

# 万家中证创业成长指数分级证券投资基金 2015 年半年度报告

2015 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：2015 年 8 月 26 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 2015 年 8 月 25 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 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	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.....	11
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.....	12
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	35
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.....	46
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	46
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	46
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>49</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>52</b>
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>52</b>
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	万家中证创业成长指数分级证券投资基金		
基金简称	成长分级		
场内简称	成长分级		
基金主代码	161910		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012 年 8 月 2 日		
基金管理人	万家基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	177,458,844.14 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012-10-12		
下属分级基金的基金简称	成长 A	成长 B	成长分级
下属分级基金的交易代码	150090	150091	161910
报告期末下属分级基金份额总额	80,400,026.00 份	80,400,027.00 份	16,658,791.14 份

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

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

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

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

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

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

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式指数化投资方法,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪偏离度不超过 0.35%,年跟踪误差不得超过 4%。		
投资策略	本基金为指数型基金,采用完全复制的方法进行投资运作,按照成份股在中证创业成长指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金管理人会对实际投资组合进行适当调整,以便实现对跟踪误差的有效控制。		
业绩比较基准	95%×中证创业成长指数收益率+5%×银行同业存款利率。		
风险收益特征	本基金为指数分级基金,不同的基金份额具有不同的风险收益特征。万家创业成长份额为常规指数基金份额,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。		
下属分级基金的风险收益特征	万家创业成长 A 份额,具有较低风险、收益相对稳定的特征。	万家创业成长 B 份额,具有高风险、高预期收益的特征。	万家创业成长份额为常规指数基金份额,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		万家基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	蒋松云
	联系电话	021-38909626	010-66105799
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95538 转 6、4008880800	95588
传真		021-38909627	010-66105798
注册地址		上海市浦东新区浦电路 360 号陆家嘴投资大厦 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市浦东新区浦电路 360 号陆家嘴投资大厦 9 楼	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	毕玉国	姜建清
-------	-----	-----

## 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	上海市浦东新区浦电路 360 号陆家嘴投资大厦 9 楼 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(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	14,092,289.05
本期利润	-12,794,000.89
加权平均基金份额本期利润	-0.2431
本期加权平均净值利润率	-21.52%
本期基金份额净值增长率	62.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	63,300,793.32
期末可供分配基金份额利润	0.3567
期末基金资产净值	144,181,835.33
期末基金份额净值	0.8125
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	78.66%

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

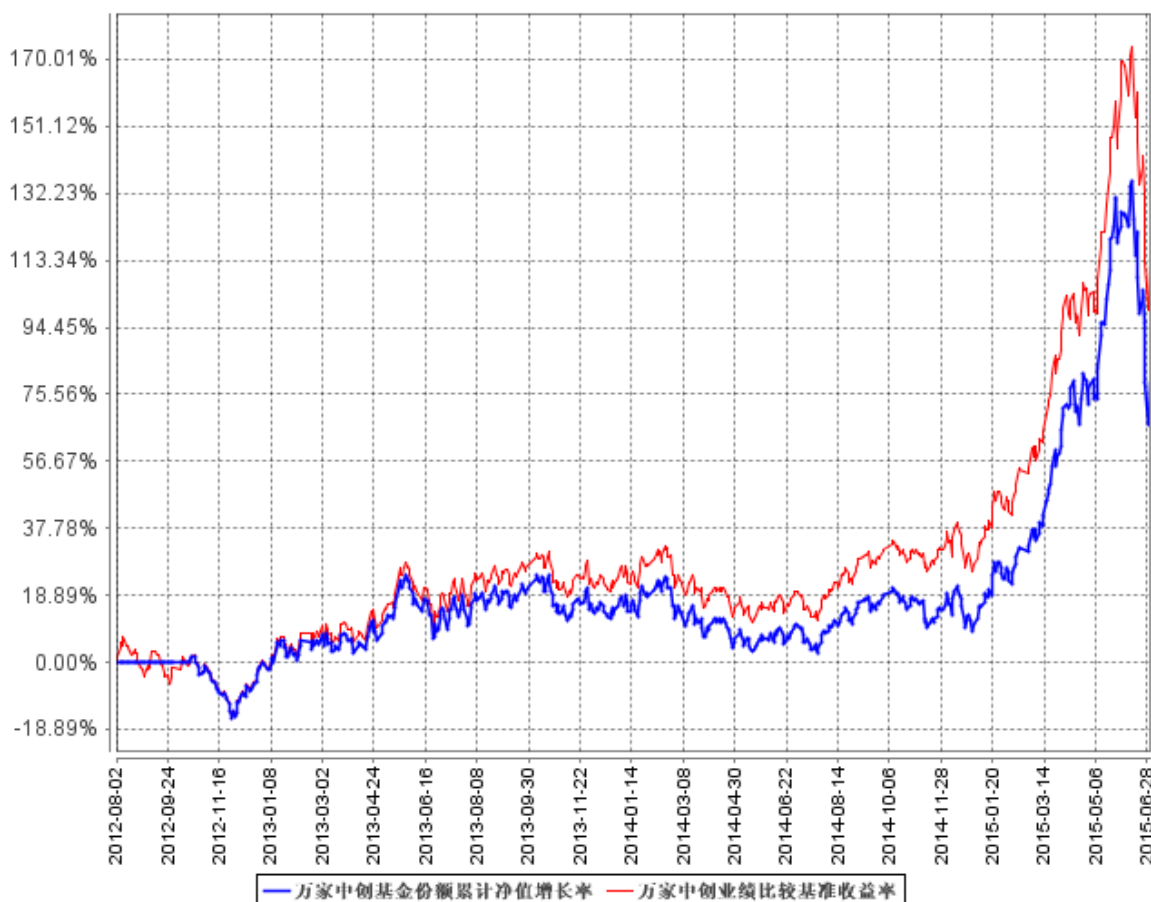
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-18.71%	3.91%	-14.49%	3.93%	-4.22%	-0.02%
过去三个月	11.76%	3.05%	13.22%	2.98%	-1.46%	0.07%
过去六个月	62.14%	2.46%	66.63%	2.40%	-4.49%	0.06%
过去一年	63.62%	1.94%	78.68%	1.89%	-15.06%	0.05%
自基金合同生效起至今	78.66%	1.60%	112.70%	1.62%	-34.04%	-0.02%

注：业绩比较基准为 95%×中证创业成长指数收益率+5%×银行同业存款利率

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

万家中创基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2012 年 8 月 2 日成立。根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同的要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同的要求。



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44 号文批准设立。公司现股东为齐鲁证券有限公司、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。目前管理二十一只开放式基金,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 380 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和万家品质生活股票型证券投资基金。

#### 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		
吴涛	本基金基金经理、万家 180 基金基金经理、万家中证红利指数(LOF)基金基金经理、万家上证 380ETF 基金基金经理、量化投资部总监	2012年8月2日	2015年5月22日	18年	硕士学位,曾任天同证券有限责任公司上海营业部副总经理、天同证券有限责任公司深圳营业部总经理、南方总部副总经理、万家基金管理有限公司监察

					稽核部总监等职。
姚霞天	本基金基金经理、万家 180 指数基金、万家中证红利指数分级基金和万家上证 380ETF 基金经理。	2015 年 5 月 22 日	-	7 年	基金经理，复旦大学金融学硕士。2007 年 7 月至 2008 年 6 月任泰信基金管理有限公司量化分析师；2008 年 9 月至 2009 年 5 月任上海金程国际金融学院 FRM 讲师；2009 年 9 月加入万家基金管理有限公司，历任风险分析师、量化分析师、基金经理助理、投资经理等职。现任万家 180 指数基金、万家中证红利指数基金（LOF）、万家中证创业成长指数分级基金和万家上证 380ETF 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》、《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 2015 年上半年,市场在年初稍事休整一个多月后,又迅速迎来一波强劲上涨的火热行情,大盘蓝筹股屡创新高,成交量急剧放大,中小板、创业板的表现相对于大盘股更加如火如荼。但进入 6 月中旬之后,本轮由流动性推动的牛市开始出现了大幅下调,而政府也迅速出手开始稳定市场,包括降息、定向降准以及成立平准基金等,预期股市快速下挫情况有望得到改善。报告

期本基金投资标的指数——中证创业成长指数收益率为 70.8%。

本基金作为被动投资型的指数基金，其投资目标是通过跟踪、复制中证创业成长指数，为投资者获取股票市场长期的平均收益。报告期内我们严格按照基金合同规定，采取了完全复制方法进行投资管理，努力拟合标的指数，减小跟踪误差。

报告期内，本基金采用有效的量化跟踪技术，将基金跟踪误差控制在较低范围内。跟踪误差主要是由于基金申购赎回、标的指数成分股定期调整、各类费用等因素所造成。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.8125 元，报告期内基金份额净值增长率为 62.14%，同期业绩比较基准收益率为 66.63%。由于个别交易日巨额申购赎回以及成分股剧烈波动，导致报告期内本基金跟踪误差有所增加，本基金报告期内的日跟踪误差为 0.5007%，年化跟踪误差为 5.44%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015 年下半年，总体上看，经济有望企稳回升，央行将继续实施稳健的货币政策，稳健货币政策效果逐步显现，更加注重松紧适度，及时进行预调微调，为经济结构调整与转型升级营造中性适度的货币金融环境。本基金标的指数所代表的是高成长中小市值公司的集合，在经济结构调整及转型的背景下，完全基于扎实的上市公司基本面成长性选股的编制方法，在今年后有望取得更好的市场表现。

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了估值委员会，定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。估值委员会由督察长、基金运营部负责人、合规稽核部负责人、权益投资部负责人、固定收益部负责人等组成。估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉政策法规，并具有丰富的实践经验。

##### 2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不介入基金日常估值业务。

##### 3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

##### 4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金合同》的约定, 存续期内, 本基金不进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内自 1 月 15 日至 4 月 7 日, 基金资产净值连续 53 个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情况; 本报告期内自 4 月 22 日至 5 月 28 日, 基金资产净值连续 26 个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情况。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。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对万家基金管理有限公司编制和披露的万家中证创业成长指数分级证券投资基金 2015 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查, 以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体: 万家中证创业成长指数分级证券投资基金

报告截止日： 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	13,160,704.64	1,873,427.70
结算备付金		100,616.20	307,593.56
存出保证金		61,142.57	20,679.39
交易性金融资产	6.4.7.2	132,211,874.56	25,877,799.27
其中：股票投资		132,211,874.56	25,877,799.27
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		-	383,033.06
应收利息	6.4.7.5	2,626.93	549.85
应收股利		-	-
应收申购款		30,551.22	10,437.38
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		145,567,516.12	28,473,520.21
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2014 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		489,667.00	767,535.53
应付管理人报酬		144,880.88	24,627.66
应付托管费		31,873.78	5,418.10
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	418,960.63	89,077.23
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	300,298.50	412,892.71
负债合计		1,385,680.79	1,299,551.23
<b>所有者权益：</b>			

实收基金	6.4.7.9	80,881,042.01	24,561,092.40
未分配利润	6.4.7.10	63,300,793.32	2,612,876.58
所有者权益合计		144,181,835.33	27,173,968.98
负债和所有者权益总计		145,567,516.12	28,473,520.21

## 6.2 利润表

会计主体：万家中证创业成长指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-11,398,871.62	-436,072.98
1.利息收入		38,020.79	14,555.86
其中：存款利息收入	6.4.7.11	38,020.79	2,700.20
债券利息收入		-	10,532.66
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	1,323.00
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		15,239,838.45	1,659,854.22
其中：股票投资收益	6.4.7.12	15,003,097.30	1,411,878.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	173,575.01
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
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	236,741.15	74,401.19
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-26,886,289.94	-2,126,218.08
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	209,559.08	15,735.02
<b>减：二、费用</b>		1,395,129.27	475,148.87
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	287,999.86	88,007.10
2. 托管费	6.4.10.2.2	63,359.91	19,361.56
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	785,785.60	49,784.94
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	257,983.90	317,995.27
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”</b>		<b>-12,794,000.89</b>	<b>-911,221.85</b>

号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-12,794,000.89	-911,221.85

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家中证创业成长指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	24,561,092.40	2,612,876.58	27,173,968.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-12,794,000.89	-12,794,000.89
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）	56,319,949.61	73,481,917.63	129,801,867.24
其中：1.基金申购款	162,638,932.56	138,597,240.42	301,236,172.98
2.基金赎回款	-106,318,982.95	-65,115,322.79	-171,434,305.74
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）	80,881,042.01	63,300,793.32	144,181,835.33
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	25,900,557.95	4,119,234.23	30,019,792.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-911,221.85	-911,221.85
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-11,142,341.41	-1,785,871.75	-12,928,213.16



(净值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	652,740.64	66,625.27	719,365.91
2.基金赎回款	-11,795,082.05	-1,852,497.02	-13,647,579.07
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）	14,758,216.54	1,422,140.63	16,180,357.17

注：本基金成立于 2012 年 8 月 2 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>毕玉国</u>	<u>李杰</u>	<u>陈广益</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

万家中证创业成长指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2012] 324 号文《关于核准万家中证创业成长指数分级证券投资基金募集的批复》的核准，由万家基金管理有限公司作为发起人于 2012 年 7 月 2 日至 2012 年 7 月 27 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2012)验字第 60778298\_B02 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2012 年 8 月 2 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 412,353,281.39 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 70,602.84 元，以上实收基金(本息)合计为人民币 412,423,884.23 元，折合 412,423,884.23 份基金份额。本基金的基金管理人为万家基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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

投资者可选择将其场内申购的万家创业成长份额按 1:1 的比例分拆成风险和收益特性不同的万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额。投资者可按 1:1 的配比将其持有的万家创业成长 A

份额与万家创业成长 B 份额申请合并为万家创业成长份额后赎回。投资者在场外申购的万家创业成长份额不得申请进行分拆（《基金合同》另有规定的除外），但可通过跨系统转托管至场内并申请将其按 1:1 的比例分拆为万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额。

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

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

本基金万家创业成长 A 份额 74,051,084.00 份和万家创业成长 B 份额 74,051,085.00 份于 2012 年 10 月 12 日上市交易。

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

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，

同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 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与最近一期年度报告相一致的说明

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。

### 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、国家税务总局财税字[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. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[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，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[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。

### 3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50% 计算应纳税所得额；

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、国家税务总局财税字[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《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》，自 2008 年 10 月 9 日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 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 2015 年 6 月 30 日
活期存款	13,160,704.64
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-

其他存款	-
合计：	13,160,704.64

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	160,140,787.58	132,211,874.56	-27,928,913.02
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	160,140,787.58	132,211,874.56	-27,928,913.02

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：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

注：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

注：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 2015年6月30日
应收活期存款利息	2,561.41
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	40.77
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	24.75
合计	2,626.93

注：上表中其他为应收证券结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

注：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 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	418,960.63
银行间市场应付交易费用	-
合计	418,960.63

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,534.60
预提费用	148,763.90
应付指数使用费	150,000.00
合计	300,298.50

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	25,622,348.35	24,561,092.40
本期申购	89,013,608.04	82,005,647.41
本期赎回(以“-”号填列)	-100,062,873.05	-93,019,506.61
2015年5月22日基金拆分/份额折算前	14,573,083.34	13,547,233.20
基金拆分/份额折算变动份额	15,151,901.87	-
本期申购	176,913,028.28	80,633,285.15

本期赎回(以“-”号填列)	-29,179,169.35	-13,299,476.34
本期末	177,458,844.14	80,881,042.01

注：1. 根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所（以下简称“深交所”）和中国证券登记结算有限责任公司的规定，本基金以 2015 年 1 月 5 日为份额折算基准日，对万家创业成长份额的场外份额、场内份额以及万家创业成长 A 份额实施定期份额折算。2015 年 1 月 5 日折算前，万家中创份额为 8,076,838.23 份，万家中创 A 份额为 8,757,550.00 份，万家中创 B 份额为 8,757,551.00 份；折算后万家中创份额增加 797,827.72 份，为 8,874,666.95 份，万家中创 A 份额为 8,757,550.00 份，万家中创 B 份额为 8,757,551.00 份。本基金以 2015 年 5 月 22 日为份额折算基准日，对万家创业成长份额的场外份额、场内份额、万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额实施定期份额折算。2015 年 5 月 22 日折算前，万家中创份额为 4,148,064.34 份，万家中创 A 份额为 5,212,509.00 份，万家中创 B 份额为 5,212,510.00 份；折算后万家中创份额增加 15,151,901.87 份，为 19,299,966.21 份，万家中创 A 份额为 5,212,509.00 份，万家中创 B 份额为 5,212,510.00 份。

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

3. 申购含转换入份额, 赎回含转换出份额。

### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,815,027.38	-7,202,150.80	2,612,876.58
本期利润	14,092,289.05	-26,886,289.94	-12,794,000.89
本期基金份额交易产生的变动数	59,752,330.43	13,729,587.20	73,481,917.63
其中：基金申购款	130,161,030.70	8,436,209.72	138,597,240.42
基金赎回款	-70,408,700.27	5,293,377.48	-65,115,322.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	83,659,646.86	-20,358,853.54	63,300,793.32

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	35,816.95

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	1,828.68
其他	375.16
合计	38,020.79

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 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	224,357,913.22
减：卖出股票成本总额	209,354,815.92
买卖股票差价收入	15,003,097.30

### 6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金报告期末未持有债券投资。

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金报告期末未持有贵金属投资。

### 6.4.7.15 衍生工具收益

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 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	236,741.15
基金投资产生的股利收益	-
合计	236,741.15

### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	-26,886,289.94
——股票投资	-26,886,289.94



——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	-26,886,289.94

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	208,647.70
转出费收入	911.38
合计	209,559.08

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	785,785.60
银行间市场交易费用	-
合计	785,785.60

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	89,258.34
上市费	29,752.78
其他	-
指数使用费	100,000.00
银行汇划费用	220.00
债券帐户维护费	9,000.00
合计	257,983.90

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

下：

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

H 为每日应计提的指数许可使用基点费

E 为前一日基金资产净值

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

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，与本基金存在控制关系或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
齐鲁证券有限公司（“齐鲁证券”）	基金管理人股东，基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
齐鲁证券	525,056,807.28	92.65%	26,878,811.31	96.07%

#### 债券交易

注：本报告期间本基金未通过关联方席位进行债券交易。

### 债券回购交易

注：本报告期间本基金未通过关联方席位进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本报告期间本基金未通过关联方席位进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015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
齐鲁证券	459,634.89	92.55%	386,046.53	92.14%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
齐鲁证券	23,529.59	96.02%	23,529.59	96.02%

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 2015年1月1日至2015年6 月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30 日
	当期发生的基金应支付 的管理费	287,999.86
其中：支付销售机构的客 户维护费	17,778.70	20,024.16

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

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管

理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	63,359.91	19,361.56

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

$$H = E \times 0.22\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

万家中创				
关联方名称	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 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
齐鲁证券股份有 限公司	2.00	0.00%	1.00	0.00%

### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年6月30日		2014年1月1日至2014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
中国工商银行股份有限公司	13,160,704.64	35,816.95	357,375.46	2,104.93

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2015年1月1日至2015年6月30日获得的利息收入为人民币1,828.68元，2015年6月30日结算备付金余额为人民币100,616.20元；2014年1月1日至2014年6月30日获得的利息收入为人民币313.60元，2014年6月30日结算备付金余额为人民币5048.10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

注：本基金本报告期未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

### 6.4.11 利润分配情况

注：根据本基金基金合同，本基金不进行利润分配。

### 6.4.12 期末（2015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

注：报告期末本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002002	鸿达兴业	2015年6月18日	重大事项	30.52	-	-	40,200	1,479,114.00	1,226,904.00	-
600807	天业股份	2015年6月30日	重大事项	21.31	2015年8月14日	19.18	32,900	1,002,704.00	701,099.00	-
000035	中国天楹	2015年6月17日	重大事项	23.43	2015年7月17日	21.09	29,301	638,849.36	686,522.43	-
002353	杰瑞股份	2015年5月27日	重大事项	44.35	-	-	11,395	434,942.26	505,368.25	-
002292	奥飞	2015	重大	37.29	-	-	13,604	285,629.37	507,293.16	-

	动漫	年 5 月 18 日	事项							
002416	爱施德	2015 年 5 月 5 日	重大事项	20.67	2015 年 7 月 29 日	18.60	7,997	148,716.49	165,297.99	-
000545	金浦钛业	2015 年 5 月 18 日	重大事项	21.34	-	-	5,635	82,280.15	120,250.90	-
002166	莱茵生物	2015 年 5 月 25 日	重大事项	40.49	2015 年 7 月 2 日	36.44	2,514	71,528.96	101,791.86	-
000863	三湘股份	2015 年 2 月 13 日	重大事项	7.52	2015 年 7 月 24 日	8.27	6,590	46,352.71	49,556.80	-
300349	金卡股份	2015 年 6 月 18 日	重大事项	59.79	2015 年 8 月 19 日	53.81	69	3,484.88	4,125.51	-
600882	华联矿业	2015 年 5 月 19 日	重大事项	13.42	-	-	198	2,174.47	2,657.16	-
300228	富瑞特装	2015 年 6 月 24 日	重大事项	90.91	2015 年 7 月 30 日	81.82	20	1,949.55	1,818.20	-
000034	深信泰丰	2015 年 3 月 23 日	重大事项	9.20	-	-	57	390.17	524.40	-

注：本基金截至 2015 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 2015 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

本基金所持证券均在证券交易所上市，因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金于本报告期末持有的流通受限证券外，本报告期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

### 6.4.13.4.1 利率风险

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

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 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	13,160,704.64	-	-	-	-	-	13,160,704.64
结算备付金	100,616.20	-	-	-	-	-	100,616.20
存出保证金	61,142.57	-	-	-	-	-	61,142.57
交易性金融资产	-	-	-	-	-	132,211,874.56	132,211,874.56
应收利息	-	-	-	-	-	2,626.93	2,626.93
应收申购款	-	-	-	-	-	30,551.22	30,551.22
资产总计	13,322,463.41	-	-	-	-	132,245,052.71	145,567,516.12
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	489,667.00	489,667.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	144,880.88	144,880.88
应付托管费	-	-	-	-	-	31,873.78	31,873.78
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	418,960.63	418,960.63
其他负债	-	-	-	-	-	300,298.50	300,298.50
负债总计	-	-	-	-	-	1,385,680.79	1,385,680.79
利率敏感度缺口	13,322,463.41	-	-	-	-	-130,859,371.92	144,181,835.33
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,873,427.70	-	-	-	-	-	1,873,427.70
结算备付金	307,593.56	-	-	-	-	-	307,593.56
存出保证金	20,679.39	-	-	-	-	-	20,679.39
交易性金融资产	-	-	-	-	-	25,877,799.27	25,877,799.27
应收证券清算款	-	-	-	-	-	383,033.06	383,033.06
应收利息	-	-	-	-	-	549.85	549.85
应收申购款	-	-	-	-	-	10,437.38	10,437.38
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,201,700.65	-	-	-	-	26,271,819.56	28,473,520.21
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	767,535.53	767,535.53
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	24,627.66	24,627.66
应付托管费	-	-	-	-	-	5,418.10	5,418.10



应付销售服务费	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	89,077.23	89,077.23
其他负债	-	-	-	-	412,892.71	412,892.71
负债总计	-	-	-	-	1,299,551.23	1,299,551.23
利率敏感度缺口	2,201,700.65	-	-	-	-	24,972,268.33

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末计息资产仅包括银行存款、结算备付金及存出保证金，且均以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本报告期末及上年度末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		上年度末 2014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	132,211,874.56	91.70	25,877,799.27	95.23
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	132,211,874.56	91.70	25,877,799.27	95.23

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

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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（2015年6月30日）	上年度末（2014年12月31日）
	2. 股票基准指数上升 100 个基点	1,445,184.99	261,402.01
	1. 股票基准指数下降 100 个基点	-1,445,184.99	-261,402.01

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

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	132,211,874.56	90.83
	其中：股票	132,211,874.56	90.83
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	13,261,320.84	9.11
7	其他各项资产	94,320.72	0.06
8	合计	145,567,516.12	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	280.50	0.00
B	采矿业	3,264.64	0.00
C	制造业	73,079,730.15	50.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,716,781.13	1.19
E	建筑业	2,948,255.36	2.04
F	批发和零售业	1,370,627.93	0.95
G	交通运输、仓储和邮政业	2,265.71	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,236,715.01	16.81
J	金融业	7,297,354.00	5.06
K	房地产业	6,194,939.73	4.30
L	租赁和商务服务业	4,213,327.77	2.92
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,236,898.06	1.55
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	521,403.00	0.36
Q	卫生和社会工作	2,783,994.06	1.93
R	文化、体育和娱乐业	5,604,111.24	3.89
S	综合	1,926.27	0.00
	合计	132,211,874.56	91.70

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 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

### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300059	东方财富	138,103	8,712,918.27	6.04
2	002415	海康威视	144,274	6,463,475.20	4.48

3	300104	乐视网	107,900	5,584,904.00	3.87
4	002450	康得新	168,936	5,169,441.60	3.59
5	300027	华谊兄弟	102,838	3,922,241.32	2.72
6	002673	西部证券	130,400	3,699,448.00	2.57
7	002736	国信证券	143,400	3,597,906.00	2.50
8	002202	金风科技	179,100	3,487,077.00	2.42
9	002241	歌尔声学	90,125	3,235,487.50	2.24
10	300124	汇川技术	55,452	2,661,696.00	1.85
11	300017	网宿科技	56,945	2,643,386.90	1.83
12	300147	香雪制药	85,613	2,636,880.40	1.83
13	300058	蓝色光标	157,687	2,493,031.47	1.73
14	002456	欧菲光	72,107	2,432,890.18	1.69
15	002030	达安基因	54,562	2,417,096.60	1.68
16	300208	恒顺众昇	28,200	2,241,618.00	1.55
17	002236	大华股份	69,114	2,206,118.88	1.53
18	300253	卫宁软件	38,728	2,013,856.00	1.40
19	002475	立讯精密	58,921	1,992,119.01	1.38
20	300315	掌趣科技	145,538	1,972,039.90	1.37
21	002410	广联达	79,977	1,871,461.80	1.30
22	002104	恒宝股份	67,369	1,595,971.61	1.11
23	002219	恒康医疗	35,707	1,587,533.22	1.10
24	300244	迪安诊断	18,899	1,586,382.06	1.10
25	300072	三聚环保	46,899	1,580,496.30	1.10
26	002573	清新环境	74,600	1,541,982.00	1.07
27	002285	世联行	68,289	1,464,116.16	1.02
28	300267	尔康制药	42,338	1,443,302.42	1.00
29	300274	阳光电源	46,000	1,406,220.00	0.98
30	002271	东方雨虹	49,193	1,264,260.10	0.88
31	000767	漳泽电力	133,109	1,253,886.78	0.87
32	002002	鸿达兴业	40,200	1,226,904.00	0.85
33	002595	豪迈科技	56,696	1,223,499.68	0.85
34	002462	嘉事堂	22,646	1,202,502.60	0.83
35	300347	泰格医药	35,100	1,197,612.00	0.83
36	300026	红日药业	52,744	1,183,575.36	0.82
37	600687	刚泰控股	28,600	1,122,550.00	0.78
38	300136	信维通信	44,500	1,108,050.00	0.77
39	002508	老板电器	28,701	1,100,970.36	0.76
40	002440	闰土股份	45,284	1,085,457.48	0.75
41	300011	鼎汉技术	30,600	1,083,852.00	0.75

42	300207	欣旺达	44,100	1,068,102.00	0.74
43	300202	聚龙股份	25,974	1,049,349.60	0.73
44	002185	华天科技	57,639	1,038,654.78	0.72
45	300367	东方网力	17,360	1,002,540.00	0.70
46	600565	迪马股份	82,000	994,660.00	0.69
47	000915	山大华特	16,800	940,800.00	0.65
48	002047	宝鹰股份	73,600	940,608.00	0.65
49	002707	众信旅游	9,870	930,148.80	0.65
50	000802	北京文化	31,700	922,787.00	0.64
51	002019	亿帆鑫富	25,999	891,765.70	0.62
52	300043	互动娱乐	58,809	882,723.09	0.61
53	300134	大富科技	30,896	863,543.20	0.60
54	002081	金螳螂	29,845	841,330.55	0.58
55	600239	云南城投	87,300	829,350.00	0.58
56	300054	鼎龙股份	30,800	816,508.00	0.57
57	002210	飞马国际	28,180	788,758.20	0.55
58	600273	嘉化能源	45,700	781,470.00	0.54
59	002373	千方科技	17,700	766,233.00	0.53
60	002699	美盛文化	19,200	753,792.00	0.52
61	300252	金信诺	19,000	753,730.00	0.52
62	002658	雪迪龙	28,560	739,704.00	0.51
63	600730	中国高科	27,300	736,554.00	0.51
64	300296	利亚德	38,000	706,800.00	0.49
65	600807	天业股份	32,900	701,099.00	0.49
66	000035	中国天楹	29,301	686,522.43	0.48
67	600133	东湖高新	52,437	603,549.87	0.42
68	000928	中钢国际	22,500	558,225.00	0.39
69	600162	香江控股	44,700	524,331.00	0.36
70	600661	新南洋	15,100	521,403.00	0.36
71	600843	上工申贝	24,900	514,932.00	0.36
72	002292	奥飞动漫	13,604	507,293.16	0.35
73	002198	嘉应制药	35,935	505,964.80	0.35
74	002353	杰瑞股份	11,395	505,368.25	0.35
75	002701	奥瑞金	19,142	498,266.26	0.35
76	300175	朗源股份	32,900	493,500.00	0.34
77	300386	飞天诚信	3,341	479,366.68	0.33
78	000553	沙隆达 A	29,636	472,101.48	0.33
79	600173	卧龙地产	50,800	468,376.00	0.32
80	600168	武汉控股	33,455	462,013.55	0.32

81	000700	模塑科技	16,084	456,946.44	0.32
82	300303	聚飞光电	36,726	451,362.54	0.31
83	300351	永贵电器	11,760	450,996.00	0.31
84	000029	深深房 A	31,617	425,880.99	0.30
85	300237	美晨科技	12,200	399,794.00	0.28
86	300263	隆华节能	17,900	399,170.00	0.28
87	300067	安诺其	31,073	351,746.36	0.24
88	300357	我武生物	7,500	324,975.00	0.23
89	002227	奥特迅	10,200	323,850.00	0.22
90	002427	尤夫股份	15,470	323,787.10	0.22
91	600081	东风科技	14,600	309,666.00	0.21
92	300234	开尔新材	12,513	267,527.94	0.19
93	603306	华懋科技	4,900	205,604.00	0.14
94	603788	宁波高发	4,800	203,952.00	0.14
95	600562	国睿科技	3,511	203,497.56	0.14
96	300098	高新兴	6,254	182,241.56	0.13
97	000902	新洋丰	6,230	169,144.50	0.12
98	002416	爱施德	7,997	165,297.99	0.11
99	000545	金浦钛业	5,635	120,250.90	0.08
100	002166	莱茵生物	2,514	101,791.86	0.07
101	000863	三湘股份	6,590	49,556.80	0.03
102	300070	碧水源	157	7,660.03	0.01
103	002153	石基信息	38	4,939.62	0.00
104	300146	汤臣倍健	119	4,674.32	0.00
105	300133	华策影视	163	4,401.00	0.00
106	300349	金卡股份	69	4,125.51	0.00
107	002324	普利特	106	3,678.20	0.00
108	300182	捷成股份	71	3,656.50	0.00
109	300355	蒙草抗旱	164	2,937.24	0.00
110	600882	华联矿业	198	2,657.16	0.00
111	002294	信立泰	80	2,288.00	0.00
112	002013	中航机电	67	1,865.95	0.00
113	000151	中成股份	61	1,860.50	0.00
114	300228	富瑞特装	20	1,818.20	0.00
115	000582	北部湾港	73	1,552.71	0.00
116	300205	天喻信息	50	1,507.50	0.00
117	600603	大洲兴业	83	1,401.87	0.00
118	002400	省广股份	55	1,389.30	0.00
119	300005	探路者	49	1,342.60	0.00

120	300014	亿纬锂能	49	1,298.50	0.00
121	300262	巴安水务	55	1,017.50	0.00
122	000701	厦门信达	42	966.84	0.00
123	002146	荣盛发展	74	925.00	0.00
124	000673	当代东方	27	889.92	0.00
125	000600	建投能源	60	880.80	0.00
126	600728	佳都科技	26	875.94	0.00
127	000739	普洛药业	84	834.96	0.00
128	002174	游族网络	9	834.84	0.00
129	002064	华峰氨纶	88	798.16	0.00
130	600076	青鸟华光	62	736.56	0.00
131	600706	曲江文旅	35	733.60	0.00
132	000905	厦门港务	46	713.00	0.00
133	000065	北方国际	16	587.20	0.00
134	000034	深信泰丰	57	524.40	0.00
135	002481	双塔食品	11	457.93	0.00
136	002302	西部建设	19	385.89	0.00
137	600988	赤峰黄金	22	347.38	0.00
138	600965	福成五丰	17	280.50	0.00
139	000409	山东地矿	18	260.10	0.00
140	600961	株冶集团	10	139.90	0.00
141	600658	电子城	6	90.78	0.00
142	300095	华伍股份	5	56.55	0.00

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002415	海康威视	14,357,718.65	52.84
2	002450	康得新	11,299,866.95	41.58
3	300027	华谊兄弟	10,884,813.36	40.06
4	300059	东方财富	10,284,947.90	37.85
5	002241	歌尔声学	8,685,762.56	31.96

6	300070	碧水源	8,275,747.18	30.45
7	300124	汇川技术	7,397,618.10	27.22
8	300104	乐视网	7,126,795.00	26.23
9	002236	大华股份	7,025,936.90	25.86
10	300253	卫宁软件	6,851,759.55	25.21
11	002030	达安基因	6,599,333.00	24.29
12	002400	省广股份	6,060,066.49	22.30
13	002153	石基信息	5,775,838.75	21.26
14	300017	网宿科技	5,516,182.52	20.30
15	300058	蓝色光标	5,489,696.71	20.20
16	002410	广联达	5,067,928.81	18.65
17	002456	欧菲光	4,972,959.12	18.30
18	300315	掌趣科技	4,677,256.66	17.21
19	002285	世联行	4,665,099.66	17.17
20	002736	国信证券	4,492,821.00	16.53
21	002673	西部证券	4,305,808.00	15.85
22	002202	金风科技	4,128,877.57	15.19
23	300147	香雪制药	4,086,628.99	15.04
24	300072	三聚环保	4,071,532.40	14.98
25	300244	迪安诊断	3,865,325.00	14.22
26	300146	汤臣倍健	3,836,268.98	14.12
27	002081	金螳螂	3,822,342.00	14.07
28	002104	恒宝股份	3,812,076.00	14.03
29	002146	荣盛发展	3,609,484.35	13.28
30	300133	华策影视	3,556,966.00	13.09
31	002440	闰土股份	3,490,679.69	12.85
32	002219	恒康医疗	3,434,534.94	12.64
33	002271	东方雨虹	3,397,391.27	12.50
34	002475	立讯精密	3,346,543.64	12.32
35	002185	华天科技	3,209,938.84	11.81
36	300134	大富科技	3,190,083.00	11.74
37	002595	豪迈科技	3,126,008.33	11.50
38	300005	探路者	3,120,170.00	11.48
39	002462	嘉事堂	3,085,329.00	11.35
40	300202	聚龙股份	3,078,344.00	11.33
41	002294	信立泰	3,069,538.64	11.30



42	600728	佳都科技	2,756,722.12	10.14
43	002353	杰瑞股份	2,712,622.48	9.98
44	002508	老板电器	2,677,548.00	9.85
45	300182	捷成股份	2,566,951.54	9.45
46	300228	富瑞特装	2,440,004.00	8.98
47	000767	漳泽电力	2,412,859.00	8.88
48	300043	互动娱乐	2,391,253.60	8.80
49	002064	华峰氨纶	2,378,507.00	8.75
50	002013	中航机电	2,307,001.23	8.49
51	002573	清新环境	2,075,671.60	7.64
52	300208	恒顺众昇	1,934,787.00	7.12
53	002481	双塔食品	1,931,589.32	7.11
54	002019	亿帆鑫富	1,931,047.00	7.11
55	000739	普洛药业	1,903,813.25	7.01
56	002210	飞马国际	1,896,638.45	6.98
57	600133	东湖高新	1,816,392.98	6.68
58	002701	奥瑞金	1,779,696.85	6.55
59	600988	赤峰黄金	1,749,807.00	6.44
60	300303	聚飞光电	1,724,294.00	6.35
61	300267	尔康制药	1,722,318.84	6.34
62	000905	厦门港务	1,717,777.34	6.32
63	300274	阳光电源	1,699,700.00	6.25
64	000673	当代东方	1,690,956.30	6.22
65	002658	雪迪龙	1,663,537.00	6.12
66	300367	东方网力	1,661,290.00	6.11
67	300014	亿纬锂能	1,639,556.92	6.03
68	300136	信维通信	1,613,617.00	5.94
69	300386	飞天诚信	1,563,149.08	5.75
70	300347	泰格医药	1,552,796.00	5.71
71	600961	株冶集团	1,538,860.00	5.66
72	300355	蒙草抗旱	1,532,649.00	5.64
73	002324	普利特	1,482,696.30	5.46
74	002002	鸿达兴业	1,479,114.00	5.44
75	002707	众信旅游	1,460,608.00	5.38
76	002047	宝鹰股份	1,440,115.00	5.30
77	000600	建投能源	1,436,990.00	5.29

78	000409	山东地矿	1,383,471.00	5.09
79	300026	红日药业	1,352,361.00	4.98
80	000035	中国天楹	1,325,618.00	4.88
81	000802	北京文化	1,311,913.92	4.83
82	002174	游族网络	1,304,126.00	4.80
83	300262	巴安水务	1,296,007.00	4.77
84	300011	鼎汉技术	1,279,310.00	4.71
85	600965	福成五丰	1,245,632.00	4.58
86	600565	迪马股份	1,236,872.00	4.55
87	000029	深深房 A	1,217,022.20	4.48
88	000151	中成股份	1,199,023.50	4.41
89	002198	嘉应制药	1,198,237.00	4.41
90	000065	北方国际	1,192,732.80	4.39
91	600687	刚泰控股	1,178,432.00	4.34
92	002292	奥飞动漫	1,172,220.00	4.31
93	600168	武汉控股	1,151,138.00	4.24
94	000915	山大华特	1,134,684.00	4.18
95	002699	美盛文化	1,118,442.00	4.12
96	002373	千方科技	1,083,923.00	3.99
97	002302	西部建设	1,082,480.40	3.98
98	300067	安诺其	1,077,044.00	3.96
99	600239	云南城投	1,071,117.00	3.94
100	600603	大洲兴业	1,062,348.76	3.91
101	300207	欣旺达	1,060,297.00	3.90
102	300252	金信诺	1,036,468.27	3.81
103	000553	沙隆达 A	1,031,480.00	3.80
104	300054	鼎龙股份	1,026,233.24	3.78
105	600562	国睿科技	1,006,149.00	3.70
106	600807	天业股份	1,002,704.00	3.69
107	600730	中国高科	963,081.00	3.54
108	600076	青鸟华光	956,320.00	3.52
109	000902	新洋丰	913,174.82	3.36
110	600658	电子城	908,776.75	3.34
111	300296	利亚德	907,410.00	3.34
112	300205	天喻信息	858,774.50	3.16
113	600273	嘉化能源	821,740.00	3.02

114	300234	开尔新材	799,995.24	2.94
115	000582	北部湾港	797,238.70	2.93
116	600706	曲江文旅	724,911.00	2.67
117	600661	新南洋	706,614.00	2.60
118	300175	朗源股份	682,012.00	2.51
119	600173	卧龙地产	674,116.00	2.48
120	600843	上工申贝	621,555.00	2.29
121	000928	中钢国际	617,171.00	2.27
122	300351	永贵电器	613,563.60	2.26
123	300349	金卡股份	581,534.00	2.14
124	000700	模塑科技	580,369.00	2.14
125	300263	隆华节能	570,743.00	2.10
126	600162	香江控股	544,374.00	2.00

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002415	海康威视	9,673,549.17	35.60
2	300070	碧水源	9,415,033.08	34.65
3	300027	华谊兄弟	7,960,533.37	29.29
4	002450	康得新	6,626,746.17	24.39
5	002400	省广股份	6,606,768.68	24.31
6	002241	歌尔声学	6,255,776.40	23.02
7	002153	石基信息	6,134,297.87	22.57
8	300124	汇川技术	5,138,272.71	18.91
9	002236	大华股份	4,959,098.02	18.25
10	300253	卫宁软件	4,625,428.59	17.02
11	300146	汤臣倍健	4,591,568.85	16.90
12	002146	荣盛发展	4,400,655.66	16.19
13	002030	达安基因	4,369,858.81	16.08
14	002081	金螳螂	4,161,891.91	15.32
15	300133	华策影视	3,970,351.40	14.61
16	002294	信立泰	3,544,356.22	13.04
17	600728	佳都科技	3,342,456.86	12.30

18	300005	探路者	3,271,461.59	12.04
19	300017	网宿科技	3,224,717.18	11.87
20	002353	杰瑞股份	3,113,088.01	11.46
21	300182	捷成股份	3,083,140.23	11.35
22	002410	广联达	3,030,231.69	11.15
23	002285	世联行	2,967,148.70	10.92
24	300058	蓝色光标	2,963,635.30	10.91
25	002456	欧菲光	2,859,114.43	10.52
26	300072	三聚环保	2,833,361.49	10.43
27	002064	华峰氨纶	2,795,097.15	10.29
28	300228	富瑞特装	2,725,164.57	10.03
29	002013	中航机电	2,706,459.39	9.96
30	002440	闰土股份	2,635,684.84	9.70
31	002481	双塔食品	2,455,187.75	9.04
32	002219	恒康医疗	2,452,931.23	9.03
33	000739	普洛药业	2,338,421.15	8.61
34	300315	掌趣科技	2,315,492.71	8.52
35	002271	东方雨虹	2,251,748.99	8.29
36	300244	迪安诊断	2,249,971.97	8.28
37	002185	华天科技	2,186,335.65	8.05
38	300202	聚龙股份	2,134,112.17	7.85
39	002462	嘉事堂	2,100,731.88	7.73
40	002475	立讯精密	2,033,549.15	7.48
41	300134	大富科技	2,023,854.90	7.45
42	002701	奥瑞金	1,994,399.35	7.34
43	000673	当代东方	1,956,371.55	7.20
44	600988	赤峰黄金	1,949,836.11	7.18
45	000905	厦门港务	1,933,352.16	7.11
46	002508	老板电器	1,927,939.35	7.09
47	300014	亿纬锂能	1,927,186.94	7.09
48	002104	恒宝股份	1,912,339.93	7.04
49	600961	株冶集团	1,829,582.19	6.73
50	002595	豪迈科技	1,808,278.47	6.65
51	300043	互动娱乐	1,773,901.17	6.53
52	000600	建投能源	1,720,912.80	6.33
53	300355	蒙草抗旱	1,711,959.30	6.30
54	002174	游族网络	1,646,030.58	6.06
55	300147	香雪制药	1,627,734.33	5.99

56	002324	普利特	1,622,546.49	5.97
57	300262	巴安水务	1,617,453.46	5.95
58	600965	福成五丰	1,576,354.83	5.80
59	000151	中成股份	1,526,601.12	5.62
60	000409	山东地矿	1,516,474.76	5.58
61	000767	漳泽电力	1,360,709.30	5.01
62	002292	奥飞动漫	1,316,209.17	4.84
63	000065	北方国际	1,314,940.86	4.84
64	300205	天喻信息	1,300,698.69	4.79
65	600133	东湖高新	1,288,431.91	4.74
66	600603	大洲兴业	1,281,605.74	4.72
67	300303	聚飞光电	1,267,346.46	4.66
68	002210	飞马国际	1,261,950.52	4.64
69	002019	亿帆鑫富	1,196,998.00	4.40
70	600562	国睿科技	1,168,582.47	4.30
71	002302	西部建设	1,116,760.17	4.11
72	600076	青鸟华光	1,101,016.40	4.05
73	600658	电子城	1,100,641.75	4.05
74	000902	新洋丰	1,056,326.14	3.89
75	300386	飞天诚信	1,027,747.56	3.78
76	000582	北部湾港	998,458.26	3.67
77	000035	中国天楹	919,171.26	3.38
78	002658	雪迪龙	877,853.62	3.23
79	600706	曲江文旅	814,952.93	3.00
80	000029	深深房A	747,236.21	2.75
81	300349	金卡股份	735,342.42	2.71
82	300067	安诺其	712,283.57	2.62
83	002198	嘉应制药	707,441.51	2.60
84	600168	武汉控股	700,989.84	2.58
85	300026	红日药业	699,644.99	2.57
86	000553	沙隆达A	666,033.87	2.45
87	000701	厦门信达	613,371.51	2.26
88	300234	开尔新材	546,984.00	2.01
89	300095	华伍股份	544,116.88	2.00

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	342,575,181.15
卖出股票收入（成交）总额	224,357,913.22

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末持有债券投资。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末持有债券投资。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：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

注：本基金报告期末未持有贵属投资。

### 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

注：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

注：根据基金合同，本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，在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.12.2

基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	61,142.57
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,626.93
5	应收申购款	30,551.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	94,320.72

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
成长 A	624	128,846.20	24,559,186.00	30.55%	55,840,840.00	69.45%
成长 B	3,363	23,907.23	20,100.00	0.20%	80,379,927.00	99.98%
成长分级	1,836	9,073.42	213,276.58	1.28%	16,445,514.56	98.72%

合计	5,823	30,475.50	24,792,562.58	13.97%	152,666,281.56	86.03%
----	-------	-----------	---------------	--------	----------------	--------

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

#### 成长 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	泰康人寿保险股份有限公司-投连-创新动力	5,740,426.00	7.14%
2	叶楹	4,677,862.00	5.82%
3	中信证券-华夏银行-中信证券贵宾定制 1 号集合资产管理计划	3,398,200.00	4.23%
4	上海中汇金投资股份有限公司	2,684,316.00	3.34%
5	杨涛	2,584,557.00	3.21%
6	叶榆	2,521,471.00	3.14%
7	富安达基金-海通证券-富安达-元普量化对冲 1 号资产管理计划	2,382,445.00	2.96%
8	陈亚克	2,000,000.00	2.49%
9	原小臭	1,700,000.00	2.11%
10	叶榆	1,548,932.00	1.93%

#### 成长 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	朱永红	3,890,082.00	4.84%
2	徐颖	3,890,000.00	4.84%
3	马常金	998,900.00	1.24%
4	夏佃壮	659,215.00	0.82%
5	甘长海	620,907.00	0.77%
6	王革	620,000.00	0.77%
7	罗桂颜	548,653.00	0.68%
8	汤仕风	526,100.00	0.65%
9	谢忠裕	507,028.00	0.63%
10	周恩蓉	505,900.00	0.63%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	成长 A	-	-
	成长 B	-	-



	成长分级	108,617.98	0.06%
	合计	108,617.98	0.06%

#### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	成长 A	0
	成长 B	0
	成长分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	成长 A	0
	成长 B	0
	成长分级	0
	合计	0

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 份；

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 份。

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	成长 A	成长 B	成长分级
基金合同生效日（2012 年 8 月 2 日） 基金份额总额	74,051,084.00	74,051,085.00	264,321,715.23
本报告期期初基金份额总额	8,737,550.00	8,737,551.00	8,147,247.35
本报告期基金总申购份额	-	-	265,128,807.60
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	129,242,042.40
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	71,662,476.00	71,662,476.00	-127,375,221.41
本报告期期末基金份额总额	80,400,026.00	80,400,027.00	16,658,791.14

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

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

1、总经理变更：2015 年 2 月 17 日，本公司发布公告，聘任方一天为万家基金管理有限公司总经理。

2、督察长变更：2015 年 4 月 11 日，本公司发布公告，聘任兰剑为万家基金管理有限公司督察长。

3、2015 年 5 月 23 日本公司发布公告，聘任姚霞天为本基金基金经理，原基金经理吴涛因个人原因离职，不再担任本基金基金经理。

基金托管人：

报告期内本基金基金托管人无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期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	
齐鲁证券	1	525,056,807.28	92.65%	459,634.89	92.55%	-
华宝证券	1	41,669,628.87	7.35%	36,977.46	7.45%	-

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；能根据本公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

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

3、基金专用交易席位的变更情况：

本期席位未变更。

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

2015 年 3 月 31 日, 万家基金管理有限公司发布关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告, 经与相关托管银行、会计事务所协商一致, 自 2015 年 3 月 30 日起, 本公司对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种 (估值处理标准另有规定的除外) 的估值方法进行调整, 采用第三方估值机构提供的价格数据进行处理进行估值。于 2015 年 3 月 30 日, 相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过 0.50%。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准万家中证创业成长指数分级证券投资基金发行及募集的文件。
- 2、《万家中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家中证创业成长指数分级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批件、营业执照、公司章程。
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金净值、季度报告、更新招募说明书及其他临时公告。
- 6、万家中证创业成长指数分级证券投资基金 2015 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](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  
2015 年 8 月 26 日