

万家双利债券型证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 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：2018 年 8 月 28 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 2018 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2018 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
3.3 其他指标.....	错误!未定义书签。
§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.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
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.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.11 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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	49
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	错误!未定义书签。
§9 开放式基金份额变动.....	50
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
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.....	53

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	53
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.....	54
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家双利债券型证券投资基金
基金简称	万家双利
基金主代码	519190
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 3 月 6 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	93,319,564.02 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在合理控制风险和保持资产流动性的前提下，追求基金资产的长期稳定增值，力争获得超过业绩比较基准的收益。
投资策略	在严格控制风险并保持良好流动性的基础上，力争通过主动的组合管理实现超越业绩比较基准的收益。基金管理人在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上，采取积极主动地投资管理策略，通过定性与定量分析，对利率变化趋势、债券收益率曲线移动方向、信用利差等影响固定收益投资品价格的因素进行评估，对不同投资品种运用不同的投资策略，并充分利用市场的非有效性，把握各类套利的机会。在信用风险可控的前提下，寻求组合流动性与收益的最佳配比，力求持续取得达到或超过业绩比较基准的收益。
业绩比较基准	中债总全价指数（总值）
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金

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	010-66105798
	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	010-66105799
注册地址		中国（上海）自由贸易试验	北京市西城区复兴门内大街 55

	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)	北京市西城区复兴门内大街 55 号
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(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	60,490.60
本期利润	-1,136,511.03
加权平均基金份额本期利润	-0.0111
本期加权平均净值利润率	-0.99%
本期基金份额净值增长率	-1.21%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	10,412,339.79
期末可供分配基金份额利润	0.1116
期末基金资产净值	103,731,903.81
期末基金份额净值	1.1116
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	18.56%

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。

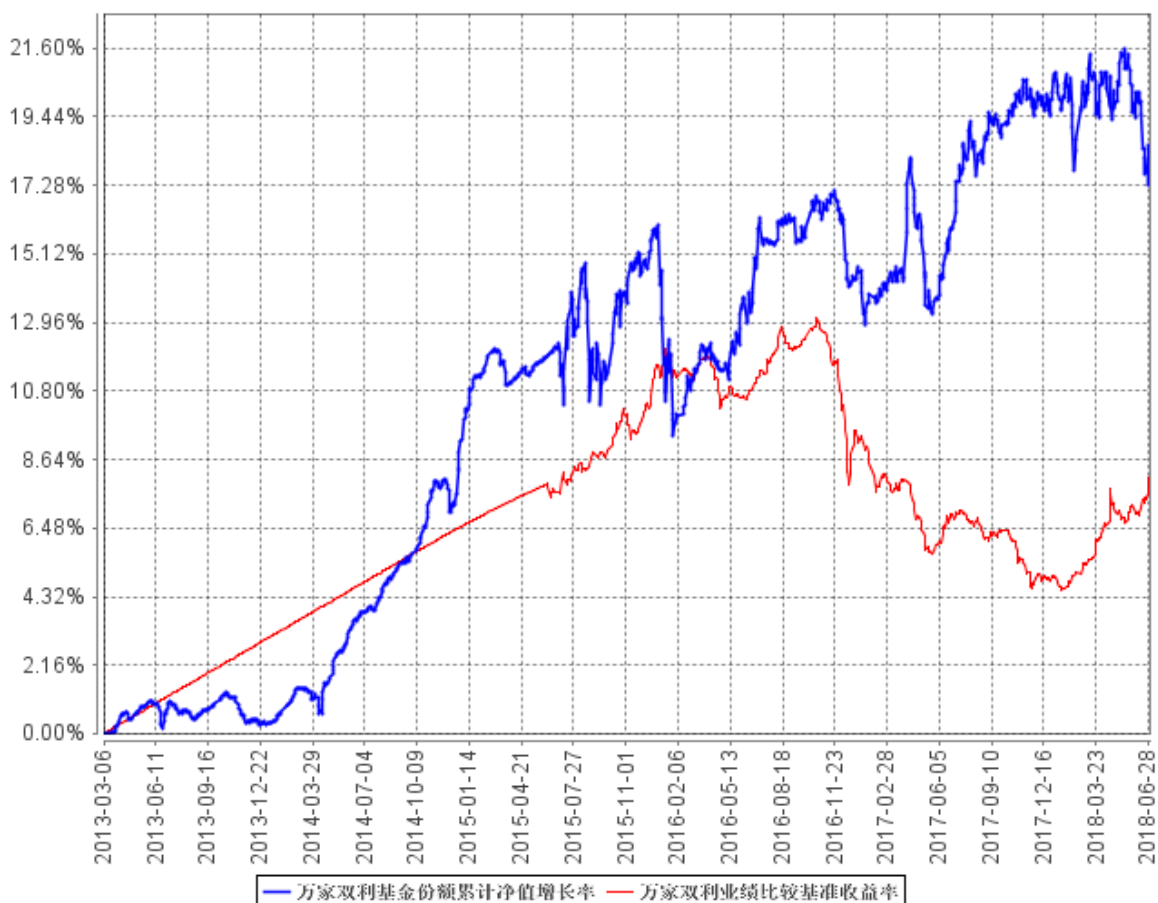
3.2 基金净值表现

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	-1.09%	0.42%	0.87%	0.10%	-1.96%	0.32%
过去三个月	-1.56%	0.36%	1.76%	0.15%	-3.32%	0.21%
过去六个月	-1.21%	0.36%	2.99%	0.12%	-4.20%	0.24%
过去一年	2.23%	0.29%	1.11%	0.10%	1.12%	0.19%
过去三年	5.53%	0.30%	0.42%	0.11%	5.11%	0.19%
自基金合同生效起至今	18.56%	0.23%	8.06%	0.08%	10.50%	0.15%

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

万家双利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：(1) 本基金成立于 2013 年 3 月 6 日，建仓期为 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。报告期末各项资产配置比例符合基金合同要求。

(2) 基金份额持有人大会于 2015 年 6 月 8 日表决通过了《关于修改万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同有关事项的议案》。《万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》修订为《万家双利债券型证券投资基金基金合同》。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44 号文批准设立。公司现股东为中泰证券股份有限公司、新疆国际实业股份有限公司和山东省国有资产投资控股有限公司,住所地址为中国(上海)自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层(名义楼层 9 层),办公地址为中国(上海)自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层(名义楼层 9 层),注册资本 1 亿元人民币。目前管理五十九只开放式基金,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、万家家裕债券型证券投资基金、万家成长优

选灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金、万家家乐债券型证券投资基金、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和万家新机遇龙头企业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		
李文宾	本基金基金经理、万家瑞兴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、万家新利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、万家瑞隆灵活配置混合型证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基	2017年2月3日	-	8年	2010年7月至2014年4月在中银国际证券有限责任公司工作，担任研究员职务。2014年5月至2015年11月在华泰资产管理有限公司工作，担任研究员职务。2015年11月进入我公司工作。

	金、万家成长优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。				
高翰昆	本基金基金经理、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞益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	2015 年 3 月 17 日	-	9 年	英国诺丁汉大学硕士。 2009 年 7 月加入万家基金管理有限公司，历任研究部助理、交易员、交易部总监助理、交易部副总监。

	颐和本混合 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 鑫瑞纯 债债券 型证券 投资基 金、万家 家裕债 券型证 券投资 基金、万 家家乐 债券型 证券投 资基金、 万家瑞 舜灵活 配置混 合型证 券投资 基金基 金经理。				
--	---	--	--	--	--

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合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理办法》和《异常交易监控及报告管理办法》等规章制度,涵盖了研究、授权、投资决策和交易执行等投资管理活动的各个环节,确保公平对待不同投资组合,防范导致不公平交易以及利益输送的异常交易发生。

公司制订了明确的投资授权制度,并建立了统一的投资管理平台,确保不同投资组合获得公平的投资决策机会。实行集中交易制度,对于交易所公开竞价交易,执行交易系统内的公平交易程序;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易,按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;对于银行间交易,按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。为保证公平交易原则的实现,通过制度规范、流程审批、系统风控参数设置等进行事前控制,通过对投资交易系统的实时监控进行事中控制,通过对异常交易的监控和分析实现事后控制。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内无下列情况:所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾市场,总的来看,2018 年上半年股市相对于 2017 年出现了非常显著的变化:价值蓝筹股(除食品饮料和医药外)大幅回撤,成长股全军覆没,市场风格更为极端。

国内上半年宏观经济保持平稳,新常态下经济内生动力逐步代替投资拉动。通胀维持在低位,

货币政策中性偏紧，后期略有缓解。整体来看，基本面仍有一定的不确定因素，有利于债券市场的稳定。短期内，债券市场仍受到各类政策影响，存在一定的波动。

年初我们对国内经济持由谨慎转为相对乐观，这主要是由于我们预判中央对去杠杆将会持有非常严厉和坚定的态度，这将会拖累包括地产和基建投资增速。所以在板块和个股配置中，我回避了与经济相关的产业和个股配置（例如部分与经济高度相关，且没有供给侧改革逻辑的板块）。但出于我们和市场意料的是，中美之间贸易摩擦在历经几轮磋商后依然无果，上半年股市走熊与此高度相关。

就板块而言，上半年我们在蓝筹和成长中均衡分布。在蓝筹股中布局保险和航空，在成长股中持有以新能源汽车、计算机、军工和智能制造为主的板块。从实际走势上来看，这些板块波动较大，同时在股市单边下跌的过程中，绝大部分板块都出现了轮动行情，这点在操作上增加了很大的难度。

上半年本组合净值基本保持稳定。权益市场变化较大，对于组合产生一定的影响。后期持仓略有调整，并且有通过波段操作获取一定的超额收益，整体净值增长尚可。当前市场对于低评级信用债风险偏好较低，本组合也在密切关注信用风险的变化。

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 1.1116 元；本报告期基金份额净值增长率为-1.21%，业绩比较基准收益率为 2.99%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

放眼 2018 年下半年，我认为目前股市较大概率处在中长期的历史底部区域，可能会出现持续的磨底和探底的过程中，但无论从盈利基本面，资金面和风险偏好几个维度来看，股市继续下跌的空间有限。

首先，股市从 2 月开始已经对宏观经济基本面走弱有了较为充分的反应；第二，央行从 2 季度开始的连续定向降准预示流动性边际将会转好，二季度末召开的国常会和政治局会议释放了托底经济的强烈信号；第三，从估值和盈利角度来看，目前上证接近 2016 年 1 月两次熔断后的位置，换句话说国内经济前进了 2 年多，反应经济基本面的股市回到了原点，平均估值水平已经低于 2016 年市场最为悲观的情形，同时部分优势企业竞争力持续增强，盈利能力非常强劲。因此，我预计 2018 年下半年股市走势将会优于上半年。

就看好的板块和风格而言，我认为 2016 年开始市场追捧的白马和价值蓝筹可能会在 2018 年下半年出现反复，这主要是因为这些板块企业盈利与经济基本面相挂钩，同时资金超额收益非常

明显,因此存在一定调整的风险。相反代表创新的板块将会迎来较好的投资机会,这主要包括 5G、新能源汽车、军工、医药、计算机、半导体等。同时部分受益于环保和供给侧结构性改革的周期板块将会获得较好收益。

下半年市场的分歧逐步加大,各类基本面不确定因素,都可能对于市场产生较大的扰动。继续关注货币政策的变化,以及地方债的供给节奏,预计下半年的市场会有一些的波动,组合将降低与权益市场的相关性,力争获取超额收益。

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

根据基金合同规定:“在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益配次数最多为 12 次,每收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配”。本报告期间本基金未进行利润分配,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,本基金没有出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情况。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对万家双利债券型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，万家双利债券型证券投资基金的管理人——万家基金管理有限公司在万家双利债券型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，万家双利债券型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双利债券型证券投资基金 2018 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：万家双利债券型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	98,597.21	4,980,975.12
结算备付金		722,343.96	214,402.63
存出保证金		24,988.72	14,240.13
交易性金融资产	6.4.7.2	105,311,003.16	137,579,042.47
其中：股票投资		18,486,430.18	22,972,703.94
基金投资		-	-
债券投资		86,824,572.98	114,606,338.53
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	-	20,000,270.00
应收证券清算款		506,047.72	-
应收利息	6.4.7.5	2,040,882.77	2,755,704.78
应收股利		-	-
应收申购款		719.42	927.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		108,704,582.96	165,545,562.13
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 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		2,700,000.00	34,476,000.00
应付证券清算款		-	2,302,219.04
应付赎回款		9,175.63	55,831.12
应付管理人报酬		60,014.62	56,947.38
应付托管费		17,147.02	16,270.67
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	75,765.75	64,446.96

应交税费		1,709,230.43	1,702,947.10
应付利息		-443.83	49,519.10
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	401,789.53	330,000.00
负债合计		4,972,679.15	39,054,181.37
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	93,319,564.02	112,421,194.83
未分配利润	6.4.7.10	10,412,339.79	14,070,185.93
所有者权益合计		103,731,903.81	126,491,380.76
负债和所有者权益总计		108,704,582.96	165,545,562.13

注：1. 报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1116 元，基金份额总额 93,319,564.02 份。

6.2 利润表

会计主体：万家双利债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		33,159.42	985,962.17
1.利息收入		2,561,456.50	706,846.04
其中：存款利息收入	6.4.7.11	16,916.56	6,444.13
债券利息收入		2,501,571.55	696,419.29
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		42,968.39	3,982.62
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,332,647.49	-555,597.31
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,239,595.23	-397,280.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-109,341.39	-175,481.44
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
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	16,289.13	17,165.01
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,197,001.63	833,521.42
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	1,352.04	1,192.02
减：二、费用		1,169,670.45	423,361.00

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	399,756.34	95,693.80
2. 托管费	6.4.10.2.2	114,216.10	27,341.04
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	200,264.85	64,044.97
5. 利息支出		325,789.47	38,015.56
其中：卖出回购金融资产支出		325,789.47	38,015.56
6. 税金及附加		5,935.01	-
7. 其他费用	6.4.7.20	123,708.68	198,265.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,136,511.03	562,601.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,136,511.03	562,601.17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家双利债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	112,421,194.83	14,070,185.93	126,491,380.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,136,511.03	-1,136,511.03
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）	-19,101,630.81	-2,521,335.11	-21,622,965.92
其中：1.基金申购款	1,558,835.85	198,070.86	1,756,906.71
2.基金赎回款	-20,660,466.66	-2,719,405.97	-23,379,872.63
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）	93,319,564.02	10,412,339.79	103,731,903.81

项目	上年度可比期间 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)	25,686,922.18	1,841,997.31	27,528,919.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	562,601.17	562,601.17
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)	13,112,224.66	981,178.07	14,093,402.73
其中：1.基金申购款	25,383,138.95	1,848,962.30	27,232,101.25
2.基金赎回款	-12,270,914.29	-867,784.23	-13,138,698.52
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)	38,799,146.84	3,385,776.55	42,184,923.39

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	李杰	陈广益
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

万家双利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金转型而来，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2012]1520号文《关于核准万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金募集的批复》的核准，由万家基金管理有限公司作为基金管理人向社会公开募集，基金合同于2013年3月6日生效，首次设立募集规模为6,380,439,193.08份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。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登记结算股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

2015 年 6 月 8 日，万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会审议并通过了《关于修改万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同有关事项的议案》，内容包括万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金变更名称、修改基金投资目标、投资范围、投资策略、收益分配方式和修订基金合同等事项。自持有人大会决议生效之日起，《万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》失效且《万家双利债券型证券投资基金基金合同》同时生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《万家双利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、央行、票据、金融债、地方政府债、公司债、企业债、次级债、短期融资券、证券公司短期公司债券、中期票据、中小企业私募债、可转债及分离交易可转债、可交换公司债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款），国内依法发行上市的股票（中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类资产，以及经法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可持有可转债转股所得的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证，也可以直接从二级市场上买入股票和权证。本基金在严格控制风险并保持良好流动性的基础上，力争通过主动的组合管理实现超越业绩比较基准的收益。本基金的业绩比较基准为：中债总全价指数（总值）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 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 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 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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	98,597.21
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	98,597.21

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	19,312,053.38	18,486,430.18	-825,623.20
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	38,189,278.26	36,936,572.98
	银行间市场	49,124,064.37	49,888,000.00
	合计	87,313,342.63	86,824,572.98
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	106,625,396.01	105,311,003.16	-1,314,392.85

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 2018年6月30日
应收活期存款利息	126.57
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	292.59
应收债券利息	2,040,453.53
应收资产支持证券利息	-
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	10.08
合计	2,040,882.77

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 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	73,638.23
银行间市场应付交易费用	2,127.52
合计	75,765.75

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	7.13
预提费用	401,782.40
合计	401,789.53

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	112,421,194.83	112,421,194.83
本期申购	1,558,835.85	1,558,835.85
本期赎回(以“-”号填列)	-20,660,466.66	-20,660,466.66
- 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	93,319,564.02	93,319,564.02

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	13,064,986.60	1,005,199.33	14,070,185.93
本期利润	60,490.60	-1,197,001.63	-1,136,511.03
本期基金份额交易产生的变动数	-2,319,419.34	-201,915.77	-2,521,335.11
其中：基金申购款	184,937.30	13,133.56	198,070.86
基金赎回款	-2,504,356.64	-215,049.33	-2,719,405.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,806,057.86	-393,718.07	10,412,339.79

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	7,060.84
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	9,654.43
其他	201.29
合计	16,916.56

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	67,453,878.78
减：卖出股票成本总额	68,693,474.01
买卖股票差价收入	-1,239,595.23

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

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-109,341.39
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-109,341.39

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	59,632,591.10
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成	57,967,150.80

本总额	
减：应收利息总额	1,774,781.69
买卖债券差价收入	-109,341.39

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	16,289.13
基金投资产生的股利收益	-
合计	16,289.13

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,197,001.63
——股票投资	-1,267,636.58
——债券投资	70,634.95
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-1,197,001.63

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,352.04
合计	1,352.04

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	199,739.85
银行间市场交易费用	525.00
合计	200,264.85

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	22,315.49
信息披露费	79,466.91
账户维护费用	18,000.00
其他	600.00
律师费	2,000.00
银行费用	1,326.28
合计	123,708.68

注：其他为上交所 CFCA 数字证书服务费。

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
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
万家共赢资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：以下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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	72,956,547.16	54.88%	19,503,398.03	44.76%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	4,849,548.69	19.43%	15,528,208.68	62.44%

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	85,630,000.00	7.49%	88,200,000.00	33.15%

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 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	65,391.33	54.32%	18,658.14	25.34%
关联方名称	上年度可比期间 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	17,481.00	44.43%	17,481.00	44.43%

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 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	399,756.34	95,693.80
其中：支付销售机构的客户维护费	25,800.73	41,520.16

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.70% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% / \text{当年天数}$$

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 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	114,216.10	27,341.04

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：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
基金合同生效日（2013年3月6日）持有的基金份额	10,001,250.00	10,001,250.00
期初持有的基金份额	8,160,999.38	0.00
期间申购/买入总份额	0.00	0.00
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	8,160,999.38	0.00
期末持有的基金份额	0.00	0.00
期末持有的基金份额	0.0000%	0.0000%

占基金总份额比例		
----------	--	--

注：基金管理人认购及申购本基金份额时所适用的费率与本基金公告的费率一致。期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

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

关联方名称	本期末 2018年6月30日		上年度末 2017年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例
万家共赢资产管理 有限公司	8,758,090.24	9.3851%	18,758,090.24	16.8655%

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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	98,597.21	7,060.84	1,320,910.64	3,387.31

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，2018年1月1日至6月30日获得的利息为人民币9,654.43元，2018年6月30日结算备付金余额为人民币722,343.96元。2017年1月1日至6月30日获得的利息为人民币2,052.26元，2017年6月30日结算备付金余额为人民币171,164.77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

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末持有因认购新发/增发而于期末持有的流通受限的证券。

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
603636	南威软件	2018 年 5 月 29 日	重大事项	8.79	-	-	92,600	949,078.00	813,954.00	-

注：本基金截至 2018 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, 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 2018 年 6 月 30 日止, 基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额共计 2,700,000.00 元, 其中回购证券款 2,700,000.00 元于 2018 年 7 月 2 日到期, 该类交易要求本基金在回购期内持有的证券。交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

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；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	30,222,000.00	39,513,230.00
合计	30,222,000.00	39,513,230.00

注：未评级债券包括超短期融资券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	14,168,820.80	12,647,293.50
AAA 以下	9,242,191.28	31,341,134.23
未评级	33,191,560.90	31,104,680.80
合计	56,602,572.98	75,093,108.53

注：未评级债券为国债、政策性金融债。

6.4.13.3 流动性风险

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易;因此,除在附注 6.4.12 中列示的本基金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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的投资市场主要为固定收益类金融工具,公司建立了健全的流动性风险管理的内部控制体系,在申购赎回确认、投资交易、估值和信息披露等运作过程中专业审慎、勤勉尽责地管控基金的流动性风险,维护投资者的合法权益,公平对待投资者。本基金运作期间公司对组合短期变现能力、流动性受限资产比例等流动性指标进行持续的监测和评估,基金未出现因投资品种变现困难或投资集中而无法以合理价格及时变现基金资产以支付赎回款的情况。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、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 2018 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	98,597.21	-	-	-	-	-	98,597.21

存款							
结算 备付 金	722,343.96	-	-	-	-	-	722,343.96
存出 保证 金	24,988.72	-	-	-	-	-	24,988.72
交易 性金 融资 产	10,228,082.90	25,537,338.14	23,282,763.68	17,491,353.36	10,285,034.90	18,486,430.18	105,311,003.16
应收 证券 清算 款	-	-	-	-	-	506,047.72	506,047.72
应收 利息	-	-	-	-	-	2,040,882.77	2,040,882.77
应收 申购 款	-	-	-	-	-	719.42	719.42
资产 总计	11,074,012.79	25,537,338.14	23,282,763.68	17,491,353.36	10,285,034.90	21,034,080.09	108,704,582.96
负债							
卖出 回购 金融 资产 款	2,700,000.00	-	-	-	-	-	2,700,000.00
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	9,175.63	9,175.63
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	60,014.62	60,014.62
应付 托管 费	-	-	-	-	-	17,147.02	17,147.02
应付 交易 费用	-	-	-	-	-	75,765.75	75,765.75
应付 利息	-	-	-	-	-	-443.83	-443.83
应交	-	-	-	-	-	1,709,230.43	1,709,230.43

税费							
其他 负债	-	-	-	-	-	401,789.53	401,789.53
负债 总计	2,700,000.00	-	-	-	-	2,272,679.15	4,972,679.15
利率 敏感 度缺 口	8,374,012.79	25,537,338.14	23,282,763.68	17,491,353.36	10,285,034.90	18,761,400.94	103,731,903.81
上年 度末 2017 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	4,980,975.12	-	-	-	-	-	4,980,975.12
结算 备付 金	214,402.63	-	-	-	-	-	214,402.63
存出 保证 金	14,240.13	-	-	-	-	-	14,240.13
交易 性金 融资 产	2,001,200.10	12,695,361.00	58,163,931.13	31,878,602.70	9,867,243.60	22,972,703.94	137,579,042.47
买入 返售 金融 资产	20,000,270.00	-	-	-	-	-	20,000,270.00
应收 利息	-	-	-	-	-	2,755,704.78	2,755,704.78
应收 申购 款	-	-	-	-	-	927.00	927.00
资产 总计	27,211,087.98	12,695,361.00	58,163,931.13	31,878,602.70	9,867,243.60	25,729,335.72	165,545,562.13
负债							
卖出 回购 金融 资产	34,476,000.00	-	-	-	-	-	34,476,000.00

款							
应付 证券 清算 款						2,302,219.04	2,302,219.04
应付 赎回 款						55,831.12	55,831.12
应付 管理 人报 酬						56,947.38	56,947.38
应付 托管 费						16,270.67	16,270.67
应付 交易 费用						64,446.96	64,446.96
应付 利息						49,519.10	49,519.10
应交 税费						1,702,947.10	1,702,947.10
其他 负债						330,000.00	330,000.00
负债 总计	34,476,000.00					4,578,181.37	39,054,181.37
利率 敏感 度缺 口	-7,264,912.02	12,695,361.00	58,163,931.13	31,878,602.70	9,867,243.60	21,151,154.35	126,491,380.76

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

假设	1、该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况	
	2、该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率以外的其他市场变量保持不变	
	3、该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动	
	4、银行存款、结算备付金及存出保证金以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对本身的公允价值无重大影响；买入返售金融资产利息收益/卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
1. 市场利率下降 25 个基点		404, 121. 91	400, 698. 53
2. 市场利率上升 25 个基点		-396, 521. 87	-393, 726. 76

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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 2018年6月30日		上年度末 2017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	18, 486, 430. 18	17. 82	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	86, 824, 572. 98	83. 70	-	-
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	105, 311, 003. 16	101. 52	-	-

注：本基金投资于债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，股票资产的投资比例不高于基金资产的 20%；现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产的 5%。本基金所

面临的其他价格风险主要系市场价格风险。于 2018 年 06 月 30 日，本基金主要投资于证券交易所和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大市场价格风险。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与证券市场的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	2、以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
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（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	1. 股票基准指数下降 100 个基点	-214,311.81	-223,555.58
2. 股票基准指数上升 100 个基点	214,311.81	223,555.58	

注：其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于交易所及银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

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	18,486,430.18	17.01
	其中：股票	18,486,430.18	17.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	86,824,572.98	79.87
	其中：债券	86,824,572.98	79.87
	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	820,941.17	0.76
8	其他各项资产	2,572,638.63	2.37
9	合计	108,704,582.96	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	-	-
C	制造业	13,787,841.92	13.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,813,139.26	1.75
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,885,449.00	2.78
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	18,486,430.18	17.82

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。

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	603799	华友钴业	41,700	4,064,499.00	3.92
2	300073	当升科技	59,700	2,033,382.00	1.96
3	002384	东山精密	83,100	1,994,400.00	1.92
4	300024	机器人	111,723	1,943,980.20	1.87
5	300159	新研股份	179,159	1,268,445.72	1.22
6	600460	士兰微	85,300	1,040,660.00	1.00
7	000066	中国长城	130,800	929,988.00	0.90
8	600115	东方航空	140,373	929,269.26	0.90
9	600029	南方航空	104,600	883,870.00	0.85
10	600536	中国软件	38,300	828,429.00	0.80
11	603636	南威软件	92,600	813,954.00	0.78
12	300369	绿盟科技	66,000	706,200.00	0.68
13	002439	启明星辰	25,300	536,866.00	0.52
14	600879	航天电子	72,900	512,487.00	0.49

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	603799	华友钴业	3,996,114.00	3.16
2	300024	机器人	3,900,519.02	3.08
3	601601	中国太保	2,773,676.28	2.19
4	600028	中国石化	2,381,208.00	1.88
5	300159	新研股份	2,263,713.00	1.79
6	000009	中国宝安	2,085,121.49	1.65
7	300059	东方财富	2,000,315.34	1.58
8	002384	东山精密	1,996,697.40	1.58
9	300377	赢时胜	1,896,113.00	1.50
10	300073	当升科技	1,585,643.00	1.25
11	300369	绿盟科技	1,411,368.34	1.12
12	002029	七匹狼	1,374,874.50	1.09
13	300613	富瀚微	1,278,874.00	1.01
14	000902	新洋丰	1,271,471.00	1.01
15	000998	隆平高科	1,269,851.00	1.00
16	600583	海油工程	1,265,020.95	1.00
17	000528	柳工	1,261,717.50	1.00
18	600990	四创电子	1,260,439.00	1.00
19	000063	中兴通讯	1,233,084.00	0.97
20	000066	中国长城	1,159,072.00	0.92

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	603929	亚翔集成	2,438,975.00	1.93
2	300059	东方财富	2,321,472.89	1.84
3	601601	中国太保	2,279,695.64	1.80

4	600028	中国石化	2,101,250.00	1.66
5	300377	赢时胜	2,072,020.00	1.64
6	600115	东方航空	1,977,846.96	1.56
7	000009	中国宝安	1,942,807.94	1.54
8	000581	威孚高科	1,895,261.00	1.50
9	600030	中信证券	1,762,157.48	1.39
10	300024	机器人	1,680,713.61	1.33
11	600362	江西铜业	1,468,884.11	1.16
12	002029	七匹狼	1,465,647.00	1.16
13	300613	富瀚微	1,352,721.00	1.07
14	600990	四创电子	1,317,204.00	1.04
15	000063	中兴通讯	1,270,972.40	1.00
16	600583	海油工程	1,229,866.00	0.97
17	000528	柳工	1,216,059.26	0.96
18	002153	石基信息	1,211,583.34	0.96
19	002465	海格通信	1,207,115.66	0.95
20	600674	川投能源	1,201,502.10	0.95

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	65,474,836.83
卖出股票收入（成交）总额	67,453,878.78

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	13,525,560.90	13.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,666,000.00	18.96
	其中：政策性金融债	19,666,000.00	18.96
4	企业债券	16,651,440.08	16.05
5	企业短期融资券	30,222,000.00	29.13
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	6,759,572.00	6.52
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	86,824,572.98	83.70

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	018002	国开 1302	115,700	11,743,550.00	11.32
2	011755076	17 平安银行 SCP013	100,000	10,077,000.00	9.71
3	011764113	17 复星高科 SCP003	100,000	10,067,000.00	9.70
4	170215	17 国开 15	100,000	9,942,000.00	9.58
5	160206	16 国开 06	100,000	9,724,000.00	9.37

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国债期货交易情况说明

根据基金合同，本基金暂不可投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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，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。

7.11.2

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。

7.11.3 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	24,988.72
2	应收证券清算款	506,047.72
3	应收股利	-
4	应收利息	2,040,882.77
5	应收申购款	719.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,572,638.63

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113014	林洋转债	1,531,372.80	1.48
2	110032	三一转债	1,166,030.00	1.12
3	113011	光大转债	939,704.80	0.91
4	123002	国祯转债	451,592.40	0.44
5	113015	隆基转债	340,697.60	0.33
6	113013	国君转债	161,082.90	0.16
7	132007	16 凤凰 EB	111,000.00	0.11

7.11.5 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不存在流通受限情况。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
1,652	56,488.84	79,821,274.79	85.54%	13,498,289.23	14.46%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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（2013年3月6日）基金份额总额	6,380,439,193.08
本报告期期初基金份额总额	112,421,194.83
本报告期基金总申购份额	1,558,835.85
减：本报告期基金总赎回份额	20,660,466.66
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	93,319,564.02

§ 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

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未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

中泰证券	1	72,956,547.16	54.88%	65,391.33	54.32%	-
华宝证券	1	37,915,254.47	28.52%	34,438.15	28.61%	-
招商证券	1	22,056,913.98	16.59%	20,541.94	17.07%	-

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	4,849,548.69	19.43%	85,630,000.00	7.49%	-	-
华宝证券	8,937,713.42	35.81%	516,600,000.00	45.18%	-	-
招商证券	11,173,542.33	44.76%	541,300,000.00	47.34%	-	-

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：

本报告期内，本基金新增招商证券交易单元 1 个。

§ 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	2018 年 01 月 01 日-2018 年 06 月 30 日	44,404,085.26	-	-	44,404,085.26	47.58%
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。</p> <p>未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准万家双利债券型证券投资基金发行及募集的文件。
- 2、《万家双利债券型证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家双利债券型证券投资基金托管协议》
- 4、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 5、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、季度报告、更新招募说明书及其他临时公告。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。
- 7、万家双利债券型证券投资基金 2018 年半年度报告原文。

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

2018 年 8 月 28 日