

万家行业优选混合型证券投资基金(LOF) 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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17

6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12 投资组合报告附注.....	42
§8 基金份额持有人信息.....	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
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.....	43
§9 开放式基金份额变动.....	44
§10 重大事件揭示.....	44
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
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.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	46
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.....	46

§12 备查文件目录	47
12.1 备查文件目录.....	47
12.2 存放地点.....	47
12.3 查阅方式.....	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家行业优选混合型证券投资基金 (LOF)
基金简称	万家行业优选
场内简称	万家优选
基金主代码	161903
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2005 年 7 月 15 日
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	270,989,011.13 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	2005 年 8 月 15 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资景气行业或预期景气度向好的行业股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采取优选行业和精选个股相结合的主动投资管理方式，并适度动态配置大类资产。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数收益率+20%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金是混合型基金，风险低于股票型基金，高于货币市场基金、债券型基金，属于中等风险、中等预期收益的证券投资基金。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	陆志俊
	联系电话	021-38909626	95559
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		95538 转 6、4008880800	95559
传真		021-38909627	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验	上海市浦东新区银城中路 188

	区浦电路 360 号 8 层(名义 楼层 9 层)	号
办公地址	中国(上海)自由贸易试验 区浦电路 360 号 8 层(名义 楼层 9 层)	上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码	200122	200120
法定代表人	方一天	牛锡明

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)自由贸易实验区浦电路 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	10,173,164.86
本期利润	5,336,304.24
加权平均基金份额本期利润	0.0232
本期加权平均净值利润率	2.67%
本期基金份额净值增长率	4.23%
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	26,229,880.77
期末可供分配基金份额利润	0.0968
期末基金资产净值	229,634,027.80
期末基金份额净值	0.8474
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	247.10%

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) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或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

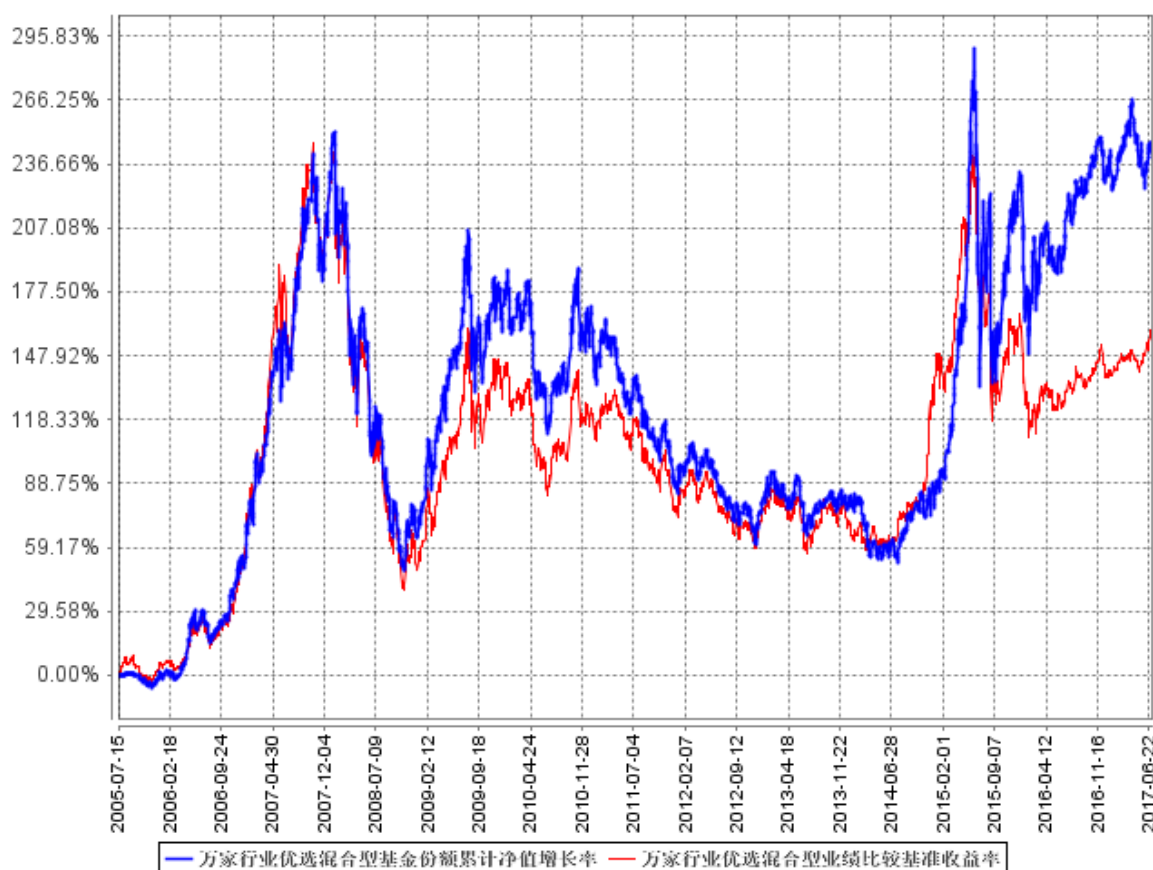
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.80%	0.82%	4.01%	0.54%	0.79%	0.28%
过去三个月	-1.50%	0.98%	4.90%	0.49%	-6.40%	0.49%
过去六个月	4.23%	0.85%	8.65%	0.45%	-4.42%	0.40%
过去一年	14.63%	0.85%	13.30%	0.54%	1.33%	0.31%
过去三年	115.34%	1.93%	59.07%	1.40%	56.27%	0.53%
过去五年	86.01%	1.64%	46.08%	1.24%	39.93%	0.40%

自基金合同生效起至今	247.10%	1.64%	158.98%	1.45%	88.12%	0.19%
------------	---------	-------	---------	-------	--------	-------

注：基金业绩比较基准增长率=80%×沪深 300 指数收益率+20%×上证国债指数收益率

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

万家行业优选混合型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 2013 年 7 月 11 日召开持有人大会，会议审议通过了《关于修改万家公用事业行业股票型证券投资基金（LOF）基金合同有关事项的议案》，该议案已于 2013 年 8 月 28 日通过并完成向中国证监会的备案。根据基金份额持有人大会决议，原“万家公用事业行业股票型证券投资基金（LOF）”更名为“万家行业优选股票型证券投资基金（LOF）”。更名后基金的建仓期为持有人大会决议生效日起 6 个月。建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同要求。2015 年 7 月 31 日，“万家行业优选股票型证券投资基金（LOF）”更名为“万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）”。报告期末各项资产配置比例符合基金合同要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44号文批准设立。公司现股东为中泰证券股份有限公司、新疆国际实业股份有限公司和山东省国有资产投资控股有限公司,住所地及办公地点均为上海市浦东新区浦电路360号9楼,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		
孙远慧	本基金基金经理、万家增强收益债券型证券投资基金基金经理	2016年3月23日	-	7年	2010年在长城基金担任研究员职务，2012年在中欧基金先后担任研究员、基金经理助理、投资经理等职务，2016年2月进入我公司，从事投资研究工作。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《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。

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

1 季度股票市场震荡上行，从 3100 点单边上涨到 3260 点。期间有两个非常重要的事件，1) 美联储加息，2) 两会的召开，在美元加息后，国内也采取了结构性加息的措施来做流动性应对，同时预期两会结束维稳政策结束下会转向全面性收紧带来股市风险，实际上市场是有效的，对风险均有了提前反应，时间落地，股市稳定运行。我们 1 月份以来一直观点鲜明地看好市场，期间不曾改变。一季度时观点和操作策略基本符合预期。

2 季度股票市场快速下跌，从 3200 点单边下跌到 3050 点，之后 6 月弱势震荡上行。虽然指数下跌不足 200 点，但市场呈现出明显的 1:9 分化格局，以食品饮料、家电为代表的上证 50 个股表现出持续上涨的态势，80% 以上的个股持续下跌，甚至有不少个股走出了股灾的走势，分化非常严重。二季度市场观点没看对，操作上，产品仍延续之前均衡分散的投资理念，导致本季度产品回撤相对较大，二季度的市场风格比较适合集中，板块集中，个股集中。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.8474 元；本报告期基金份额净值增长率为 4.23%，业绩比较基准收益率为 8.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着 6 月份美国加息落地，三季度再次加息的概率几乎为零，预计最快 12 月份再次启动加息，欧洲、日本经济呈现出明显的复苏态势，美国囿于特朗普财政刺激政策尚未落地，经济基本面边际上弱于欧洲，但近期中美贸易摩擦端倪开始显现，后期如何演化需要进一步观察；国内经济二季度经济数据超预期，三季度担忧有所下降；随着十九大的临近，预期政策面逐步偏向改革。金融监管政策三季度有望落地，有助于市场企稳。未来几个月股市维持震荡上行的主趋势。

我们选择倾向于改革与景气趋势确定向上的行业，比如化工、工业供给侧改革方向等。同时关注券商、医疗健康、电子、互联网彩票、环保水务等未来部分趋势确定的细分子行业。

同时结合自下而上挖掘部分个股的重大投资机会。

本基金依据稳健操作的投资思路，在市场逐步调整中逐步加仓，在坚持个股精选的同时，努力把握行业轮动的机会，从而实现为投资者带来较好收益的最终目标。

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

根据基金合同规定：“基金收益分配后基金份额净值不能低于基金面值;基金当期收益应先弥补前期亏损后,才可进行当期收益分配;在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益每年至少分配一次,最多 6 次,基金每次收益分配比例最低不低于已实现收益的 60%”。

本基金本报告期内进行了 1 次收益分配,分配金额为 20,540,834.28 元,符合基金合同的规定。

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出现基金资产净值低于五千万元或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

2017 年上半年度，基金托管人在万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2017 年上半年度，万家基金管理有限公司在万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）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、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本基金本报告期内进行了 1 次收益分配，分配金额为 20540834.28 元，符合基金合同的规定。

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

2017 年上半年度，由万家基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：万家行业优选混合型证券投资基金 (LOF)

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	19,537,776.37	10,779,073.38
结算备付金		27,412.62	456,105.49
存出保证金		133,238.08	153,553.05
交易性金融资产	6.4.7.2	209,713,676.54	159,940,826.95
其中：股票投资		209,713,676.54	159,940,826.95
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		1,593,048.95	5,453,684.52
应收利息	6.4.7.5	4,106.16	7,686.06
应收股利		-	-
应收申购款		27,271.41	56,426.96
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		231,036,530.13	176,847,356.41
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		-	4,031,622.70
应付赎回款		204,270.29	74,692.56
应付管理人报酬		241,153.67	306,483.82
应付托管费		37,100.57	47,151.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	113,478.76	576,385.71

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	806,499.04	723,226.40
负债合计		1,402,502.33	5,759,562.57
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	152,754,486.19	107,733,361.26
未分配利润	6.4.7.10	76,879,541.61	63,354,432.58
所有者权益合计		229,634,027.80	171,087,793.84
负债和所有者权益总计		231,036,530.13	176,847,356.41

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8474 元，基金份额总额 270,989,011.13 份。

6.2 利润表

会计主体：万家行业优选混合型证券投资基金 (LOF)

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		7,590,336.52	-26,915,826.06
1.利息收入		72,449.71	515,806.44
其中：存款利息收入	6.4.7.11	72,449.71	279,849.75
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		-	235,956.69
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		12,328,974.61	5,678,986.60
其中：股票投资收益	6.4.7.12	10,313,712.30	4,448,478.35
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	2,015,262.31	1,230,508.25
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-4,836,860.62	-33,374,293.25
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	25,772.82	263,674.15
减：二、费用		2,254,032.28	4,822,032.76

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1, 284, 989. 84	2, 323, 707. 87
2. 托管费	6.4.10.2.2	197, 690. 75	357, 493. 52
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	537, 627. 69	1, 906, 819. 71
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	233, 724. 00	234, 011. 66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5, 336, 304. 24	-31, 737, 858. 82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5, 336, 304. 24	-31, 737, 858. 82

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家行业优选混合型证券投资基金(LOF)

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）	107, 733, 361. 26	63, 354, 432. 58	171, 087, 793. 84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5, 336, 304. 24	5, 336, 304. 24
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）	45, 021, 124. 93	28, 729, 639. 07	73, 750, 764. 00
其中：1.基金申购款	63, 930, 958. 48	39, 585, 419. 31	103, 516, 377. 79
2. 基金赎回款	-18, 909, 833. 55	-10, 855, 780. 24	-29, 765, 613. 79
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）	-	-20, 540, 834. 28	-20, 540, 834. 28
五、期末所有者权益（基金净值）	152, 754, 486. 19	76, 879, 541. 61	229, 634, 027. 80

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)	220,115,500.66	170,212,105.54	390,327,606.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-31,737,858.82	-31,737,858.82
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)	20,526,603.51	14,512,137.38	35,038,740.89
其中：1.基金申购款	167,828,488.62	80,859,893.52	248,688,382.14
2.基金赎回款	-147,301,885.11	-66,347,756.14	-213,649,641.25
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)	-	-46,149,087.97	-46,149,087.97
五、期末所有者权益(基金净值)	240,642,104.17	106,837,296.13	347,479,400.30

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

李杰

主管会计工作负责人

陈广益

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

万家行业优选混合型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”),原名天同公用事业行业股票型证券投资基金,系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2005]83号文《关于同意天同公用事业行业股票型开放式证券投资基金募集的批复》的核准,由天同基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集,基金合同于2005年7月15日正式生效,首次设立的募集规模为309,958,613.24份基金份额。经中国证监会证监基金字[2006]13号文《关于同意天同基金管理有限公司变更名称及修改公司章程的批复》的核准,天同基金管理有限公司于2006年

2 月更名为万家基金管理有限公司;另经基金管理人董事会审议通过,基金托管人同意,中国证监会基金部核准,本基金于 2006 年 2 月更名为万家公用事业行业股票型证券投资基金(LOF)。本基金为契约型上市开放式(LOF),存续期限不定。本基金经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2005]66 号文审核同意,于 2005 年 8 月 15 日在深交所挂牌交易。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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

2008 年 3 月 3 日(拆分日),本基金管理人万家基金管理有限公司对本基金进行了基金份额拆分。拆分前,本基金的基金份额净值为人民币 1.7741 元,根据基金份额拆分公式,计算精确到小数点后第 9 位(第 9 位以后舍去)为人民币 1.774103626 元。本基金管理人于拆分日,按照 1:1.774103626 的拆分比例对本基金进行拆分。拆分后,基金份额净值为人民币 1.0000 元,基金份额面值为人民币 0.5637 元。

为提高基金资产的运作效率,保护基金份额持有人利益,经与本基金托管人交通银行股份有限公司协商一致,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《万家公用事业行业股票型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,我公司于 2013 年 7 月召集了基金份额持有人大会,基金份额持有人大会的决议现已生效。根据基金份额持有人大会决议,从 2013 年 8 月 30 日起,原“万家公用事业行业股票型证券投资基金(LOF)”更名为“万家行业优选股票型证券投资基金(LOF)”。2015 年 7 月 31 日,万家基金管理有限公司经与基金托管人协商一致,并报中国证监会 备案,现将万家行业优选混合型证券投资基金(LOF)更名为万家行业优选混合型证券投资基金(LOF),基金类别变更为混合型证券投资基金。

本基金主要投资景气行业或预期景气度向好的行业股票,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报。本基金采取优选行业和精选个股相结合的主动投资管理方式,并适度动态配置大类资产。本基金的业绩比较基准为:80%×沪深 300 指数收益率+20%×上证国债指数收益率。

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 2 号《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 年上半年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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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

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	19,537,776.37
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	19,537,776.37

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	217,512,020.03	209,713,676.54	-7,798,343.49
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	217,512,020.03	209,713,676.54	-7,798,343.49

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	4,041.09
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	11.16
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	53.91
合计	4,106.16

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	113,478.76
银行间市场应付交易费用	-
合计	113,478.76

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	308.89
其他	292,959.48
预提费用	513,230.67
合计	806,499.04

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	191,120,349.32	107,733,361.26
本期申购	113,415,176.81	63,930,958.48
本期赎回(以“-”号填列)	-33,546,515.00	-18,909,833.55
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	270,989,011.13	152,754,486.19

注：申购含红利再投、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	27,801,165.27	35,553,267.31	63,354,432.58
本期利润	10,173,164.86	-4,836,860.62	5,336,304.24
本期基金份额交易产生的变动数	8,796,384.92	19,933,254.15	28,729,639.07
其中：基金申购款	12,504,071.57	27,081,347.74	39,585,419.31
基金赎回款	-3,707,686.65	-7,148,093.59	-10,855,780.24
本期已分配利润	-20,540,834.28	-	-20,540,834.28
本期末	26,229,880.77	50,649,660.84	76,879,541.61

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	62,274.09
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	4,921.56
其他	5,254.06
合计	72,449.71

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	163,171,805.08
减：卖出股票成本总额	152,858,092.78
买卖股票差价收入	10,313,712.30

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

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**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	-

注：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	2,015,262.31
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,015,262.31

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	-4,836,860.62
——股票投资	-4,836,860.62
——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	-4,836,860.62

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	24,167.79
转换费	1,605.03
合计	25,772.82

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	537,627.69
银行间市场交易费用	-
合计	537,627.69

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	34,712.18
信息披露费	148,765.71
其他	4,800.00
上市年费	29,752.78
银行汇划费用	1,893.33
结算服务费	13,800.00
合计	233,724.00

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

本报告期内,与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 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
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	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”)	基金管理人的股东、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。

6.4.9.3 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.3.1 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	-	-	73,115,391.56	5.75%

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.9.3.2 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。

6.4.9.3.3 债券回购交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.9.3.4 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。

6.4.9.3.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

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	68,091.59	5.73%	68,091.59	13.82%

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.9.4 关联方报酬

6.4.9.4.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付 的管理费	1,284,989.84	2,323,707.87
其中：支付销售机构的客 户维护费	299,428.01	337,096.64

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.30% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提, 逐日累计至每个月月末, 按月支付。由基金管理人向基金托管人发送管理费划付指令, 基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支付, 若遇法定节假日、休息日等, 支付日期顺延。

6.4.9.4.2 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	197,690.75	357,493.52

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提, 逐日累计至每个月月末, 按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令, 基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人, 若遇法定节假日、休息日等, 支付日期顺延。

6.4.9.5 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。

6.4.9.6 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.6.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.9.6.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.9.7 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
交通银行	19,537,776.37	62,274.09	11,897,239.72	64,353.64

注：本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2017年1月1日至6月30日获得的利息为人民币4,921.56元（2016年1月1日至6月30日为人民币211,810.56元），2017年6月30日结算备付金余额为人民币27,412.62元（2016年6月30日余额为人民币34,296,861.07元）。

6.4.9.8 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不存在在承销期内直接购入关联方所承销证券的情况。

6.4.10 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2017年 3月27 日	2017年 3月28 日	2017年 3月27 日	0.8800	14,993,305.68	5,547,528.60	20,540,834.28	
合计	-	-	-	0.8800	14,993,305.68	5,547,528.60	20,540,834.28	

6.4.11 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.11.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功 认购日	可流 通日	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单位： 股)	期末 成本总额	期末估值 总额	备注
603933	睿能科技	2017年 6月28 日	2017 年7月 6日	新股流 通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-

002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-

6.4.11.2 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
300109	新开源	2017年3月27日	拟筹划重大资产重组	42.11	-	-	119,895	6,030,103.22	5,048,778.45	-

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券,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%,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,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;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。

6.4.12.3 流动性风险

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

本基金所持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资产的公允价值。

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

6.4.12.4 市场风险

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

6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	19,537,776.37	-	-	-	-	-	19,537,776.37
结算备付金	27,412.62	-	-	-	-	-	27,412.62
存出保证金	133,238.08	-	-	-	-	-	133,238.08
交易性金融资产	-	-	-	-	-	209,713,676.54	209,713,676.54
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,593,048.95	1,593,048.95
应收利息	-	-	-	-	-	4,106.16	4,106.16
应收申购款	-	-	-	-	-	27,271.41	27,271.41
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	19,698,427.07	-	-	-	-	211,338,103.06	231,036,530.13
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	204,270.29	204,270.29
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	241,153.67	241,153.67
应付托管费	-	-	-	-	-	37,100.57	37,100.57
应付交易费用	-	-	-	-	-	113,478.76	113,478.76
其他负债	-	-	-	-	-	806,499.04	806,499.04
负债总计	-	-	-	-	-	1,402,502.33	1,402,502.33
利率敏感度缺口	19,698,427.07	-	-	-	-	-209,935,600.73	229,634,027.80
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	10,779,073.38	-	-	-	-	-	10,779,073.38

结算备付金	456,105.49	-	-	-	-	456,105.49
存出保证金	153,553.05	-	-	-	-	153,553.05
交易性金融资产	-	-	-	-	-159,940,826.95	159,940,826.95
应收证券清算款	-	-	-	-	5,453,684.52	5,453,684.52
应收利息	-	-	-	-	7,686.06	7,686.06
应收申购款	-	-	-	-	56,426.96	56,426.96
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	11,388,731.92	-	-	-	-165,458,624.49	176,847,356.41
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	4,031,622.70	4,031,622.70
应付赎回款	-	-	-	-	74,692.56	74,692.56
应付管理人报酬	-	-	-	-	306,483.82	306,483.82
应付托管费	-	-	-	-	47,151.38	47,151.38
应付交易费用	-	-	-	-	576,385.71	576,385.71
其他负债	-	-	-	-	723,226.40	723,226.40
负债总计	-	-	-	-	5,759,562.57	5,759,562.57
利率敏感度缺口	11,388,731.92	-	-	-	-159,699,061.92	171,087,793.84

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。

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金未持有交易性债券投资，银行存款、结算备付金以及存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.12.4.2 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。

6.4.12.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2017 年 6 月 30 日		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	209,713,676.54	91.33	159,940,826.95	93.48
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	209,713,676.54	91.33	159,940,826.95	93.48

注：本基金投资组合中投资于股票资产的比例为 60%-95 债券、现金类资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%，其中，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，权证占基金资产净值的 0-3%。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如表中数据。

6.4.12.4.3.2 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	-1,971,810.51	-2,130,904.55
	股票基准指数上升 100 个基点	1,971,810.51	2,130,904.55

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。上表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。

6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	209,713,676.54	90.77
	其中：股票	209,713,676.54	90.77
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	19,565,188.99	8.47
7	其他各项资产	1,757,664.60	0.76
8	合计	231,036,530.13	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	-	-
B	采矿业	8,464,847.00	3.69
C	制造业	127,680,482.96	55.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	44,318,347.36	19.30
E	建筑业	15,829,283.72	6.89
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,639.62	0.00
J	金融业	7,370,431.00	3.21
K	房地产业	6,042,644.88	2.63

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	209,713,676.54	91.33

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

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

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	600021	上海电力	1,440,852	17,419,900.68	7.59
2	000669	金鸿能源	609,800	11,055,674.00	4.81
3	600329	中新药业	487,400	8,826,814.00	3.84
4	600011	华能国际	1,196,402	8,781,590.68	3.82
5	603968	醋化股份	386,650	8,684,159.00	3.78
6	300303	聚飞光电	1,856,520	8,038,731.60	3.50
7	002496	辉丰股份	1,550,800	7,691,968.00	3.35
8	601991	大唐发电	1,212,700	5,481,404.00	2.39
9	300083	劲胜精密	568,183	5,250,010.92	2.29
10	600990	四创电子	84,000	5,207,160.00	2.27
11	600963	岳阳林纸	677,207	5,099,368.71	2.22
12	300109	新开源	119,895	5,048,778.45	2.20
13	600436	片仔癀	81,600	4,980,864.00	2.17
14	300164	通源石油	686,380	4,701,703.00	2.05
15	600885	宏发股份	115,218	4,596,046.02	2.00
16	600240	华业资本	474,028	4,294,693.68	1.87
17	600160	巨化股份	346,936	4,173,640.08	1.82
18	601997	贵阳银行	263,700	4,169,097.00	1.82
19	600803	新奥股份	295,700	4,062,918.00	1.77

20	300568	星源材质	94,800	4,024,260.00	1.75
21	002683	宏大爆破	417,200	3,763,144.00	1.64
22	002053	云南能投	298,431	3,745,309.05	1.63
23	600458	时代新材	325,800	3,730,410.00	1.62
24	002310	东方园林	215,300	3,599,816.00	1.57
25	600409	三友化工	347,090	3,495,196.30	1.52
26	300351	永贵电器	181,500	3,308,745.00	1.44
27	600919	江苏银行	344,600	3,201,334.00	1.39
28	300197	铁汉生态	238,524	3,167,598.72	1.38
29	300121	阳谷华泰	225,400	3,110,520.00	1.35
30	600491	龙元建设	275,000	2,950,750.00	1.28
31	002630	华西能源	245,046	2,840,083.14	1.24
32	002466	天齐锂业	50,668	2,753,805.80	1.20
33	300203	聚光科技	92,500	2,601,100.00	1.13
34	002108	沧州明珠	189,210	2,525,953.50	1.10
35	300233	金城医药	117,100	2,457,929.00	1.07
36	600068	葛洲坝	216,600	2,434,584.00	1.06
37	000063	中兴通讯	102,500	2,433,350.00	1.06
38	600884	杉杉股份	146,700	2,416,149.00	1.05
39	600889	南京化纤	251,700	2,388,633.00	1.04
40	600502	安徽水利	288,400	2,217,796.00	0.97
41	600967	内蒙一机	130,700	1,781,441.00	0.78
42	601155	新城控股	94,280	1,747,951.20	0.76
43	002222	福晶科技	121,100	1,728,097.00	0.75
44	600038	中直股份	37,500	1,716,375.00	0.75
45	601766	中国中车	164,800	1,667,776.00	0.73
46	300129	泰胜风能	234,700	1,664,023.00	0.72
47	002635	安洁科技	45,004	1,630,044.88	0.71
48	600856	中天能源	140,300	1,579,778.00	0.69
49	000018	神州长城	192,700	1,458,739.00	0.64
50	603111	康尼机电	105,700	1,289,540.00	0.56
51	002092	中泰化学	95,800	1,216,660.00	0.53
52	000059	华锦股份	109,700	1,098,097.00	0.48
53	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.02
54	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.02
55	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.02
56	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.02
57	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
58	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01

59	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
60	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
61	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
62	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
63	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
64	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
65	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
66	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
67	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.01
68	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
69	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
70	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

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	002310	东方园林	10,912,225.04	6.38
2	000669	金鸿能源	10,317,673.76	6.03
3	002108	沧州明珠	9,312,603.56	5.44
4	600011	华能国际	8,859,368.45	5.18
5	002496	辉丰股份	8,056,995.30	4.71
6	300303	聚飞光电	6,466,367.00	3.78
7	601377	兴业证券	5,930,699.00	3.47
8	603968	醋化股份	5,778,267.26	3.38
9	601991	大唐发电	5,626,536.89	3.29
10	601555	东吴证券	5,578,779.00	3.26
11	600021	上海电力	5,384,705.00	3.15
12	601155	新城控股	5,132,030.00	3.00
13	300164	通源石油	4,715,968.80	2.76
14	300041	回天新材	4,683,322.64	2.74
15	300072	三聚环保	4,642,831.10	2.71
16	300351	永贵电器	4,620,136.68	2.70

17	300568	星源材质	4,371,473.20	2.56
18	600436	片仔癀	4,081,217.50	2.39
19	002683	宏大爆破	4,050,489.00	2.37
20	600885	宏发股份	4,005,613.34	2.34
21	601997	贵阳银行	3,962,055.00	2.32
22	000928	中钢国际	3,597,973.00	2.10
23	300121	阳谷华泰	3,451,237.19	2.02

注：本项买入金额均按买入成交金额(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	002310	东方园林	8,318,253.26	4.86
2	002108	沧州明珠	7,983,123.18	4.67
3	601155	新城控股	7,627,151.95	4.46
4	601377	兴业证券	6,073,870.37	3.55
5	601555	东吴证券	5,613,623.22	3.28
6	300072	三聚环保	5,446,348.15	3.18
7	600596	新安股份	5,262,661.30	3.08
8	002458	益生股份	5,186,918.82	3.03
9	300041	回天新材	5,106,224.80	2.98
10	000750	国海证券	4,717,899.12	2.76
11	000059	华锦股份	4,437,031.29	2.59
12	000928	中钢国际	4,411,933.91	2.58
13	600664	哈药股份	3,959,392.00	2.31
14	300370	安控科技	3,912,894.69	2.29
15	600365	通葡股份	3,841,463.31	2.25
16	601229	上海银行	3,502,827.94	2.05
17	300232	洲明科技	3,486,097.40	2.04
18	002589	瑞康医药	3,203,623.42	1.87
19	300207	欣旺达	3,153,144.22	1.84
20	600096	云天化	3,033,923.01	1.77

注：本项卖出金额均按卖出成交金额(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	207,467,802.99
卖出股票收入（成交）总额	163,171,805.08

注：本项买入金额均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用；本项卖出金额均按卖出成交金额（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。

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。

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。

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

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

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情况,在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

本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	133,238.08
2	应收证券清算款	1,593,048.95
3	应收股利	-
4	应收利息	4,106.16
5	应收申购款	27,271.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,757,664.60

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§ 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

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
14,770	18,347.26	80,906,937.95	29.86%	190,082,073.18	70.14%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	王明瑞	1,504,299.00	11.11%
2	高德荣	818,145.00	6.04%
3	何汉昭	290,812.00	2.15%
4	高旺	290,264.00	2.14%
5	陈明杰	289,368.00	2.14%
6	刘庆营	227,782.00	1.68%
7	李选	200,075.00	1.48%
8	胡培安	200,000.00	1.48%
9	钱霞琴	168,495.00	1.24%
10	杨易	160,000.00	1.18%

注：上述持有人为场内持有人

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	20,733.45	0.0077%

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2005年7月15日）基金份额总额	309,958,613.24
本报告期期初基金份额总额	191,120,349.32
本报告期基金总申购份额	113,415,176.81
减：本报告期基金总赎回份额	33,546,515.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	270,989,011.13

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

报告期内无涉及基金管理人的重大人事变动。

基金托管人：

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

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事项。

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

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未受到任何稽查或处罚。

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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	1	153,308,260.34	41.77%	145,842.20	42.66%	-
华福证券	1	109,817,790.38	29.92%	102,273.13	29.91%	-
银河证券	2	75,455,962.08	20.56%	67,296.31	19.68%	-
广发证券	1	28,441,735.71	7.75%	26,487.88	7.75%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
江南证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

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服务; 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:

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

本基金本报告期内未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017-03-24-2017-04-20	0.00	52,398,868.16	0.00	52,398,868.16	19.34

产品特有风险

报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。
 未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回, 基金管理人可能无法及时变现基金资产, 可能对基金份额净值产生一定的影响; 极端情况下可能引发基金的流动性风险, 发生暂停赎回或延缓支付赎回款项; 若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元, 还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

§ 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行业优选混合型证券投资基金（LOF）发行及募集的文件。
- 2、《万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）基金合同》。
- 3、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 4、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的基金净值及其他临时公告。
- 5、万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）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、《万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）托管协议》。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人网站：<http://www.wjasset.com>

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司

2017 年 8 月 29 日