

万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 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：上海银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 25 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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 24 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 2016 年 01 月 01 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合规守信情况的说明..... | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 10 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明..... | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 13 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明..... | 14 |
| §5 托管人报告 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 14 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 14 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见..... | 14 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表..... | 14 |
| 6.2 利润表..... | 16 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 17 |
| 6.4 报表附注..... | 18 |
| §7 投资组合报告 | 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..... | 33 |
| 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..... | 35 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 38 |
| 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..... | 38 |
| 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..... | 38 |
| 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..... | 38 |
| 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..... | 38 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 38 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 38 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 38 |

| | |
|----------------------------------------|-----------|
| §8 基金份额持有人信息 | 39 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 39 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 39 |
| 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..... | 40 |
| §9 开放式基金份额变动 | 40 |
| §10 重大事件揭示 | 40 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 40 |
| 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..... | 40 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 40 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 41 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 41 |
| 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..... | 41 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 41 |
| §11 备查文件目录 | 41 |
| 11.1 备查文件目录..... | 41 |
| 11.2 存放地点..... | 42 |
| 11.3 查阅方式..... | 42 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-------------------|
| 基金名称 | 万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 万家瑞兴灵活配置 |
| 基金主代码 | 001518 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015 年 7 月 23 日 |
| 基金管理人 | 万家基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 上海银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 57,190,506.56 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金投资于具有成长潜力的上市公司，以获取未来资本增值的机会，并谋求基金资产的中长期稳定增值，同时通过分散投资提高基金资产的流动性。 |
| 投资策略 | 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，采取积极主动地的投资管理策略，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 | 沪深 300 指数收益率*50% + 中证全债指数收益率*50% |
| 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但低于股票型基金，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 | 上海银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 兰剑 | 叶忆红 |
| | 联系电话 | 021-38909626 | 021-68475888 |
| | 电子邮箱 | lanj@wjasset.com | yeyh@bankofshanghai.com |
| 客户服务电话 | | 95538 转 6、4008880800 | 95594 |
| 传真 | | 021-38909627 | 021-68476936 |

| | | |
|-------|--------------------------------------|-------------------|
| 注册地址 | 中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层） | 上海市浦东新区银城中路 168 号 |
| 办公地址 | 中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层） | 上海市浦东新区银城中路 168 号 |
| 邮政编码 | 200122 | 200120 |
| 法定代表人 | 方一天 | 金煜 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|-------------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《中国证券报》、《上海证券报》及《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）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层） |

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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日) |
|---------------|---------------------------------------|
| 本期已实现收益 | -830,207.59 |
| 本期利润 | -4,861,221.04 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0797 |
| 本期加权平均净值利润率 | -5.26% |
| 本期基金份额净值增长率 | -7.29% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 32,904,525.20 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.5753 |
| 期末基金资产净值 | 90,095,031.76 |
| 期末基金份额净值 | 1.5753 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2016 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 57.53% |

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 | 3.00% | 1.30% | 0.13% | 0.49% | 2.87% | 0.81% |
| 过去三个月 | 0.60% | 1.40% | -0.75% | 0.51% | 1.35% | 0.89% |
| 过去六个月 | -7.29% | 2.31% | -6.83% | 0.92% | -0.46% | 1.39% |
| 自基金合同生效起至今 | 57.53% | 3.48% | -8.94% | 1.08% | 66.47% | 2.40% |

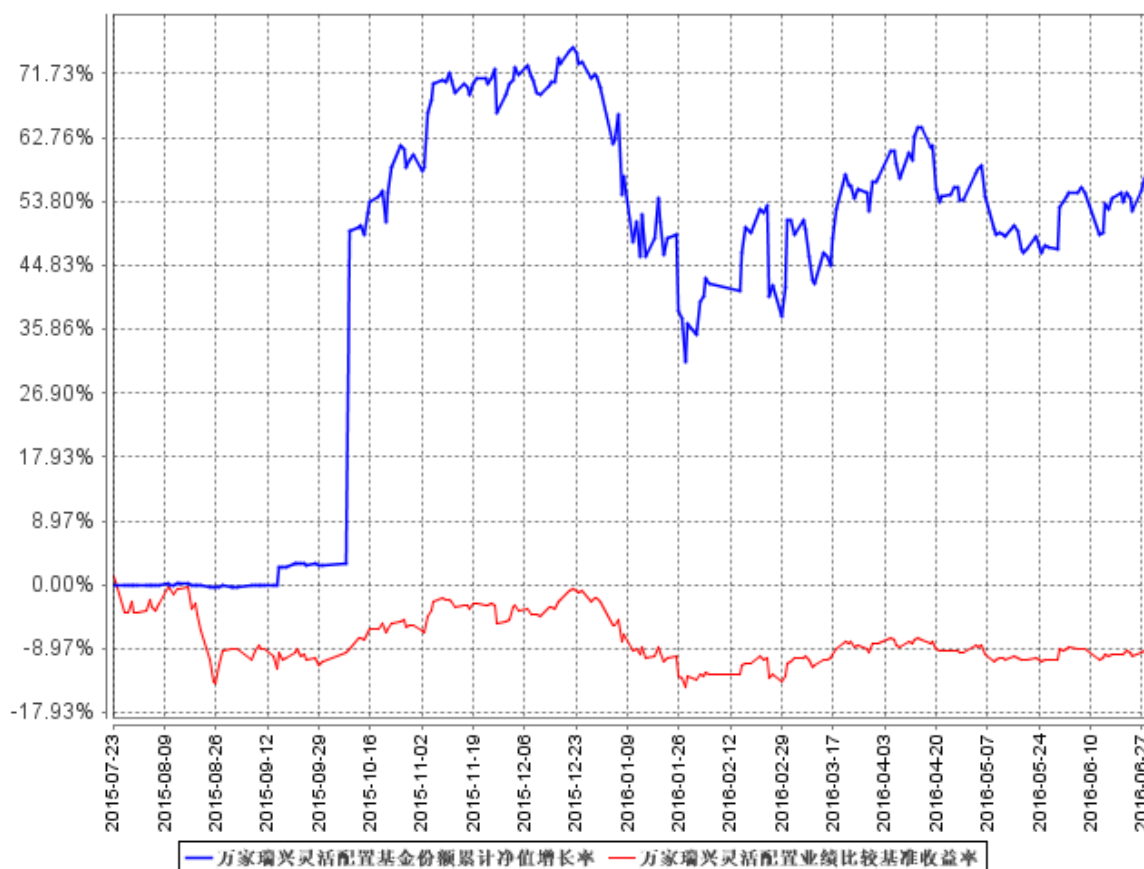
注：(1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

(2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

(3) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2.2 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

万家瑞兴灵活配置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 2015 年 7 月 23 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要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44 号文批准设立。公司现股东为中泰证券股份有限公司、新疆国际实业股份有限公司和山东省国有资产投资控股有限公司,住所：中国（上海）自由贸易实验区浦电路 360 号 8 楼（名义楼层 9 层），办公地点：中国（上海）自由贸易

实验区浦电路 360 号 8 楼（名义楼层 9 层），注册资本 1 亿元人民币。目前管理二十六只开放式基金，分别为万家 180 指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金（LOF）、万家添利债券型证券投资基金（LOF）、万家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和万家颐和保本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 | | |
| 莫海波 | 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、万家精选混合型证券投资基金基金经理、万家行业优选混合型证券投资基金基金经理、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理、 | 2015 年 12 月 5 日 | - | 6 | 投资研究部总监，MBA，2010 年进入财富证券责任有限公司，任分析师、投资经理助理；2011 年进入中银国际证券有限责任公司基金，任分析师、环保行业研究员、策略分析师、投资经理。2015 年 3 月加入本公司，现任投资研究部总监。 |

| | | | | | |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|--|
| | 质生活 股票型 证券投资 基金 基金经 理、万家 新利灵 活配置 混合型 证券投资 基金 基金经 理和万 家新兴 蓝筹灵 活配置 混合型 证券投资 基金 基金经 理 | | | | |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|--|

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

15 年底出于对利空因素以及大盘风格转变的判断，我们的产品始终保持较低的仓位，并且在两次熔断之后逐步提高仓位。15 年 12 月份，中小创估值偏高，因此我们逐步卖出已取得较高收益的中小创股票，锁定之前反弹收益。另外一季度重点配置的行业放在房地产以及基建领域。首先，房地产投资占 GDP 权重较高，而且随着供给侧改革逐步深化落实，房地产成为首当其冲的受益领域。因此我们判断商品房销量回暖提升地产商的边际利润，房地产企业的投资乘数效应对周期品上下游产生巨大拉动，对未来经济走势预期判断至关重要。其次，1、2 月份信贷数据放量以及两会期间政府稳增长意图明显，尤其是以 PPP 为代表的地方政府平台项目会加速推广落实。我们预计基建会成为贯穿全年的投资主题，供给端收缩以及需求端发力避免中国经济出现硬着陆现象。相比之前反弹较大的中小创股票，房地产、基建板块估值合理，配置策略上相对稳健，所以我们避免了产品在 1、2 月份出现较大幅度的净值回撤。

上半年由于受到美元加息以及全球经济增速放缓等风险事件的影响，风险资产价格普遍承压，国内货币宽松预期使得 A 股市场呈现区间震荡行情。经济数据再次面临考验下行压力，供给侧改革进度加快，宏观调控手段强调积极的财政政策和稳健的货币政策。基于对上述不确定因素的判断，我们认为 A 股市场整体基本面在期间并没有发生太大的变化，股市已经反应了大部分利空，所以在进行行业投资决策时应当过滤掉目前市场对于未来预期产生的噪音。中期依旧维持宽幅震荡格局的判断，改革预期始终是未来影响风险偏好的重大因素。在行业配置方面，我们延续一季度的板块选择，将配置重点放在基建和地产领域。以 PPP 为代表的地方政府平台项目会加速推广落实，随着下半年订单利润的确认，基建行业有望迎来超预期的业绩。相比之前反弹较大的相关主题股票，房地产、基建板块估值合理，配置策略上相对稳健，进可攻退可守；另外我们也采取自下而上的主动管理策略，积极配置行业景气度高以及业绩提升明确的禽产业链、新能源汽车以及食品饮料等细分行业。同时诸如有色以及维生素涨价等带有主题催化性质的相关股票，期间也给我们产品带来了较大的净值贡献。

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 1.5753 元，本报告期份额净值增长率为-7.29%，同期业绩比较基准增长率为-6.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

七月份 CPI 重回“1 时代”，通胀压力得到缓解，央行更多以公开市场操作的方式维持市场流动性，宽松预期得到进一步巩固。美国非农数据向好，较五月份显著增加，缓解投资者对于美国劳动力市场和经济增长的担忧，但脱欧风险发酵使得美联储不得不重新评估其加息频率，下半年加息概率并没有随着非农数据而大幅度提高。经济复苏缓慢、脱欧对于市场扰动会让美联储在今后几个月加息更加谨慎。在汇率方面，近期人民币贬值的情况下外汇储备却保持平稳，实际人民币外流压力减小，汇率不会成为当前 A 股市场的主要风险。

短期内 A 股所面临的利空已基本出尽，市场悲观情绪也已经得到宣泄。存量博弈的行情下，沪指在 3000 点附近会出现一定程度的整固，但结合市场目前驱动因素较多、改革预期升温，未来一段时间将出现较好的投资机会。在行业配置上，我们在保持低估值蓝筹（如：基建、地产等）仓位的同时，适时加大对高景气周期行业的配置（包括：新能源汽车、高端制造、电子、农业、白酒及部分化工品等）。长期来看供给端配套改革才是驱动市场风险偏好继续回升、资金持续注入的重要因素。预计下半年相应改革会陆续迎来配套文件出台，重组兼并试点也有望陆续展开，国企改革相关标的有望迎来投资机会。

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

基金合同规定“本基金收益每年最多分配 12 次,全年基金收益分配比例不低于可分配收益的

10%。若基金合同当年生效不满 3 个月可不进行收益分配。”

本报告期本基金未进行收益分配符合合同约定。

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，上海银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2016 年 6 月 30 日 | 上年度末 2015 年 12 月 31 日 |
|----|-----|------------------------|--------------------------|
|----|-----|------------------------|--------------------------|

| | | | |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 5,474,522.85 | 35,944,436.32 |
| 结算备付金 | | 61,361.51 | 286,681.13 |
| 存出保证金 | | 120,036.97 | 100,581.48 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 85,037,113.66 | 34,125,275.05 |
| 其中：股票投资 | | 85,037,113.66 | 34,125,275.05 |
| 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 | | 838,300.22 | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 1,110.95 | 7,583.34 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 94,695.28 | 2,405,397.84 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 91,627,141.44 | 72,869,955.16 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2016年6月30日 | 上年度末 2015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 | | - | 718,605.73 |
| 应付赎回款 | | 1,273,623.42 | 75,591.84 |
| 应付管理人报酬 | | 45,633.41 | 28,138.94 |
| 应付托管费 | | 11,408.37 | 7,034.76 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 70,210.09 | 152,410.95 |
| 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 | 131,234.39 | 200,000.42 |
| 负债合计 | | 1,532,109.68 | 1,181,782.64 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 57,190,506.56 | 42,192,936.96 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 32,904,525.20 | 29,495,235.56 |
| 所有者权益合计 | | 90,095,031.76 | 71,688,172.52 |
| 负债和所有者权益总计 | | 91,627,141.44 | 72,869,955.16 |

6.2 利润表

会计主体：万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 一、收入 | | -4,033,132.47 | - |
| 1.利息收入 | | 33,065.10 | - |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 33,065.10 | - |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -416,779.76 | - |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | -1,385,657.97 | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.5 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 968,878.21 | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | -4,031,013.45 | - |
| 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 | 381,595.64 | - |
| 减：二、费用 | | 828,088.57 | - |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 274,257.87 | - |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 68,564.50 | - |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 337,124.77 | - |
| 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 | 148,141.43 | - |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -4,861,221.04 | - |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -4,861,221.04 | - |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | | |
|----------------------------------------|--------------------------------------------|----------------|----------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 42,192,936.96 | 29,495,235.56 | 71,688,172.52 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -4,861,221.04 | -4,861,221.04 |
| 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） | 14,997,569.60 | 8,270,510.68 | 23,268,080.28 |
| 其中：1.基金申购款 | 57,291,589.82 | 30,515,409.77 | 87,806,999.59 |
| 2.基金赎回款 | -42,294,020.22 | -22,244,899.09 | -64,538,919.31 |
| 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） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 57,190,506.56 | 32,904,525.20 | 90,095,031.76 |
| 项目 | 上年度可比期间 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） | - | - | - |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | - | - |
| 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） | - | - | - |
| 其中：1.基金申购款 | - | - | - |
| 2.基金赎回款 | - | - | - |
| 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） | - | - | - |

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

万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金（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[2015]1147 号文《关于准予万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由万家基金管理有限公司作为发起人于 2015 年 6 月 23 日至 2015 年 7 月 17 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(2015) 验字 60778298_B22 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 2015 年 7 月 23 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 268,892,757.74 人民币元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 12,595.13 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 268,905,352.87 元，折合 268,905,352.87 份基金份额。本基金的基金管理机构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，基金托管人为上海银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行、上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为：50%×沪深 300 指数收益率+50%×中证全债指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则-基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，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 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、证监会公告[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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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。

6.4.6.3 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、储蓄存款利息收入, 由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]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、国家税务总局财税字[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。

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 2016 年 6 月 30 日 |
|-----------------|------------------------|
| 活期存款 | 5,474,522.85 |
| 定期存款 | - |
| 其中: 存款期限 1-3 个月 | - |

| | |
|------|--------------|
| 其他存款 | - |
| 合计: | 5,474,522.85 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年6月30日 | | |
|---------------|-------------------|---------------|---------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 89,826,712.74 | 85,037,113.66 | -4,789,599.08 |
| 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 | 89,826,712.74 | 85,037,113.66 | -4,789,599.08 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金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

本报告期末本基金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

本报告期末本基金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 2016年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 1,029.35 |
| 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 | 27.60 |
| 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 | 54.00 |
| 合计 | 1,110.95 |

6.4.7.6 其他资产

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 70,210.09 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 70,210.09 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 1,943.41 |
| 预提费用 | 129,290.98 |
| 合计 | 131,234.39 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|----------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 42,192,936.96 | 42,192,936.96 |
| 本期申购 | 57,291,589.82 | 57,291,589.82 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -42,294,020.22 | -42,294,020.22 |
| - 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 | 57,190,506.56 | 57,190,506.56 |

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 | 26,867,903.22 | 2,627,332.34 | 29,495,235.56 |
| 本期利润 | -830,207.59 | -4,031,013.45 | -4,861,221.04 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 9,580,714.48 | -1,310,203.80 | 8,270,510.68 |
| 其中：基金申购款 | 35,169,232.45 | -4,653,822.68 | 30,515,409.77 |
| 基金赎回款 | -25,588,517.97 | 3,343,618.88 | -22,244,899.09 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 35,618,410.11 | -2,713,884.91 | 32,904,525.20 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 29,795.41 |
| 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 | 3,269.20 |
| 其他 | 0.49 |
| 合计 | 33,065.10 |

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 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 96,377,853.41 |
| 减：卖出股票成本总额 | 97,763,511.38 |
| 买卖股票差价收入 | -1,385,657.97 |

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期内本基金未投资贵金属。

6.4.7.15 衍生工具收益

本报告期内本基金未投资衍生工具。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 968,878.21 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 968,878.21 |

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -4,031,013.45 |
| ——股票投资 | -4,031,013.45 |
| ——债券投资 | - |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 合计 | -4,031,013.45 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|--------------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 378,692.39 |
| 转换费收入 001488 | 2,903.25 |
| 合计 | 381,595.64 |

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 337,124.77 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 337,124.77 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
|-------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 24,863.02 |
| 信息披露费 | 104,427.96 |
| 其他 | 14,100.00 |
| 银行费用 | 250.45 |
| 帐户维护费 | 4,500.00 |
| 合计 | 148,141.43 |

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

截至本财务报表批准日,本基金无需要说明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 |
| 上海银行股份有限公司 | 基金托管人、基金代销机构 |
| 中泰证券股份有限公司 | 基金管理人股东、基金代销机构 |

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 2016年1月1日至2016年6月30日 | | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015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 |
| 中泰证券股份有限公司 | 230,362,155.68 | 92.65% | - | - |

6.4.10.1.2 债券交易

本报告期内及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本报告期内及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本报告期内及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

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 2016年1月1日至2016年6月30日 | | | |
|----------------|----------------------------|----------------|-----------|------------------|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量 的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金 总额的比例 |
| 中泰证券股份有限 公司 | 201,661.60 | 92.65% | 53,181.19 | 75.75% |

本基金于 2015 年 7 月 23 日成立，故无上年度应支付关联方佣金数据。

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 2016年1月1日至2016年6月 30日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日 |
|----|--------------------------------|---------------------------------|
| | | |

| | | |
|-----------------|------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 274,257.87 | - |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 59,979.16 | - |

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.6% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，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 5 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 |
|----------------|----------------------|----------------------|
| | 2016年1月1日至2016年6月30日 | 2015年1月1日至2015年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 68,564.50 | - |

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，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 5 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

本基金本报告期间及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 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 | 上年度可比期间 |
|----------------------------|----------------------|----------------------|
| | 2016年1月1日至2016年6月30日 | 2015年1月1日至2015年6月30日 |
| 基金合同生效日（2015年7月23日）持有的基金份额 | 268,905,352.87 | - |

| | | |
|-----------------------|---------------|---|
| 额 | | |
| 期初持有的基金份额 | 25,412,291.85 | - |
| 期间申购/买入总份额 | 0.00 | - |
| 期间因拆分变动份额 | 0.00 | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | 0.00 | - |
| 期末持有的基金份额 | 25,412,291.85 | - |
| 期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | 44.4300% | - |

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

除基金管理人之外本基金其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

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 2016年1月1日至2016年6月30日 | | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015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 |
| 上海银行 | 5,474,522.85 | 29,795.41 | - | - |

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，2016年1月1日至6月30日获得的利息为人民币3,269.20元，2016年6月30日结算备付金余额为人民币61,361.51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

本基金本期及上年度可比期间未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

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（2016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 |
| 300520 | 科大 | 2016年6 | 2016年 | 新股未上 | 10.05 | 10.05 | 570 | 5,728.50 | 5,728.50 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|-----|-----------------|----------------|---------|------|------|-----|----------|----------|---|
| | 国创 | 月 30 日 | 7 月 8 日 | 市流通 | | | | | | |
| 603016 | 新宏泰 | 2016 年 6 月 23 日 | 2016 年 7 月 1 日 | 新股未上市流通 | 8.49 | 8.49 | 754 | 6,401.46 | 6,401.46 | - |

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 |
|--------|------|-----------------|------|--------|-----------------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 600318 | 新力金融 | 2016 年 3 月 24 日 | 重大事项 | 26.91 | - | - | 285,202 | 7,470,983.49 | 7,674,785.82 | - |
| 300284 | 苏交科 | 2016 年 5 月 20 日 | 重大事项 | 23.62 | 2016 年 8 月 10 日 | 21.44 | 201,871 | 3,975,321.24 | 4,768,193.02 | - |
| 000923 | 河北宣工 | 2016 年 4 月 6 日 | 重大事项 | 15.78 | - | - | 129,500 | 2,012,953.65 | 2,043,510.00 | - |

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

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.13 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。

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

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

6.4.13.4 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 2016 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 | 5,474,522.85 | - | - | - | - | - | 5,474,522.85 |
| 结算备付金 | 61,361.51 | - | - | - | - | - | 61,361.51 |
| 存出保证金 | 120,036.97 | - | - | - | - | - | 120,036.97 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | -85,037,113.66 | 85,037,113.66 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 838,300.22 | 838,300.22 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 1,110.95 | 1,110.95 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 94,695.28 | 94,695.28 |
| 资产总计 | 5,655,921.33 | - | - | - | - | -85,971,220.11 | 91,627,141.44 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 1,273,623.42 | 1,273,623.42 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 45,633.41 | 45,633.41 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 11,408.37 | 11,408.37 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 70,210.09 | 70,210.09 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 131,234.39 | 131,234.39 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 1,532,109.68 | 1,532,109.68 |
| 利率敏感度缺口 | 5,655,921.33 | - | - | - | - | -84,439,110.43 | 90,095,031.76 |
| 上年度末 2015 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 | 35,944,436.32 | - | - | - | - | - | 35,944,436.32 |
| 结算备付金 | 286,681.13 | - | - | - | - | - | 286,681.13 |
| 存出保证金 | 100,581.48 | - | - | - | - | - | 100,581.48 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | -34,125,275.05 | 34,125,275.05 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 7,583.34 | 7,583.34 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 2,405,397.84 | 2,405,397.84 |
| 资产总计 | 36,331,698.93 | - | - | - | - | -36,538,256.23 | 72,869,955.16 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 718,605.73 | 718,605.73 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 75,591.84 | 75,591.84 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 28,138.94 | 28,138.94 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 7,034.76 | 7,034.76 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 152,410.95 | 152,410.95 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 200,000.42 | 200,000.42 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 1,181,782.64 | 1,181,782.64 |
| 利率敏感度缺口 | 36,331,698.93 | - | - | - | - | -35,356,473.59 | 71,688,172.52 |

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，银行存款、结算备付金及存出保证金均以

活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年6月30日 | | 上年度末 2015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 | 85,037,113.66 | 94.39 | 34,125,275.05 | 47.60 |
| 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 | 85,037,113.66 | 94.39 | 34,125,275.05 | 47.60 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 1. 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（2016年6月30日） | 上年度末（2015年12月31日） |
| | 2. 股票基准指数上升 100 个基点 | 1,202,287.04 | 396,942.91 |
| 1. 股票基准指数下降 100 个基点 | -1,202,287.04 | -396,942.91 | |

| | | | |
|--|----|--|--|
| | 基点 | | |
|--|----|--|--|

§ 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 | 85,037,113.66 | 92.81 |
| | 其中：股票 | 85,037,113.66 | 92.81 |
| 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 | 5,535,884.36 | 6.04 |
| 7 | 其他各项资产 | 1,054,143.42 | 1.15 |
| 8 | 合计 | 91,627,141.44 | 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 | 19,233,743.36 | 21.35 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 35,241,795.28 | 39.12 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,563.30 | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 5,728.50 | 0.01 |

| | | | |
|---|---------------|---------------|-------|
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 23,299,390.22 | 25.86 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 7,254,893.00 | 8.05 |
| 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 | 85,037,113.66 | 94.39 |

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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 | 600318 | 巢东股份 | 285,202 | 7,674,785.82 | 8.52 |
| 2 | 600068 | XD 葛洲坝 | 1,285,439 | 7,481,254.98 | 8.30 |
| 3 | 600491 | 龙元建设 | 816,960 | 7,009,516.80 | 7.78 |
| 4 | 001979 | 招商蛇口 | 441,582 | 6,292,543.50 | 6.98 |
| 5 | 300284 | 苏交科 | 201,871 | 4,768,193.02 | 5.29 |
| 6 | 002586 | 围海股份 | 465,861 | 4,202,066.22 | 4.66 |
| 7 | 002047 | 宝鹰股份 | 411,800 | 4,118,000.00 | 4.57 |
| 8 | 601800 | XD 中国交 | 382,400 | 4,026,672.00 | 4.47 |
| 9 | 600266 | 北京城建 | 318,800 | 3,981,812.00 | 4.42 |
| 10 | 600325 | 华发股份 | 297,000 | 3,287,790.00 | 3.65 |
| 11 | 600884 | 杉杉股份 | 177,200 | 3,049,612.00 | 3.38 |
| 12 | 000065 | 北方国际 | 89,615 | 2,897,252.95 | 3.22 |
| 13 | 300278 | 华昌达 | 168,100 | 2,872,829.00 | 3.19 |
| 14 | 601669 | 中国电建 | 499,097 | 2,849,843.87 | 3.16 |
| 15 | 600048 | 保利地产 | 322,428 | 2,782,553.64 | 3.09 |
| 16 | 002146 | 荣盛发展 | 380,000 | 2,553,600.00 | 2.83 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 17 | 600629 | 华建集团 | 129,800 | 2,475,286.00 | 2.75 |
| 18 | 600240 | 华业资本 | 244,204 | 2,446,924.08 | 2.72 |
| 19 | 000923 | 河北宣工 | 129,500 | 2,043,510.00 | 2.27 |
| 20 | 600223 | 鲁商置业 | 383,170 | 1,954,167.00 | 2.17 |
| 21 | 600169 | 太原重工 | 440,900 | 1,719,510.00 | 1.91 |
| 22 | 000800 | 一汽轿车 | 155,547 | 1,692,351.36 | 1.88 |
| 23 | 300197 | 铁汉生态 | 115,300 | 1,598,058.00 | 1.77 |
| 24 | 000928 | 中钢国际 | 79,833 | 1,004,299.14 | 1.11 |
| 25 | 601611 | 中国核建 | 2,621 | 54,831.32 | 0.06 |
| 26 | 603131 | 上海沪工 | 758 | 46,010.60 | 0.05 |
| 27 | 300515 | 三德科技 | 948 | 44,432.76 | 0.05 |
| 28 | 601127 | 小康股份 | 1,302 | 31,078.74 | 0.03 |
| 29 | 002799 | 环球印务 | 648 | 28,278.72 | 0.03 |
| 30 | 002802 | 洪汇新材 | 955 | 14,401.40 | 0.02 |
| 31 | 603909 | 合诚股份 | 621 | 11,413.98 | 0.01 |
| 32 | 603958 | 哈森股份 | 727 | 10,541.50 | 0.01 |
| 33 | 603016 | 新宏泰 | 754 | 6,401.46 | 0.01 |
| 34 | 300520 | 科大国创 | 570 | 5,728.50 | 0.01 |
| 35 | 600017 | 日照港 | 386 | 1,563.30 | 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 | 600068 | 葛洲坝 | 7,994,846.22 | 11.15 |
| 2 | 600318 | 新力金融 | 7,188,115.00 | 10.03 |
| 3 | 002070 | 众和股份 | 6,785,171.69 | 9.46 |
| 4 | 600491 | 龙元建设 | 6,426,152.28 | 8.96 |
| 5 | 601669 | 中国电建 | 6,353,936.38 | 8.86 |
| 6 | 300284 | 苏交科 | 5,806,965.49 | 8.10 |
| 7 | 002586 | 围海股份 | 5,806,531.00 | 8.10 |
| 8 | 002047 | 宝鹰股份 | 5,746,501.26 | 8.02 |
| 9 | 001979 | 招商蛇口 | 5,739,358.02 | 8.01 |
| 10 | 600266 | 北京城建 | 4,993,716.60 | 6.97 |
| 11 | 000800 | 一汽轿车 | 4,736,570.88 | 6.61 |

| | | | | |
|----|--------|--------|--------------|------|
| 12 | 601800 | 中国交建 | 4,365,053.26 | 6.09 |
| 13 | 600240 | 华业资本 | 3,729,416.00 | 5.20 |
| 14 | 002594 | 比亚迪 | 3,543,404.00 | 4.94 |
| 15 | 600325 | 华发股份 | 3,463,432.00 | 4.83 |
| 16 | 000488 | 晨鸣纸业 | 3,375,221.62 | 4.71 |
| 17 | 000503 | 海虹控股 | 3,245,816.20 | 4.53 |
| 18 | 600884 | 杉杉股份 | 3,201,634.00 | 4.47 |
| 19 | 002019 | 亿帆鑫富 | 3,189,987.01 | 4.45 |
| 20 | 300278 | 华昌达 | 2,775,369.00 | 3.87 |
| 21 | 000060 | 中金岭南 | 2,694,639.32 | 3.76 |
| 22 | 600048 | 保利地产 | 2,685,886.00 | 3.75 |
| 23 | 300073 | 当升科技 | 2,657,340.00 | 3.71 |
| 24 | 600223 | 鲁商置业 | 2,589,834.98 | 3.61 |
| 25 | 601106 | 中国一重 | 2,567,690.46 | 3.58 |
| 26 | 600629 | 华建集团 | 2,513,818.00 | 3.51 |
| 27 | 000090 | 天健集团 | 2,404,306.12 | 3.35 |
| 28 | 000998 | 隆平高科 | 2,222,034.17 | 3.10 |
| 29 | 600169 | 太原重工 | 2,199,874.00 | 3.07 |
| 30 | 600497 | 驰宏锌锗 | 2,167,778.10 | 3.02 |
| 31 | 002146 | 荣盛发展 | 2,138,230.00 | 2.98 |
| 32 | 000923 | 河北宣工 | 2,012,953.65 | 2.81 |
| 33 | 000065 | 北方国际 | 1,988,195.62 | 2.77 |
| 34 | 601618 | 中国中冶 | 1,975,374.00 | 2.76 |
| 35 | 002234 | 民和股份 | 1,961,522.00 | 2.74 |
| 36 | 600831 | 广电网络 | 1,838,588.00 | 2.56 |
| 37 | 000928 | 中钢国际 | 1,743,676.00 | 2.43 |
| 38 | 600373 | 中文传媒 | 1,726,597.68 | 2.41 |
| 39 | 000831 | *ST 五稀 | 1,689,019.56 | 2.36 |
| 40 | 002051 | 中工国际 | 1,601,159.67 | 2.23 |
| 41 | 300197 | 铁汉生态 | 1,542,380.30 | 2.15 |
| 42 | 600017 | 日照港 | 1,541,090.00 | 2.15 |
| 43 | 300144 | 宋城演艺 | 1,537,435.00 | 2.14 |

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 | 002070 | 众和股份 | 8,236,897.23 | 11.49 |
| 2 | 000488 | 晨鸣纸业 | 7,215,723.29 | 10.07 |
| 3 | 000402 | 金融街 | 4,064,121.53 | 5.67 |
| 4 | 002594 | 比亚迪 | 4,015,165.99 | 5.60 |
| 5 | 002019 | 亿帆鑫富 | 3,892,311.35 | 5.43 |
| 6 | 601669 | 中国电建 | 3,644,285.84 | 5.08 |
| 7 | 300284 | 苏交科 | 3,632,249.44 | 5.07 |
| 8 | 600048 | 保利地产 | 3,444,749.70 | 4.81 |
| 9 | 002047 | 宝鹰股份 | 3,126,943.38 | 4.36 |
| 10 | 000800 | 一汽轿车 | 2,854,872.60 | 3.98 |
| 11 | 600497 | 驰宏锌锗 | 2,783,302.22 | 3.88 |
| 12 | 601106 | 中国一重 | 2,726,253.35 | 3.80 |
| 13 | 000503 | 海虹控股 | 2,709,863.00 | 3.78 |
| 14 | 300073 | 当升科技 | 2,510,110.70 | 3.50 |
| 15 | 000910 | 大亚科技 | 2,424,164.52 | 3.38 |
| 16 | 000090 | 天健集团 | 2,297,878.48 | 3.21 |
| 17 | 000060 | 中金岭南 | 2,245,162.00 | 3.13 |
| 18 | 601880 | DR 大连港 | 2,237,902.52 | 3.12 |
| 19 | 600017 | 日照港 | 2,123,412.80 | 2.96 |
| 20 | 000928 | 中钢国际 | 2,116,375.79 | 2.95 |
| 21 | 002234 | 民和股份 | 2,071,193.53 | 2.89 |
| 22 | 002475 | 立讯精密 | 1,929,735.00 | 2.69 |
| 23 | 000998 | 隆平高科 | 1,895,376.00 | 2.64 |
| 24 | 600831 | 广电网络 | 1,874,558.74 | 2.61 |
| 25 | 000831 | *ST 五稀 | 1,731,809.92 | 2.42 |
| 26 | 601618 | 中国中冶 | 1,684,535.58 | 2.35 |
| 27 | 300144 | 宋城演艺 | 1,681,815.00 | 2.35 |
| 28 | 600373 | 中文传媒 | 1,666,735.00 | 2.32 |
| 29 | 002051 | 中工国际 | 1,586,828.00 | 2.21 |
| 30 | 002586 | 围海股份 | 1,526,847.26 | 2.13 |

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 | 152,706,363.44 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 96,377,853.41 |

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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

本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|-------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 120,036.97 |

| | | |
|---|---------|--------------|
| 2 | 应收证券清算款 | 838,300.22 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,110.95 |
| 5 | 应收申购款 | 94,695.28 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,054,143.42 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|--------------|---------------|----------|
| 1 | 600318 | 新力金融 | 7,674,785.82 | 8.52 | 重大事项 |
| 2 | 300284 | 苏文科 | 4,768,193.02 | 5.29 | 重大事项 |

§ 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 |
| 3,710 | 15,415.23 | 25,412,291.85 | 44.43% | 31,778,214.71 | 55.57% |

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 | 36,489.85 | 0.0600% |

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（2015年7月23日）基金份额总额 | 268,905,352.87 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 42,192,936.96 |
| 本报告期基金总申购份额 | 57,291,589.82 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 42,294,020.22 |
| 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 | 57,190,506.56 |

§ 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：

报告期内无涉及基金托管人的重大人事变动。

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

报告期期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

报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 华泰证券 | 2 | 18,285,120.77 | 7.35% | 17,028.90 | 7.35% | - |
| 中泰证券 | 1 | 230,362,155.68 | 92.65% | 201,661.60 | 92.65% | - |

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 |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金发行及募集的文件。

- 2、《万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 4、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金净值及其他临时公告。
- 5、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告原文。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。

11.2 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>

11.3 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
2016 年 8 月 25 日