

# 万家日日薪货币市场证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期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 2024 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2024 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>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
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.....	13
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.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 净资产变动表.....	18
6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 债券回购融资情况.....	44
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	44
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.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	45

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离 .....	46
7.8 期末按实际利率计算的账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资 明细.....	46
7.9 投资组合报告附注.....	46
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
8.4 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情况.....	48
<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
10.9 其他重大事件.....	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	20,301,626,085.38 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	16,714,766,281.32 份	3,586,859,804.06 份	-份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	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	本基金在投资组合的管理中，将通过短期市场利率预期策略、类属资产配置策略和无风险套利操作策略等策略构建投资组合，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。具体包括：（1）短期市场利率预期策略；（2）投资组合优化策略；（3）类属配置策略；（4）个券选择策略；（5）回购策略；（6）无风险套利操作策略；（7）现金流管理策略。
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。

### 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
	联系电话	021-38909626
	电子邮箱	lanj@wjasset.com
客户服务电话	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	北京市西城区复兴门内大街 28

	电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	200122	100031
法定代表人	方一天	谷澍

## 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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.wjasset.com">http://www.wjasset.com</a>
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	万家基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）

## § 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)		
	万家日日薪 A	万家日日薪 B	万家日日薪 R
本期已实现收益	79,773,310.25	42,594,224.85	-
本期利润	79,773,310.25	42,594,224.85	-
本期净值收益率	0.9643%	1.0819%	-
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)		
期末基金资产净值	16,714,766,281.32	3,586,859,804.06	-
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	-
3.1.3 累计期末指	报告期末(2024 年 6 月 30 日)		

标			
累计净值 收益率	34.5399%	31.9358%	-

注：1、本基金收益分配按日结转份额。

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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 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	0.1375%	0.0010%	0.0288%	0.0000%	0.1087 %	0.0010 %
过去三个月	0.4330%	0.0008%	0.0873%	0.0000%	0.3457 %	0.0008 %
过去六个月	0.9643%	0.0017%	0.1745%	0.0000%	0.7898 %	0.0017 %
过去一年	1.9717%	0.0013%	0.3510%	0.0000%	1.6207 %	0.0013 %
过去三年	6.1056%	0.0012%	1.0510%	0.0000%	5.0546 %	0.0012 %
自基金合同生效起 至今	34.5399 %	0.0049%	5.3418%	0.0009%	29.198 1%	0.0040 %

万家日日薪 B

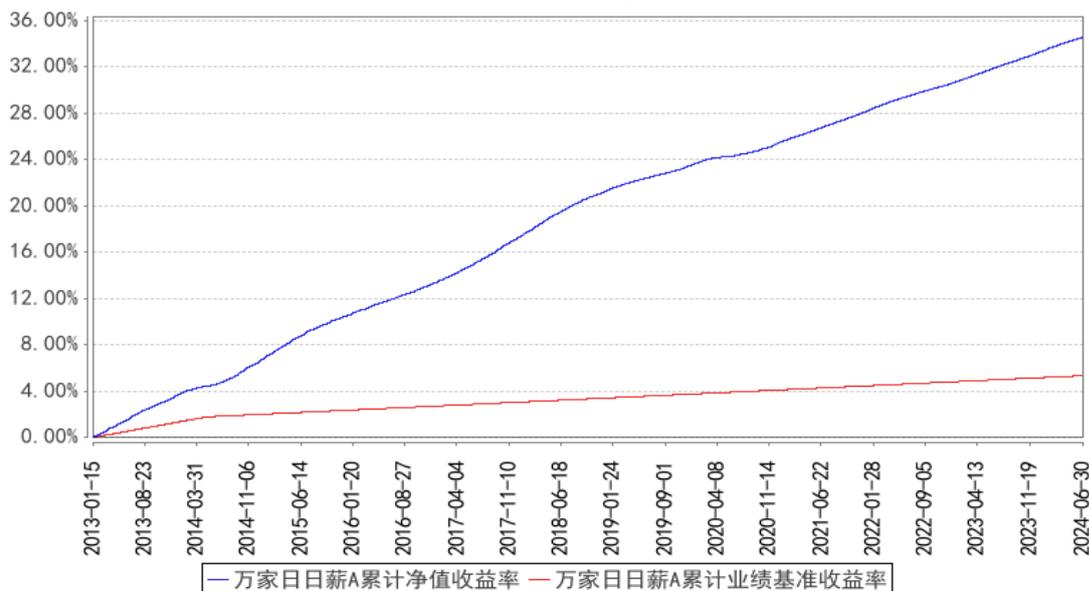
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标准 差④	①-③	②-④
----	--------------	---------------------	----------------	-----------------------	-----	-----

过去一个月	0.1571%	0.0010%	0.0288%	0.0000%	0.1283%	0.0010%
过去三个月	0.4927%	0.0008%	0.0873%	0.0000%	0.4054%	0.0008%
过去六个月	1.0819%	0.0017%	0.1745%	0.0000%	0.9074%	0.0017%
过去一年	2.2140%	0.0013%	0.3510%	0.0000%	1.8630%	0.0013%
过去三年	6.8697%	0.0012%	1.0510%	0.0000%	5.8187%	0.0012%
自基金合同生效起至今	31.9358%	0.0048%	3.5479%	0.0000%	28.3879%	0.0048%

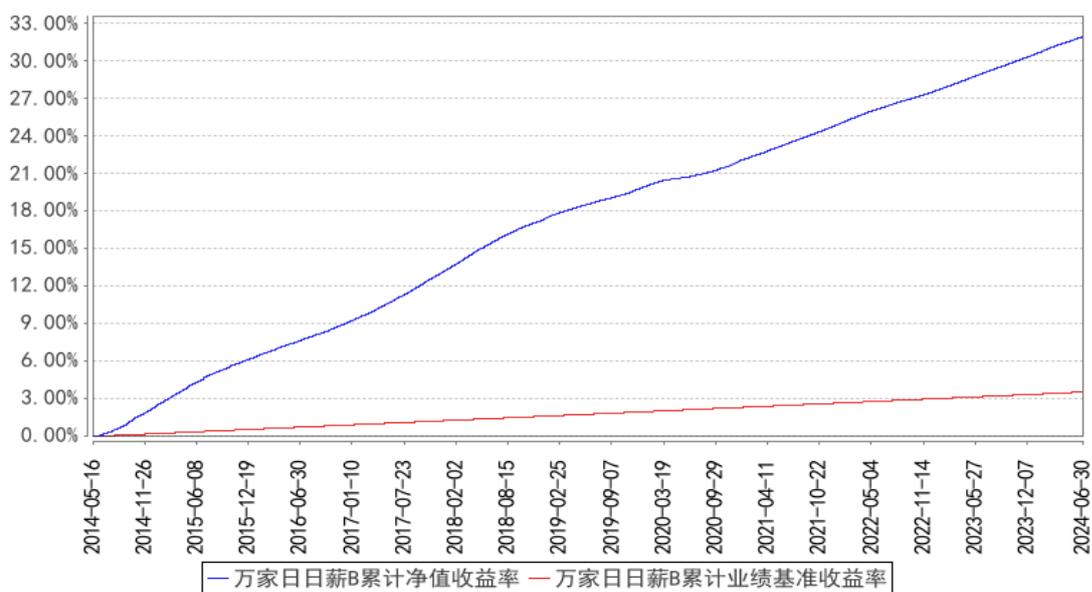
注：万家日日薪 B 上述“自基金合同生效起至今”实际为“自基金份额类别首次确认起至今”，下同。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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、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，R 类基金份额为 0，因此无收益数据。

3、本基金自 2019 年 5 月 16 日起由按月结转收益调整为按日结转收益。

## § 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。截至报告期末，公司的股东为中泰证券股份有限公司、山东省新动能基金管理有限公司,住所：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 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 3 亿元人民币。截至报告期末，公司共管理一百五十二只开放式基金，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、万家颐达灵活配置混合型证券投资基金、万家颐和灵活配置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、万家家享中短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 1-3 年政策性金融债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、万家成长优选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、万家新机遇龙头企业灵活配置混合型证券投资基金、万家智造优势混合型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型证券投资基金、万家人工智能混合型证券投资基金、万家社会责任 18 个月定期开放混合型证券投资基金 (LOF)、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、万家平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、万家科创主题灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、万家鑫盛纯债债券型证券投资基金、万家民安增利 12 个月定期开放债券型证券投资基金、万家汽车新趋势混合型证券投资基金、万家惠享 39 个月定期开放债券型证券投资基金、万家科技创新混合型证券投资基金、万家自主创新混合型证券投资基金、万家民丰回报一年持有期混合型证券投资基金、万家可转债债券型证券投资基金、万家民瑞祥和 6 个月持有期债券型证券投资基金、万家价值优势一年持有期混合型证券投资基金、万家养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、万家鑫动力月月购一年滚动持有混合型证券投资基金、万家科创板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家创业板 2 年定期开放混合型证券投资基金、万家周期优势企业混合型证券投资基金、万家健康产业混合型证券投资基金、万家互联互通中国优势量化策略混合型证券投资基金、万家战略发展产业

混合型证券投资基金、万家创业板指数增强型证券投资基金、万家陆家嘴金融城金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家内需增长一年持有期混合型证券投资基金、万家互联互通核心资产量化策略混合型证券投资基金、万家民瑞祥明 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家瑞泽回报一年持有期混合型证券投资基金、万家惠裕回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、万家悦兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金、万家稳鑫 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、万家全球成长一年持有期混合型证券投资基金(QDII)、万家沪港深蓝筹混合型证券投资基金、万家北交所慧选两年定期开放混合型证券投资基金、万家鼎鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、万家新机遇成长一年持有期混合型发起式证券投资基金、万家港股通精选混合型证券投资基金、万家景气驱动混合型证券投资基金、万家安恒纯债 3 个月持有期债券型发起式证券投资基金、万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫橙纯债债券型证券投资基金、万家聚优稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、万家新能源主题混合型发起式证券投资基金、万家中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、万家匠心致远一年持有期混合型证券投资基金、万家鑫融纯债债券型证券投资基金、万家颐远均衡一年持有期混合型发起式证券投资基金、万家鑫耀纯债债券型证券投资基金、万家欣远混合型证券投资基金、万家国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家惠利债券型证券投资基金、万家鑫怡债券型证券投资基金、万家优享平衡混合型发起式证券投资基金、万家洞见进取混合型发起式证券投资基金、万家沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、万家中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金、万家沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家元贞量化选股股票型证券投资基金、万家 CFETS0-3 年期政策性金融债指数证券投资基金、万家中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家先进制造混合型发起式证券投资基金、万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金、万家颐德一年持有期混合型证券投资基金、万家北证 50 成份指数型发起式证券投资基金、万家恒生互联网科技业指数型发起式证券投资基金(QDII)、万家中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家欣优混合型证券投资基金、万家集利债券型发起式证券投资基金、万家远见先锋一年持有期混合型证券投资基金、万家国证 2000 指数增强型证券投资基金、万家纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金(QDII)、万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金、万家稳安 60 天持有期债券型证券投资基金、万家周期驱动股票型发起式证券投资基金、万家优选积极三个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、万家养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、万家红利量化选股混合型发起式证券投资基金、万家医药量化选股混合型发起式

证券投资基金、万家锦利债券型发起式证券投资基金、万家高端装备量化选股混合型发起式证券投资基金、万家趋势领先混合型证券投资基金、万家稳航 90 天持有期债券型证券投资基金、万家中证红利交易型开放式指数证券投资基金、万家惠诚回报平衡一年持有期混合型证券投资基金、万家创业板综合交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、万家国企动力混合型证券投资基金、万家 CFETS 0-3 年期山东省国有企业信用债精选指数发起式证券投资基金、万家稳丰 6 个月持有期债券型证券投资基金、万家研究领航混合型证券投资基金、万家中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金。

#### 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		
鄧元	现金管理部部门副总监；万家中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、万家天添宝货币市场基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家现金增利货币市场基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、万家货币市场证券投资基金的基金经理。	2019 年 1 月 31 日	-	12.5 年	国籍：中国；学历：英国雷丁大学金融风险管理专业硕士，2018 年 6 月入职万家基金管理有限公司，现任现金管理部副总监（主持工作）、基金经理，历任固定收益部基金经理。曾任天安财产保险股份有限公司交易员，华安基金管理有限公司集中交易部债券交易员、基金经理助理等职。
张如晨	万家天添宝货币市	2021 年 4 月 12 日	-	11 年	国籍：中国；学历：中国人民大学金融专业硕士，2019 年 12 月入职万家基金管理

	<p>场基金、 万家日日 薪货币市 场证券投 资基金的 基金经 理。</p>				<p>有限公司，现任现金管理部基金经理，历任现金管理部基金经理助理。曾任中国工商银行安徽省分行营业部客户经理，徽商银行金融市场部/资产负债部债券交易员等职。</p>
--	--	--	--	--	--

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的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

#### 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。

本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，原则上按照价格优先、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，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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%的交易共有 9 次,均为量化投资组合或不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易。

#### 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

2024 年上半年,基本面复苏之后又有所回落。一季度,基本面出现一些积极因素,PMI 在 1-2 月低位震荡之后,3 月重新回到扩张区间,超出市场预期,新订单和新出口订单回升,库存有所回补,海外需求改善,工业出口由降转增。得益于出口提升,制造业投资表现较好。地产投资仍是拖累,但整体降幅有所收窄,二手房成交热度地提升。二季度,基本面的景气度有所回落,PMI 连续三个月下滑,重新回落至枯荣线以下。在外需回升支撑下,出口增速继续维持高位。截至 7 月,人民银行下调金融机构存款准备金率 0.5 个百分点,并下调公开市场操作利率 10BP,同时非对称下调 LPR 利率 10-35BP,MLF 的作为利率锚的功能被逐渐弱化。

上半年的货币市场趋势基本符合历史规律,但波动性有所下降,信贷脉冲对市场影响较弱,市场走势受负债端影响趋势性较强,但下行空间又受到短期资金面的约束,1 年存单从年初的 2.45%附近一路下行至 1.85%附近,本组合在收益率下行过程中不断捕捉机会,维持杠杆和中高久期,资产负债双向管理,在逐渐提升管理规模的同时,不断优化组合收益,寻求超额机会。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期万家日日薪 A 的基金份额净值收益率为 0.9643%,本报告期万家日日薪 B 的基金份额净值收益率为 1.0819%,同期业绩比较基准收益率为 0.1745%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

考虑到目前需求依然较弱,地产在持续触底过程中,下半年财政政策可能会有所发力,专项债发行使用速率可能加快,但当前市场仍面临一定的资产荒,债券供给与需求有一定程度不匹配,存款搬家对债券需求亦有所支撑。随着美联储降息临近,外部约束降低,预计未来债券市场更多坚持“以我为主”,8 月在过去两年容易出现货币市场的低点,目前是否会进一步走低尚需观察,组合会在流动性、安全性、收益性中间不断寻求平衡,选取最优点进行投资。

#### 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。估值委员会由负责估值业务的分管领导、合规稽核部负责人、基金运营部负责人、相关估值业务岗位人员、相关风控人员等组成。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

本基金管理人与中债金融估值中心有限公司签署了《中债信息产品服务协议》，本基金管理人与中证指数有限公司签署了《中证债券估值数据服务协议》、《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》。

### 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，按日结转支付。本报告期内本基金万家日日薪 A 应分配利润 79,773,310.25 元，本报告期内本基金已分配利润 79,773,310.25 元；本报告期内本基金万家日日薪 B 应分配利润 42,594,224.85 元，本报告期内本基金已分配利润 42,594,224.85 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，本基金未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形。

## § 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—万家基金管理有限公司 2024 年 1 月 1 日至 2024 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本基金的投资运作、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《中华人民共和国证券投资基金法》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 托管人对本中期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《公开募集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本基金中期报告中的财务指标、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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	13,842,750,359.14	1,747,279,721.49
结算备付金		-	-
存出保证金		4,216.82	238.36
交易性金融资产	6.4.7.2	6,986,406,567.78	1,699,972,915.94
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		6,986,406,567.78	1,699,972,915.94
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	375,106,175.13	924,964,979.31
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		6,498,416.45	22,742,300.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		21,210,765,735.32	4,394,960,155.27
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 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		900,152,876.71	443,305,635.61
应付清算款		-	300,000,000.00
应付赎回款		-	1,000.12
应付管理人报酬		4,266,729.65	822,839.33
应付托管费		853,345.91	164,567.88
应付销售服务费		3,509,162.96	39,785.21
应付投资顾问费		-	-
应交税费		27,468.51	13,954.54
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	330,066.20	276,338.51
负债合计		909,139,649.94	744,624,121.20
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	20,301,626,085.38	3,650,336,034.07
其他综合收益	6.4.7.8	-	-
未分配利润	6.4.7.9	-	-
净资产合计		20,301,626,085.38	3,650,336,034.07
负债和净资产总计		21,210,765,735.32	4,394,960,155.27

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 20,301,626,085.38 份，其中万家日日薪 A 基金份额总额 16,714,766,281.32 份；万家日日薪 B 基金份额总额 3,586,859,804.06 份；万家日日薪 R 基金份额总额 0 份。

## 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		163,314,116.57	36,367,305.51
1. 利息收入		105,188,807.07	19,529,118.52
其中：存款利息收入	6.4.7.10	100,633,990.27	10,386,816.72
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,554,816.80	9,142,301.80
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		58,125,309.50	16,838,186.99
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	58,125,309.50	16,838,186.99
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
收益			
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	-	-
以摊余成本计量的			
金融资产终止确认产生的		-	-
收益			
其他投资收益		-	-
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、营业总支出</b>		40,946,581.47	6,219,860.89
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	15,887,563.87	3,331,148.87
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,177,512.78	666,229.75
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	11,144,765.74	170,017.40
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		10,532,145.14	1,923,046.57
其中：卖出回购金融资产			
支出		10,532,145.14	1,923,046.57
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		18,382.79	5,292.45
8. 其他费用	6.4.7.20	186,211.15	124,125.85
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		122,367,535.10	30,147,444.62
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		122,367,535.10	30,147,444.62
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		122,367,535.10	30,147,444.62

### 6.3 净资产变动表

会计主体：万家日日薪货币市场证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	3,650,336,034.07	-	-	3,650,336,034.07
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	3,650,336,034.07	-	-	3,650,336,034.07
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	16,651,290,051.31	-	-	16,651,290,051.31
(一)、综合收益总额	-	-	122,367,535.10	122,367,535.10
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	16,651,290,051.31	-	-	16,651,290,051.31
其中：1. 基金申购款	63,618,331,027.14	-	-	63,618,331,027.14
2. 基金赎回款	-46,967,040,975.83	-	-	-46,967,040,975.83
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-122,367,535.10	-122,367,535.10
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	20,301,626,085.38	-	-	20,301,626,085.38
项目	上年度可比期间			

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,531,790,964.05	-	-	2,531,790,964.05
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,531,790,964.05	-	-	2,531,790,964.05
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,181,712,735.57	-	-	1,181,712,735.57
(一)、综合收益总额	-	-	30,147,444.62	30,147,444.62
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	1,181,712,735.57	-	-	1,181,712,735.57
其中：1. 基金申购款	7,878,350,010.16	-	-	7,878,350,010.16
2. 基金赎回款	-6,696,637,274.59	-	-	-6,696,637,274.59
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-30,147,444.62	-30,147,444.62
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	3,713,503,699.62	-	-	3,713,503,699.62

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：

方一天

基金管理人负责人

陈广益

主管会计工作负责人

尹超

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。本基金为契约型开放式，存续期限不定期。本基金的基金管理人为万家基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。根据《万家基金管理有限公司关于万家日日薪货币市场证券投资基金变更部分基金份额的登记机构的公告》，自 2022 年 3 月 24 日起，原通过上海天天基金销售有限公司销售的基金份额的登记机构由中国证券登记结算有限责任公司转移回万家基金管理有限公司。转移完成后，该部分基金份额的登记机构将变更为万家基金管理有限公司。本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司和万家基金管理有限公司。

2014 年 3 月 12 日至 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，2014 年 4 月 15 日，会议审议通过了《关于修改万家 14 天理财债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。2014 年 5 月 15 日，本基金完成了向中国证监会关于本次基金份额持有人大会决议及相关事项的备案程序，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 15 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。

本基金于 2022 年 6 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日以通讯方式召开基金份额持有人大会, 2022 年 7 月 1 日本基金基金份额持有人大会审议并通过了《关于调整万家日日薪货币市场证券投资基金管理费费率有关事项的议案》, 本次大会决议自该日起生效。基金管理人经与基金托管人协商一致, 并经中国证监会备案, 对《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》进行修订。

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

本基金的财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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修订的《证券投资基金会计核算业务指引》中国证监会制定的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》及其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作。

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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 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的说明

本中期报告所采用的会计政策、会计估计与上年度报告相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

### 6.4.5.3 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。

## 6.4.6 税项

### (一) 印花税

经国务院批准，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‰；

经国务院批准，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）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》的规定，基金通过深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税；

根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

### (二) 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]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

### (三) 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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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。

### (四) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 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，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、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别化个人所得税政策有关问题的通知》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税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》的规定，对基金通过深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	4,225,425,507.35
等于：本金	4,222,770,601.25
加：应计利息	2,654,906.10
减：坏账准备	-
定期存款	9,617,324,851.79
等于：本金	9,575,000,000.00
加：应计利息	42,324,851.79

减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	1, 152, 207, 277. 45
存款期限 3 个月以上	8, 465, 117, 574. 34
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	13, 842, 750, 359. 14

#### 6. 4. 7. 2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 6 月 30 日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	6, 986, 406, 567. 78	6, 991, 872, 142. 59	5, 465, 574. 81	0. 0269
	合计	6, 986, 406, 567. 78	6, 991, 872, 142. 59	5, 465, 574. 81	0. 0269
资产支持证券		-	-	-	-
合计		6, 986, 406, 567. 78	6, 991, 872, 142. 59	5, 465, 574. 81	0. 0269

#### 6. 4. 7. 3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 6. 4. 7. 4 买入返售金融资产

##### 6. 4. 7. 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 2024 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	375, 106, 175. 13	-
合计	375, 106, 175. 13	-

##### 6. 4. 7. 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. 7. 5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6. 4. 7. 6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
----	------------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	122,181.60
其中：交易所市场	-
银行间市场	122,181.60
应付利息	-
预提费用	204,884.60
其他	3,000.00
合计	330,066.20

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

##### 万家日日薪 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	33,720,454.22	33,720,454.22
本期申购	56,931,872,188.31	56,931,872,188.31
本期赎回（以“-”号填列）	-40,250,826,361.21	-40,250,826,361.21
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	16,714,766,281.32	16,714,766,281.32

##### 万家日日薪 B

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,616,615,579.85	3,616,615,579.85
本期申购	6,686,458,838.83	6,686,458,838.83
本期赎回（以“-”号填列）	-6,716,214,614.62	-6,716,214,614.62
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,586,859,804.06	3,586,859,804.06

注：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。

#### 6.4.7.8 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

#### 6.4.7.9 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	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	79,773,310.25	-	79,773,310.25
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	-79,773,310.25	-	-79,773,310.25
本期末	-	-	-

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	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	42,594,224.85	-	42,594,224.85
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	-42,594,224.85	-	-42,594,224.85
本期末	-	-	-

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	52,377,684.49
定期存款利息收入	48,218,257.31
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	38,022.25
其他	26.22
合计	100,633,990.27

6.4.7.11 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	52,975,443.80
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	5,149,865.70
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	58,125,309.50

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	10,383,285,458.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,346,765,447.76
减：应计利息总额	31,370,145.04
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	5,149,865.70

#### 6.4.7.13 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。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

#### 6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	15,912.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	91,726.55
账户维护费	18,900.00
合计	186,211.15

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 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。

#### 6.4.8.2 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。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 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

2024 年 2 月 20 日，基金管理人万家基金管理有限公司控制的上海万家朴智投资管理有限公司已办理完成工商注销手续。

#### 6.4.9.2 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（“万家基金”）	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、基金销售机构
万家共赢资产管理有限公司（“万家共赢”）	基金管理人的子公司
万家财富基金销售（天津）有限公司（“万家财富”）	基金管理人的子公司、基金销售机构

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。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 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。

##### 6.4.10.1.2 债券交易

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债券交易。

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

### 6.4.10.1.4 权证交易

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权证交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	15,887,563.87	3,331,148.87
其中：应支付销售机构的客户维护费	7,629,184.13	1,380,903.02
应支付基金管理人的净管理费	8,258,379.74	1,950,245.85

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,177,512.78	666,229.75

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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。

#### 6.4.10.2.3 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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
农业银行	22,038.25	73.25	-	22,111.50
万家财富	-	176.42	-	176.42
万家基金	7,120.28	22,700.17	-	29,820.45
合计	29,158.53	22,949.84	-	52,108.37
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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
农业银行	17,676.36	290.78	-	17,967.14
万家基金	6,767.23	19,791.76	-	26,558.99
合计	24,443.59	20,082.54	-	44,526.13

注：A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，R 类基金份额不收取销售服务费。本基金 A 类与 B 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

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

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。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	-	-
报告期初持有的基金 份额	-	-	-
报告期间申购/买入总 份额	-	-	-
报告期间因拆分变动 份额	-	-	-
减：报告期间赎回/卖 出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金 份额	-	-	-
报告期末持有的基金 份额 占基金总份额比例	-	-	-
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	-	-	-
报告期初持有的基金 份额	-	110,325,116.99	-
报告期间申购/买入总 份额	-	80,647,449.70	-
报告期间因拆分变动 份额	-	-	-
减：报告期间赎回/卖 出总份额	-	160,969,518.46	-
报告期末持有的基金 份额	-	30,003,048.23	-
报告期末持有的基金	-	0.8147%	-

份额 占基金总份额比例			
----------------	--	--	--

**6.4.10.4.2 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**

份额单位：份

万家日日薪 B

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023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 (%)
万家共赢	5,911,444.36	0.1648	2,507,672.87	0.0693

**6.4.10.5 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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
农业银行-活期存款	4,225,425,507.35	52,377,684.49	2,531,368.05	6,006.72
农业银行-定期存款	100,178,666.56	178,666.56	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，存款按银行同业利率或约定利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方所承销的证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期及上年度可比期间没有需作说明的其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

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
79,762,584.14	10,726.11	-	79,773,310.25	-
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
42,572,515.08	21,709.77	-	42,594,224.85	-

#### 6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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发/增发而流通受限证券。

##### 6.4.12.2 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。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 900,152,876.71 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
112406060	24 交通银行 CD060	2024 年 7 月 1 日	99.16	3,261,000	323,354,002.62
112417099	24 光大银行 CD099	2024 年 7 月 1 日	98.63	4,446,000	438,501,904.79
112499849	24 长沙银行 CD120	2024 年 7 月 1 日	99.16	2,177,000	215,863,246.61
合计				9,884,000	977,719,154.02

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应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。

##### 6.4.13.2 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。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险。本基金

均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，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。

#### 6.4.13.2.1 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	50,915,330.72
A-1 以下	-	-
未评级	6,926,357,690.39	1,324,363,499.93
合计	6,926,357,690.39	1,375,278,830.65

注：未评级债券包括短期融资券、同业存单。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-	112,976,276.64
AAA 以下	-	-
未评级	60,048,877.39	211,717,808.65
合计	60,048,877.39	324,694,085.29

注：未评级债券包括政策性金融债。

#### 6.4.13.3 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。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金期末持有的流通受限证券外，其余均能及时变现。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。

### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金资产的流动性风险进行管理，基金管理人建立了健全的流动性风险管理的内部控制体系，在申购赎回确认、投资交易、估值和信息披露等运作过程中专业审慎、勤勉尽责地管控基金的流动性风险，维护投资者的合法权益，公平对待投资者。本基金开放期间管理人对组合持仓集中度、短期变现能力、流动性受限资产比例、现金类资产比例等流动性指标进行持续的监测和分析，通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，对交易对手进行必要的尽职调查和准入，加强逆回购的流动性风险和交易对手风险的管理，并健全了逆回购交易质押品管理制度。

本基金所持有的证券大部分具有良好的流动性，部分证券流通暂时受限的情况参见附注 6.4.12 “期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券”，本报告期内本基金未出现因投资品种变现困难或投资集中而无法以合理价格及时变现基金资产以支付赎回款的情况。

### 6.4.13.4 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。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 4 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
资 产							

货币资金	4,786,066,875.69	3,720,783,763.66	5,335,899,719.79	-	-	-	13,842,750,359.14
存出保证金	4,216.82	-	-	-	-	-	4,216.82
交易性金融资产	90,603,573.44	2,764,358,418.84	4,131,444,575.50	-	-	-	6,986,406,567.78
买入返售金融资产	375,106,175.13	-	-	-	-	-	375,106,175.13
应收申购款	-	-	-	-	-	6,498,416.45	6,498,416.45
资产总计	5,251,780,841.08	6,485,142,182.50	9,467,344,295.29	-	-	6,498,416.45	21,210,765,735.32
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,266,729.65	4,266,729.65
应付托	-	-	-	-	-	853,345.91	853,345.91

管费							
卖出回购金融资产款	900,152,876.71	-	-	-	-	-	900,152,876.71
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,509,162.96	3,509,162.96
应交税费	-	-	-	-	-	27,468.51	27,468.51
其他负债	-	-	-	-	-	330,066.20	330,066.20
负债总计	900,152,876.71	-	-	-	-	8,986,773.23	909,139,649.94
利率敏感度缺口	4,351,627,964.37	36,485,142,182.50	59,467,344,295.29	-	-	-2,488,356.78	20,301,626,085.38
上年度末 2023 年 12 月	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

31日							
资产							
货币资金	564,535,669.11	50,564,105.78	1,132,179,946.60	-	-	-	1,747,279,721.49
存出保证金	238.36	-	-	-	-	-	238.36
交易性金融资产	-	427,836,610.14	1,272,136,305.80	-	-	-	1,699,972,915.94
买入返售金融资产	924,964,979.31	-	-	-	-	-	924,964,979.31
应收申购款	-	-	-	-	-	22,742,300.17	22,742,300.17
资产总计	1,489,500,886.78	478,400,715.92	2,404,316,252.40	-	-	22,742,300.17	4,394,960,155.27
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,000.12	1,000.12
应	-	-	-	-	-	822,839.33	822,839.33

付 管 理 人 报 酬							
应 付 托 管 费	-	-	-	-	-	164,567.88	164,567.88
应 付 清 算 款	-	-	-	-	-	300,000,000.00	300,000,000.00
卖 出 回 购 金 融 资 产 款	443,305,635.61	-	-	-	-	-	443,305,635.61
应 付 销 售 服 务 费	-	-	-	-	-	39,785.21	39,785.21
应 交 税 费	-	-	-	-	-	13,954.54	13,954.54
其 他 负 债	-	-	-	-	-	276,338.51	276,338.51
负 债 总 计	443,305,635.61	-	-	-	-	301,318,485.59	744,624,121.20
利	1,046,195,251.1	478,400,715.92	2,404,316,252.4	-	-	-278,576,185.4	3,650,336,034.0

率 敏 感 度 缺 口	7	0	2	7
----------------------------	---	---	---	---

注：该表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	5,845,099.75	1,826,739.97
2. 市场利率上升 25 个基点	-5,832,156.34	-1,823,428.07	

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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。

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

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 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最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第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。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	6,986,406,567.78	1,699,972,915.94
第三层次	-	-
合计	6,986,406,567.78	1,699,972,915.94

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期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均未发生重大变动。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产以及其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 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	6,986,406,567.78	32.94
	其中：债券	6,986,406,567.78	32.94
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	375,106,175.13	1.77
	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	13,842,750,359.14	65.26
4	其他各项资产	6,502,633.27	0.03

5	合计	21, 210, 765, 735. 32	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	8. 85	
	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	900, 152, 876. 71	4. 43
	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%。

## 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	98
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	60

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

报告期内未发生投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

### 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	25. 67	4. 43
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	15. 21	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	16. 43	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	4. 77	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	42. 36	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
合计		104.45	4.43

#### 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

本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

#### 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	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,048,877.39	0.30
	其中：政策性 金融债	60,048,877.39	0.30
4	企业债券	-	-
5	企业短期融 资券	732,249,582.01	3.61
6	中期票据	-	-
7	同业存单	6,194,108,108.38	30.51
8	其他	-	-
9	合计	6,986,406,567.78	34.41
10	剩余存续期 超过 397 天的 浮动利率债 券	-	-

#### 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资 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)	按实际利率计算的 账面价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	112420048	24 广发银行 CD048	9,000,000	897,776,006.49	4.42
2	112499849	24 长沙银行 CD120	5,000,000	495,781,457.54	2.44
3	112417099	24 光大银行 CD099	5,000,000	493,142,043.17	2.43
4	112492742	24 广州农村 商业银行 CD016	4,000,000	398,644,138.22	1.96
5	112406060	24 交通银行 CD060	4,000,000	396,631,711.28	1.95
6	112409033	24 浦发银行	3,000,000	297,600,879.61	1.47

		CD033			
7	112495089	24 西安银行 CD012	2,000,000	199,139,359.48	0.98
8	112496041	24 杭州银行 CD054	2,000,000	198,763,277.28	0.98
9	112496101	24 厦门国际 银行 CD071	2,000,000	198,752,691.24	0.98
10	112499876	24 重庆农村 商行 CD075	2,000,000	198,312,747.16	0.98

### 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0.0697%
报告期内偏离度的最低值	0.0199%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0397%

#### 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达到 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达到 0.5%。

### 7.8 期末按实际利率计算的账面价值占基金资产净值比例大小排名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。

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1 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。

#### 7.9.2 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局商丘监管分局的处罚，广发银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，中国光大银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，杭州银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局浙江监管局的处罚，西安银行股份有限公司在报告编制日前一

年内曾受到国家金融监督管理总局陕西监管局的处罚，本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、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	4,216.82
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	6,498,416.45
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	6,502,633.27

### 7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 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	743,818	22,471.58	2,838,002.55	0.02	16,711,928,278.77	99.98
万家日日薪 B	432,474	8,293.82	438,671,882.94	12.23	3,148,187,921.12	87.77
万家日日薪 R	-	-	-	-	-	-
合计	1,175,365	17,272.61	441,509,885.49	2.17	19,860,116,199.89	97.83

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	券商类机构	234,523,177.88	1.16
2	银行类机构	101,602,423.90	0.50
3	其他机构	20,444,107.38	0.10
4	基金类机构	19,141,203.66	0.09
5	基金类机构	12,462,768.69	0.06
6	个人	12,225,039.28	0.06
7	保险类机构	9,027,015.59	0.04
8	个人	8,035,507.31	0.04
9	个人	7,624,003.40	0.04
10	个人	7,313,678.48	0.04

## 8.3 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	1,884,329.02	0.0113
	万家日日薪 B	814,832.01	0.0227
	万家日日薪 R	-	-
	合计	2,699,161.03	0.0133

## 8.4 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	0
	万家日日薪 R	0
	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	0
	万家日日薪 B	0
	万家日日薪 R	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	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）基金份额总额	7,535,700,214.64	-	-

本报告期期初基金份额总额	33,720,454.22	3,616,615,579.85	-
本报告期基金总申购份额	56,931,872,188.31	6,686,458,838.83	-
减：本报告期基金总赎回份额	40,250,826,361.21	6,716,214,614.62	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	16,714,766,281.32	3,586,859,804.06	-

## § 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

报告期内本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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

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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

### 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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 (%)	
海通证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 财务状况良好，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) 具有较强的金融服务能力和水平。

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：

无。

### 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 (%)
海通证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	50,015,050.00	100.00	3,727,073,000.00	100.00	-	-

### 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。

### 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	万家基金管理有限公司关于暂停网站、网上交易、微信交易、app、客户服务系统等相关服务的公告	指定媒介	2024 年 1 月 11 日
2	万家基金管理有限公司关于暂停网站、网上交易、微信交易、app、客户服务系统等相关服务的公告	指定媒介	2024 年 1 月 18 日
3	万家日日薪货币市场证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	指定媒介	2024 年 1 月 19 日

4	万家基金管理有限公司旗下基金季度报告提示性公告	指定媒介	2024 年 1 月 19 日
5	关于万家日日薪货币市场证券投资基金 2024 年春节节前暂停申购(含转换转入、定期定额投资)业务的公告	指定媒介	2024 年 2 月 6 日
6	万家基金管理有限公司关于暂停网上交易、微信交易、app 系统等相关服务的公告	指定媒介	2024 年 2 月 21 日
7	万家基金管理有限公司关于旗下基金在华源证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2024 年 2 月 24 日
8	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增兴业银行为销售机构并开通转换、基金定投业务的公告	指定媒介	2024 年 3 月 25 日
9	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国贸期货为销售机构并开通转换、基金定投业务的公告	指定媒介	2024 年 3 月 25 日
10	万家基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	指定媒介	2024 年 3 月 29 日
11	万家日日薪货币市场证券投资基金 2023 年年度报告	指定媒介	2024 年 3 月 29 日
12	万家基金管理有限公司旗下基金季度报告提示性公告	指定媒介	2024 年 4 月 19 日
13	万家日日薪货币市场证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	指定媒介	2024 年 4 月 19 日
14	万家基金管理有限公司关于暂停网站、网上交易、微信交易、APP、客户服务、电话交易、在线客服系统等相关服务的公告	指定媒介	2024 年 4 月 19 日
15	万家日日薪货币市场证券投资基金基金产品资料概要(更新)	指定媒介	2024 年 6 月 7 日
16	万家基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金更新基金产品资料概要的提示性公告	指定媒介	2024 年 6 月 7 日
17	万家基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在交通银行股份有限公司定投起点的公告	指定媒介	2024 年 6 月 28 日

## § 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

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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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、《万家日日薪货币市场证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家日日薪货币市场证券投资基金托管协议》。
- 4、万家日日薪货币市场证券投资基金 2024 年中期报告原文。
- 5、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。
- 7、本报告期内在中国证监会指定媒介公开披露的基金净值、更新招募说明书及其他临时公告。

### 12.2 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](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

2024 年 8 月 30 日