

万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金 2019 年半年度报告摘要

2019 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 24 日

§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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 23 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 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	万家双引擎灵活配置混合
基金主代码	519183
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 6 月 27 日
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	11,631,285.46 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过股票、债券的有效配置,把握价值、成长风格特征,精选个股,构造风格类资产组合。在有效控制风险的前提下,谋求基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金根据对宏观经济环境、经济增长前景及证券市场状况的综合分析,结合对股票市场整体估值水平、上市公司利润增长情况,债券市场整体收益率曲线变化等综合指标的分析,形成对各大类资产收益风险水平的前瞻性预测,以此确定股票、固定收益证券和现金等大类资产及中国证监会允许基金投资的其他金融工具在给定区间内的动态配置。
业绩比较基准	60%×沪深 300 指数收益率+40%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金是混合型基金,风险高于货币市场基金和债券型基金,属于中高风险、中高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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	龚小武
	联系电话	021-38909626	021-52629999*212056
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话		95538 转 6、4008880800	95561
传真		021-38909627	021-62159217

2.4 信息披露方式

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）

§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(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	935,726.25
本期利润	1,813,629.80
加权平均基金份额本期利润	0.1374
本期基金份额净值增长率	6.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.3646
期末基金资产净值	15,872,100.32
期末基金份额净值	1.3646

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

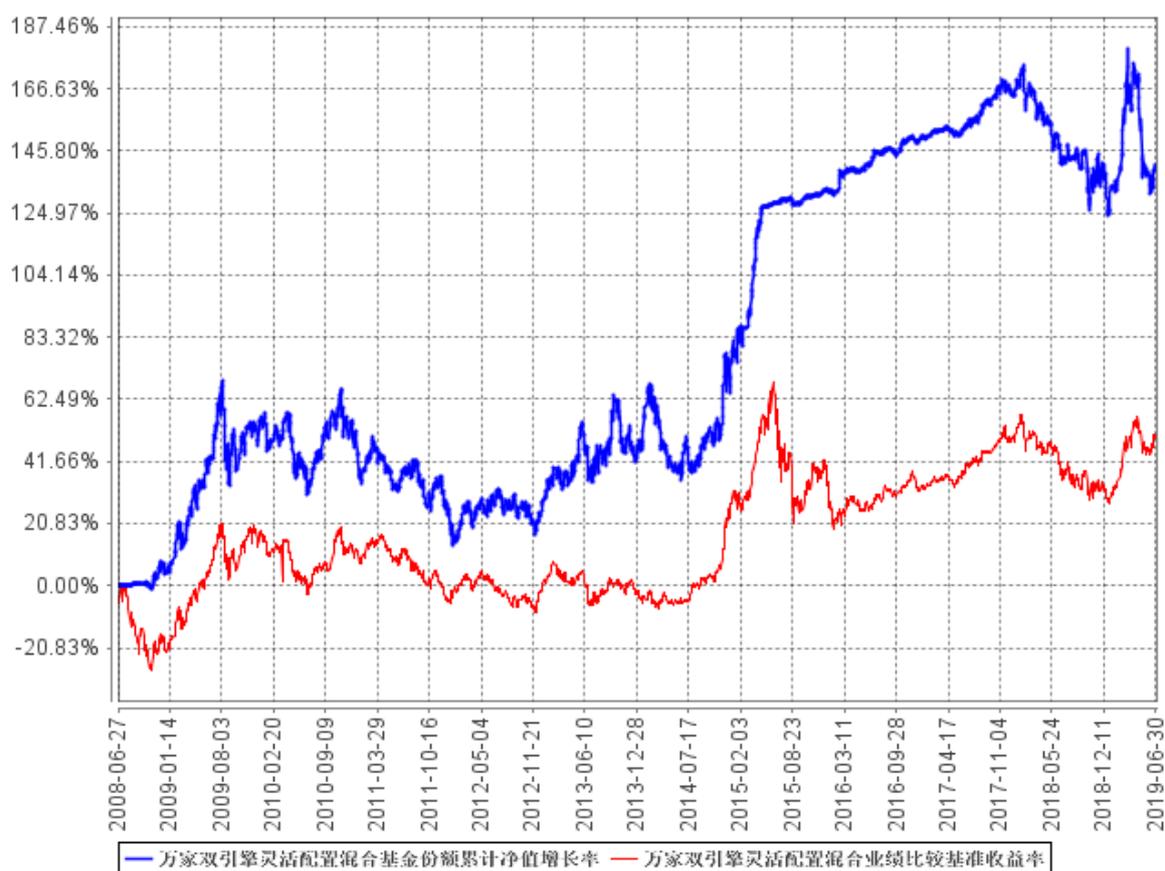
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.22%	0.82%	3.42%	0.70%	-2.20%	0.12%
过去三个月	-9.07%	1.16%	-0.26%	0.92%	-8.81%	0.24%
过去六个月	6.51%	1.18%	16.79%	0.93%	-10.28%	0.25%
过去一年	-1.18%	1.05%	8.00%	0.92%	-9.18%	0.13%
过去三年	-1.14%	0.66%	17.89%	0.67%	-19.03%	-0.01%

过去五年	63.93%	0.72%	58.14%	0.95%	5.79%	-0.23%
自基金合同生效起至今	140.57%	1.00%	50.35%	0.99%	90.22%	0.01%

注:业绩比较基准收益率=60%×沪深 300 指数收益率+40%×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

万家双引擎灵活配置混合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 2008 年 6 月 27 日成立,建仓期为六个月,建仓期结束时和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齐河众鑫投资有限公司,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 1 亿元人民币。目前管理六十六只开放式基金,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 3-5 年政策性金融债纯债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、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家成长优选灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞舜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、万家鑫悦纯债债券型证券投资基金、万家智造优势混合型证券投资基金、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 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金。

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		
叶勇	万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金	2018 年 8 月 24 日	-	5.5 年	中国政法大学法学本科。2007 年 7 月至 2011 年 7 月在上海证券报社担任财经报道记者；2011 年 8 月至 2012 年 8 月在华泰证券研究所担任研究员；2012 年 9 月至 2013 年 8 月在大公报上海办事处担任副主任；2013 年 9 月至 2014 年 8 月在上海市北高新股份有限公司担任投资管理部经理助理；2014 年 9 月至 2015 年 2 月在上海三熙投资管理咨询有限公司担任副总经理；2015 年 3 月加入万家基金管理有限公司，曾任股权投资部副总监、权益投资二部总监、投资经理，2018 年 8 月起担任投资研究部基金经理职务。
陈佳昀	万家日日薪货币市场证券投资基金、万家添利债券型证券投资基金（LOF）、万家	2018 年 8 月 15 日	-	7.5 年	上海财经大学金融学硕士。2011 年 7 月至 2015 年 11 月在财达证券有限责任公司工作，先后担任固

	货币市场证券投资基金、万家玖盛纯债 9 个月定期开放债券型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家天添宝货币市场基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金基金经理				定收益部经理助理、资产管理部投资经理职务；2015 年 12 月至 2017 年 4 月在平安证券股份有限公司工作，担任资产管理部投资经理职务。2017 年 4 月进入万家基金管理有限公司，从事债券研究与投资工作，自 2017 年 5 月起担任固定收益部基金经理职务。
--	--	--	--	--	--

注：1、任职日期以及离任日期均以公告日为准。

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。

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

2019 年以来,一季度,资本市场在政策上不断受到呵护,流动性进入边际宽松阶段,金融供给侧改革不断推进,叠加中美贸易谈判进展顺利影响,科创板作为资本市场年度重点以最快的速度出台,这些因素共同作用下,A 股在一季度在估值底部位置展开了强势反转行情,上证指数一季度反弹幅度约 27%。二季度,受 4 月 19 日政治局会议政策口径调整影响,A 股 4 月下旬开始调整。中小创率先开始较大幅度调整,五一节后,受美国突然加征关税和贸易战阴云重起的重大利空打击,市场快速调整到位。这一波调整中,上证 50 和沪深 300 调整幅度较小,而中小创调整幅度较大。

报告期内,本基金在投资理念上:坚持绝对回报的基本理念,追求长期稳健盈利目标;坚持趋势投资为主,逆向投资为辅;坚持基本面投资策略与量化投资策略相结合。

本基金以右侧布局、趋势投资为主导,偏好动量强劲、走势稳健、基本面逻辑通顺的行业和个股;量化选股与基本面选股结合;仓位控制上,本基金最高股票仓位不超过 60%,严守被动择时纪律,在 2 月 11 日指数上穿半年线后全面加仓,之后基本以接近 60%的最高仓位运行组合。本基金积极自下而上挖掘潜力股,尤其是底部反转的个股,为产品贡献了良好的收益。由于二季度调整过于剧烈,而本基金重仓的中小创和养殖股调整幅度更大,给本基金造成了很大的回撤损失。本轮市场调整后,基金经理已认真反思,并深入总结了经验教训,进一步完善本产品的投资策略,从而使本产品更加符合绝对回报和低回撤的特点:一方面,在择时上坚持趋势过滤,被动择时为主,不做频繁主动择时;另一方面,选股上,当前震荡市格局中,偏好基本面优质、动量趋势强劲或者底部企稳反转的优质个股,聚焦主流行业和热点板块。此外,采用宏观对冲策略,开展对利率债和黄金股的配置,降低组合波动、稳健获取收益。

受制股票 60%最高权益仓位的限制以及绝对收益理念本位的影响,本基金报告期内,收益表现大幅跑输指数,且由于期间受重仓农业股的波动影响,造成期间净值波动偏大,基金经理已认

真反思，并深入总结了经验教训，进一步完善了个股和行业仓位控制策略。

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 1.3646 元；本报告期基金份额净值增长率为 6.51%，业绩比较基准收益率为 16.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

后市展望方面，虽然本基金策略原则上不依赖于主动择时，被动择时为主，主动择时只是参考，但是观点方面，从市场整体方向看，基金经理对后市继续持乐观态度。

从宏观角度看，当前进入经济下行期和政策宽松期，总需求角度，货币边际宽松，资金成本下行，稳增长措施持续发力；从金融角度，供给侧改革持续推进，银行体系不断推动发展中小微企业融资，资本市场方面，科创板作为年度资本市场最重点工作和改革试验田，一方面将根本改变制约中国资本市场发展的体制机制问题，另一方面意味着资本市场已经成为促进中国经济转型升级、由投资驱动转向创新驱动的发动机，中国资本市场将迎来新一轮蓬勃向上的发展阶段；从产业面看，5G 的建设将带来新一轮的技术驱动，不断提高社会生产效率，催生新的产业发展机遇，比如人工智能、物联网、大数据、云计算等等，这也将为资本市场带来新的投资机遇。

当前，受制于中美贸易战悬而未决的影响，且在当前经济下行期的背景下，尚未见底，各项经济数据尚处于低迷阶段，在数据见底回升之前，将制约股票市场出现大牛市级别的行情，因此，对于未来中长的资本市场走势我们持乐观态度，但是短期来看，未来半年之内，将会呈现出反复震荡的特征。

因此，从操作策略上而言，我们将继续坚持绝对回报的基本理念，追求长期稳健盈利目标，坚持趋势投资为主的方法，坚持基本面投资策略与量化投资策略相结合。进一步精选行业和个股，尤其是做好组合均衡和个股仓位控制，平抑组合波动，在有效控制回撤率的前提下追求稳定收益。

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》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

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,本基金没有出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情况;自1月1日至6月30日基金资产净值连续118个工作日低于五千万元。目前我司正积极加强营销,力争扩大本基金规模。

§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

本托管人依据《万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金基金合同》与《万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金托管协议》，自 2008 年 6 月 27 日起托管万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金(以下称本基金)的全部资产。

报告期内,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本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

报告期内,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为;基金管理人在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	1,382,047.74	1,076,757.45
结算备付金	555,524.85	191,997.38
存出保证金	41,403.12	45,134.99
交易性金融资产	13,512,052.00	18,843,966.71
其中：股票投资	7,106,620.00	11,676,873.00
基金投资	-	-
债券投资	6,405,432.00	7,167,093.71
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	1,164,028.58	885,717.55
应收利息	185,694.53	45,939.92
应收股利	-	-
应收申购款	2,109.77	4,854.80
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	16,842,860.59	21,094,368.80
负债和所有者权益	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	722,402.63	-
应付赎回款	26,068.41	24,267.73
应付管理人报酬	10,285.82	14,721.49
应付托管费	3,214.33	4,600.46
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	133,424.15	93,832.00

应交税费	8.34	29.93
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	75,356.59	140,489.36
负债合计	970,760.27	277,940.97
所有者权益：		
实收基金	11,631,285.46	16,248,102.87
未分配利润	4,240,814.86	4,568,324.96
所有者权益合计	15,872,100.32	20,816,427.83
负债和所有者权益总计	16,842,860.59	21,094,368.80

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3646 元，基金份额总额 11,631,285.46 份。

6.2 利润表

会计主体：万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入	2,307,482.20	-11,483,998.34
1.利息收入	97,711.86	4,337,810.79
其中：存款利息收入	39,931.63	33,738.01
债券利息收入	17,987.95	4,273,926.57
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	39,792.28	30,146.21
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	1,326,654.90	-15,382,221.38
其中：股票投资收益	1,305,765.03	-13,935,882.83
基金投资收益	-	-
债券投资收益	3,688.27	-1,790,185.13
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	17,201.60	343,846.58
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	877,903.55	-551,325.99
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	5,211.89	111,738.24

减：二、费用	493,852.40	2,656,019.60
1. 管理人报酬	73,936.10	897,370.15
2. 托管费	23,104.99	280,428.12
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	363,148.46	432,748.96
5. 利息支出	-	846,053.88
其中：卖出回购金融资产支出	-	846,053.88
6. 税金及附加	1.46	-
7. 其他费用	33,661.39	199,418.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	1,813,629.80	-14,140,017.94
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	1,813,629.80	-14,140,017.94

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	16,248,102.87	4,568,324.96	20,816,427.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,813,629.80	1,813,629.80
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）	-4,616,817.41	-2,141,139.90	-6,757,957.31
其中：1. 基金申购款	1,372,313.44	611,565.46	1,983,878.90
2. 基金赎回款	-5,989,130.85	-2,752,705.36	-8,741,836.21
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）	-	-	-

为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行、上市的股票、债券、现金、短期金融工具、资产支持证券、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。本基金通过股票、债券的有效配置,谋求基金资产的持续稳健增值。本基金的业绩比较基准为:60%×沪深 300 指数收益率+40%×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》、证监会公告[2010]5 号关于发布《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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 6 月 30 日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 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[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，继续免征营业税；

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，管理人接受投资者委托或信托对受托资产提供的管理服务以及管理人发生的其他增值税应税行为，按照现行规定缴纳增值税，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。本通知自 2018 年 1 月 1 日起施行，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。

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 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日, 本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方关系

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

报告期内, 经中国证券监督管理委员会证监许可[2019]126 号文核准, 基金管理人原股东山东省国有资产投资控股有限公司将其持有的基金管理人的 11% 股权转让给齐河众鑫投资有限公司。本次股权变更的工商变更登记手续已办理完毕, 基金管理人于 2019 年 2 月 13 日发布了《关于公司股权变更的公告》, 公司股东由山东省国有资产投资控股有限公司变更为齐河众鑫投资有限公司。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司	基金管理人, 基金销售机构
兴业银行股份有限公司 (“兴业银行”)	基金托管人, 基金代销机构
中泰证券股份有限公司	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。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	236, 653, 660. 70	100. 00%	14, 843, 153. 47	5. 50%

6.4.9.1.2 债券交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
-------	----------------------------	---------------------------------

	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 成交总额的比例
中泰证券	12,500,680.50	100.00%	14,309,280.34	32.39%

6.4.9.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例
中泰证券	271,900,000.00	100.00%	3,200,000.00	0.97%

6.4.9.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019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	220,396.17	100.00%	133,424.15	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	13,823.67	0.55%	13,823.67	12.90%

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	73,936.10	897,370.15
其中：支付销售机构的客户维护费	29,415.70	39,823.44

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.80%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提, 按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令, 经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇不可抗力致使无法按时支付的, 顺延至最近可支付日支付。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	23,104.99	280,428.12

注:

依照基金合同, 在通常情况下, 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。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托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费在基金合同生效后每日计提, 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 2 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。

6.4.9.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过银行间同业市场与关联方进行银行间债券(含回购)交易。

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位: 份

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金合同生效日（ 2008 年 6 月 27 日）持有的 基金份额	10,021,602.16	10,021,602.16
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

注：基金管理人认购本基金的认购费符合基金招募说明书规定。

6.4.9.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度可比期间均未投资本基金。

6.4.9.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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
兴业银行	1,382,047.74	36,537.84	11,471,633.34	28,316.95

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公司，2019 年 1 月 1 日至 6 月 30 日度获得的利息收入为 3,061.60 元，(2018 年 1 月 1 日至 6 月 30 日获得的利息收入为 4,855.90 元)，2019 年 6 月 30 日结算备付金余额为人民币 555,524.85 元(2018 年 6 月 30 日为人民币 256,206.85 元)。

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本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证券。

6.4.10 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金报告期末未持有新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金报告期末未持有流通受限股票。

6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

本基金报告期末不存在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

本基金报告期末不存在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.11 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	7,106,620.00	42.19
	其中：股票	7,106,620.00	42.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,405,432.00	38.03
	其中：债券	6,405,432.00	38.03
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,937,572.59	11.50
8	其他各项资产	1,393,236.00	8.27
9	合计	16,842,860.59	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	2,050,180.00	12.92
C	制造业	2,689,960.00	16.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	498,960.00	3.14
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	659,600.00	4.16

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	1,207,920.00	7.61
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,106,620.00	44.77

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投资股票投资组合。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600489	中金黄金	64,000	657,280.00	4.14
2	002155	湖南黄金	60,000	604,200.00	3.81
3	600298	安琪酵母	16,000	506,080.00	3.19
4	000966	长源电力	88,000	498,960.00	3.14
5	600760	中航沈飞	16,000	464,480.00	2.93
6	002589	瑞康医药	60,000	455,400.00	2.87
7	002230	科大讯飞	13,000	432,120.00	2.72
8	300122	智飞生物	10,000	431,000.00	2.72
9	000538	云南白药	5,000	417,100.00	2.63
10	600547	山东黄金	10,000	411,700.00	2.59

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站的半年度报告正文。

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	002714	牧原股份	2,368,661.38	11.38
2	600406	国电南瑞	2,066,646.34	9.93
3	000876	新希望	2,020,912.00	9.71
4	603966	法兰泰克	1,971,329.00	9.47
5	002157	正邦科技	1,924,457.00	9.24
6	603108	润达医疗	1,888,546.00	9.07
7	600073	上海梅林	1,753,336.00	8.42
8	600748	上实发展	1,642,029.00	7.89
9	603444	吉比特	1,597,740.00	7.68
10	300461	田中精机	1,594,179.60	7.66
11	002100	天康生物	1,578,924.26	7.58
12	600030	中信证券	1,521,944.00	7.31
13	601933	永辉超市	1,495,178.00	7.18
14	300498	温氏股份	1,437,340.00	6.90
15	603605	珀莱雅	1,435,804.00	6.90
16	603363	傲农生物	1,419,978.00	6.82
17	002367	康力电梯	1,396,609.00	6.71
18	600009	上海机场	1,383,917.00	6.65
19	002733	雄韬股份	1,347,642.00	6.47
20	601088	中国神华	1,317,031.00	6.33
21	600105	永鼎股份	1,227,471.90	5.90
22	601066	中信建投	1,224,086.00	5.88
23	601688	华泰证券	1,223,400.00	5.88
24	600536	中国软件	1,213,791.00	5.83
25	600213	亚星客车	1,120,193.99	5.38
26	600489	中金黄金	1,093,210.00	5.25
27	600055	万东医疗	1,071,729.28	5.15
28	603288	海天味业	1,051,510.00	5.05
29	000063	中兴通讯	1,041,308.00	5.00
30	300262	巴安水务	1,007,873.00	4.84

31	002555	三七互娱	986,491.86	4.74
32	300033	同花顺	963,250.98	4.63
33	600547	山东黄金	961,902.00	4.62
34	002548	金新农	959,160.00	4.61
35	002589	瑞康医药	946,250.00	4.55
36	600872	中炬高新	945,590.00	4.54
37	002230	科大讯飞	944,335.00	4.54
38	601012	隆基股份	932,309.00	4.48
39	002212	南洋股份	927,562.00	4.46
40	002507	涪陵榨菜	920,851.04	4.42
41	000401	冀东水泥	917,907.00	4.41
42	002002	鸿达兴业	896,300.00	4.31
43	002414	高德红外	893,460.00	4.29
44	002020	京新药业	877,354.00	4.21
45	002373	千方科技	866,191.00	4.16
46	300001	特锐德	804,550.00	3.86
47	002624	完美世界	787,260.00	3.78
48	601021	春秋航空	776,193.80	3.73
49	002124	天邦股份	762,531.00	3.66
50	600848	上海临港	751,364.00	3.61
51	002385	大北农	733,866.00	3.53
52	603026	石大胜华	724,865.00	3.48
53	002439	启明星辰	712,490.00	3.42
54	002250	联化科技	705,300.00	3.39
55	300323	华灿光电	700,300.00	3.36
56	600050	中国联通	691,920.00	3.32
57	002508	老板电器	679,540.00	3.26
58	002531	天顺风能	663,393.00	3.19
59	600131	岷江水电	653,363.00	3.14
60	603888	新华网	649,583.00	3.12
61	600348	阳泉煤业	647,799.00	3.11
62	600276	恒瑞医药	637,151.00	3.06
63	603708	家家悦	635,712.00	3.05
64	603323	苏农银行	634,794.00	3.05
65	002063	远光软件	631,186.00	3.03
66	600004	白云机场	625,668.80	3.01

67	600031	三一重工	625,000.00	3.00
68	601636	旗滨集团	618,600.00	2.97
69	002155	湖南黄金	611,000.00	2.94
70	002648	卫星石化	610,646.36	2.93
71	603883	老百姓	608,900.00	2.93
72	600351	亚宝药业	599,162.68	2.88
73	601939	建设银行	587,400.00	2.82
74	002129	中环股份	569,155.00	2.73
75	300244	迪安诊断	566,300.00	2.72
76	002127	南极电商	560,903.60	2.69
77	002675	东诚药业	559,651.00	2.69
78	600977	中国电影	559,154.65	2.69
79	002309	中利集团	554,079.00	2.66
80	601288	农业银行	550,500.00	2.64
81	002223	鱼跃医疗	550,060.00	2.64
82	603882	金域医学	549,436.00	2.64
83	601699	潞安环能	541,080.00	2.60
84	601233	桐昆股份	526,350.00	2.53
85	600312	平高电气	518,400.00	2.49
86	600305	恒顺醋业	515,063.00	2.47
87	300413	芒果超媒	511,500.00	2.46
88	000951	中国重汽	509,967.00	2.45
89	300059	东方财富	508,800.00	2.44
90	000983	西山煤电	504,166.00	2.42
91	002080	中材科技	503,196.17	2.42
92	300379	东方通	500,162.00	2.40
93	600298	安琪酵母	492,800.00	2.37
94	300274	阳光电源	490,802.00	2.36
95	300735	光弘科技	487,346.00	2.34
96	000966	长源电力	487,340.00	2.34
97	002422	科伦药业	476,000.00	2.29
98	603806	福斯特	471,095.00	2.26
99	601318	中国平安	470,650.00	2.26
100	600760	中航沈飞	464,772.00	2.23
101	600703	三安光电	463,144.00	2.22
102	000338	潍柴动力	462,000.00	2.22

103	002821	凯莱英	460,870.00	2.21
104	600188	兖州煤业	460,446.00	2.21
105	601888	中国国旅	459,000.00	2.20
106	000001	平安银行	439,000.00	2.11
107	300251	光线传媒	433,406.00	2.08
108	600388	龙净环保	431,077.00	2.07
109	600835	上海机电	430,899.00	2.07
110	300369	绿盟科技	424,500.00	2.04
111	300253	卫宁健康	424,396.00	2.04
112	600459	贵研铂业	422,756.00	2.03
113	002174	游族网络	421,380.00	2.02
114	600309	万华化学	420,932.00	2.02
115	300760	迈瑞医疗	420,816.00	2.02
116	300122	智飞生物	419,500.00	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	002714	牧原股份	2,643,167.00	12.70
2	002367	康力电梯	2,597,546.50	12.48
3	000876	新希望	2,459,067.00	11.81
4	600030	中信证券	2,448,964.58	11.76
5	600406	国电南瑞	2,429,593.00	11.67
6	600748	上实发展	2,190,400.00	10.52
7	601688	华泰证券	2,022,720.00	9.72
8	603108	润达医疗	2,016,860.00	9.69
9	601066	中信建投	1,952,364.00	9.38
10	603966	法兰泰克	1,890,308.00	9.08
11	002157	正邦科技	1,886,882.00	9.06
12	300461	田中精机	1,674,050.00	8.04
13	300498	温氏股份	1,664,601.00	8.00
14	603444	吉比特	1,625,663.00	7.81
15	600073	上海梅林	1,622,582.00	7.79
16	300033	同花顺	1,602,395.00	7.70

17	002100	天康生物	1,515,032.00	7.28
18	603363	傲农生物	1,446,143.00	6.95
19	600009	上海机场	1,438,009.00	6.91
20	603323	苏农银行	1,360,426.60	6.54
21	601088	中国神华	1,335,992.00	6.42
22	603605	珀莱雅	1,330,089.00	6.39
23	600105	永鼎股份	1,329,418.00	6.39
24	601933	永辉超市	1,301,523.00	6.25
25	002733	雄韬股份	1,212,098.00	5.82
26	600055	万东医疗	1,174,581.00	5.64
27	600536	中国软件	1,166,456.00	5.60
28	002507	涪陵榨菜	1,161,918.00	5.58
29	000063	中兴通讯	1,081,257.00	5.19
30	603288	海天味业	1,080,043.00	5.19
31	601012	隆基股份	1,075,830.00	5.17
32	600872	中炬高新	1,011,422.00	4.86
33	002555	三七互娱	984,184.00	4.73
34	600547	山东黄金	977,995.00	4.70
35	002414	高德红外	967,976.00	4.65
36	600213	亚星客车	964,944.00	4.64
37	300001	特锐德	936,074.00	4.50
38	000401	冀东水泥	933,048.00	4.48
39	002212	南洋股份	925,994.00	4.45
40	001979	招商蛇口	914,936.00	4.40
41	002373	千方科技	903,800.00	4.34
42	601155	新城控股	895,562.00	4.30
43	002439	启明星辰	888,272.00	4.27
44	002548	金新农	882,061.00	4.24
45	300262	巴安水务	871,954.00	4.19
46	002002	鸿达兴业	863,584.00	4.15
47	002020	京新药业	851,600.00	4.09
48	002624	完美世界	777,286.62	3.73
49	601021	春秋航空	775,259.00	3.72
50	600048	保利地产	774,150.00	3.72
51	002594	比亚迪	745,674.00	3.58
52	002385	大北农	717,700.00	3.45
53	002508	老板电器	708,512.76	3.40
54	600050	中国联通	706,100.00	3.39

55	300323	华灿光电	694,600.00	3.34
56	603026	石大胜华	694,223.00	3.33
57	600848	上海临港	684,967.00	3.29
58	002250	联化科技	684,650.00	3.29
59	600837	海通证券	668,164.00	3.21
60	600351	亚宝药业	664,680.00	3.19
61	603708	家家悦	664,307.86	3.19
62	002124	天邦股份	662,319.00	3.18
63	600004	白云机场	655,637.76	3.15
64	600999	招商证券	654,218.00	3.14
65	000002	万科A	648,500.00	3.12
66	600348	阳泉煤业	640,259.00	3.08
67	002675	东诚药业	636,780.00	3.06
68	002531	天顺风能	623,627.00	3.00
69	600031	三一重工	614,300.00	2.95
70	600276	恒瑞医药	601,331.50	2.89
71	300244	迪安诊断	598,900.00	2.88
72	601233	桐昆股份	589,928.37	2.83
73	002063	远光软件	582,885.00	2.80
74	603883	老百姓	579,975.00	2.79
75	002129	中环股份	578,890.00	2.78
76	600305	恒顺醋业	576,400.00	2.77
77	603882	金域医学	572,800.00	2.75
78	601939	建设银行	570,200.00	2.74
79	601211	国泰君安	568,145.00	2.73
80	600977	中国电影	565,955.00	2.72
81	603888	新华网	548,854.00	2.64
82	600312	平高电气	544,365.00	2.62
83	601288	农业银行	540,000.00	2.59
84	300735	光弘科技	536,889.00	2.58
85	603806	福斯特	535,910.00	2.57
86	002223	鱼跃医疗	535,509.00	2.57
87	601699	潞安环能	532,516.00	2.56
88	600131	岷江水电	525,341.64	2.52
89	002309	中利集团	525,076.00	2.52
90	002589	瑞康医药	518,498.86	2.49
91	002648	卫星石化	518,084.00	2.49
92	000338	潍柴动力	508,750.00	2.44

93	002127	南极电商	507,000.00	2.44
94	002230	科大讯飞	506,708.00	2.43
95	000400	许继电气	505,094.41	2.43
96	000951	中国重汽	503,210.00	2.42
97	300413	芒果超媒	500,375.00	2.40
98	600703	三安光电	500,161.00	2.40
99	000983	西山煤电	498,600.00	2.40
100	600489	中金黄金	491,400.00	2.36
101	300059	东方财富	486,000.00	2.33
102	000001	平安银行	477,560.00	2.29
103	002422	科伦药业	475,200.00	2.28
104	601318	中国平安	473,940.00	2.28
105	000550	江铃汽车	468,630.00	2.25
106	601888	中国国旅	459,200.00	2.21
107	600188	兖州煤业	452,500.00	2.17
108	002080	中材科技	450,100.00	2.16
109	300760	迈瑞医疗	449,082.00	2.16
110	002821	凯莱英	446,350.00	2.14
111	300379	东方通	442,214.00	2.12
112	600388	龙净环保	439,032.00	2.11
113	002174	游族网络	437,429.00	2.10
114	600835	上海机电	437,348.00	2.10
115	300274	阳光电源	437,005.00	2.10
116	300253	卫宁健康	425,100.00	2.04
117	300502	新易盛	418,497.00	2.01
118	600309	万华化学	418,118.00	2.01

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	115,017,171.06
卖出股票收入（成交）总额	121,636,489.64

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	641,620.00	4.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,981,812.00	31.39
	其中：政策性金融债	4,981,812.00	31.39
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	782,000.00	4.93
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,405,432.00	40.36

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	018009	国开 1803	38,000	4,108,940.00	25.89
2	108901	农发 1801	8,720	872,872.00	5.50
3	132018	G 三峡 EB1	7,820	782,000.00	4.93
4	019547	16 国债 19	7,000	641,620.00	4.04

7.7 期末按公允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。

7.8 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

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金报告期末未持有股指期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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本期受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的情况,在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	41,403.12
2	应收证券清算款	1,164,028.58
3	应收股利	-
4	应收利息	185,694.53
5	应收申购款	2,109.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,393,236.00

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
2,444	4,759.12	9,627.25	0.08%	11,621,658.21	99.92%

8.2 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	34.93	0.00%

注：1、截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间均为 0；

2、截止本报告期末，本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2008年6月27日）基金份额总额	353,835,521.84
本报告期期初基金份额总额	16,248,102.87
本报告期期间基金总申购份额	1,372,313.44
减：本报告期期间基金总赎回份额	5,989,130.85
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	11,631,285.46

§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

基金管理人的专门基金托管部门的无重大人事变动；

基金托管人：自 2019 年 1 月 22 日起，叶文煌先生担任基金托管人资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作，吴若曼女士不再担任基金托管人资产托管部总经理。

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

本报告期内未改聘会计师事务所。

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，基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

中泰证券	2	236,653,660.70	100.00%	220,396.17	100.00%	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中金	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范, 内控制度健全, 在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平, 包括但不限于: 有较好的研究能力和行业分析能力, 能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求, 提供专门研究报告, 具有开发量化投资组合模型的能力; 能积极为公司投资业务的开展, 投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

3、报告期内基金租用证券公司交易单元的变更情况: 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
中泰证券	12,500,680.50	100.00%	271,900,000.00	100.00%	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中金	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-

§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。

万家基金管理有限公司

2019 年 8 月 24 日