

万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金 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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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

§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	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
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.....	11
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.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
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.....	40
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.....	40
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	41
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12 投资组合报告附注.....	41

§8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
§9 开放式基金份额变动	42
§10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
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.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
§11 影响投资者决策的其他重要信息	45
§12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录.....	46
12.2 存放地点.....	46
12.3 查阅方式.....	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金
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	5,929,953,795.21 份
基金合同存续期	不定期

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发展状况的综合分析,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	张志永
	联系电话	021-38909626	021-62677777*212004
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		95538 转 6、4008880800	95561
传真		021-38909627	021-62159217
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	福州市湖东路 154 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	上海市江宁路 168 号兴业大厦 20 楼
邮政编码		200122	200041
法定代表人		毕玉国	高建平

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

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	63,270,730.92
本期利润	70,525,263.93
加权平均基金份额本期利润	0.0340
本期加权平均净值利润率	2.65%
本期基金份额净值增长率	28.09%
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	1,763,251,914.39
期末可供分配基金份额利润	0.2973
期末基金资产净值	7,693,205,709.60
期末基金份额净值	1.2973
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	128.71%

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

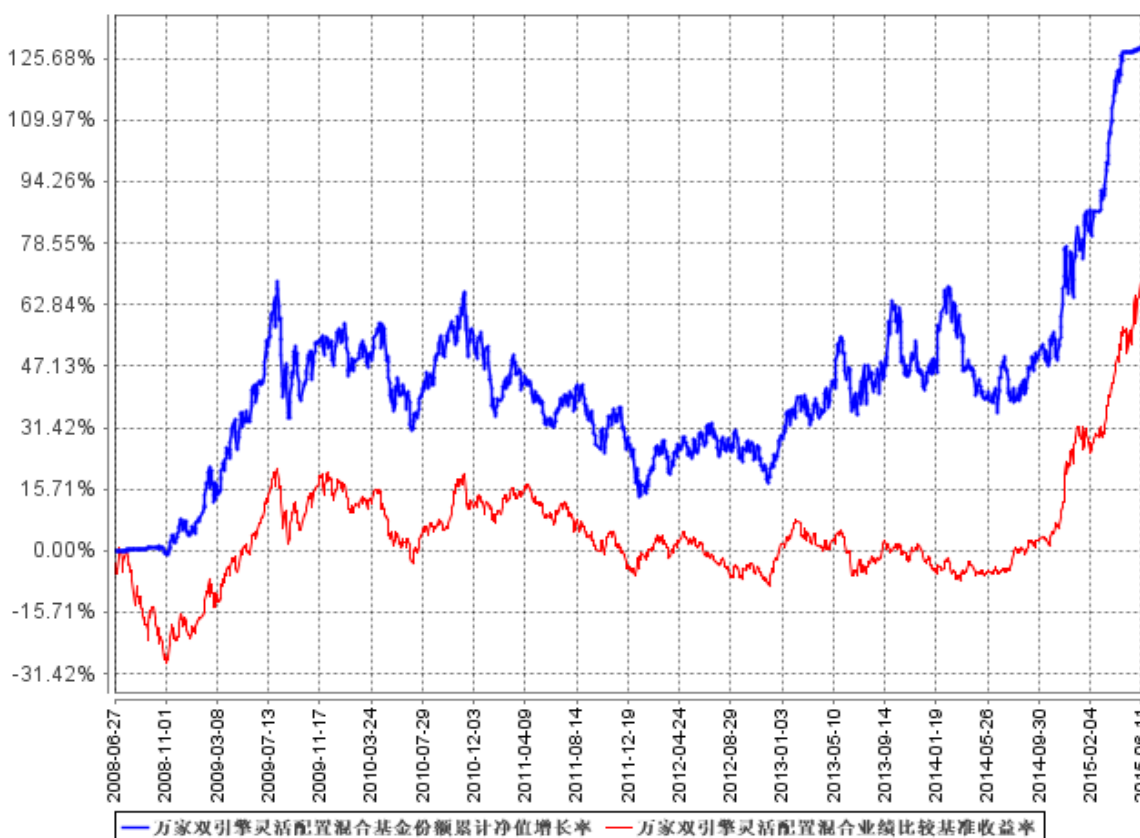
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.39%	0.02%	-4.16%	2.10%	4.55%	-2.08%
过去三个月	9.27%	0.49%	7.14%	1.57%	2.13%	-1.08%
过去六个月	28.09%	0.86%	17.30%	1.36%	10.79%	-0.50%
过去一年	55.85%	1.12%	59.43%	1.10%	-3.58%	0.02%
过去三年	76.14%	1.20%	52.65%	0.90%	23.49%	0.30%
自基金合同生效起至今	128.71%	1.17%	51.59%	1.03%	77.12%	0.14%

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		
高翰昆	本基金基金经理、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、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资和万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2014 年 12 月 1 日	-	5 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。
华光磊	本基金基金经理、万家和谐增长混合型证券投资基金基金经理、权益投资部副总监	2013 年 8 月 8 日	2015 年 5 月 22 日	11 年	学士学位,2004 年 8 月进入光大证券研究所工作,于 2008 年获得新财富房地产行业最佳分析师第三名(团队);2008 年 12 月加入

					光大证券资产管理总部, 2009 年 9 月加入天弘基金, 分别担任研究员、基金经理助理等职务; 2011 年 5 月加入万家基金, 先后担任研究总监助理、研究总监等职务。
--	--	--	--	--	--

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

上半年各项经济数据继续震荡走低，但下跌幅度逐渐收窄并已经开始出现企稳迹象。房地产销售持续回升，下半年大概率会传导到地产开发投资上。地方债置换方案出台并顺利实施有效降低地方政府融资成本基本化解地方融资平台的系统性风险，同时也给下半年地方政府配合积极的财政政策实施提供了较充足的弹药。此外整个上半年央行连续降准降息也为市场及经济企稳提供了充足的流动性，预计为了配合积极的财政政策下半年将继续保持这种宽松的货币政策。资本市场方面，整个上半年市场经历了一轮快速拉升的牛市，但是在二季度尤其是 5 月末开始的暴涨中很多个股板块的估值被严重高估，终于在六月中下旬开始了一轮叠加去杠杆的暴跌并直接引致流动性危机。本基金在报告期内采取灵活的操作思路逢高不断减持股票持仓基本规避本轮大幅回调，同时加大对债券的配置力度并积极参与新股的网下申购取得了较好的绝对收益。

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 1.2973 元，本报告期份额净值增长率为 28.09%，业绩比较基准收益率为 17.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

近期的决策层高层会议基本定调防范风险稳增长为下半年经济运行主线。预示着财政政策将迎来发力。预计下半年宏观经济在积极的财政政策刺激下大概率企稳走平。资本市场方面管理层在治理好全社会的杠杆率及杠杆结构并采取措施有效降低热钱流出意愿后极有可能继续维持宽松的货币政策配合积极的财政政策。目前看股市在经历了一轮快速下跌后已经有很多个股估值长期看具有较强吸引力。受益于中国经济转型的很多个股板块依然具有较强的成长性也具有了介入的价值。但值得注意的是，经过本轮快速下跌管理层未来必定会加大对杠杆资金入市的管控。加之市场上最活跃风险偏好最高的资金基本被消耗殆尽。我们没法乐观预期未来市场短期还会快速上涨创新高。应该会在下半年步入一个逐步分化的震荡行情，在经济企稳市场信心恢复后方可形成新的上涨动力。基于如上判断下阶段本组合将继续灵活操作规避较大的回撤风险，逢低加大对价值股及成长股的配置，精选并持有那些可能引领未来中国经济增长的行业个股。

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

本基金 2015 年 2 月 26 日进行分红, 分红方案: 2 元/10 份基金份额。

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 6 日至 2 月 12 日, 基金资产净值连续 28 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 3 月 5 日至 4 月 27 日, 基金资产净值连续 37 个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情况。

§ 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：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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,709,250,184.34	11,837,329.42
结算备付金		1,552,500.00	496,692.97
存出保证金		101,942.49	124,758.53
交易性金融资产	6.4.7.2	1,202,747,803.23	41,695,315.60
其中：股票投资		36,085,803.23	41,695,315.60
基金投资		-	-
债券投资		1,166,662,000.00	-
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	2,775,896,083.83	-
应收证券清算款		790,346.91	-
应收利息	6.4.7.5	12,633,487.15	6,364.93
应收股利		-	-
应收申购款		117,247.65	19,960.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		7,703,089,595.60	54,180,421.93
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		239,251.05	1,118,140.79
应付管理人报酬		7,705,832.69	62,465.47
应付托管费		1,579,149.27	10,410.91
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	175,483.10	321,599.26
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	184,169.89	364,381.29
负债合计		9,883,886.00	1,876,997.72
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	5,929,953,795.21	43,433,809.20
未分配利润	6.4.7.10	1,763,251,914.39	8,869,615.01
所有者权益合计		7,693,205,709.60	52,303,424.21
负债和所有者权益总计		7,703,089,595.60	54,180,421.93

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：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
一、收入		93,606,106.36	2,485,792.13
1.利息收入		33,341,937.77	166,459.65
其中：存款利息收入	6.4.7.11	17,280,373.40	166,459.65
债券利息收入		5,895,199.96	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		10,166,364.41	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		49,158,214.62	-147,257.54
其中：股票投资收益	6.4.7.12	48,873,208.00	-269,516.66
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	224,659.12	-
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	60,347.50	122,259.12

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	7,254,533.01	2,428,506.51
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	3,851,420.96	38,083.51
减：二、费用		23,080,842.43	1,703,424.36
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	18,167,049.15	435,110.27
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,322,685.37	72,518.38
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	485,470.63	1,012,602.31
5. 利息支出		906,396.82	-
其中：卖出回购金融资产支出		906,396.82	-
6. 其他费用	6.4.7.20	199,240.46	183,193.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		70,525,263.93	782,367.77
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		70,525,263.93	782,367.77

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：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)	43,433,809.20	8,869,615.01	52,303,424.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	70,525,263.93	70,525,263.93
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 （净值减少以“-”号填列）	5,886,519,986.01	2,255,512,502.67	8,142,032,488.68
其中：1.基金申购款	8,753,563,220.82	2,438,078,915.17	11,191,642,135.99
2. 基金赎回款	-2,867,043,234.81	-182,566,412.50	-3,049,609,647.31
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）	-	-571,655,467.22	-571,655,467.22
五、期末所有者权益(基金净值)	5,929,953,795.21	1,763,251,914.39	7,693,205,709.60

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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.5.2 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	54,250,184.34
定期存款	3,655,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	3,655,000,000.00
其他存款	-
合计：	3,709,250,184.34

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	28,934,330.99	36,085,803.23	7,151,472.24
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,121,000.00	1,121,000.00
	银行间市场	1,162,060,659.08	1,165,541,000.00
	合计	1,163,181,659.08	1,166,662,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,192,115,990.07	1,202,747,803.23	10,631,813.16

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	2,775,896,083.83	-
合计	2,775,896,083.83	-

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 2015年6月30日
应收活期存款利息	243,599.19
应收定期存款利息	1,871,686.17
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	628.74
应收债券利息	8,423,328.82
应收买入返售证券利息	2,094,202.80
应收申购款利息	0.12
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	41.31
合计	12,633,487.15

6.4.7.6 其他资产

本基金报告期末未持有其它资产。

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	100,591.84
银行间市场应付交易费用	74,891.26
合计	175,483.10

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	135.84
其他应付款	10,473.15
预提费用	173,560.90
合计	184,169.89

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	43,433,809.20	43,433,809.20
本期申购	8,753,563,220.82	8,753,563,220.82
本期赎回(以“-”号填列)	-2,867,043,234.81	-2,867,043,234.81
- 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	5,929,953,795.21	5,929,953,795.21

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	13,479,759.89	-4,610,144.88	8,869,615.01
本期利润	63,270,730.92	7,254,533.01	70,525,263.93
本期基金份额交易产生的变动数	3,180,451,792.99	-924,939,290.32	2,255,512,502.67
其中：基金申购款	3,828,887,878.23	-1,390,808,963.06	2,438,078,915.17
基金赎回款	-648,436,085.24	465,869,672.74	-182,566,412.50
本期已分配利润	-571,655,467.22	-	-571,655,467.22
本期末	2,685,546,816.58	-922,294,902.19	1,763,251,914.39

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
定期存款利息收入	14,530,307.80
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	8,323.53
其他	293,660.88
合计	17,280,373.40

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	182,681,090.91
减：卖出股票成本总额	133,807,882.91
买卖股票差价收入	48,873,208.00

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 2015年1月1日至2015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	224,659.12
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	224,659.12

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 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	51,898,258.72
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	51,341,736.74
减：应收利息总额	331,862.86
买卖债券差价收入	224,659.12

6.4.7.13.3 债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
申购基金份额对价总额	-
减：现金支付申购款总额	-
减：申购债券成本总额	-
减：申购债券应收利息总额	144,362.80

申购差价收入	-
--------	---

6.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期内本基金未投资贵金属。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内未持有衍生工具。

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	60,347.50
基金投资产生的股利收益	-
合计	60,347.50

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	7,254,533.01
——股票投资	3,774,192.09
——债券投资	3,480,340.92
——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	7,254,533.01

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	3,840,979.14
转换费	6,951.41
其他	3,490.41
合计	3,851,420.96

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	479,020.63
银行间市场交易费用	6,450.00
合计	485,470.63

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	24,795.19
信息披露费	148,765.71
银行费用	10,679.56
帐户维护费	15,000.00
合计	199,240.46

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日,本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内,与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司	基金管理人,基金销售机构
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

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

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。

6.4.10.1 关联方报酬

6.4.10.1.1 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	18,167,049.15	435,110.27
其中：支付销售机构的客户维护费	241,596.54	95,636.47

注：2015年1月1日至2015年6月18日

基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提, 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。

2015年6月19日起

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 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提, 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。

6.4.10.1.2 基金托管费

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托管费	3,322,685.37	72,518.38

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。

6.4.10.2 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。

6.4.10.3 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.3.1 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
	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
基金合同生效日（2008 年 6 月 27 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	10,021,602.16	10,021,602.16
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	10,021,602.16	10,021,602.16
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.17%	17.89%

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。

6.4.10.3.2 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。

6.4.10.4 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
兴业银行	54,250,184.34	2,448,081.19	12,258,795.39	160,991.69

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，2015 年 1 月 1 日至 6 月 30 日度获得的利息收入为 8323.53 元，(2014 年 1 月 1 日至 6 月 30 日获得的利息收入为 4124.35

元)，2015 年 6 月 30 日结算备付金余额为人民币 15525004 元 (2014 年 6 月 30 日为人民币 285785.40 元)。

6.4.10.5 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。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2015 年 2 月 26 日	2015 年 2 月 26 日	2015 年 2 月 26 日	2.0000	570,780,919.69	874,547.53	571,655,467.22	
合计	-	-	-	2.0000	570,780,919.69	874,547.53	571,655,467.22	

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通 日	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单位：股)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
300487	蓝晓 科技	2015 年 6 月 24 日	2015 年 7 月 2 日	新股流 通受限	14.83	14.83	10,700	158,681.00	158,681.00	-
603838	四通 股份	2015 年 6 月 23 日	2015 年 7 月 1 日	新股流 通受限	7.73	7.73	18,119	140,059.87	140,059.87	-
300488	恒锋 工具	2015 年 6 月 25 日	2015 年 7 月 1 日	新股流 通受限	20.11	20.11	6,734	135,420.74	135,420.74	-
300489	中飞 股份	2015 年 6 月 24 日	2015 年 7 月 1 日	新股流 通受限	17.56	17.56	7,319	128,521.64	128,521.64	-
300480	光力 科技	2015 年 6 月 25 日	2015 年 7 月 2 日	新股流 通受限	7.28	7.28	7,263	52,874.64	52,874.64	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
132002	15 天集 EB	2015 年 6 月 10 日	2015 年 7 月 2 日	新债未上市	100.00	100.00	11,210	1,121,000.00	1,121,000.00	-

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
300467	迅游科技	2015 年 6 月 25 日	重大事项	297.30	2015 年 7 月 2 日	267.57	3,726	125,752.50	1,107,739.80	-
002170	芭田股份	2015 年 5 月 25 日	重大事项	26.12	2015 年 7 月 2 日	23.51	35,000	395,070.01	914,200.00	-

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

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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.12.4 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.12.5 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。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券,不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行,申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外,在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算,因此违约风险发生的可能性很小;基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估,以控制相应的信用风险。

6.4.12.5.1 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 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
A-1	70,324,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,095,217,000.00	-
合计	1,165,541,000.00	-

注:未评级债券为政策性金融债、超短期融资券。

6.4.12.5.2 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 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	1,121,000.00	-
未评级	-	-
合计	1,121,000.00	-

6.4.12.6 流动性风险

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

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

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

6.4.12.7 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、外汇风险和市场价格风险。

6.4.12.7.1 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。

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

6.4.12.7.1.1 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	3,709,250,184.34	-	-	-	-	-	3,709,250,184.34
结算备付金	1,552,500.00	-	-	-	-	-	1,552,500.00
存出保证金	101,942.49	-	-	-	-	-	101,942.49
交易性金融资产	-	230,484,000.00	935,057,000.00	1,121,000.00	-	36,085,803.23	1,202,747,803.23
买入返售金融资产	2,775,887,000.00	-	-	-	-	-	2,775,887,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	790,346.91	790,346.91

应收利息	-	-	-	-	-	12,633,487.15	12,633,487.15
应收申购款	-	-	-	-	-	117,247.65	117,247.65
其他资产	-	-	-	-	-	9,083.83	9,083.83
资产总计	6,486,791,626.83	230,484,000.00	935,057,000.00	1,121,000.00	-	49,635,968.77	7,703,089,595.60
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	239,251.05	239,251.05
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	7,705,832.69	7,705,832.69
应付托管费	-	-	-	-	-	1,579,149.27	1,579,149.27
应付交易费用	-	-	-	-	-	175,483.10	175,483.10
其他负债	-	-	-	-	-	184,169.89	184,169.89
负债总计	-	-	-	-	-	9,883,886.00	9,883,886.00
利率敏感 度缺口	6,486,791,626.83	230,484,000.00	935,057,000.00	1,121,000.00	-	39,752,082.77	7,693,205,709.60
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	11,837,329.42	-	-	-	-	-	11,837,329.42
结算备付金	496,692.97	-	-	-	-	-	496,692.97
存出	124,758.53	-	-	-	-	-	124,758.53

保证 金							
交易 性金 融资 产		-	-	-	-	-41,695,315.60	41,695,315.60
应收 利息		-	-	-	-	6,364.93	6,364.93
应收 申购 款	497.02	-	-	-	-	19,463.46	19,960.48
资产 总计	12,459,277.94	-	-	-	-	-41,721,143.99	54,180,421.93
负债							
应付 赎回 款		-	-	-	-	1,118,140.79	1,118,140.79
应付 管理 人报 酬		-	-	-	-	62,465.47	62,465.47
应付 托管 费		-	-	-	-	10,410.91	10,410.91
应付 交易 费用		-	-	-	-	321,599.26	321,599.26
其他 负债		-	-	-	-	364,381.29	364,381.29
负债 总计		-	-	-	-	1,876,997.72	1,876,997.72
利率 敏感 度缺 口	12,459,277.94	-	-	-	-	-39,844,146.27	52,303,424.21

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

6.4.12.7.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	若市场利率发生变动而其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015年6月30日）	上年度末（2014年12月31日）

			日)
	市场利率下降 25 个基点	1,775,270.51	-
	市场利率上升 25 个基点	1,767,628.61	-

6.4.12.7.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价,因此无外汇风险。

6.4.12.7.3 其他价格风险

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

本基金投资组合中股票投资比例范围为基金资产净值的 30%-80%;债券、现金类资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种为 20%-70%;其中,现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%;权证为 0%-3%;资产支持证券为 0%-20%。于资产负债表日,本基金面临的整体市场价格风险列示如下:

6.4.12.7.3.1 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	36,085,803.23	0.47	41,695,315.60	79.72
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	1,166,662,000.00	15.16	-	-
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	1,202,747,803.23	15.63	41,695,315.60	79.72

注:本基金投资组合中投资于股票资产的比例为 60%-95 债券、现金类资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%,其中,现金或者到期日在一年以内的政府债券的比

例合计不低于基金资产净值的 5%，权证占基金资产净值的 0-3%。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如表中数据。

6.4.12.7.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	若股票基准指数发生变动而其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015年6月30日）	上年度末（2014年12月31日）
	股票基准指数下降 100 个基点	244,856.92	465,555.78
股票基准指数上升 100 个基点	244,856.92	465,555.78	

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

§ 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	36,085,803.23	0.47
	其中：股票	36,085,803.23	0.47
2	固定收益投资	1,166,662,000.00	15.15
	其中：债券	1,166,662,000.00	15.15
	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	2,775,896,083.83	36.04
	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	3,710,802,684.34	48.17
7	其他各项资产	13,643,024.20	0.18
8	合计	7,703,089,595.60	100.00

7.2 期末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	484,279.65	0.01
B	采矿业	1,635,059.25	0.02
C	制造业	14,739,658.75	0.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,048,986.92	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	225,347.22	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,234,260.04	0.02
J	金融业	15,220,908.32	0.20
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	673,691.40	0.01
M	科学研究和技术服务业	823,611.68	0.01
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	36,085,803.23	0.47

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	600016	民生银行	600,028	5,964,278.32	0.08
2	603116	红蜻蜓	65,334	1,831,965.36	0.02
3	300463	迈克生物	20,000	1,755,200.00	0.02
4	002142	宁波银行	80,000	1,692,000.00	0.02
5	603979	N 金诚信	66,063	1,635,059.25	0.02

6	601688	华泰证券	70,000	1,619,100.00	0.02
7	000728	国元证券	40,000	1,519,200.00	0.02
8	002241	歌尔声学	40,000	1,436,000.00	0.02
9	601288	农业银行	350,000	1,298,500.00	0.02
10	300485	赛升药业	17,372	1,164,097.72	0.02
11	603589	口子窖	45,168	1,144,557.12	0.01
12	300467	迅游科技	3,726	1,107,739.80	0.01
13	002170	芭田股份	35,000	914,200.00	0.01
14	002776	柏堡龙	20,296	823,611.68	0.01
15	600581	八一钢铁	50,000	651,500.00	0.01
16	000776	广发证券	26,000	588,900.00	0.01
17	600111	北方稀土	30,000	544,200.00	0.01
18	000513	丽珠集团	8,000	542,640.00	0.01
19	002775	文科园林	19,306	517,786.92	0.01
20	002772	众兴菌业	21,381	484,279.65	0.01
21	600019	宝钢股份	50,000	437,000.00	0.01
22	002773	康弘药业	17,338	411,430.74	0.01
23	601318	中国平安	5,000	409,700.00	0.01
24	002770	N 科迪	40,555	399,872.30	0.01
25	601169	北京银行	30,000	399,600.00	0.01
26	002757	南兴装备	10,000	389,500.00	0.01
27	600388	龙净环保	20,000	379,800.00	0.00
28	002768	N 国恩	14,405	362,429.80	0.00
29	000783	长江证券	25,000	348,750.00	0.00
30	002769	普路通	7,710	347,952.30	0.00
31	603117	万林股份	34,690	325,739.10	0.00
32	601818	光大银行	60,000	321,600.00	0.00
33	601336	新华保险	5,000	305,300.00	0.00
34	600089	特变电工	20,000	296,200.00	0.00
35	002081	金螳螂	10,000	281,900.00	0.00
36	600030	中信证券	10,000	269,100.00	0.00
37	601668	中国建筑	30,000	249,300.00	0.00
38	601988	中国银行	50,000	244,500.00	0.00
39	600031	三一重工	25,000	242,250.00	0.00
40	601211	国泰君安	7,000	240,380.00	0.00
41	600118	中国卫星	4,000	227,840.00	0.00
42	603223	N 恒通	18,826	225,347.22	0.00
43	300486	N 东杰	16,092	207,104.04	0.00
44	300482	N 万孚	7,942	182,983.68	0.00

45	300487	蓝晓科技	10,700	158,681.00	0.00
46	300483	沃施股份	9,356	153,438.40	0.00
47	300481	N 惠成	11,296	148,542.40	0.00
48	601989	中国重工	10,000	148,000.00	0.00
49	603838	四通股份	18,119	140,059.87	0.00
50	300488	恒锋工具	6,734	135,420.74	0.00
51	300489	中飞股份	7,319	128,521.64	0.00
52	002771	真视通	6,251	126,520.24	0.00
53	603085	N 天成	11,690	122,394.30	0.00
54	300480	光力科技	7,263	52,874.64	0.00
55	002766	索菱股份	500	17,005.00	0.00
56	601968	宝钢包装	1,000	13,950.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600016	民生银行	5,596,414.48	10.70
2	600352	浙江龙盛	3,854,200.17	7.37
3	002653	海思科	3,796,896.00	7.26
4	300380	安硕信息	3,653,724.08	6.99
5	600079	人福医药	3,615,805.00	6.91
6	300226	上海钢联	3,568,164.00	6.82
7	002170	芭田股份	3,446,984.36	6.59
8	002241	歌尔声学	3,375,986.72	6.45
9	300463	迈克生物	2,718,327.12	5.20
10	600089	特变电工	2,512,400.00	4.80
11	603116	红蜻蜓	2,312,823.60	4.42
12	601988	中国银行	2,296,000.00	4.39
13	600271	航天信息	2,253,054.76	4.31
14	002142	宁波银行	2,111,495.00	4.04
15	600581	八一钢铁	2,066,163.00	3.95
16	601288	农业银行	2,042,000.00	3.90
17	000671	阳光城	2,033,918.00	3.89
18	601688	华泰证券	1,890,635.00	3.61

19	600211	西藏药业	1,868,303.12	3.57
20	000651	格力电器	1,668,000.00	3.19
21	300026	红日药业	1,651,757.89	3.16
22	600031	三一重工	1,613,113.26	3.08
23	601377	兴业证券	1,592,750.00	3.05
24	000513	丽珠集团	1,590,946.20	3.04
25	000150	宜华健康	1,557,736.00	2.98
26	603989	艾华集团	1,524,929.24	2.92
27	000728	国元证券	1,498,820.00	2.87
28	002174	游族网络	1,475,400.00	2.82
29	600019	宝钢股份	1,468,028.10	2.81
30	300115	长盈精密	1,450,600.00	2.77
31	603589	口子窖	1,445,376.00	2.76
32	002756	永兴特钢	1,440,622.84	2.75
33	603198	迎驾贡酒	1,423,316.00	2.72
34	600111	北方稀土	1,394,815.00	2.67
35	601989	中国重工	1,387,500.00	2.65
36	300485	赛升药业	1,336,254.24	2.55
37	000425	徐工机械	1,329,115.14	2.54
38	002268	卫士通	1,275,980.72	2.44
39	300036	超图软件	1,268,357.72	2.42
40	601299	中国北车	1,254,211.00	2.40
41	601318	中国平安	1,212,397.00	2.32
42	002236	大华股份	1,191,958.17	2.28
43	600887	伊利股份	1,189,600.00	2.27
44	000952	广济药业	1,189,195.88	2.27
45	002557	洽洽食品	1,175,510.20	2.25
46	002657	中科金财	1,174,260.00	2.25
47	600388	龙净环保	1,162,056.50	2.22
48	600872	中炬高新	1,139,000.00	2.18
49	603979	金诚信	1,135,622.97	2.17
50	300104	乐视网	1,134,480.00	2.17
51	000732	泰禾集团	1,113,645.00	2.13

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	600352	浙江龙盛	5,226,731.72	9.99
2	600048	保利地产	4,544,131.52	8.69
3	300380	安硕信息	4,279,869.49	8.18
4	300226	上海钢联	4,205,251.00	8.04
5	002653	海思科	4,036,823.51	7.72
6	600079	人福医药	3,922,130.78	7.50
7	002170	芭田股份	3,631,458.13	6.94
8	000024	招商地产	3,572,071.23	6.83
9	603989	艾华集团	3,441,602.40	6.58
10	002756	永兴特钢	3,274,544.00	6.26
11	600271	航天信息	3,207,054.30	6.13
12	603198	迎驾贡酒	2,954,316.10	5.65
13	600030	中信证券	2,724,413.00	5.21
14	600089	特变电工	2,543,550.00	4.86
15	600340	华夏幸福	2,488,800.00	4.76
16	300463	迈克生物	2,442,521.07	4.67
17	603885	吉祥航空	2,441,422.34	4.67
18	000528	柳 工	2,335,173.12	4.46
19	002241	歌尔声学	2,334,741.21	4.46
20	002174	游族网络	2,269,723.62	4.34
21	000150	宜华健康	2,267,967.98	4.34
22	000671	阳 光 城	2,127,435.00	4.07
23	300115	长盈精密	2,080,605.61	3.98
24	601336	新华保险	2,063,002.00	3.94
25	601988	中国银行	2,062,859.00	3.94
26	600211	西藏药业	1,949,322.00	3.73
27	000786	北新建材	1,946,890.30	3.72
28	600500	中化国际	1,938,090.00	3.71
29	601299	中国北车	1,918,800.00	3.67
30	000333	美的集团	1,916,364.00	3.66
31	601628	中国人寿	1,887,091.04	3.61
32	603566	普莱柯	1,839,624.80	3.52
33	601377	兴业证券	1,833,650.00	3.51
34	002236	大华股份	1,813,344.61	3.47
35	300026	红日药业	1,742,978.53	3.33

36	000651	格力电器	1,694,969.00	3.24
37	603108	润达医疗	1,663,987.00	3.18
38	600837	海通证券	1,641,200.00	3.14
39	002657	中科金财	1,632,465.00	3.12
40	601989	中国重工	1,630,200.00	3.12
41	601233	桐昆股份	1,619,513.00	3.10
42	002157	正邦科技	1,599,141.00	3.06
43	601669	中国电建	1,596,986.97	3.05
44	300253	卫宁软件	1,567,423.64	3.00
45	603128	华贸物流	1,554,689.98	2.97
46	000680	山推股份	1,541,089.00	2.95
47	601688	华泰证券	1,539,588.00	2.94
48	600118	中国卫星	1,527,275.00	2.92
49	600031	三一重工	1,516,696.00	2.90
50	603669	灵康药业	1,488,227.61	2.85
51	600581	八一钢铁	1,485,342.00	2.84
52	300468	四方精创	1,445,961.89	2.76
53	603300	华铁科技	1,428,775.26	2.73
54	300130	新国都	1,413,073.00	2.70
55	002268	卫士通	1,399,255.00	2.68
56	603968	醋化股份	1,382,239.44	2.64
57	000425	徐工机械	1,375,542.00	2.63
58	603568	伟明环保	1,370,662.50	2.62
59	600872	中炬高新	1,323,561.00	2.53
60	603311	金海环境	1,290,610.06	2.47
61	000513	丽珠集团	1,256,399.14	2.40
62	300465	高伟达	1,248,660.00	2.39
63	600016	民生银行	1,239,600.00	2.37
64	603901	永创智能	1,228,044.94	2.35
65	000810	创维数字	1,206,342.60	2.31
66	002557	洽洽食品	1,199,756.00	2.29
67	600019	宝钢股份	1,195,385.00	2.29
68	300104	乐视网	1,191,459.00	2.28
69	300451	创业软件	1,185,789.85	2.27
70	600999	招商证券	1,181,901.00	2.26
71	000952	广济药业	1,153,233.00	2.20
72	300036	超图软件	1,144,679.92	2.19
73	600887	伊利股份	1,107,513.00	2.12

74	000732	泰禾集团	1,096,899.31	2.10
75	002753	永东股份	1,053,350.00	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	124,424,178.45
卖出股票收入（成交）总额	182,681,090.91

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	643,708,000.00	8.37
	其中：政策性金融债	643,708,000.00	8.37
4	企业债券	1,121,000.00	0.01
5	企业短期融资券	521,833,000.00	6.78
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,166,662,000.00	15.16

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	150211	15 国开 11	3,500,000	351,225,000.00	4.57
2	150206	15 国开 06	2,500,000	252,300,000.00	3.28
3	011510004	15 中电投 SCP004	1,000,000	100,350,000.00	1.30
4	011598008	15 浙物产 SCP008	1,000,000	100,340,000.00	1.30
5	011599233	15 苏国信 SCP003	1,000,000	100,130,000.00	1.30

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据基金合同, 本基金暂不可投资于股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同, 本基金暂不可投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1**

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	101,942.49
2	应收证券清算款	790,346.91
3	应收股利	-
4	应收利息	12,633,487.15
5	应收申购款	117,247.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,643,024.20

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

注：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
1,148	5,165,464.98	5,916,408,494.96	99.77%	13,545,300.25	0.23%

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	54,687.90	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	43,433,809.20
本报告期基金总申购份额	8,753,563,220.82
减：本报告期基金总赎回份额	2,867,043,234.81
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	5,929,953,795.21

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

2015 年 5 月 25 日召开基金份额持有人大会，会议通过《关于修改万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金合同有关事项的议案》，按照相关法律法规及中国证监会的有关规定对本基金的投资范围、投资策略、收益分配方式等事项进行相应修改。

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

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。

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。

万家双引擎：2015 年 2 月 12 日本公司发布公告，原基金经理朱颖因个人原因离职，不再担任本基金基金经理。

2015 年 5 月 5 日本公司发布公告，聘任高翰昆为本基金基金经理，与原基金经理华光磊共同管理本基金。

2015 年 2015 年 5 月 23 日本公司发布公告，原基金经理华光磊因个人原因离职，不再担任本基金基金经理。

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

2015 年 5 月 25 日召开基金份额持有人大会，增加资产支持证券、证券公司短期公司债券、中小企业私募债券投资策略。

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	
联合证券	1	147,649,401.35	50.91%	134,419.46	50.91%	-
招商证券	2	142,363,001.55	49.09%	129,607.70	49.09%	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中金	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
国泰君安	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、个股分析报告及丰富全面的信息服务; 能根据公司所管理基金的特定要求, 提供专门研究报告, 具有开发量化投资组合模型的能力; 能积极为公司投资业务的开展, 投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

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

3、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
联合证券	1,485,758.00	100.00%	1,398,100,000.00	67.74%	-	-
招商证券	-	-	665,852,000.00	32.26%	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中金	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

1、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双引擎灵活配置混合型证券投资基金发行及募集的文件。
- 2、《万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家双引擎灵活配置混合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、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金 2015 年半年度报告原文。
- 7、万家基金管理有限公司董事会决议。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司
2015 年 8 月 26 日