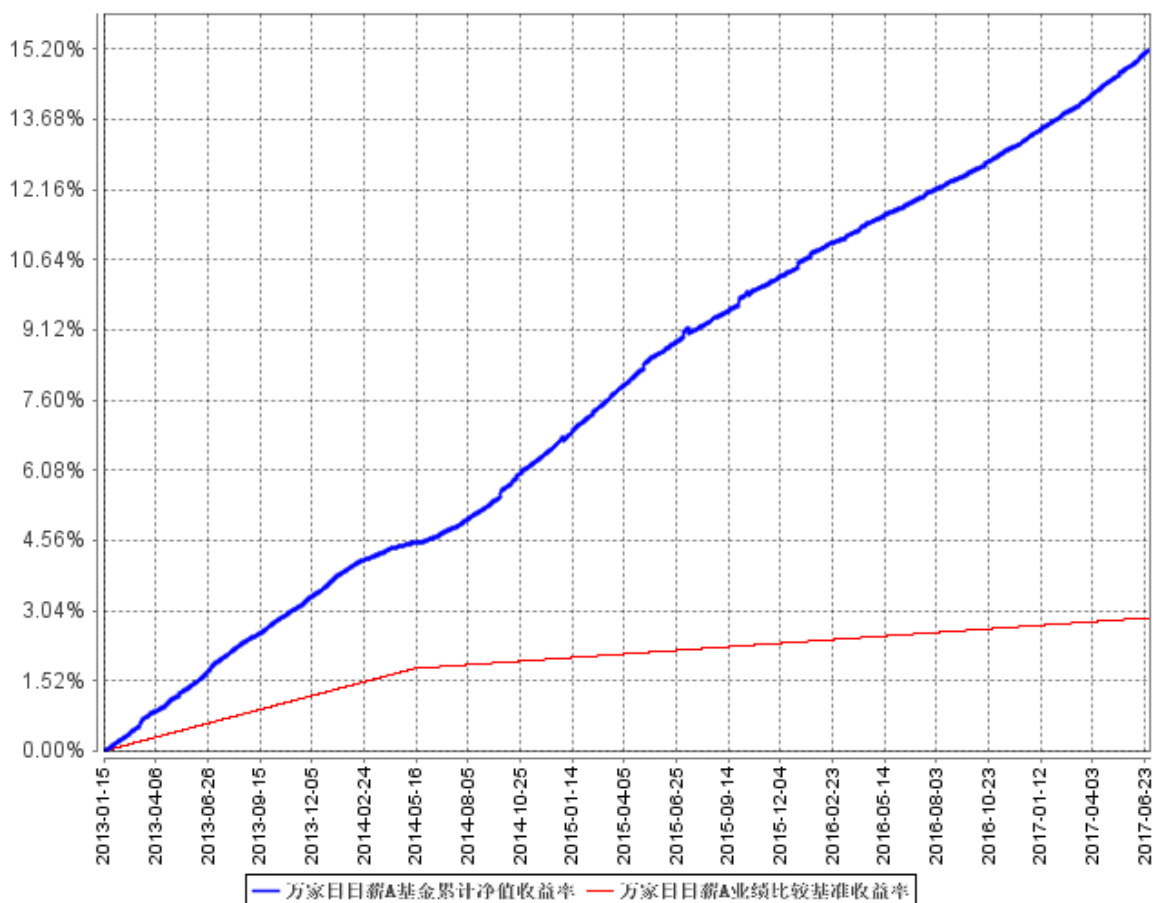
万家日日薪 B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.3272%	0.0007%	0.0288%	0.0000%	0.2984%	0.0007%
过去三个月	0.9462%	0.0008%	0.0873%	0.0000%	0.8589%	0.0008%
过去六个月	1.7433%	0.0014%	0.1736%	0.0000%	1.5697%	0.0014%
过去一年	3.1666%	0.0030%	0.3500%	0.0000%	2.8166%	0.0030%
过去三年	10.8450%	0.0075%	1.0510%	0.0000%	9.7940%	0.0075%
自基金合同生效起至今	11.0885%	0.0074%	1.0960%	0.0000%	9.9925%	0.0074%

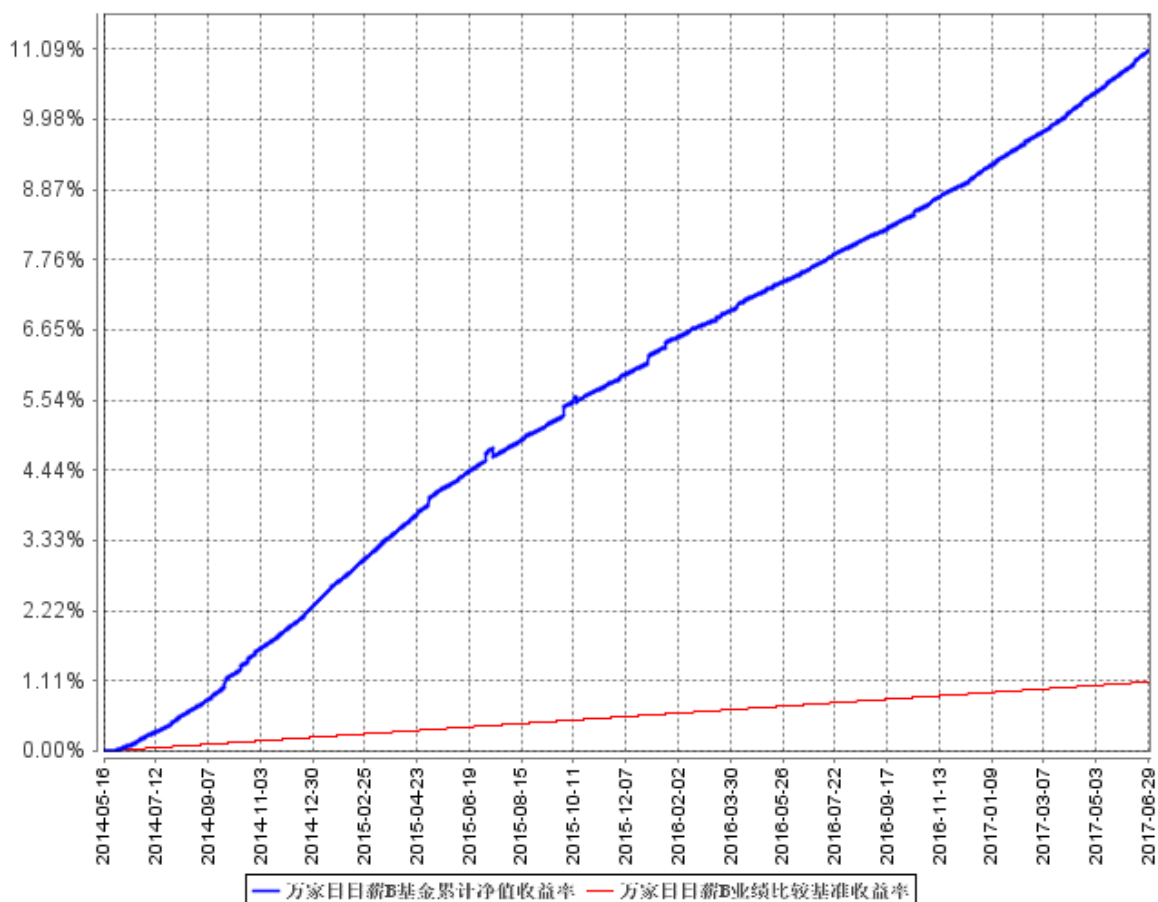
注：本基金转型为货币市场基金前，业绩比较基准为 7 天通知存款税后利率。2014 年 5 月 16 日，本基金转型为货币市场证券投资基金，转型后本基金设三类基金份额：A 类基金份额、B 类基金份额和 R 类基金份额，并采用银行活期存款利率（税后）为业绩比较基准。

### 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

万家日日薪A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



万家日日薪B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金成立于 2013 年 1 月 15 日，建仓期为本《基金合同》生效之日（2013 年 1 月 15 日）起两周，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、2014 年 5 月 16 日，本基金转型为货币市场基金，转型后本基金设三类基金份额：A 类基金份额、B 类基金份额和 R 类基金份额，其中 B 类基金份额的指标计算自分类实施日（2014 年 5 月 16 日）算起，报告期内 R 类基金份额为 0，因此无收益数据。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 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,住所地址为中国(上海)自由贸易试验区浦电路360号8层(名义楼层9层),办公地址为中国(上海)自由贸易试验区浦电路360号8层(名义楼层9层),注册资本1亿元人民币。目前管理四十九只开放式基金,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)、万家货币市场证券投资基金、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)、万家中证创业成长指数分级证券投资基金、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、万家瑞旭灵活配置混合型证券投资基金、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、万家鑫通纯债债券型证券投资基金、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、万家瑞隆灵活配置混合型证券投资基金、万家恒景18个月定期开放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。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理（助理）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、万家添利债券型证券投资基金（LOF）、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、万家年年恒荣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、万家恒景 18 个月定期开放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、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家现金增利货币市场基金基金经理	2013 年 8 月 8 日	-	9 年	复旦大学经济学硕士，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，担任投资经理职务。2013 年加入万家基金管理有限公司，现任固定收益部副总监。
陈佳昀	本基金基金经理、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基金经理。	2017 年 6 月 5 日	-	6 年	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合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 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，执行交易系统内的公平交易程序；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 管理人对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

2017 年上半年，经济基本面平稳向好，供给侧改革推升大宗商品价格上涨。政府去杠杆的决心强，监管态度趋严，货币增速下降。央行货币政策态度趋紧，银行超额准备金率下降，资金面波动加剧，短期资金利率淡季不落，旺季更紧。

本基金上半年操作中，较好地预判了市场趋紧的局面，在季末前后月末前后安排了较多资产到期，整体组合久期保持偏短，较好地应对了产品规模的变化。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。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期万家日日薪 A 基金净值收益率为 1.6213%，同期业绩比较基准收益率为 0.1736%；万家日日薪 B 基金净值收益率为 1.7433%，同期业绩比较基准收益率为 0.1736%；万家日日薪 R 类基金份额本报告期份额为 0，因此无收益数据。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年下半年，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。国内外大宗商品供给收缩，将继续改善资源品基本面，大宗商品价格上升将逐步传导，下游价格面临一定上涨压力。主要的风险来自于国际政治冲突，引发贸易摩擦加剧，从而对外需带来负面影响。经历了上半年的调整后，收益率曲线短端已经处于历史较高水平，进一步上行空间有限。

基于上述判断，下半年我们将投资高评级高流动性资产，适当提高组合久期。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。

#### 4.6 管理人对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。估值委员会由督察长、基金运营部负责人、合规稽核部负责人、权益投资部负责人、固定收益部负责人等组成。估值委员会的成员均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,熟悉政策法规,并具有丰富的实践经验。

##### 2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论,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的性质与程度

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金每日计算分配收益,按月集中支付。本报告期内本基金应分配利润 4,451,772.90 元,本报告期内本基金已分配利润 4,451,772.90 元。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

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 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管万家日日薪货币市场证券投资基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《万家日日薪货币市场证券投资基金基金合同》、《万家日日薪货币市场证券投资基金托管协议》的约定，对万家日日薪货币市场证券投资基金管理人——万家基金管理有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，万家基金管理有限公司在万家日日薪货币市场证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，万家基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的万家日日薪货币市场证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：万家日日薪货币市场证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	69,955,429.29	198,598,272.16
结算备付金		-	48,501.44
存出保证金		1,164.37	648.36
交易性金融资产	6.4.7.2	67,496,403.00	139,935,526.54
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		67,496,403.00	139,935,526.54
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	76,000,150.00	577,709,892.58
应收证券清算款		5,071.23	-
应收利息	6.4.7.5	919,254.19	1,073,151.02
应收股利		-	-
应收申购款		269,165.48	423,234,223.46
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		214,646,637.56	1,340,600,215.56
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	30,399,754.40
应付证券清算款		-	296,000,000.00
应付赎回款		3,435.30	36,073.89
应付管理人报酬		73,872.07	95,026.68
应付托管费		22,385.47	28,795.99
应付销售服务费		10,743.99	24,391.42
应付交易费用	6.4.7.7	10,780.70	14,859.42

应交税费		-	-
应付利息		-	6,286.10
应付利润		319,506.71	572,484.85
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	208,032.79	209,000.00
负债合计		648,757.03	327,386,672.75
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	213,997,880.53	1,013,213,542.81
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		213,997,880.53	1,013,213,542.81
负债和所有者权益总计		214,646,637.56	1,340,600,215.56

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 213,997,880.53 份，其中，万家日日薪 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 40,754,649.08 份，万家日日薪 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 173,243,231.45 份，万家日日薪 R 基金份额为 0。

## 6.2 利润表

会计主体：万家日日薪货币市场证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年1月1日至2017 年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016 年6月30日
<b>一、收入</b>		5,410,713.34	5,043,745.05
1.利息收入		5,381,790.97	4,878,531.60
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,199,608.75	1,289,527.49
债券利息收入		1,244,480.78	1,934,287.22
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,937,701.44	1,654,716.89
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		28,922.37	165,213.45
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	28,922.37	165,213.45
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	-	-
<b>减: 二、费用</b>		958,940.44	974,358.54
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	442,272.75	521,117.51
2. 托管费	6.4.10.2.2	134,022.02	157,914.52
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	97,549.21	100,040.51
4. 交易费用	6.4.7.19	-	-
5. 利息支出		152,905.17	56,282.26
其中: 卖出回购金融资产支出		152,905.17	56,282.26
6. 其他费用	6.4.7.20	132,191.29	139,003.74
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		4,451,772.90	4,069,386.51
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		4,451,772.90	4,069,386.51

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 万家日日薪货币市场证券投资基金

本报告期: 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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)	1,013,213,542.81	-	1,013,213,542.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,451,772.90	4,451,772.90
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)	-799,215,662.28	-	-799,215,662.28
其中: 1. 基金申购款	562,420,093.46	-	562,420,093.46
2. 基金赎回款	-1,361,635,755.74	-	-1,361,635,755.74
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)	-	-4,451,772.90	-4,451,772.90

五、期末所有者权益(基金净值)	213,997,880.53	-	213,997,880.53
	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日		
项目	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)	181,773,688.48	-	181,773,688.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,069,386.51	4,069,386.51
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)	309,236,055.10	-	309,236,055.10
其中：1.基金申购款	1,220,040,829.20	-	1,220,040,829.20
2.基金赎回款	-910,804,774.10	-	-910,804,774.10
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)	-	-4,069,386.51	-4,069,386.51
五、期末所有者权益(基金净值)	491,009,743.58	-	491,009,743.58

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>方一天</u>	<u>李杰</u>	<u>陈广益</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

万家日日薪货币市场证券投资基金(以下简称“本基金”),系万家 14 天理财债券型证券投资基金转型而来,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]1441 号文《关于核准万家 14 天理财债券型证券投资基金募集的批复》的核准,由万家基金管理有限公司作为基金管理人于 2013 年 1 月 4 日至 2013 年 1 月 10 日向社会公开发行募集,基金合同于 2013 年 1 月 15 日正式生效,首次设立的募集规模为 7,535,700,214.64 份基金份额。本基金的基金管

理人为万家基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

2014 年 4 月 14 日，万家 14 天理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会讨论通过了关于修改基金名称及投资细节的议案。在基金管理人向中国证监会履行相应备案手续，并经中国证监会书面确认后，基金份额持有人大会决议生效。2014 年 5 月 15 日，中国证监会基金部函[2014]203 号文《关于万家 14 天理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》书面确认后，原《万家 14 天理财债券型证券投资基金基金合同》失效，《万家日日薪货币市场证券投资基金基金合同》生效，“万家 14 天理财债券型证券投资基金基金”更名为“万家日日薪货币市场证券投资基金”，同时基金投资目标、投资范围等投资细节相应调整。

转型日（2014 年 5 月 16 日）后本基金设三类基金份额：A 类基金份额、B 类基金份额和 R 类基金份额，各类基金份额单独公布每万份基金净收益和 7 日年化收益率。其中，本基金 A 类基金份额持有人是指在任何一天开放日，在单个基金账户保留的基金份额低于 500 万份（不含未付收益）的普通持有人，本基金 B 类基金份额持有人是指在任何一天开放日，在单个基金账户保留的基金份额达到或超过 500 万份（不含未付收益）的持有人，本基金 R 类基金份额目前仅限通过直销渠道的特定投资群体进行申购。特定投资群体指依法设立的基本养老保险基金、依法制定的企业年金计划筹集的资金及其投资运营收益形成的企业补充养老保险基金（包括全国社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划），以及可以投资基金的其他社会保险基金。如将来出现可以投资基金的住房公积金、享受税收优惠的个人养老账户、经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入特定投资群体范围，并按规定向中国证监会备案。

本基金投资于法律法规允许的金融工具包括：现金；通知存款；短期融资券；1 年以内（含 1 年）的银行定期存款、大额存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券；期限在 1 年以内（含 1 年）的债券回购；期限在 1 年以内（含 1 年）的中央银行票据；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的资产支持证券；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的中期票据；以及中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。对于法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金在力保本金安全性和基金资产流动性的基础上，追求超过业绩比较基准的稳定收益。本基金的业绩比较基准：银行活期存款利率（税后）。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则-基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

## 6.4.4 本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期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。

### 6.4.4.1 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。

## 6.4.5 税项

### 1 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关

政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

## 2 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，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、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，暂不征收企业所得税。

## 3 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。

### 6.4.6 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	955,429.29



定期存款	69,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	58,500,000.00
存款期限 3 个月-1 年	10,500,000.00
其他存款	-
合计：	69,955,429.29

#### 6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017 年 6 月 30 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	67,496,403.00	67,402,600.00	-93,803.00	-0.0438%
	合计	67,496,403.00	67,402,600.00	-93,803.00	-0.0438%

#### 6.4.6.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.6.4 买入返售金融资产

##### 6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	14,000,000.00	-
买入返售证券_银行间	20,000,150.00	-
买入返售证券_固定平台	42,000,000.00	-
合计	76,000,150.00	-

##### 6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	323.02
应收定期存款利息	240,470.90
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	498,608.21
应收买入返售证券利息	179,851.56
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.50
合计	919,254.19

### 6.4.6.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	10,780.70
合计	10,780.70

### 6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	208,032.79
合计	208,032.79

### 6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

万家日日薪 A		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	248,580,776.25	248,580,776.25
本期申购	119,448,005.54	119,448,005.54
本期赎回(以“-”号填列)	-327,274,132.71	-327,274,132.71
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	40,754,649.08	40,754,649.08

金额单位：人民币元

万家日日薪 B		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	764,632,766.56	764,632,766.56
本期申购	442,972,087.92	442,972,087.92
本期赎回(以“-”号填列)	-1,034,361,623.03	-1,034,361,623.03
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	173,243,231.45	173,243,231.45

注：1、总申购含红利再投、转入、级别调整调入份额，总赎回含转换出、级别调整调出份额。

#### 6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

万家日日薪 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	1,076,816.38	-	1,076,816.38
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-1,076,816.38	-	-1,076,816.38

本期末	-	-	-
-----	---	---	---

单位：人民币元

万家日日薪 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	3,374,956.52	-	3,374,956.52
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-3,374,956.52	-	-3,374,956.52
本期末	-	-	-

注：本报告期万家日日薪 R 类基金份额为 0，因此无收益数据。

#### 6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	8,767.30
定期存款利息收入	2,187,754.87
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,070.21
其他	16.37
合计	2,199,608.75

注：其他为结算保证金利息收入。

#### 6.4.6.12 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.6.13 债券投资收益

##### 6.4.6.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	28,922.37
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	28,922.37

#### 6.4.6.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	111,966,127.38
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	111,281,329.56
减：应收利息总额	655,875.45
买卖债券差价收入	28,922.37

#### 6.4.6.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.6.14 贵金属投资收益

##### 6.4.6.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.6.15 衍生工具收益

##### 6.4.6.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.6.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.6.17 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

#### 6.4.6.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.6.19 交易费用

本基金本报告期无交易费用。

#### 6.4.6.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	74,385.57
其他	600.00
银行间账户维护费	17,852.03
银行费用	14,558.50
合计	132,191.29

#### 6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日, 本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.7.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日, 本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.8 关联方关系

##### 6.4.8.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内, 与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人、基金代销机构
上海万家朴智投资管理有限公司	基金管理人控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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交易。

#### 6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.9.1.1 股票交易

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交易。

##### 6.4.9.1.2 债券交易

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债券交易。

##### 6.4.9.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

##### 6.4.9.1.4 权证交易

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。

##### 6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

#### 6.4.9.2 关联方报酬

##### 6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	442,272.75	521,117.51
其中：支付销售机构的客户维护费	81,765.67	75,175.23

注：2014年5月16日，本基金转型为货币市场证券投资基金，转型前本基金的管理费按前一日基金资产净值0.27%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.27\% \div \text{当年天数}$$

转型后本基金的管理费按前一日基金资产净值0.33%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，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划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	134,022.02	157,914.52

注：2014 年 5 月 16 日，本基金转型为货币市场证券投资基金，转型前本基金的托管费按前一日基金资产净值 0.08% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$$

转型后本基金的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，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托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 6.4.9.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期			
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	万家日日薪 A	万家日日薪 B	万家日日薪 R	合计
万家基金管理有限公司	21,151.62	7,684.16	-	28,835.78
中国农业银行股份有限公司	37,425.92	1,617.54	-	39,043.46
合计	58,577.54	9,301.70	-	67,879.24
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间			
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			



	万家日日薪 A	万家日日薪 B	万家日日薪 R	合计
万家基金管理有限公司	11,158.65	10,936.49	-	22,095.14
中国农业银行股份有限公司	31,753.63	1,281.91	-	33,035.54
合计	42,912.28	12,218.40	-	55,130.68

注:1、2014年5月16日,本基金转型为货币市场证券投资基金,转型前本基金销售服务费按前一日基金资产净值0.30%的年费率计算,转型后本基金设三类基金份额:A类基金份额、B类基金份额和R类基金份额,A类基金份额销售服务费年费率为0.25%,B类基金份额销售服务费年费率为0.01%,R类基金份额销售服务费年费率为0。各类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下:

$H = E \times \text{销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提,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销售服务费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给注册登记机构,由注册登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

2、本报告期万家日日薪 R 类基金份额为 0,未产生销售服务费。

### 6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		
	万家日日薪 A	万家日日薪 B	万家日日薪 R
基金合同生效日(2013年1月15日)持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	-	24,141,713.31	-
期间申购/买入总份额	-	57,490,114.10	-
期间因拆分变动份额	-	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	52,000,000.00	-
期末持有的基金份额	-	29,631,827.41	-
期末持有的基金份额	-	13.85%	-

占基金总份额比例			
----------	--	--	--

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	万家日日薪 A	万家日日薪 B	万家日日薪 R
基金合同生效日（2013 年 1 月 15 日）持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	10,005,652.15	-
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	-	10,005,652.15	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	2.28%	-

#### 6.4.9.4.2 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

万家日日薪 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	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	1,896.08	0.00%	-	-

#### 6.4.9.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	955,429.29	8,767.30	1,244,998.19	6,479.52

注：本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限公司，2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日获得的利息收入为人民币 3,070.21 元（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日获得的利息收入为人民币 197.28 元），2016 年 6 月 30 日结算备付金余额为人民币 0.00 元（2016 年 6 月 30 日为人民币 0.00 元）。

#### 6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期本基金未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10 利润分配情况

金额单位：人民币元

万家日日薪A

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	本期利润分配合计	备注
954,206.93	208,596.97	-85,987.52	1,076,816.38	-

万家日日薪B

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	本期利润分配合计	备注
2,601,806.47	940,140.67	-166,990.62	3,374,956.52	-

注：本报告期万家日日薪 R 类基金份额为 0，因此无收益数据。

#### 6.4.11 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，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余额。

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，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余额。

#### 6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，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款余额。

### 6.4.12 金融工具风险及管理

#### 6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理融入各业务层面，建立了三道防线：以各岗位目标责任制为基础，形成第一道防线；通过相关部门、相关岗位之间相互监督制衡，形成第二道防线；由监察稽核部门、督察长对各岗位、各部门、各机构、各项业务实施监督反馈，形成第三道防线。

#### 6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的国债、企业债、央行票据等，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

根据本基金的信用风险控制要求，本基金投资的短期融资券的信用评级，不低于以下标准：

- 1) 国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别；
- 2) 根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近三年的信用评级和跟踪评级具备下列条件之一：
  - A. 国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的长期信用级别；
  - B. 国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别。（例如，若中国主权评级为 A-级，则低于中国主权评级一个级别的为 BBB+级）。

同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准。

#### 6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	57,481,401.63	-
合计	57,481,401.63	-

注：未评级债券包括政策性金融债和同业存单。

#### 6.4.12.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级所列示的债券投资。

#### 6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的国债、企业债及央行票据等，除在证券交易所的债券回购交易，其余均在银行间同业市场交易，因此，本年末本基金的资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.12.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，以摊余成本计价，并通过“影子定价”机制使按摊余成本确认的基金资产净值能近似反映基金资产的公允价值，因此本基金的运作仍然存在相应的利率风险。

本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感度缺口进行监控。

### 6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
<b>资产</b>							
银行存款	955,429.29	58,500,000.00	10,500,000.00	-	-	-	69,955,429.29
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	1,164.37	-	-	-	-	-	1,164.37
交易性金融资产	9,974,935.05	19,946,779.51	37,574,688.44	-	-	-	67,496,403.00
买入返售金融资产	76,000,150.00	-	-	-	-	-	76,000,150.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	5,071.23	5,071.23
应收利息	-	-	-	-	-	919,254.19	919,254.19
应收申购款	-	-	-	-	-	269,165.48	269,165.48
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>86,931,678.71</b>	<b>78,446,779.51</b>	<b>48,074,688.44</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>1,193,490.90</b>	<b>214,646,637.56</b>
<b>负债</b>							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,435.30	3,435.30
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	73,872.07	73,872.07
应付托管费	-	-	-	-	-	22,385.47	22,385.47
应付销售服务费	-	-	-	-	-	10,743.99	10,743.99
应付交易费用	-	-	-	-	-	10,780.70	10,780.70
应付利润	-	-	-	-	-	319,506.71	319,506.71
其他负债	-	-	-	-	-	208,032.79	208,032.79
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>648,757.03</b>	<b>648,757.03</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>86,931,678.71</b>	<b>78,446,779.51</b>	<b>48,074,688.44</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>544,733.87</b>	<b>213,997,880.53</b>
<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>1 个月以内</b>	<b>1-3 个月</b>	<b>3 个月-1 年</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以 上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>							
银行存款	83,598,272.16	91,000,000.00	24,000,000.00	-	-	-	198,598,272.16
结算备付金	48,501.44	-	-	-	-	-	48,501.44
存出保证金	648.36	-	-	-	-	-	648.36
交易性金融资产	9,999,344.64	54,971,490.96	74,964,690.94	-	-	-	139,935,526.54
买入返售金融资产	557,718,542.59	19,991,349.99	-	-	-	-	577,709,892.58
应收利息	-	-	-	-	-	1,073,151.02	1,073,151.02
应收申购款	32,675,515.70	-	-	-	-	390,558,707.76	423,234,223.46
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>684,040,824.89</b>	<b>165,962,840.95</b>	<b>98,964,690.94</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>391,631,858.78</b>	<b>1,340,600,215.56</b>
<b>负债</b>							

卖出回购金融资产款	30,399,754.40	-	-	-	-	30,399,754.40
应付证券清算款	-	-	-	-	-296,000,000.00	296,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	36,073.89	36,073.89
应付管理人报酬	-	-	-	-	95,026.68	95,026.68
应付托管费	-	-	-	-	28,795.99	28,795.99
应付销售服务费	-	-	-	-	24,391.42	24,391.42
应付交易费用	-	-	-	-	14,859.42	14,859.42
应付利息	-	-	-	-	6,286.10	6,286.10
应付利润	-	-	-	-	572,484.85	572,484.85
其他负债	-	-	-	-	209,000.00	209,000.00
负债总计	30,399,754.40	-	-	-	-296,986,918.35	327,386,672.75
利率敏感度缺口	653,641,070.49	165,962,840.95	98,964,690.94	-	-94,644,940.43	1,013,213,542.81

注：上表统计了本基金资产和负债的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；		
	该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率以外的其他市场变量保持不变；		
	该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；		
	银行存款、结算备付金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；买入返售金融资产的利息收益和卖出回购金融资产的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响；		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	47,134.60	138,791.92
市场利率上升 25 个基点	-46,973.61	-138,245.25	

注：表中所示利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

#### 6.4.12.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债均以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.12.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种和证券交易所的债券回购产品, 且以摊余成本进行后续计量, 因此无重大市场价格风险。

#### 6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	67,402,600.00	31.50	139,478,685.20	13.77
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	67,402,600.00	31.50	139,478,685.20	13.77

#### 6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日, 本基金无需要说明的其他重要事项。



## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	67,496,403.00	31.45
	其中：债券	67,496,403.00	31.45
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	76,000,150.00	35.41
	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	69,955,429.29	32.59
4	其他各项资产	1,194,655.27	0.56
5	合计	214,646,637.56	100.00

### 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

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	2.28	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	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

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 1 月 26 日	24.15	大额赎回	-
2	2017 年 1 月 27 日	24.15	大额赎回	-

3	2017 年 1 月 28 日	24.15	大额赎回	-
4	2017 年 1 月 29 日	24.15	大额赎回	-
5	2017 年 1 月 30 日	24.15	大额赎回	-
6	2017 年 1 月 31 日	24.15	大额赎回	-
7	2017 年 2 月 1 日	24.15	大额赎回	-
8	2017 年 2 月 2 日	24.15	大额赎回	-
9	2017 年 2 月 3 日	24.17	大额赎回	-
10	2017 年 2 月 4 日	24.17	大额赎回	-
11	2017 年 2 月 5 日	24.17	大额赎回	-
12	2017 年 2 月 6 日	24.23	大额赎回	-

### 7.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 7.3.1 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	62
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	81
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	33

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金合同约定：“本基金组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天”。本报告期内，本基金未发生超标情况。

#### 7.3.2 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	40.63	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	15.86	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	20.79	-
	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)	22.47	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		99.75	-

#### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金合同约定：“本基金组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天”。本报告期内，本基金未发生超标情况。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	17,970,118.98	8.40
	其中：政策性金融债	17,970,118.98	8.40
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	49,526,284.02	23.14
8	其他	-	-
9	合计	67,496,403.00	31.54
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 7.6 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

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	占基金资产净值比例(%)
1	140220	14 国开 20	100,000	10,015,001.37	4.68
2	111799936	17 青岛银行 CD087	100,000	9,974,935.05	4.66
3	111711209	17 平安银行 CD209	100,000	9,931,778.14	4.64

4	111699367	16 唐山银行 CD018	100,000	9,889,279.89	4.62
5	111699554	16 贵州银行 CD025	100,000	9,885,028.72	4.62
6	111681045	16 杭州银行 CD192	100,000	9,845,262.22	4.60
7	170204	17 国开 04	80,000	7,955,117.61	3.72

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

### 7.7 “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	-
报告期内偏离度的最高值	-0.0392%
报告期内偏离度的最低值	-0.1604%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1001%

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1

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。

#### 7.9.2

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、处罚的情形。

#### 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,164.37
2	应收证券清算款	5,071.23
3	应收利息	919,254.19
4	应收申购款	269,165.48

5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,194,655.27

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
万家日日薪 A	17,525	2,325.51	7,520,866.40	18.45%	33,233,782.68	81.55%
万家日日薪 B	11	15,749,384.68	157,206,796.33	90.74%	16,036,435.12	9.26%
万家日日薪 R	-	-	-	-	-	-
合计	17,536	12,203.35	164,727,662.73	76.98%	49,270,217.80	23.02%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	万家日日薪 A	1,674,755.33	4.1094%
	万家日日薪 B	-	-
	万家日日薪 R	-	-
	合计	1,674,755.33	0.7826%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	万家日日薪 A	10~50
	万家日日薪 B	-
	万家日日薪 R	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	万家日日薪 A	50~100
	万家日日薪 B	-
	万家日日薪 R	-

---

	合计	50~100
--	----	--------

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	万家日日薪 A	万家日日薪 B
基金合同生效日（2013 年 1 月 15 日）基金份额总额	7,535,700,214.64	-
本报告期期初基金份额总额	248,580,776.25	764,632,766.56
本报告期基金总申购份额	119,448,005.54	442,972,087.92
减：本报告期基金总赎回份额	327,274,132.71	1,034,361,623.03
本报告期基金拆分变动份额 （份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	40,754,649.08	173,243,231.45



## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 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

基金管理人：

2017 年 6 月 5 日，公司增聘陈佳昀为万家日日薪货币市场基金的基金经理，与基金经理苏谋东共同管理该基金。

基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

### 10.3 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、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期内未投资股票。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
银河证券	8,241,100.00	100.00%	337,360,000.00	97.12%	-	-
海通证券	-	-	10,000,000.00	2.88%	-	-

注：1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范,内控制度健全,在业内有良好的声誉;
- (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;
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于:有较好的研究能力和行业分析能力,能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息;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良好的服务和支持。

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、报告期内基金租用证券公司交易单元的变更情况：

报告期内本基金租用的证券公司交易单元无变化。

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内无偏离度绝对值超过0.5%(含)的情况。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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	2017/1/24	60,587,426.80	48,681,199.55	109,268,626.35	0.00	0.00
	2	2017/4/28-2017/5/2	0.00	50,147,595.96	50,147,595.96	0.00	0.00
	3	2017/3/16-2017/4/16, 2017/4/26-2017/4/27	24,141,713.31	57,490,114.10	52,000,000.00	29,631,827.41	13.85
	4	2017/5/25-2017/6/27	0.00	96,133,205.08	67,400,000.00	28,733,205.08	13.43
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p>							

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准万家日日薪货币市场证券投资基金发行及募集的文件。
- 2、《万家日日薪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批件、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、万家日日薪货币市场证券投资基金 2017 年半年度报告原文。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。
- 7、《万家日日薪货币市场证券投资基金托管协议》。

### 12.2 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：[www.wjasset.com](http://www.wjasset.com)

### 12.3 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 8 月 29 日