

万家中证创业成长指数分级证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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、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。

基金托管人中国工商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、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

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 6 |
| 2.1 基金基本情况..... | 6 |
| 2.2 基金产品说明..... | 7 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 7 |
| 2.4 信息披露方式..... | 8 |
| 2.5 其他相关资料..... | 8 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 9 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 9 |
| 3.2 基金净值表现..... | 9 |
| 3.3 其他指标..... | 错误!未定义书签。 |
| §4 管理人报告 | 11 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 11 |
| 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..... | 13 |
| 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..... | 15 |
| 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 |
| §5 托管人报告 | 16 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 16 |
| 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..... | 16 |
| 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..... | 16 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 17 |
| 6.1 资产负债表..... | 17 |
| 6.2 利润表..... | 18 |

| | |
|--|-----------|
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 19 |
| 6.4 报表附注..... | 20 |
| §7 投资组合报告..... | 40 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 40 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 40 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 41 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 44 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 46 |
| 7.6 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..... | 46 |
| 7.7 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..... | 46 |
| 7.8 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贵金属投资明细..... | 46 |
| 7.9 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..... | 46 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 46 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 47 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 47 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 49 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 49 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人..... | 49 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 50 |
| 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的情况..... | 50 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 51 |
| §10 重大事件揭示..... | 52 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 52 |
| 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..... | 52 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 52 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 52 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 52 |
| 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..... | 52 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 52 |
| 10.8 其他重大事件..... | 错误!未定义书签。 |

| | |
|---|-----------|
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 | 54 |
| 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 | 54 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 错误!未定义书签。 |
| §12 备查文件目录 | 55 |
| 12.1 备查文件目录..... | 55 |
| 12.2 存放地点..... | 55 |
| 12.3 查阅方式..... | 55 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | | |
|----------------|--------------------|----------------|----------------|
| 基金名称 | 万家中证创业成长指数分级证券投资基金 | | |
| 基金简称 | 成长分级 | | |
| 场内简称 | 成长分级 | | |
| 基金主代码 | 161910 | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | |
| 基金合同生效日 | 2012 年 8 月 2 日 | | |
| 基金管理人 | 万家基金管理有限公司 | | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | | |
| 报告期末基金份额总额 | 22,319,361.49 份 | | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | | |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 | | |
| 上市日期 | 2012 年 10 月 12 日 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 成长 A | 成长 B | 成长分级 |
| 下属分级基金的交易代码 | 150090 | 150091 | 161910 |
| 报告期末下属分级基金份额总额 | 6,918,283.00 份 | 6,918,283.00 份 | 8,482,795.49 份 |

注：本基金的基金份额包括万家中证创业成长指数分级证券投资基金之基础份额（简称“万家创业成长份额”）、万家中证创业成长指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（简称“万家创业成长 A 份额”）与万家中证创业成长指数分级证券投资基金之积极收益类份额（简称“万家创业成长 B 份额”）。其中，万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比例不变，且两类基金份额的基金资产合并运作。

本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后，投资者场外认购的全部基金份额确认为万家创业成长份额；投资者场内认购的全部基金份额将按 1:1 的比例自动分离预期收益与风险不同的两个份额类别，即万家创业成长 A 份额和万家创业成长 B 份额。

本《基金合同》生效后，万家创业成长份额只接受场内与场外的申购和赎回，但不上市交易。万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额只可在深圳证券交易所上市交易，不可单独进行申购或赎回。

基金管理人将根据《基金合同》约定办理万家创业成长份额与万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额之间的份额配对转换业务。

投资者可选择将其场内申购的万家创业成长份额按 1:1 的比例分拆成万家创业成长 A 份额和万家创业成长 B 份额。投资者可按 1:1 的配比将其持有的万家创业成长 A 份额和万家创业成长 B 份额申请合并为万家创业成长份额后赎回。

投资者在场外申购的万家创业成长份额不得申请进行分拆(《基金合同》另有规定的除外),但可通过跨系统转托管至场内并申请将其按 1:1 的比例分拆为万家创业成长 A 份额和万家创业成长 B 份额。

2.2 基金产品说明

| | | | |
|---------------|--|-----------------------------|---|
| 投资目标 | 本基金采用被动式指数化投资方法,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%。 | | |
| 投资策略 | 本基金为指数型基金,采用完全复制的方法进行投资运作,按照成份股在中证创业成长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%×中证创业成长指数收益率+5%×银行同业存款利率。 | | |
| 风险收益特征 | 本基金为指数分级基金,不同的基金份额具有不同的风险收益特征。万家创业成长份额为常规指数基金份额,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。 | | |
| 下属分级基金的风险收益特征 | 万家创业成长 A 份额,具有较低风险、收益相对稳定的特征。 | 万家创业成长 B 份额,具有高风险、高预期收益的特征。 | 万家创业成长份额为常规指数基金份额,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。 |

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 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 兰剑 | 郭明 |
| | 联系电话 | 021-38909626 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | lanj@wjasset.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 95538 转 6、4008880800 | 95588 |
| 传真 | | 021-38909627 | 010-66105798 |
| 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) | 北京市西城区复兴门内大街 55 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 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |

| | | |
|-------|---------|--------|
| | 楼层 9 层) | |
| 邮政编码 | 200122 | 100140 |
| 法定代表人 | 方一天 | 易会满 |

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 | http://www.wjasset.com |
| 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 | 北京市西城区太平桥大街 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

| 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) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益 | -96,716.17 |
| 本期利润 | 912,796.54 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0357 |
| 本期加权平均净值利润率 | 3.64% |
| 本期基金份额净值增长率 | 3.78% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2017年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | -4,673,322.82 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.2094 |
| 期末基金资产净值 | 22,586,509.22 |
| 期末基金份额净值 | 1.0120 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2017年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 32.58% |

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。

2、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。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

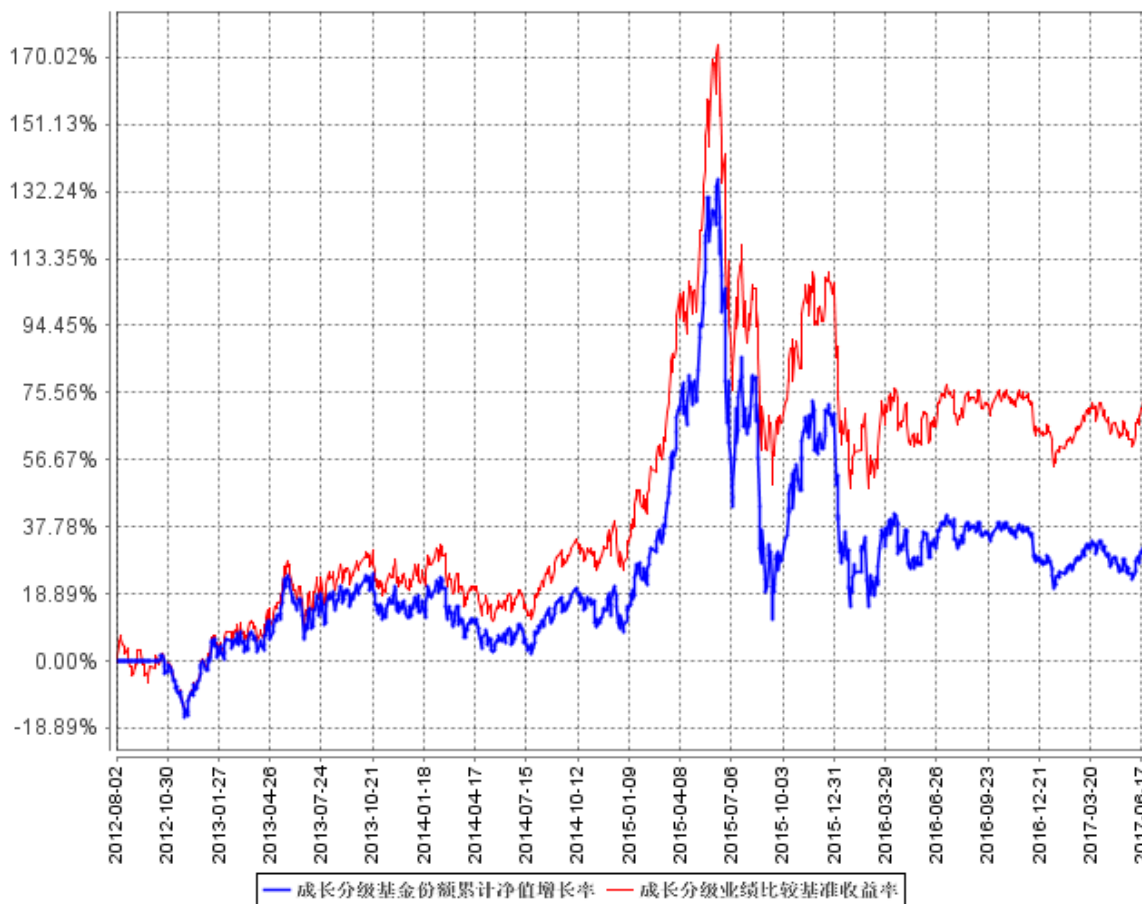
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一个月 | 6.45% | 0.85% | 7.16% | 0.83% | -0.71% | 0.02% |
| 过去三个月 | 0.63% | 0.87% | 2.42% | 0.84% | -1.79% | 0.03% |
| 过去六个月 | 3.78% | 0.84% | 6.13% | 0.83% | -2.35% | 0.01% |
| 过去一年 | -3.31% | 0.85% | 0.55% | 0.84% | -3.86% | 0.01% |
| 过去三年 | 21.42% | 2.12% | 46.18% | 1.89% | -24.76% | 0.23% |
| 自基金合同生效起至今 | 32.58% | 1.87% | 74.01% | 1.73% | -41.43% | 0.14% |

注：业绩比较基准为 95%×中证创业成长指数收益率+5%×银行同业存款利率

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

成长分级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注： 本基金于 2012 年 8 月 2 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的要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同的要求。

§ 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: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:中国(上海)自由贸易试验区浦电路360号8楼(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 | | |
| 卞勇 | 本基金基金经理，万家 180 指数证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金（LOF）、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基金经理。 | 2015 年 8 月 18 日 | - | 9 年 | 量化投资部总监，基金经理，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 月进入在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、万家中证红利指数证券投资基金（LOF）、万家 180 指数证券投资基金、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 年 | 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、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律、法规和监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金持有人谋取最大利益,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 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，宏观数据显示国内经济走势基本保持稳定，各方面积极因素正逐步增加。反映在市场上，投资者风险偏好有所提升，市场信心逐步恢复，交投趋于活跃，在经历前期震荡后随即走出上升趋势。但随着后续热点不足以及监管政策升级，市场进行了迅速调整，直至 5 月中下旬逐步企稳后开始反弹。风格方面分化明显，随着 ipo 提速，打击炒壳并购重组，以及加入 MSCI，股市估值体系正在全面重构。价值投资复兴，大盘蓝筹表现抢眼，小盘股估值回归，整体较为暗淡。报告期本基金投资标的指数——中证创业成长指数收益率为 6.41%。

本基金作为被动投资的指数基金，其投资目标是通过跟踪、复制中证创业成长指数，为投资者获取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，原则上采取完全复制的方法进行投资管理，努力拟合标的指数，减小跟踪误差，将基金跟踪误差控制在较低范围之内。同时，本基金采用有效的量化跟踪技术，降低管理成本。导致跟踪误差的主要原因是基金申购赎回、标的指数成分股调整、指数调出非成分股长期停牌、成分股分红和基金费用等因素。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.012 元，本报告期份额净值增长率为 3.78%，业绩比较基准收益率 6.13%。本基金报告期内日跟踪误差为 0.24%，年化跟踪误差为 5.69%，与标的指数产生偏离的主要原因为基金整体规模较小、成分股和非成分股长期停牌且占比较大、成份股分红、成份股定期调整、日常运作费用等产生的差异。

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，货币政策维持中性，M2 增速下降，金融监管趋严，地产和基建投资资料将继续放缓。国内政策重心从稳增长向调结构、防风险转变。2017 是世界政治大年，但目前看主要大选均平稳度过，没有出现此前市场担心的黑天鹅事件。发过国家和主要新兴国家经济增速均超预期。外汇市场上，人民币对美元的贬值压力有了较大缓解，资本流出和外汇占款下降压力有所缓和。受益于外部市场向好以及供给侧改革驱动，国内经济总体稳定。在结构性改革逐步落实及地产调控的背景下，需关注产业、财税等具有结构性作用的领域，对于符合改革目标、基本面和盈利均有改善的标的有望获得较好的市场表现。

本基金将继续贯彻被动投资理念，恪守基金合同规定的投资目标和投资策略，一如既往地规范、勤勉运作，将本基金打造为稳定有效的指数投资工具，为基金份额持有人谋求长期、稳定回报。

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

根据《基金合同》的约定,存续期内,本基金不进行收益分配。

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

本报告期内本基金自1月1日至6月30日基金资产净值连续119个工作日低于五千万元。我公司已经将该基金情况向证监会报备。

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两百人的情况。

§ 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

本报告期内，本基金托管人在对万家中证创业成长指数分级证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，万家中证创业成长指数分级证券投资基金的管理人——万家基金管理有限公司在万家中证创业成长指数分级证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，万家中证创业成长指数分级证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对万家基金管理有限公司编制和披露的万家中证创业成长指数分级证券投资基金 2017 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：万家中证创业成长指数分级证券投资基金

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 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 1,514,765.25 | 1,547,055.45 |
| 结算备付金 | | 3,812.59 | 8,859.19 |
| 存出保证金 | | 1,892.26 | 3,456.50 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 21,504,577.16 | 27,434,915.15 |
| 其中：股票投资 | | 21,504,577.16 | 27,434,915.15 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 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 | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 300.35 | 316.39 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 119.86 | 1,131.16 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 23,025,467.47 | 28,995,733.84 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 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 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 13,103.05 | 3,955.07 |
| 应付管理人报酬 | | 18,433.58 | 24,936.96 |
| 应付托管费 | | 4,055.42 | 5,486.12 |
| 应付销售服务费 | | 50,000.00 | 50,000.00 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 24,552.93 | 17,433.92 |

| | | | |
|---------------|----------|---------------|---------------|
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 328,813.27 | 300,014.43 |
| 负债合计 | | 438,958.25 | 401,826.50 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 16,876,294.17 | 22,172,171.87 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 5,710,215.05 | 6,421,735.47 |
| 所有者权益合计 | | 22,586,509.22 | 28,593,907.34 |
| 负债和所有者权益总计 | | 23,025,467.47 | 28,995,733.84 |

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，万家中证创业成长指数分级证券投资基金之基础（以下简称“成长分级”）份额净值 1.0120 元，万家中证创业成长指数分级证券投资基金之稳健收益类（以下简称“成长 A”）份额净值 1.0248 元，万家中证创业成长指数分级证券投资基金之积极收益类（以下简称“成长 B”）份额净值 0.9992；成长分级基金份额 8,482,795.49 份，成长 A 基金份额 6,918,283.00 份，成长 B 基金份额 6,918,283.00 份。

6.2 利润表

会计主体：万家中证创业成长指数分级证券投资基金

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 |
|------------------|------------|--|---|
| 一、收入 | | 1,358,055.72 | -4,559,328.68 |
| 1.利息收入 | | 5,491.28 | 12,667.24 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 5,491.28 | 11,271.95 |
| 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 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | 1,395.29 |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 333,631.42 | -3,921,597.08 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 250,286.24 | -4,140,673.56 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 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 | 83,345.18 | 219,076.48 |

| | | | |
|----------------------------|------------|--------------|---------------|
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 1,009,512.71 | -734,686.43 |
| 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 | 9,420.31 | 84,287.59 |
| 减：二、费用 | | 445,259.18 | 804,916.36 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 124,611.98 | 212,149.83 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 27,414.66 | 46,673.00 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 44,264.64 | 240,656.23 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.20 | 248,967.90 | 305,437.30 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 912,796.54 | -5,364,245.04 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 912,796.54 | -5,364,245.04 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家中证创业成长指数分级证券投资基金

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） | 22,172,171.87 | 6,421,735.47 | 28,593,907.34 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 912,796.54 | 912,796.54 |
| 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） | -5,295,877.70 | -1,624,316.96 | -6,920,194.66 |
| 其中：1.基金申购款 | 636,803.04 | 189,227.39 | 826,030.43 |
| 2.基金赎回款 | -5,932,680.74 | -1,813,544.35 | -7,746,225.09 |
| 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） | | | |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 16,876,294.17 | 5,710,215.05 | 22,586,509.22 |
| 项目 | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016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） | 19,398,669.09 | 12,972,267.81 | 32,370,936.90 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -5,364,245.04 | -5,364,245.04 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | 9,713,297.53 | 3,573,867.46 | 13,287,164.99 |
| 其中：1.基金申购款 | 59,127,709.83 | 21,906,059.74 | 81,033,769.57 |
| 2.基金赎回款 | -49,414,412.30 | -18,332,192.28 | -67,746,604.58 |
| 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） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 29,111,966.62 | 11,181,890.23 | 40,293,856.85 |

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

万家中证创业成长指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”），系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] 324 号文《关于核准万家中证创业成长指数分级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发起人于 2012 年 7 月 2 日至 2012 年 7 月 27 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2012)验字第 60778298_B02 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2012

年 8 月 2 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 412,353,281.39 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 70,602.84 元，以上实收基金(本息)合计为人民币 412,423,884.23 元，折合 412,423,884.23 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的基金份额包括万家中证创业成长指数分级证券投资基金之基础份额（简称“万家创业成长份额”）、万家中证创业成长指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（简称“万家创业成长 A 份额”）和万家中证创业成长指数分级证券投资基金之积极收益类份额（简称“万家创业成长 B 份额”）。万家创业成长份额只接受场内与场外的申购和赎回，但不上市交易，万家创业成长 A 份额和万家创业成长 B 份额分别在深圳交易所上市交易，不可单独进行申购或赎回。

投资者可选择将其场内申购的万家创业成长份额按 1:1 的比例分拆成风险和收益特性不同的万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额。投资者可按 1:1 的配比将其持有的万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额申请合并为万家创业成长份额后赎回。投资者在场外申购的万家创业成长份额不得申请进行分拆（《基金合同》另有规定的除外），但可通过跨系统转托管至场内并申请将其按 1:1 的比例分拆为万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额。

本基金定期进行份额折算。在每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)第一个工作日,本基金根据基金合同的规定对万家创业成长 A 份额、万家创业成长份额进行定期份额折算。对于万家创业成长 A 份额上一会计年度的约定收益,即万家创业成长 A 份额每个会计年度 12 月 31 日份额参考净值超出 1.000 元部分,将折算为场内万家创业成长份额分配给万家创业成长 A 份额持有人。万家创业成长份额持有人持有的每两份万家创业成长份额将按一份万家创业成长 A 份额获得新增万家创业成长份额的分配。经过上述份额折算,万家创业成长 A 份额的基金份额参考净值和万家创业成长份额的基金份额净值将相应调整。

本基金还进行不定期份额折算。当万家创业成长份额的基金份额净值大于或等于 2.000 元或者当万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元,基金管理人将根据基金合同的规定对万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额和万家创业成长份额进行份额折算,份额折算后万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的比例仍保持 1:1 不变。份额折算后万家创业成长份额的基金份额净值、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元,万家创业成长份额、万家创业成长 A 份额和万家创业成长 B 份额的份额数将得到相应的调整。

本基金万家创业成长 A 份额 74,051,084.00 份和万家创业成长 B 份额 74,051,085.00 份于

2012 年 10 月 12 日上市交易。

本基金为指数型基金，采用完全复制的方法进行投资运作，按照成份股在中证创业成长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。本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证创业成长指数成份股及其备选成份股（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、新股（一级市场初次发行或增发）、债券、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，中证创业成长指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证创业成长指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$ 。

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 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本半年度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。

6.4.6 税项

1、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。

2、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。

3、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，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。

4、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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 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 | 1,514,765.25 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 1,514,765.25 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | | |
|-------------------|------------------------|---------------|------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 21,131,990.41 | 21,504,577.16 | 372,586.75 |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - |
| | 银行间市场 | - | - |
| | 合计 | - | - |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 21,131,990.41 | 21,504,577.16 | 372,586.75 |

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**

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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 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 | 297.92 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 1.62 |
| 应收债券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 0.81 |
| 合计 | 300.35 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 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 | 24,552.93 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 24,552.93 |

6.4.7.8 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 | 49.37 |
| 预提费用 | 328,763.90 |
| 合计 | 328,813.27 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 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 | 28,590,961.12 | 22,172,171.87 |
| 本期申购 | 9.99 | 7.75 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -1,967.70 | -1,525.97 |
| 2017年1月3日 基金拆分/份额折算前 | 28,589,003.41 | 22,170,653.65 |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | 732,373.39 | - |
| 本期申购 | 842,179.03 | 636,795.29 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -7,844,194.34 | -5,931,154.77 |
| 本期末 | 22,319,361.49 | 16,876,294.17 |

注：1. 根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所（以下简称“深交所”）和中国证券登记结算有限责任公司的规定，本基金以2017年1月3日为份额折算基准日，对万家创业成长份额的场外份额、场内份额以及万家创业成长A份额实施定期份额折算。

2. 根据《基金合同》规定，投资者可申购、赎回万家创业成长份额，万家创业成长A份额和万家创业成长B份额只可在深圳证券交易所上市交易，因此上表不再单独披露万家创业成长A份额和万家创业成长B份额的情况。

3. 申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末 | -6,064,397.47 | 12,486,132.94 | 6,421,735.47 |
| 本期利润 | -96,716.17 | 1,009,512.71 | 912,796.54 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,487,790.82 | -3,112,107.78 | -1,624,316.96 |
| 其中：基金申购款 | -179,195.85 | 368,423.24 | 189,227.39 |
| 基金赎回款 | 1,666,986.67 | -3,480,531.02 | -1,813,544.35 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |

| | | | |
|-----|---------------|---------------|--------------|
| 本期末 | -4,673,322.82 | 10,383,537.87 | 5,710,215.05 |
|-----|---------------|---------------|--------------|

6.4.7.11 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 | 5,356.60 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 119.34 |
| 其他 | 15.34 |
| 合计 | 5,491.28 |

注：上表中其他为直销申购款利息收入及证券结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 17,282,277.41 |
| 减：卖出股票成本总额 | 17,031,991.17 |
| 买卖股票差价收入 | 250,286.24 |

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金报告期无债权投资收益。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 83,345.18 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 83,345.18 |

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 1,009,512.71 |
| ——股票投资 | 1,009,512.71 |
| ——债券投资 | - |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 合计 | 1,009,512.71 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 9,419.93 |
| 转出费收入 | 0.38 |
| 合计 | 9,420.31 |

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 44,264.64 |

| | |
|-----------|-----------|
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 44,264.64 |

6.4.7.20 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 | 29,752.78 |
| 信息披露费 | 89,258.34 |
| 上市费 | 29,752.78 |
| 指数使用费 | 100,000.00 |
| 银行汇划费用 | 204.00 |
| 合计 | 248,967.90 |

注：1. 在通常情况下，指数许可使用基点费按前一日基金资产净值的 0.02% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数许可使用基点费

E 为前一日基金资产净值

指数使用费从基金合同生效日开始每日计提，按季支付。收取下限为每季度人民币伍万元。

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，本基金无需要披露的重大或有事项。

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

本报告期内，与本基金存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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 | 基金管理人，基金销售机构 |
| 工商银行股份有限公司（“工商银行”） | 基金托管人，基金代销机构 |
| 中泰证券股份有限公司（“中泰证券”） | 基金管理人股东，基金代销机构 |

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

金额单位：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 | |
|-------|----------------------------|----------------------|---------------------------------|----------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的 比例 | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的 比例 |
| 中泰证券 | 25,927,847.04 | 94.72% | 152,665,014.92 | 91.79% |

6.4.10.1.2 债券交易

本报告期间本基金未通过关联方席位进行债券回购交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本报告期间本基金未通过关联方席位进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本报告期间本基金未通过关联方席位进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 | | | |
|-------|---------------------------------|----------------|-----------|------------------|
| | 当期 佣金 | 占当期佣金 总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣 金总额的比例 |
| 中泰证券 | 23,239.09 | 94.65% | 23,239.09 | 94.65% |
| 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 佣金 | 占当期佣金 总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣 金总额的比例 |
| 中泰证券 | 136,581.01 | 91.52% | 70,508.80 | 91.05% |

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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 | 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管理费 | 124,611.98 | 212,149.83 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 16,458.68 | 18,905.38 |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

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前 2 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 | 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 | 27,414.66 | 46,673.00 |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.22% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.22\% / \text{当年天数}$$

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前 2 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。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 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

报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

| 成长分级 | | | | |
|-------|-------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
| 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 |
| 中泰证券 | 1.00 | 0.00% | 1.00 | 0.00% |

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 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 |
| 工商银行 | 1,514,765.25 | 5,356.60 | 2,176,960.97 | 11,272.00 |

注：除上表列示的金额外，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责任公司，2017年1月1日至2017年6月30日获得的利息收入为人民币119.34元，2017年6月30日结算备付金余额为人民币3,812.59元。2016年1月1日至6月30日获得的利息为人民币1,004.55元，2016年6月30日结算备付金余额为人民币0元。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

根据本基金基金合同，本基金不进行利润分配。

6.4.12 期末（2017 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

报告期末本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末 估值单 价 | 复牌 日期 | 复牌 开盘单价 | 数量（股） | 期末 成本总额 | 期末估值总 额 | 备注 |
|--------|-------|-------------------------|----------|----------------|------------------------|------------|--------|--------------|------------|----|
| 300104 | 乐视网 | 2017 年4 月17 日 | 重大 事项 | 28.63 | - | - | 26,184 | 1,295,397.21 | 749,647.92 | - |
| 002252 | 上海莱士 | 2017 年4 月21 日 | 重大 事项 | 20.24 | - | - | 21,360 | 458,247.98 | 432,326.40 | - |
| 002426 | 胜利精密 | 2017 年1 月16 日 | 重大 事项 | 7.68 | - | - | 45,200 | 430,719.48 | 347,136.00 | - |
| 300367 | 东方网力 | 2016 年12 月15 日 | 重大 事项 | 20.00 | 2017 年7 月3 日 | 18.01 | 11,350 | 332,625.31 | 227,000.00 | - |
| 000034 | 神州数码 | 2017 年3 月21 日 | 重大 事项 | 24.45 | 2017 年7 月18 日 | 22.01 | 7,700 | 190,130.50 | 188,265.00 | - |
| 300267 | 尔康制药 | 2017 年5 月10 日 | 重大 事项 | 11.46 | - | - | 13,164 | 193,229.69 | 150,859.44 | - |
| 000836 | 鑫茂科技 | 2017 年5 月24 日 | 重大 事项 | 6.05 | - | - | 24,400 | 187,581.25 | 147,620.00 | - |
| 002504 | *ST弘高 | 2017 年5 | 重大 | 8.10 | - | - | 11,025 | 112,197.59 | 89,302.50 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-----------------|---------|-------|-----------------|-------|-------|------------|-----------|---|
| | | 月 2 日 | 事 项 | | | | | | | |
| 300252 | 金信诺 | 2017 年 4 月 27 日 | 重 大 事 项 | 21.65 | 2017 年 7 月 27 日 | 19.49 | 3,800 | 104,427.79 | 82,270.00 | - |
| 300100 | 双林股份 | 2017 年 4 月 5 日 | 重 大 事 项 | 25.96 | - | - | 2,700 | 123,153.75 | 70,092.00 | - |

注:本基金截至 2017 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

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 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证券款余额。

6.4.12.3.2 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证券款余额。

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。

6.4.13.2 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。本基金投资于一家上市公司发行的股票市

值不超过基金资产净值的 10%。

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。

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。

本基金所持证券均在证券交易所上市，因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金于本报告期末持有的流通受限证券外，本报告期末本基金的其他资产均能及时变现。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投资的公允价值。

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。

6.4.13.4 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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 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 |
|------------------------|--------------|--------|-------------|-------|-------|----------------|---------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 1,514,765.25 | - | - | - | - | - | 1,514,765.25 |
| 结算备付金 | 3,812.59 | - | - | - | - | - | 3,812.59 |
| 存出保证金 | 1,892.26 | - | - | - | - | - | 1,892.26 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | -21,504,577.16 | 21,504,577.16 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 300.35 | 300.35 |

| | | | | | | | |
|---------------------|--------------|-------|--------|------|------|----------------|---------------|
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 119.86 | 119.86 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 1,520,470.10 | - | - | - | - | -21,504,997.37 | 23,025,467.47 |
| 负债 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 13,103.05 | 13,103.05 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 18,433.58 | 18,433.58 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 4,055.42 | 4,055.42 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 50,000.00 | 50,000.00 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 24,552.93 | 24,552.93 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 328,813.27 | 328,813.27 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 438,958.25 | 438,958.25 |
| 利率敏感度缺口 | 1,520,470.10 | - | - | - | - | -21,066,039.12 | 22,586,509.22 |
| 上年度末 2016年12月31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 | - | - | - | - | - | - | - |
| 银行存款 | 1,547,055.45 | - | - | - | - | - | 1,547,055.45 |
| 结算备付金 | 8,859.19 | - | - | - | - | - | 8,859.19 |
| 存出保证金 | 3,456.50 | - | - | - | - | - | 3,456.50 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | -27,434,915.15 | 27,434,915.15 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 316.39 | 316.39 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 1,131.16 | 1,131.16 |
| 资产总计 | 1,559,371.14 | - | - | - | - | -27,436,362.70 | 28,995,733.84 |
| 负债 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 3,955.07 | 3,955.07 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 24,936.96 | 24,936.96 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 5,486.12 | 5,486.12 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 50,000.00 | 50,000.00 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 17,433.92 | 17,433.92 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 300,014.43 | 300,014.43 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 401,826.50 | 401,826.50 |
| 利率敏感度缺口 | 1,559,371.14 | - | - | - | - | -27,034,536.20 | 28,593,907.34 |

注：该表统计了本基金交易的利率风险敞口。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

本基金本报告期末计息资产仅包括银行存款、结算备付金及存出保证金，且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其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本报告期末及上年度末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产精致的影响并不显著。

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,因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 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。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券,所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险,并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 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 | 21,504,577.16 | 95.21 | 27,434,915.15 | 95.95 |
| 交易性金融资产-基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-债券投资 | - | - | - | - |
| 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 | 21,504,577.16 | 95.21 | 27,434,915.15 | 95.95 |

注:本基金投资于中证创业成长指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的90%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。上表列示于资产负债表日本基金面临的整体市场价格风险。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 若股票基准指数发生变动而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(2017年6月30日) | 上年度末(2016年12月31日) |
| | 股票基准指数下降100个基点 | -210,003.93 | -265,730.45 |

| | | | |
|--|-----------------------|------------|------------|
| | 股票基准指数上升 100 个基 准点 | 210,003.93 | 265,730.45 |
|--|-----------------------|------------|------------|

注:本基金管理人运用资本-资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。表中为市场价格风险的敏感性分析,反映了在其他变量不变的假设下,证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时,将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 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 | 权益投资 | 21,504,577.16 | 93.39 |
| | 其中：股票 | 21,504,577.16 | 93.39 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 1,518,577.84 | 6.60 |
| 7 | 其他各项资产 | 2,312.47 | 0.01 |
| 8 | 合计 | 23,025,467.47 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 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 | 2,036,870.68 | 9.02 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 12,024,338.91 | 53.24 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 193,672.00 | 0.86 |
| E | 建筑业 | 609,633.30 | 2.70 |
| F | 批发和零售业 | 651,804.00 | 2.89 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 308,310.00 | 1.37 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 3,169,745.27 | 14.03 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 333,842.00 | 1.48 |
| L | 租赁和商务服务业 | 535,835.00 | 2.37 |

| | | | |
|---|---------------|---------------|-------|
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 261,598.00 | 1.16 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 789,389.00 | 3.49 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 589,539.00 | 2.61 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 21,504,577.16 | 95.21 |

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|--------------|--------------|
| 1 | 300498 | 温氏股份 | 67,922 | 1,592,091.68 | 7.05 |
| 2 | 300104 | 乐视网 | 26,184 | 749,647.92 | 3.32 |
| 3 | 300072 | 三聚环保 | 19,448 | 720,548.40 | 3.19 |
| 4 | 002466 | 天齐锂业 | 12,945 | 703,560.75 | 3.11 |
| 5 | 300136 | 信维通信 | 17,040 | 681,940.80 | 3.02 |
| 6 | 002460 | 赣锋锂业 | 11,400 | 527,250.00 | 2.33 |
| 7 | 002572 | 索菲亚 | 12,068 | 494,788.00 | 2.19 |
| 8 | 002044 | 美年健康 | 26,300 | 447,100.00 | 1.98 |
| 9 | 002252 | 上海莱士 | 21,360 | 432,326.40 | 1.91 |
| 10 | 300156 | 神雾环保 | 13,100 | 429,156.00 | 1.90 |
| 11 | 002027 | 分众传媒 | 26,500 | 364,640.00 | 1.61 |
| 12 | 002074 | 国轩高科 | 11,400 | 359,670.00 | 1.59 |
| 13 | 002092 | 中泰化学 | 27,900 | 354,330.00 | 1.57 |
| 14 | 002426 | 胜利精密 | 45,200 | 347,136.00 | 1.54 |
| 15 | 300017 | 网宿科技 | 28,732 | 346,795.24 | 1.54 |
| 16 | 300115 | 长盈精密 | 11,769 | 343,419.42 | 1.52 |
| 17 | 300296 | 利亚德 | 17,700 | 332,760.00 | 1.47 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 18 | 300144 | 宋城演艺 | 15,800 | 329,746.00 | 1.46 |
| 19 | 002407 | 多氟多 | 13,990 | 307,640.10 | 1.36 |
| 20 | 002624 | 完美世界 | 8,600 | 294,980.00 | 1.31 |
| 21 | 002411 | 必康股份 | 10,000 | 289,200.00 | 1.28 |
| 22 | 002217 | 合力泰 | 27,100 | 267,748.00 | 1.19 |
| 23 | 002366 | 台海核电 | 5,600 | 262,696.00 | 1.16 |
| 24 | 000820 | 神雾节能 | 6,900 | 262,062.00 | 1.16 |
| 25 | 002573 | 清新环境 | 13,900 | 261,598.00 | 1.16 |
| 26 | 002558 | 巨人网络 | 5,300 | 244,966.00 | 1.08 |
| 27 | 300113 | 顺网科技 | 9,000 | 242,100.00 | 1.07 |
| 28 | 002352 | 顺丰控股 | 4,500 | 239,220.00 | 1.06 |
| 29 | 002019 | 亿帆医药 | 14,297 | 238,473.96 | 1.06 |
| 30 | 002555 | 三七互娱 | 9,000 | 230,130.00 | 1.02 |
| 31 | 300367 | 东方网力 | 11,350 | 227,000.00 | 1.01 |
| 32 | 300244 | 迪安诊断 | 7,100 | 223,366.00 | 0.99 |
| 33 | 300182 | 捷成股份 | 22,244 | 212,652.64 | 0.94 |
| 34 | 002714 | 牧原股份 | 7,500 | 204,150.00 | 0.90 |
| 35 | 300014 | 亿纬锂能 | 11,132 | 202,045.80 | 0.89 |
| 36 | 002640 | 跨境通 | 9,500 | 201,875.00 | 0.89 |
| 37 | 300207 | 欣旺达 | 16,800 | 198,072.00 | 0.88 |
| 38 | 600856 | 中天能源 | 17,200 | 193,672.00 | 0.86 |
| 39 | 300253 | 卫宁健康 | 24,287 | 189,681.47 | 0.84 |
| 40 | 000034 | 神州数码 | 7,700 | 188,265.00 | 0.83 |
| 41 | 002635 | 安洁科技 | 5,100 | 184,722.00 | 0.82 |
| 42 | 600779 | 水井坊 | 7,400 | 181,892.00 | 0.81 |
| 43 | 002477 | 雏鹰农牧 | 40,800 | 180,744.00 | 0.80 |
| 44 | 300450 | 先导智能 | 3,400 | 176,018.00 | 0.78 |
| 45 | 002468 | 申通快递 | 6,600 | 167,706.00 | 0.74 |
| 46 | 002517 | 恺英网络 | 4,700 | 165,393.00 | 0.73 |
| 47 | 002002 | 鸿达兴业 | 21,000 | 164,430.00 | 0.73 |
| 48 | 600076 | 康欣新材 | 17,900 | 160,563.00 | 0.71 |
| 49 | 002036 | 联创电子 | 9,700 | 160,050.00 | 0.71 |
| 50 | 000036 | 华联控股 | 17,300 | 157,430.00 | 0.70 |
| 51 | 002043 | 兔宝宝 | 11,200 | 155,008.00 | 0.69 |
| 52 | 300267 | 尔康制药 | 13,164 | 150,859.44 | 0.67 |
| 53 | 000687 | 华讯方舟 | 9,900 | 149,886.00 | 0.66 |
| 54 | 000836 | 鑫茂科技 | 24,400 | 147,620.00 | 0.65 |
| 55 | 002709 | 天赐材料 | 3,500 | 144,095.00 | 0.64 |
| 56 | 300294 | 博雅生物 | 3,441 | 141,906.84 | 0.63 |

| | | | | | |
|----|--------|--------|--------|------------|------|
| 57 | 300118 | 东方日升 | 9,800 | 137,690.00 | 0.61 |
| 58 | 300376 | 易事特 | 15,000 | 136,050.00 | 0.60 |
| 59 | 002018 | 华信国际 | 19,800 | 135,630.00 | 0.60 |
| 60 | 002091 | 江苏国泰 | 13,600 | 129,880.00 | 0.58 |
| 61 | 300237 | 美晨科技 | 7,000 | 120,820.00 | 0.53 |
| 62 | 000150 | 宜华健康 | 4,900 | 118,923.00 | 0.53 |
| 63 | 000018 | 神州长城 | 15,540 | 117,637.80 | 0.52 |
| 64 | 600285 | 羚锐制药 | 10,300 | 115,669.00 | 0.51 |
| 65 | 600986 | 科达股份 | 8,400 | 113,904.00 | 0.50 |
| 66 | 300297 | 蓝盾股份 | 10,200 | 111,690.00 | 0.49 |
| 67 | 002636 | 金安国纪 | 6,300 | 108,801.00 | 0.48 |
| 68 | 002210 | 飞马国际 | 6,300 | 108,171.00 | 0.48 |
| 69 | 000065 | 北方国际 | 4,500 | 107,010.00 | 0.47 |
| 70 | 000957 | 中通客车 | 9,000 | 105,300.00 | 0.47 |
| 71 | 002120 | 韵达股份 | 2,000 | 103,200.00 | 0.46 |
| 72 | 300131 | 英唐智控 | 11,600 | 97,672.00 | 0.43 |
| 73 | 002147 | 新光圆成 | 6,100 | 94,794.00 | 0.42 |
| 74 | 300506 | 名家汇 | 3,300 | 93,159.00 | 0.41 |
| 75 | 000802 | 北京文化 | 6,300 | 91,728.00 | 0.41 |
| 76 | 002504 | *ST 弘高 | 11,025 | 89,302.50 | 0.40 |
| 77 | 000055 | 方大集团 | 11,750 | 85,540.00 | 0.38 |
| 78 | 000892 | 欢瑞世纪 | 8,500 | 85,255.00 | 0.38 |
| 79 | 300302 | 同有科技 | 4,600 | 82,846.00 | 0.37 |
| 80 | 300426 | 唐德影视 | 3,500 | 82,810.00 | 0.37 |
| 81 | 000952 | 广济药业 | 5,500 | 82,665.00 | 0.37 |
| 82 | 300252 | 金信诺 | 3,800 | 82,270.00 | 0.36 |
| 83 | 002314 | 南山控股 | 12,200 | 81,618.00 | 0.36 |
| 84 | 000070 | 特发信息 | 6,800 | 79,900.00 | 0.35 |
| 85 | 300231 | 银信科技 | 5,900 | 77,880.00 | 0.34 |
| 86 | 300056 | 三维丝 | 5,000 | 75,800.00 | 0.34 |
| 87 | 300457 | 赢合科技 | 1,100 | 75,240.00 | 0.33 |
| 88 | 002841 | 视源股份 | 1,000 | 74,220.00 | 0.33 |
| 89 | 300100 | 双林股份 | 2,700 | 70,092.00 | 0.31 |
| 90 | 600119 | 长江投资 | 4,700 | 69,090.00 | 0.31 |
| 91 | 300242 | 明家联合 | 6,900 | 65,481.00 | 0.29 |
| 92 | 603579 | 荣泰健康 | 500 | 64,910.00 | 0.29 |
| 93 | 300497 | 富祥股份 | 1,200 | 63,348.00 | 0.28 |
| 94 | 000796 | 凯撒旅游 | 5,200 | 63,024.00 | 0.28 |
| 95 | 300246 | 宝莱特 | 2,200 | 60,170.00 | 0.27 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|-------|-----------|------|
| 96 | 002458 | 益生股份 | 2,900 | 59,885.00 | 0.27 |
| 97 | 002270 | 华明装备 | 5,500 | 58,960.00 | 0.26 |
| 98 | 000565 | 渝三峡 A | 5,700 | 58,710.00 | 0.26 |
| 99 | 002172 | 澳洋科技 | 6,400 | 51,456.00 | 0.23 |
| 100 | 002323 | 雅百特 | 4,900 | 50,176.00 | 0.22 |
| 101 | 603239 | 浙江仙通 | 1,800 | 46,854.00 | 0.21 |
| 102 | 300121 | 阳谷华泰 | 3,100 | 42,780.00 | 0.19 |
| 103 | 300484 | 蓝海华腾 | 1,400 | 42,504.00 | 0.19 |
| 104 | 300571 | 平治信息 | 300 | 41,598.00 | 0.18 |
| 105 | 600828 | 茂业商业 | 4,100 | 34,112.00 | 0.15 |
| 106 | 603929 | 亚翔集成 | 1,400 | 31,528.00 | 0.14 |

7.3.2 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所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1 | 300498 | 温氏股份 | 1,437,109.40 | 5.03 |
| 2 | 002044 | 美年健康 | 435,344.06 | 1.52 |
| 3 | 002092 | 中泰化学 | 324,711.86 | 1.14 |
| 4 | 000820 | 神雾节能 | 270,689.00 | 0.95 |
| 5 | 002407 | 多氟多 | 264,084.80 | 0.92 |
| 6 | 002558 | 巨人网络 | 251,791.00 | 0.88 |
| 7 | 002217 | 合力泰 | 248,556.00 | 0.87 |
| 8 | 002366 | 台海核电 | 240,196.66 | 0.84 |
| 9 | 002352 | 顺丰控股 | 239,614.00 | 0.84 |
| 10 | 002027 | 分众传媒 | 222,074.00 | 0.78 |
| 11 | 300244 | 迪安诊断 | 219,994.00 | 0.77 |
| 12 | 002477 | 雏鹰农牧 | 189,449.07 | 0.66 |
| 13 | 300014 | 亿纬锂能 | 174,133.40 | 0.61 |
| 14 | 002468 | 申通快递 | 166,486.00 | 0.58 |
| 15 | 002043 | 兔宝宝 | 165,781.00 | 0.58 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 16 | 002002 | 鸿达兴业 | 158,262.00 | 0.55 |
| 17 | 000687 | 华讯方舟 | 157,387.00 | 0.55 |
| 18 | 600076 | 康欣新材 | 153,838.00 | 0.54 |
| 19 | 300294 | 博雅生物 | 148,769.82 | 0.52 |
| 20 | 300136 | 信维通信 | 144,217.00 | 0.50 |

注:买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,“买入金额”按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1 | 002415 | 海康威视 | 2,129,251.41 | 7.45 |
| 2 | 002450 | 康得新 | 1,353,500.40 | 4.73 |
| 3 | 300059 | 东方财富 | 1,242,897.88 | 4.35 |
| 4 | 002594 | 比亚迪 | 743,148.00 | 2.60 |
| 5 | 002202 | 金风科技 | 670,329.00 | 2.34 |
| 6 | 002475 | 立讯精密 | 613,096.02 | 2.14 |
| 7 | 002508 | 老板电器 | 557,170.63 | 1.95 |
| 8 | 002085 | 万丰奥威 | 456,274.44 | 1.60 |
| 9 | 002179 | 中航光电 | 317,464.00 | 1.11 |
| 10 | 002602 | 世纪华通 | 301,978.00 | 1.06 |
| 11 | 300324 | 旋极信息 | 293,521.00 | 1.03 |
| 12 | 002400 | 省广股份 | 288,633.03 | 1.01 |
| 13 | 002174 | 游族网络 | 285,625.00 | 1.00 |
| 14 | 000048 | 康达尔 | 278,790.00 | 0.97 |
| 15 | 002221 | 东华能源 | 240,681.00 | 0.84 |
| 16 | 300072 | 三聚环保 | 234,684.06 | 0.82 |
| 17 | 002373 | 千方科技 | 210,443.12 | 0.74 |
| 18 | 300199 | 翰宇药业 | 194,509.00 | 0.68 |
| 19 | 002643 | 万润股份 | 184,126.00 | 0.64 |
| 20 | 002466 | 天齐锂业 | 178,481.00 | 0.62 |

注:卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票,“卖出金额”按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|---------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 10,092,140.47 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 17,282,277.41 |

注：买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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投资。

7.6 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投资。

7.7 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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

根据基金合同，本基金暂不可投资于股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同，本基金暂不可投资于股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同，本基金暂不可投资于国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

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。

7.12.3 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 | 1,892.26 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 300.35 |
| 5 | 应收申购款 | 119.86 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,312.47 |

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|------|------|-------------|---------------|----------|
|----|------|------|-------------|---------------|----------|

| | | | | | |
|---|--------|------|------------|------|------|
| 1 | 300104 | 乐视网 | 749,647.92 | 3.32 | 重大事项 |
| 2 | 002252 | 上海莱士 | 432,326.40 | 1.91 | 重大事项 |

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

§ 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 |
| 成长 A | 139 | 49,771.82 | 3,984,384.00 | 57.59% | 2,933,899.00 | 42.41% |
| 成长 B | 1,190 | 5,813.68 | 718,660.00 | 10.39% | 6,199,623.00 | 89.61% |
| 成长分级 | 1,310 | 6,475.42 | 62,109.46 | 0.73% | 8,420,686.03 | 99.27% |
| 合计 | 2,639 | 8,457.51 | 4,765,153.46 | 21.35% | 17,554,208.03 | 78.65% |

8.2 期末上市基金前十名持有人

成长 A

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例 |
|----|-------------------------------|--------------|----------|
| 1 | 上海铂绅投资中心（有限合伙）—铂绅四号证券投资基金（私募） | 1,777,907.00 | 25.70% |
| 2 | 黄松友 | 1,227,589.00 | 17.74% |
| 3 | 李怡名 | 1,207,382.00 | 17.45% |
| 4 | 上海边域投资管理有限公司—边域海际 1 号私募证券投资基金 | 588,030.00 | 8.50% |
| 5 | 华泰期货有限公司—华泰期货 1 期资产管理计划 | 574,900.00 | 8.31% |
| 6 | 华泰期货有限公司—华泰期货 3 期资产管理计划 | 522,000.00 | 7.55% |
| 7 | 上海明泫投资管理有限公司—明泫全天候一号基金 | 398,801.00 | 5.76% |
| 8 | 上海明泫投资管理有限公司—明泫 CTA 一号基金 | 106,309.00 | 1.54% |
| 9 | 李力 | 100,000.00 | 1.45% |
| 10 | 童冬 | 70,000.00 | 1.01% |

成长 B

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例 |
|----|--------------------|------------|----------|
| 1 | 济南市人民政府国有资产监督管理委员会 | 706,500.00 | 10.21% |
| 2 | 刁成芳 | 687,500.00 | 9.94% |

| | | | |
|----|-----|------------|-------|
| 3 | 李新民 | 300,000.00 | 4.34% |
| 4 | 邹璞如 | 200,000.00 | 2.89% |
| 5 | 郑信芳 | 194,000.00 | 2.80% |
| 6 | 石天兴 | 167,700.00 | 2.42% |
| 7 | 温建云 | 137,231.00 | 1.98% |
| 8 | 郑大凯 | 85,600.00 | 1.24% |
| 9 | 何凤珍 | 83,900.00 | 1.21% |
| 10 | 郭雅君 | 78,100.00 | 1.13% |

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 | 成长 A | 0.00 | 0.00% |
| | 成长 B | 0.00 | 0.00% |
| | 成长分级 | 0.00 | 0.00% |
| | 合计 | 0.00 | 0.00% |

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 | 成长 A | 0 |
| | 成长 B | 0 |
| | 成长分级 | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 成长 A | 0 |
| | 成长 B | 0 |
| | 成长分级 | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 成长 A | 成长 B | 成长分级 |
|-----------------------------------|---------------|---------------|----------------|
| 基金合同生效日（2012 年 8 月 2 日） 基金份额总额 | 74,051,084.00 | 74,051,084.00 | 264,321,715.23 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 10,258,793.00 | 10,258,793.00 | 8,073,375.12 |
| 本报告期基金总申购份额 | - | - | 842,187.08 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | - | - | 7,846,160.10 |
| 本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) | -3,340,510.00 | -3,340,510.00 | 7,413,393.39 |
| 本报告期末基金份额总额 | 6,918,283.00 | 6,918,283.00 | 8,482,795.49 |

注：本报告期基金拆分变动份额包含基金份额配对转换及基金份额折算所带来的变动数。

§ 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

10.2.1 基金管理人的专门基金托管部门的重大人事变动

2017 年 4 月 8 日，公司增聘朱小明为万家中证创业成长指数分级基金的基金经理，与基金经理卞勇共同管理该基金。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，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

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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

| | 交易单元 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 | 备注 |
|------|------------|---------------|----------------------|-----------|----------------|----|
| 中泰证券 | 1 | 25,927,847.04 | 94.72% | 23,239.09 | 94.65% | - |
| 华宝证券 | 1 | 1,446,570.84 | 5.28% | 1,313.84 | 5.35% | - |

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，本公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

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、基金专用交易席位的变更情况：

本期席位未变更。

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 |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华宝证券 | - | - | - | - | - | - |

§ 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。

§ 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中证创业成长指数分级证券投资基金发行及募集的文件。
- 2、《万家中证创业成长指数分级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、万家中证创业成长指数分级证券投资基金 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、《万家中证创业成长指数分级证券投资基金托管协议》。

12.2 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

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