

万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金

2018 年半年度报告

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。本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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2018 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	14
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	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	50
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.....	50
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.....	50
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.....	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	51
§8 基金份额持有人信息.....	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
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.....	53
§9 开放式基金份额变动.....	54
§10 重大事件揭示.....	55
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	59
§12 备查文件目录.....	60

12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	万家睿选
基金主代码	004641
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 8 月 4 日
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	137,645,634.65 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在坚持风险收益合理定价的理念基础上，利用行业内领先的机器学习算法，并引入多维度数据，建立有效因子组合，在合理控制风险的基础上，寻求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的股票资产投资主要以自主开发的量化多因子模型为基础，对股票池进行投资价值定量分析，从而构建市场上具备超额收益的股票投资组合。通过采用积极主动的投资策略，结合宏观经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，运用久期调整、凸度挖掘、信用分析、波动性交易、品种互换、回购套利等策略，权衡到期收益率与市场流动性，精选个券，构造债券投资组合。本基金参与股指期货交易以套期保值为目的，利用股指期货剥离部分多头股票资产的系统性风险。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*50%+一年期银行定期存款收益率（税后）*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，属于较高风险、较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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	田青
	联系电话	021-38909626	010-67595096
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	tianqing1.zh@ccb.com

客户服务电话	95538 转 6、4008880800	010-67595096
传真	021-38909627	010-66275853
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）	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200122	100033
法定代表人	方一天	田国立

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》、《证券日报》
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）基金管理人办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	19,070,351.86
本期利润	-770,579.23
加权平均基金份额本期利润	-0.0043
本期加权平均净值利润率	-0.41%
本期基金份额净值增长率	-7.17%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	-5,336,388.32
期末可供分配基金份额利润	-0.0388
期末基金资产净值	132,309,246.33
期末基金份额净值	0.9612
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-3.88%

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(为期末余额,不是当期发生数)。

4、本基金合同生效于2017年8月4日,无可比期间数据。

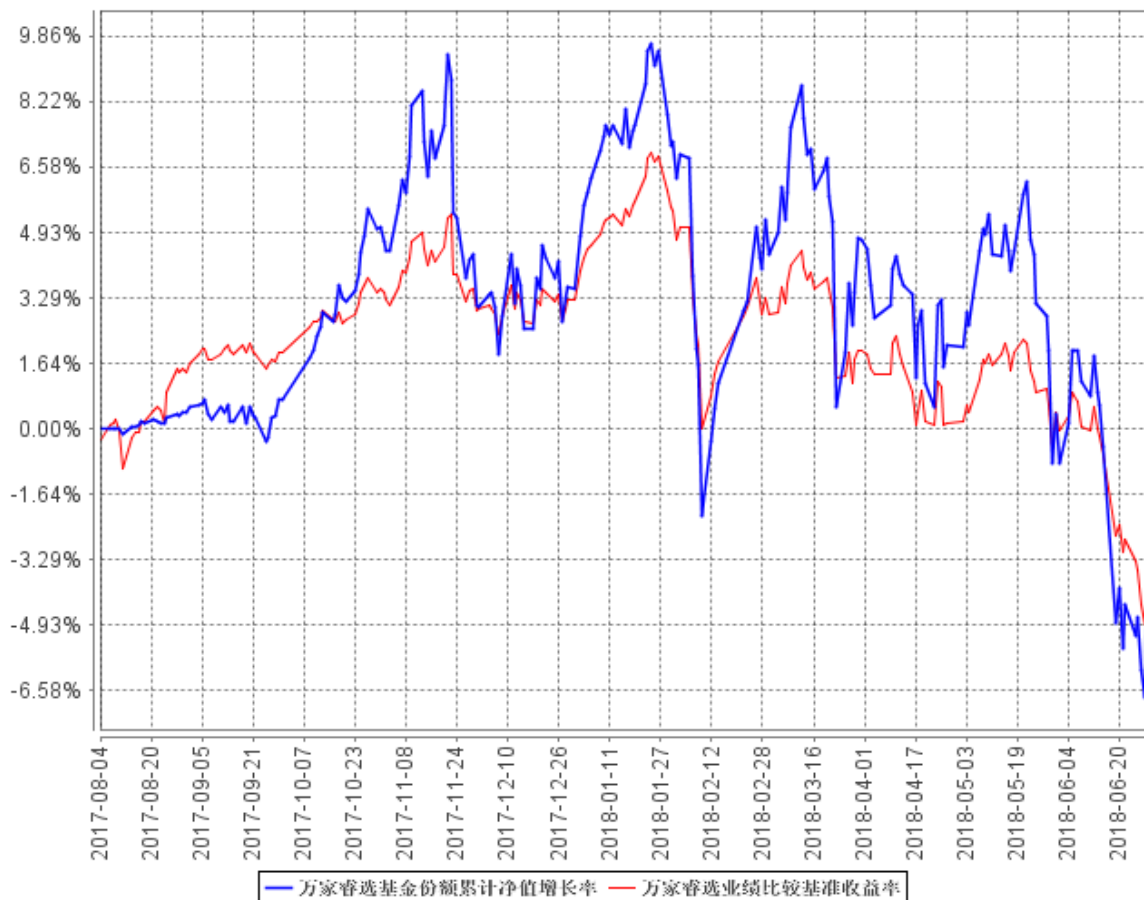
3.2 基金净值表现

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	-4.22%	1.52%	-4.02%	0.69%	-0.20%	0.83%
过去三个月	-8.26%	1.22%	-5.49%	0.58%	-2.77%	0.64%
过去六个月	-7.17%	1.21%	-6.64%	0.58%	-0.53%	0.63%
自基金合同生效起至今	-3.88%	1.00%	-3.61%	0.49%	-0.27%	0.51%

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

万家睿选基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：(1) 本基金合同生效日期为 2017 年 8 月 4 日，基金合同生效起至披露时点未满一年。

(2) 本基金建仓期为基金合同生效后三个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。报告期末各项资产配置比例符合基金合同要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44号文批准设立。公司现股东为中泰证券股份有限公司、新疆国际实业股份有限公司和山东省国有资产投资控股有限公司,住所地址为中国(上海)自由贸易试验区浦电路360号8层(名义楼层9层),办公地址为中国(上海)自由贸易试验区浦电路360号8层(名义楼层9层),注册资本1亿元人民币。目前管理五十九只开放式基金,分别为万家180指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选混合型证券投资基金(LOF)、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金(LOF)、万家添利债券型证券投资基金(LOF)、万家中证创业成长指数分级证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家上证50交易型开放式指数证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞和灵活配置混合型证券投资基金、万家颐达保本混合型证券投资基金、万家颐和保本混合型证券投资基金、万家恒瑞18个月定期开放债券型证券投资基金、万家年年恒祥定期开放债券型证券投资基金、万家鑫安纯债债券型证券投资基金、万家鑫璟纯债债券型证券投资基金、万家瑞旭灵活配置混合型证券投资基金、万家家享纯债债券型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫稳纯债债券型证券投资基金、万家瑞隆混合型证券投资基金、万家恒景18个月定期开放债券型证券投资基金、万家鑫丰纯债债券型证券投资基金、万家鑫享纯债债券型证券投资基金、万家现金增利货币市场基金、万家消费成长股票型证券投资基金、万家宏观择时多策略灵活配置混合型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家玖盛纯债9个月定期开放债券型证券投资基金、万家天添宝货币市场基金、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、万家家瑞债券型证券投资基金、万家臻选混合型证券投资基金、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金、万家家裕债券型证券投资基金、万家成长优

选灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金、万家家乐债券型证券投资基金、万家潜力价值灵活配置混合型证券投资基金、万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金和万家新机遇龙头企业灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
卞勇	本基金基金经理，万家180指数证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金（LOF）、万家中证创业成长指数分级证券投资基金、万家上证50交易型开放式指数证券投资基金、万家瑞瑞债券型证券投资基金、万家量化同顺多策略灵活配置混合型证券投资基金	2017年8月4日	-	9年	量化投资部总监，基金经理，硕士研究生。2008年进入上海双隆投资管理有限公司，任金融工程师；2010年进入上海尚雅投资管理有限公司，从事高级量化分析师工作；2010年10月进入在国泰基金管理有限公司，历任产品开发、专户投资经理助理等职务；2014年4月进入广发证券担任投资经理职务；2014年11月进入中融基金管理有限公司担任产品开发部总监职务；2015年4月加入本公司，现任量化投资部总监。

	的基金 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

2018 年上半年,国内宏观经济政策以防风险、去杠杆为主,3 月份开始的中美贸易纠纷,增加了市场的不确定性。出于对经济下行的担忧、中美贸易摩擦的反复、去杠杆过程中伴随的股票质押平仓风险、债务违约、信用风险提升等问题使得市场信心较为脆弱,投资者风险偏好显著降

低。宏观层面，目前国内经济温和放缓，PPI 回落、社融收缩，通胀压力不大。货币政策基调仍然维持稳健中性，流动性转向合理充裕。

本报告期内本基金正常运作，量化选股模型平稳运行。本基金将在坚持风险收益合理定价的理念基础上，利用行业内领先的机器学习算法，引入多维度数据，建立有效因子组合，顺应市场的变化，在合理控制风险的基础上，勤勉尽责，寻求基金资产的长期稳健增值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9612 元；本报告期基金份额净值增长率为-7.17%，业绩比较基准收益率为-6.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年下半年，下半年流动性维持宽松，但随监管对非标融资的进一步加强，实体经济融资快速收紧，融资成本有所上升，预计金融体系流动性好于实体经济流动性局面延续。在强监管背景下，信用风险仍然显著大于利率风险。此外，中美贸易摩擦仍然具有较大的不确定性。市场的机会或更多来自于结构化供给侧改革。

站在当前时点，我们认为不宜过度悲观，市场在当前点位上继续大幅杀跌的可能性很小。当前 A 股估值已处近年低位，主要指数估值已处于历史较低分位数水平，在充分消化负面因素的影响后，市场信心有望修复，市场估值也将回复正常水平。基本面良好、业绩增速符合预期并且与估值相对匹配的绩优价值和优质成长股有望获得较好的市场表现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

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

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不介入基金日常估值业务。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中债金融估值中心有限公司签署了《中债信息产品服务协议》，本基金管理人与中证指数有限公司签署了《中证债券估值数据服务协议》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金在报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未发生连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或基金资产净值低于 5000 万的情况。

§ 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，中国建设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：万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	6,770,585.10	21,145,073.31
结算备付金		1,473,460.68	21,365,399.43
存出保证金		2,230,737.75	4,612,408.29
交易性金融资产	6.4.7.2	101,696,372.45	361,483,308.43
其中：股票投资		101,224,395.32	361,122,008.43
基金投资		-	-
债券投资		471,977.13	361,300.00
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	21,500,000.00	2,500,000.00
应收证券清算款		222,914.03	1,762,621.44
应收利息	6.4.7.5	-1,551.60	15,274.71
应收股利		-	-
应收申购款		9,814.19	30,264.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		133,902,332.60	412,914,350.28
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		193,877.77	1,605,075.94
应付管理人报酬		168,253.43	538,514.35
应付托管费		28,042.23	89,752.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	885,865.11	2,354,043.59
应交税费		2.58	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	317,045.15	126,504.20
负债合计		1,593,086.27	4,713,890.46
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	137,645,634.65	394,232,193.83
未分配利润	6.4.7.10	-5,336,388.32	13,968,265.99
所有者权益合计		132,309,246.33	408,200,459.82
负债和所有者权益总计		133,902,332.60	412,914,350.28

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9612 元，基金份额总额 137645634.65 份。

6.2 利润表

会计主体：万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		2,661,291.61
1.利息收入		287,391.28
其中：存款利息收入	6.4.7.11	106,736.72
债券利息收入		461.78
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		180,192.78
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		21,637,673.91
其中：股票投资收益	6.4.7.12	21,941,458.77
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-3,167.62
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-1,176,251.33
股利收益	6.4.7.16	875,634.09
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-19,840,931.09
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	577,157.51
减：二、费用		3,431,870.84
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,397,729.85
2. 托管费	6.4.10.2.2	232,954.98
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,591,281.35

5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		0.63
7. 其他费用	6.4.7.20	209,904.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-770,579.23
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-770,579.23

注：本基金基金合同生效日为 2017 年 8 月 4 日，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	394,232,193.83	13,968,265.99	408,200,459.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-770,579.23	-770,579.23
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）	-256,586,559.18	-18,534,075.08	-275,120,634.26
其中：1.基金申购款	7,613,130.39	246,321.76	7,859,452.15
2.基金赎回款	-264,199,689.57	-18,780,396.84	-282,980,086.41
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）	137,645,634.65	-5,336,388.32	132,309,246.33

注：本基金基金合同生效日为 2017 年 8 月 4 日，无上年度可比期间数据。

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

万家量化睿选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”）《关于准予万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2017]569 号文）批准，由万家基金管理有限公司作为基金管理人于 2017 年 7 月 3 日至 2017 年 7 月 28 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资并出具安永华明(2017)验字第 60778298_B03 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 2017 年 8 月 4 日生效。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期限不定期。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 937,133,525.86 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 315,926.82 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 937,449,452.68 元，折合 937,449,452.68 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、股指期货、国债期货、股票期权、权证以及债券等金融工具（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可交换公司债券、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可参与融资业务。本基金为混合型基金，股票资产占基金资产的 0%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证投资占基金资产净值的 0-3%。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率*50%+一年期银行定期存款收益率（税后）*50%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

告和半年度报告》及其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本半年度报告所采取的会计政策、会计估计与上年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1、印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券

取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，管理人接受投资者委托或信托对受托资产提供的管理服务以及管理人发生的其他增值税应税行为，按照现行规定缴纳增值税，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。本通知自 2018 年 1 月 1 日起施行，对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

4、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	6,770,585.10
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	6,770,585.10

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	106,583,959.84	101,224,395.32	-5,359,564.52
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	443,200.00	471,977.13
	银行间市场	-	-
	合计	443,200.00	471,977.13
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	107,027,159.84	101,696,372.45	-5,330,787.39

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	11,063,880.00	11,063,880.00	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	11,063,880.00	11,063,880.00	-	

注：期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况见下表：

代码名称持仓量（买/卖）合约市值（元）公允价值变动（元）风险说明

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1812	IC1812	9	9,015,120.00	-1,206,880.00	-
IF1812	IF1812	2	2,048,760.00	-213,240.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-1,420,120.00
股指期货投资本期收益（元）					-1,176,251.33
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-1,581,766.67

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 2018年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	21,500,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	21,500,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,393.07
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	2,629.78
应收债券利息	381.49
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-6,010.14
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	54.20
合计	-1,551.60

注：其他为证券结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本报告期期末本基金未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	885,865.11
银行间市场应付交易费用	-
合计	885,865.11

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	364.35
预提费用	316,680.80
合计	317,045.15

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	394,232,193.83	394,232,193.83
本期申购	7,613,130.39	7,613,130.39
本期赎回(以“-”号填列)	-264,199,689.57	-264,199,689.57
- 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	137,645,634.65	137,645,634.65

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	17,870,742.78	-3,902,476.79	13,968,265.99
本期利润	19,070,351.86	-19,840,931.09	-770,579.23
本期基金份额交易产生的变动数	-20,927,013.79	2,392,938.71	-18,534,075.08
其中：基金申购款	894,286.37	-647,964.61	246,321.76
基金赎回款	-21,821,300.16	3,040,903.32	-18,780,396.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,014,080.85	-21,350,469.17	-5,336,388.32

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	50,016.46
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	54,466.71
其他	2,253.55
合计	106,736.72

注：其他为直销申购款利息收入及证券结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	608,732,204.15
减：卖出股票成本总额	586,790,745.38
买卖股票差价收入	21,941,458.77

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-3,167.62
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	-3,167.62

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	623,610.64
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	626,262.52
减：应收利息总额	515.74
买卖债券差价收入	-3,167.62

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	-1,176,251.33

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	875,634.09
基金投资产生的股利收益	-
合计	875,634.09

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-18,259,164.42
——股票投资	-18,287,941.55
——债券投资	28,777.13
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-1,581,766.67
——权证投资	-
股指期货投资	-1,581,766.67
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估	-

增值税	
合计	-19,840,931.09

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	576,873.25
转换费	284.26
合计	577,157.51

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	1,591,281.35
银行间市场交易费用	-
合计	1,591,281.35

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	22,315.49
信息披露费	171,865.31
银行汇划费用	6,723.23
债券帐户维护费	9,000.00
合计	209,904.03

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
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金代售机构
中泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代售机构

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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
中泰证券	13,374,426.35	1.41%	-	-

注：本基金成立日为 2017 年 8 月 4 日，无上年度可比数据。

6.4.10.1.2 债券交易

本报告期内，本基金未通过关联方席位进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本报告期内，本基金未通过关联方席位进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本报告期内，本基金未通过关联方席位进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中泰证券	12,455.61	1.41%	12,455.61	1.41%

关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

注：本基金成立日为 2017 年 8 月 4 日，无上年度可比数据。

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 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,397,729.85	-
其中：支付销售机构的客户维护费	1,004,030.96	-

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、本基金成立日为 2017 年 8 月 4 日，无上年度可比数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	232,954.98	-

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一

致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、本基金成立日为 2017 年 8 月 4 日，无上年度可比数据。

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

本基金本报告期内未与关联方进行同业市场的债券（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

本基金本报告期内无基金管理人投资本基金的情况。

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

本基金本报告期内无除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况。

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	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	6,770,585.10	50,016.46	-	-

注：

1、本基金的银行存款由基金托管人中国建设股份有限公司保管，活期存款按银行同业利率计息。本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日获得的利息收入为人民币 15,905.66 元，2018 年 6 月 30 日结算备付金余额为人民币 1,473,460.68 元。

2、本基金成立日为 2017 年 8 月 4 日，无上年度可比数据。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期不存在在承销期内直接购入关联方所承销证券的情况。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金报告期末持有因认购新发/增发证券而流通受限制的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌日期	复牌 开盘单 价	数量(股)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
300266	兴源环境	2018年2月5日	重大事项停牌	19.99	2018年7月2日	11.97	45,800	1,129,207.10	915,542.00	-
300072	三聚环保	2018年6月19日	重大事项停牌	23.28	2018年7月10日	18.38	37,500	1,231,709.29	873,000.00	-
300324	旋极信息	2018年5月30日	重大事项停牌	9.49	-	-	38,987	429,520.80	369,986.63	-
600844	丹化科技	2018年6月1日	重大事项停牌	5.36	-	-	52,600	308,592.05	281,936.00	-
300197	铁汉生态	2018年5月28日	重大事项停牌	4.71	-	-	55,050	382,825.50	259,285.50	-
300118	东方日升	2018年5月7日	重大事项停牌	10.80	2018年8月7日	9.63	21,600	245,324.01	233,280.00	-
600745	闻泰科技	2018年4月17日	重大事项停牌	30.48	-	-	7,000	208,691.97	213,360.00	-
002310	东方园林	2018年5月25日	重大事项停牌	13.07	2018年8月27日	13.47	10,700	203,885.13	139,849.00	-
002602	世纪华通	2018年6月12日	重大事项停牌	32.50	-	-	2,600	83,720.00	84,500.00	-
000415	渤海金控	2018年1月	重大事项停牌	5.84	2018年7月17日	5.20	11,700	67,275.00	68,328.00	-

		月 17 日								
002437	誉衡药业	2018 年 6 月 11 日	重大事件停牌	6.20	2018 年 8 月 13 日	5.57	4,100	27,284.00	25,420.00	-
300146	汤臣倍健	2018 年 1 月 31 日	重大事件停牌	16.60	2018 年 7 月 31 日	16.50	1,200	16,451.17	19,920.00	-

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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末无持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券，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

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。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。

本基金所持部分证券在证券交易所上市, 其余亦可在银行间同业市场交易。因此, 除在附注 6.4.12 中列示的本基金期末持有的流通受限证券外, 其余均能及时变现。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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

金、存出保证金、债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	6,770,585.10	-	-	-	-	-	6,770,585.10
结算备付金	1,473,460.68	-	-	-	-	-	1,473,460.68
存出保证金	120,399.75	-	-	-	-	2,110,338.00	2,230,737.75
交易性金融资产	-	-	471,977.13	-	-	101,224,395.32	101,696,372.45
买入返售金融资产	21,500,000.00	-	-	-	-	-	21,500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	222,914.03	222,914.03
应收利息	-	-	-	-	-	-1,551.60	-1,551.60
应收申购款	-	-	-	-	-	9,814.19	9,814.19
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	29,864,445.53	-	471,977.13	-	-	103,565,909.94	133,902,332.60
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	193,877.77	193,877.77
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	168,253.43	168,253.43
应付托管费	-	-	-	-	-	28,042.23	28,042.23
应付交易费用	-	-	-	-	-	885,865.11	885,865.11
应交税费	-	-	-	-	-	2.58	2.58
其他负债	-	-	-	-	-	317,045.15	317,045.15
负债总计	-	-	-	-	-	1,593,086.27	1,593,086.27
利率敏感度缺口	29,864,445.53	-	471,977.13	-	-	-101,972,823.67	132,309,246.33
上年度末 2017年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	21,145,073.31	-	-	-	-	-	21,145,073.31
结算备付金	21,365,399.43	-	-	-	-	-	21,365,399.43
存出保证金	300,778.29	-	-	-	-	4,311,630.00	4,612,408.29
交易性金融资产	-	-	361,300.00	-	-	361,122,008.43	361,483,308.43
买入返售金融资产	2,500,000.00	-	-	-	-	-	2,500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,762,621.44	1,762,621.44
应收利息	-	-	-	-	-	15,274.71	15,274.71
应收申购款	-	-	-	-	-	30,264.67	30,264.67
资产总计	45,311,251.03	-	361,300.00	-	-	367,241,799.25	412,914,350.28

负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,605,075.94	1,605,075.94
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	538,514.35	538,514.35
应付托管费	-	-	-	-	-	89,752.38	89,752.38
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,354,043.59	2,354,043.59
其他负债	-	-	-	-	-	126,504.20	126,504.20
负债总计	-	-	-	-	-	4,713,890.46	4,713,890.46
利率敏感度缺口	45,311,251.03	-361,300.00	-	-	-	-362,527,908.79	408,200,459.82

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金与资产负债表日的利率风险状况；		
	该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；		
	该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；		
	银行存款、结算备付金及存出保证金以活期存款计息，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；买入返售金融资产利息收益/卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响；		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	6,386.34	5,250.29
市场利率上升 25 个基点	-6,284.84	-5,161.94	

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其他市场价格风险，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，通过组合估值、行业配置分析等进

行市场价格风险管理。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	101,224,395.32	76.51	361,122,008.43	88.47
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	471,977.13	0.36	361,300.00	0.09
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	101,696,372.45	76.86	361,483,308.43	88.56

注：基金为混合型基金，股票资产占基金资产的 0%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证投资占基金资产净值的 0-3%。于 2018 年 6 月 30 日，本基金面临的整体其他价格风险列示见上表。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	股票基准指数下降 100 个基点	-847,598.71	-4,034,066.15
	股票基准指数上升 100 个基点	847,598.71	4,034,066.15

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。

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	101,224,395.32	75.60
	其中：股票	101,224,395.32	75.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	471,977.13	0.35
	其中：债券	471,977.13	0.35
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	21,500,000.00	16.06
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,244,045.78	6.16
8	其他各项资产	2,461,914.37	1.84
9	合计	133,902,332.60	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	559,665.00	0.42
B	采矿业	1,498,813.20	1.13
C	制造业	57,553,887.79	43.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	969,508.00	0.73
E	建筑业	2,596,969.10	1.96
F	批发和零售业	1,059,397.00	0.80
G	交通运输、仓储和邮政业	1,365,816.00	1.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务	12,685,913.31	9.59

	业		
J	金融业	10,286,104.84	7.77
K	房地产业	2,867,090.00	2.17
L	租赁和商务服务业	1,133,966.00	0.86
M	科学研究和技术服务业	474,611.20	0.36
N	水利、环境和公共设施管理业	2,303,220.90	1.74
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,729,961.42	2.82
R	文化、体育和娱乐业	2,139,471.56	1.62
S	综合	-	-
	合计	101,224,395.32	76.51

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600346	恒力股份	350,800	5,142,728.00	3.89
2	600309	万华化学	100,000	4,542,000.00	3.43
3	000676	智度股份	261,800	3,241,084.00	2.45
4	600519	贵州茅台	3,500	2,560,110.00	1.93
5	300059	东方财富	154,500	2,036,310.00	1.54
6	001979	招商蛇口	100,600	1,916,430.00	1.45
7	601318	中国平安	31,500	1,845,270.00	1.39
8	300408	三环集团	70,000	1,645,000.00	1.24
9	300015	爱尔眼科	49,998	1,614,435.42	1.22
10	600664	哈药股份	354,400	1,406,968.00	1.06
11	300124	汇川技术	40,320	1,323,302.40	1.00
12	002415	海康威视	34,850	1,293,980.50	0.98
13	002711	欧浦智网	152,700	1,279,626.00	0.97
14	600104	上汽集团	31,600	1,105,684.00	0.84
15	603019	中科曙光	23,000	1,055,010.00	0.80
16	300136	信维通信	33,000	1,014,090.00	0.77
17	000040	东旭蓝天	97,532	985,073.20	0.74
18	002384	东山精密	41,000	984,000.00	0.74

19	600256	广汇能源	238,880	977,019.20	0.74
20	300070	碧水源	69,300	965,349.00	0.73
21	300474	景嘉微	20,400	948,192.00	0.72
22	000651	格力电器	19,673	927,581.95	0.70
23	300266	兴源环境	45,800	915,542.00	0.69
24	300142	沃森生物	45,200	903,096.00	0.68
25	601668	中国建筑	165,340	902,756.40	0.68
26	300296	利亚德	68,500	882,280.00	0.67
27	300024	机器人	50,500	878,700.00	0.66
28	300072	三聚环保	37,500	873,000.00	0.66
29	600036	招商银行	32,586	861,573.84	0.65
30	300003	乐普医疗	23,400	858,312.00	0.65
31	300122	智飞生物	18,421	842,576.54	0.64
32	300459	金科文化	82,100	793,086.00	0.60
33	000333	美的集团	14,900	778,078.00	0.59
34	601888	中国国旅	11,900	766,479.00	0.58
35	600585	海螺水泥	22,700	759,996.00	0.57
36	300347	泰格医药	11,900	736,253.00	0.56
37	600031	三一重工	81,500	731,055.00	0.55
38	000661	长春高新	3,200	728,640.00	0.55
39	300144	宋城演艺	29,900	702,650.00	0.53
40	000063	中兴通讯	52,300	681,469.00	0.52
41	300168	万达信息	33,152	676,300.80	0.51
42	300595	欧普康视	14,400	645,408.00	0.49
43	300253	卫宁健康	51,500	638,085.00	0.48
44	002304	洋河股份	4,500	592,200.00	0.45
45	601288	农业银行	170,900	587,896.00	0.44
46	300098	高新兴	73,340	585,253.20	0.44
47	600763	通策医疗	12,000	584,040.00	0.44
48	601166	兴业银行	39,200	564,480.00	0.43
49	300357	我武生物	14,100	562,167.00	0.42
50	600016	民生银行	79,100	553,700.00	0.42
51	002044	美年健康	24,000	542,400.00	0.41
52	300723	一品红	12,900	536,124.00	0.41
53	002714	牧原股份	11,800	524,628.00	0.40
54	600681	百川能源	40,100	519,696.00	0.39
55	300529	健帆生物	12,000	514,680.00	0.39
56	601328	交通银行	87,900	504,546.00	0.38
57	300166	东方国信	33,800	497,874.00	0.38

58	300450	先导智能	15,766	476,763.84	0.36
59	300009	安科生物	25,400	468,376.00	0.35
60	300170	汉得信息	28,600	464,464.00	0.35
61	601398	工商银行	87,300	464,436.00	0.35
62	600567	山鹰纸业	119,900	462,814.00	0.35
63	300088	长信科技	79,500	461,100.00	0.35
64	603387	基蛋生物	8,901	451,992.78	0.34
65	300315	掌趣科技	103,400	432,212.00	0.33
66	300182	捷成股份	55,700	422,206.00	0.32
67	300433	蓝思科技	20,100	421,698.00	0.32
68	600030	中信证券	25,400	420,878.00	0.32
69	600741	华域汽车	17,700	419,844.00	0.32
70	300444	双杰电气	27,500	417,450.00	0.32
71	300418	昆仑万维	21,200	400,256.00	0.30
72	600836	界龙实业	97,900	396,495.00	0.30
73	601100	恒立液压	18,580	387,950.40	0.29
74	300014	亿纬锂能	21,600	380,160.00	0.29
75	300558	贝达药业	6,800	378,556.00	0.29
76	300316	晶盛机电	28,470	378,366.30	0.29
77	300271	华宇软件	21,400	378,352.00	0.29
78	600338	西藏珠峰	18,200	377,104.00	0.29
79	300413	快乐购	9,900	375,606.00	0.28
80	300324	旋极信息	38,987	369,986.63	0.28
81	000880	潍柴重机	48,000	369,120.00	0.28
82	000078	海王生物	76,300	367,003.00	0.28
83	600083	博信股份	18,000	359,460.00	0.27
84	300274	阳光电源	39,800	357,006.00	0.27
85	601601	中国太保	11,200	356,720.00	0.27
86	300073	当升科技	10,400	354,224.00	0.27
87	300618	寒锐钴业	2,700	346,518.00	0.26
88	601139	深圳燃气	61,800	342,990.00	0.26
89	601988	中国银行	94,200	340,062.00	0.26
90	300010	立思辰	27,400	335,376.00	0.25
91	600000	浦发银行	34,800	332,688.00	0.25
92	300203	聚光科技	12,900	330,240.00	0.25
93	300113	顺网科技	18,500	322,085.00	0.24
94	300285	国瓷材料	15,900	317,046.00	0.24
95	600173	卧龙地产	72,400	311,320.00	0.24
96	300287	飞利信	43,200	310,608.00	0.23

97	300055	万邦达	26,800	307,932.00	0.23
98	300133	华策影视	28,900	307,785.00	0.23
99	300308	中际旭创	5,000	300,200.00	0.23
100	300115	长盈精密	23,100	299,607.00	0.23
101	002176	江特电机	30,500	296,460.00	0.22
102	300199	翰宇药业	20,400	291,312.00	0.22
103	600844	丹化科技	52,600	281,936.00	0.21
104	300355	蒙草生态	46,900	281,869.00	0.21
105	300207	欣旺达	31,100	280,211.00	0.21
106	000568	泸州老窖	4,590	279,347.40	0.21
107	300463	迈克生物	11,100	276,723.00	0.21
108	300077	国民技术	24,700	274,664.00	0.21
109	300367	东方网力	21,500	268,750.00	0.20
110	300750	宁德时代	3,719	267,619.24	0.20
111	300180	华峰超纤	24,460	264,901.80	0.20
112	300628	亿联网络	4,000	263,640.00	0.20
113	300026	红日药业	72,000	262,800.00	0.20
114	600837	海通证券	27,600	261,372.00	0.20
115	300197	铁汉生态	55,050	259,285.50	0.20
116	300496	中科创达	8,700	256,389.00	0.19
117	300244	迪安诊断	13,300	252,833.00	0.19
118	300377	赢时胜	18,500	251,415.00	0.19
119	300080	易成新能	51,300	251,370.00	0.19
120	600566	济川药业	5,100	245,769.00	0.19
121	300294	博雅生物	7,900	244,821.00	0.19
122	300212	易华录	10,240	242,176.00	0.18
123	000818	航锦科技	20,700	240,741.00	0.18
124	300409	道氏技术	6,000	240,660.00	0.18
125	300053	欧比特	20,600	238,960.00	0.18
126	601169	北京银行	38,800	233,964.00	0.18
127	300118	东方日升	21,600	233,280.00	0.18
128	300145	中金环境	29,500	230,985.00	0.17
129	300257	开山股份	15,100	230,879.00	0.17
130	300068	南都电源	19,100	228,818.00	0.17
131	300423	鲁亿通	9,976	227,951.60	0.17
132	300222	科大智能	12,100	224,334.00	0.17
133	300251	光线传媒	21,900	222,942.00	0.17
134	000858	五粮液	2,900	220,400.00	0.17
135	601009	南京银行	28,100	217,213.00	0.16

136	000001	平安银行	23,500	213,615.00	0.16
137	600745	闻泰科技	7,000	213,360.00	0.16
138	300676	华大基因	2,200	212,982.00	0.16
139	300027	华谊兄弟	34,391	211,848.56	0.16
140	300001	特锐德	18,600	211,296.00	0.16
141	300002	神州泰岳	49,800	207,666.00	0.16
142	002142	宁波银行	12,700	206,883.00	0.16
143	300323	华灿光电	15,800	204,136.00	0.15
144	300020	银江股份	21,100	200,661.00	0.15
145	300699	光威复材	4,400	198,880.00	0.15
146	603799	华友钴业	2,000	194,940.00	0.15
147	601388	怡球资源	75,000	189,000.00	0.14
148	601211	国泰君安	12,800	188,672.00	0.14
149	300083	劲胜智能	38,400	185,088.00	0.14
150	600426	华鲁恒升	10,500	184,695.00	0.14
151	300085	银之杰	14,100	183,018.00	0.14
152	300078	思创医惠	19,100	181,068.00	0.14
153	002460	赣锋锂业	4,583	176,812.14	0.13
154	300431	暴风集团	11,300	171,534.00	0.13
155	601628	中国人寿	7,500	168,900.00	0.13
156	601688	华泰证券	10,800	161,676.00	0.12
157	601229	上海银行	9,600	151,296.00	0.11
158	000717	韶钢松山	22,700	148,912.00	0.11
159	300364	中文在线	21,000	147,840.00	0.11
160	300284	苏交科	18,540	147,022.20	0.11
161	600486	扬农化工	2,600	145,418.00	0.11
162	002310	东方园林	10,700	139,849.00	0.11
163	601818	光大银行	38,200	139,812.00	0.11
164	300081	恒信东方	12,700	138,684.00	0.10
165	600260	凯乐科技	5,000	134,200.00	0.10
166	300310	宜通世纪	21,000	133,980.00	0.10
167	300458	全志科技	7,300	130,816.00	0.10
168	300422	博世科	8,900	126,825.00	0.10
169	600683	京投发展	27,200	124,848.00	0.09
170	300148	天舟文化	27,600	124,200.00	0.09
171	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.09
172	600015	华夏银行	16,200	120,690.00	0.09
173	600276	恒瑞医药	1,560	118,185.60	0.09
174	600196	复星医药	2,800	115,892.00	0.09

175	000963	华东医药	2,400	115,800.00	0.09
176	002475	立讯精密	5,100	114,954.00	0.09
177	002466	天齐锂业	2,300	114,057.00	0.09
178	000157	中联重科	27,200	111,792.00	0.08
179	000776	广发证券	8,400	111,468.00	0.08
180	002027	分众传媒	11,400	109,098.00	0.08
181	002236	大华股份	4,700	105,985.00	0.08
182	300679	电连技术	2,800	105,308.00	0.08
183	002456	欧菲科技	6,500	104,845.00	0.08
184	600703	三安光电	5,400	103,788.00	0.08
185	601788	光大证券	9,300	102,114.00	0.08
186	300427	红相股份	7,000	100,800.00	0.08
187	600887	伊利股份	3,600	100,440.00	0.08
188	600028	中国石化	15,400	99,946.00	0.08
189	601155	新城控股	3,200	99,104.00	0.07
190	600466	蓝光发展	15,580	96,596.00	0.07
191	600919	江苏银行	15,000	96,150.00	0.07
192	600048	保利地产	7,700	93,940.00	0.07
193	300398	飞凯材料	4,800	93,888.00	0.07
194	002219	恒康医疗	8,900	93,806.00	0.07
195	000791	甘肃电投	21,200	93,280.00	0.07
196	300467	迅游科技	2,900	93,090.00	0.07
197	603986	兆易创新	840	91,156.80	0.07
198	000002	万 科A	3,700	91,020.00	0.07
199	600176	中国巨石	8,880	90,842.40	0.07
200	600999	招商证券	6,400	87,552.00	0.07
201	601377	兴业证券	16,600	87,482.00	0.07
202	000702	正虹科技	15,100	86,976.00	0.07
203	600029	南方航空	10,200	86,190.00	0.07
204	603589	口子窖	1,400	86,030.00	0.07
205	002602	世纪华通	2,600	84,500.00	0.06
206	002685	华东重机	10,200	83,946.00	0.06
207	000537	广宇发展	8,600	82,904.00	0.06
208	600645	中源协和	4,200	80,892.00	0.06
209	002736	国信证券	8,800	80,080.00	0.06
210	002202	金风科技	6,200	78,368.00	0.06
211	300174	元力股份	3,700	78,366.00	0.06
212	600618	氯碱化工	9,100	77,441.00	0.06
213	000815	美利云	9,400	76,798.00	0.06

214	002365	永安药业	5,300	76,161.00	0.06
215	000166	申万宏源	17,400	76,038.00	0.06
216	600390	五矿资本	9,500	73,625.00	0.06
217	002707	众信旅游	7,600	72,960.00	0.06
218	300006	莱美药业	17,100	71,136.00	0.05
219	300268	佳沃股份	5,000	70,650.00	0.05
220	601012	隆基股份	4,200	70,098.00	0.05
221	000415	渤海金控	11,700	68,328.00	0.05
222	000581	威孚高科	2,900	64,119.00	0.05
223	601901	方正证券	9,500	63,555.00	0.05
224	600109	国金证券	8,800	62,568.00	0.05
225	600369	西南证券	16,200	62,370.00	0.05
226	300038	梅泰诺	5,800	61,828.00	0.05
227	000783	长江证券	11,300	61,359.00	0.05
228	601998	中信银行	9,800	60,858.00	0.05
229	002127	南极电商	6,300	59,157.00	0.04
230	600958	东方证券	6,100	55,693.00	0.04
231	000683	远兴能源	18,900	53,487.00	0.04
232	300567	精测电子	600	47,760.00	0.04
233	000728	国元证券	6,400	47,360.00	0.04
234	300400	劲拓股份	3,400	45,934.00	0.03
235	600673	东阳光科	4,400	45,452.00	0.03
236	002013	中航机电	6,000	45,420.00	0.03
237	601918	新集能源	11,900	44,744.00	0.03
238	601555	东吴证券	6,400	43,712.00	0.03
239	000662	天夏智慧	6,676	42,926.68	0.03
240	300121	阳谷华泰	3,000	42,090.00	0.03
241	000058	深赛格	8,200	41,984.00	0.03
242	600201	生物股份	2,450	41,870.50	0.03
243	600739	辽宁成大	2,700	40,986.00	0.03
244	000425	徐工机械	9,500	40,280.00	0.03
245	600019	宝钢股份	4,900	38,171.00	0.03
246	600160	巨化股份	5,200	38,064.00	0.03
247	002803	吉宏股份	1,100	37,268.00	0.03
248	002514	宝馨科技	6,300	36,540.00	0.03
249	000623	吉林敖东	2,000	35,960.00	0.03
250	600061	国投资本	3,800	35,264.00	0.03
251	300094	国联水产	5,100	35,037.00	0.03
252	601997	贵阳银行	2,800	34,608.00	0.03

253	000830	鲁西化工	2,000	34,160.00	0.03
254	300017	网宿科技	3,100	33,201.00	0.03
255	600812	华北制药	7,600	32,984.00	0.02
256	603808	歌力思	1,400	31,514.00	0.02
257	300571	平治信息	450	30,690.00	0.02
258	601198	东兴证券	2,300	29,992.00	0.02
259	600926	杭州银行	2,600	28,834.00	0.02
260	300554	三超新材	760	26,782.40	0.02
261	300649	杭州园林	900	26,559.00	0.02
262	002673	西部证券	3,500	26,425.00	0.02
263	000606	神州易桥	3,900	25,740.00	0.02
264	000932	华菱钢铁	3,000	25,500.00	0.02
265	600793	宜宾纸业	1,800	25,452.00	0.02
266	002437	誉衡药业	4,100	25,420.00	0.02
267	601881	中国银河	3,000	24,390.00	0.02
268	000042	中洲控股	1,600	23,728.00	0.02
269	300437	清水源	1,400	23,268.00	0.02
270	002373	千方科技	1,700	22,185.00	0.02
271	603108	润达医疗	1,900	21,318.00	0.02
272	300391	康跃科技	2,000	20,600.00	0.02
273	002168	深圳惠程	2,000	20,560.00	0.02
274	300146	汤臣倍健	1,200	19,920.00	0.02
275	000560	我爱我家	3,050	17,263.00	0.01
276	000703	恒逸石化	1,100	16,368.00	0.01
277	300058	蓝色光标	2,800	15,960.00	0.01
278	300033	同花顺	400	15,548.00	0.01
279	002447	晨鑫科技	4,500	15,390.00	0.01
280	002832	比音勒芬	370	13,690.00	0.01
281	002717	岭南股份	1,390	13,635.90	0.01
282	000591	太阳能	3,700	13,542.00	0.01
283	601336	新华保险	300	12,864.00	0.01
284	300159	新研股份	1,800	12,744.00	0.01
285	600963	岳阳林纸	2,400	12,432.00	0.01
286	300132	青松股份	1,100	11,913.00	0.01
287	002670	国盛金控	1,000	10,770.00	0.01
288	600658	电子城	1,900	9,937.00	0.01
289	600516	方大炭素	400	9,752.00	0.01
290	601838	成都银行	1,100	9,625.00	0.01
291	002624	完美世界	300	9,303.00	0.01

292	002035	华帝股份	300	7,329.00	0.01
293	603959	百利科技	400	7,156.00	0.01
294	600779	水井坊	100	5,523.00	0.00
295	002677	浙江美大	300	5,220.00	0.00
296	603429	集友股份	200	4,538.00	0.00
297	600291	西水股份	300	4,008.00	0.00
298	600438	通威股份	500	3,450.00	0.00
299	000519	中兵红箭	400	3,108.00	0.00
300	002798	帝欧家居	100	2,960.00	0.00
301	300076	GQY 视讯	400	2,092.00	0.00
302	300506	名家汇	100	2,073.00	0.00
303	600866	星湖科技	500	1,940.00	0.00
304	000952	广济药业	100	1,437.00	0.00
305	000712	锦龙股份	100	998.00	0.00
306	002354	天神娱乐	100	926.00	0.00
307	603025	大豪科技	8	154.72	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	000651	格力电器	6,954,839.92	1.70
2	000895	双汇发展	5,438,201.20	1.33
3	600346	恒力股份	5,348,864.60	1.31
4	601006	大秦铁路	4,459,232.93	1.09
5	601668	中国建筑	4,186,901.00	1.03
6	601318	中国平安	4,108,231.00	1.01
7	300122	智飞生物	3,961,047.00	0.97
8	601688	华泰证券	3,612,734.00	0.89
9	600031	三一重工	3,588,452.50	0.88
10	000002	万科 A	3,535,400.00	0.87
11	000676	智度股份	3,131,934.00	0.77
12	600782	新钢股份	3,087,728.96	0.76
13	600565	迪马股份	3,070,395.00	0.75
14	600703	三安光电	3,066,954.49	0.75

15	601225	陕西煤业	2,729,272.52	0.67
16	000980	众泰汽车	2,593,854.00	0.64
17	300059	东方财富	2,512,034.98	0.62
18	600340	华夏幸福	2,466,061.31	0.60
19	600522	中天科技	2,434,164.00	0.60
20	600585	海螺水泥	2,406,566.00	0.59

注：“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	601318	中国平安	22,234,680.10	5.45
2	600519	贵州茅台	16,963,569.81	4.16
3	000402	金融街	13,678,770.10	3.35
4	600690	青岛海尔	10,787,725.44	2.64
5	000338	潍柴动力	10,774,007.50	2.64
6	002008	大族激光	10,641,656.92	2.61
7	300015	爱尔眼科	10,551,266.89	2.58
8	601919	中远海控	10,397,621.80	2.55
9	600036	招商银行	10,114,442.32	2.48
10	600674	川投能源	8,733,703.22	2.14
11	000651	格力电器	8,642,975.51	2.12
12	002601	龙鳞佰利	7,961,054.86	1.95
13	601688	华泰证券	7,799,157.12	1.91
14	000895	双汇发展	7,638,377.53	1.87
15	603799	华友钴业	7,343,507.36	1.80
16	601012	隆基股份	7,109,398.67	1.74
17	600820	隧道股份	6,243,971.00	1.53
18	601288	农业银行	6,195,370.00	1.52
19	000959	首钢股份	6,070,447.56	1.49
20	601211	国泰君安	5,889,751.47	1.44

注：“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	345,181,073.82
卖出股票收入（成交）总额	608,732,204.15

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	471,977.13	0.36
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	471,977.13	0.36

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128024	宁行转债	3,613	377,955.93	0.29
2	128035	大族转债	819	94,021.20	0.07

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

代码	名称	持仓量（买/	合约市值	公允价值变动	风险说明
----	----	--------	------	--------	------

		卖)	(元)	(元)	
IC1812	IC1812	9	9,015,120.00	-1,206,880.00	-
IF1812	IF1812	2	2,048,760.00	-213,240.00	-
公允价值变动总额合计 (元)					-1,420,120.00
股指期货投资本期收益 (元)					-1,176,251.33
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					-1,581,766.67

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易以套期保值为目的，利用股指期货剥离部分多头股票资产的系统性风险。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金可基于谨慎原则运用国债期货对基本投资组合进行管理，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

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，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	2,230,737.75
2	应收证券清算款	222,914.03
3	应收股利	-
4	应收利息	-1,551.60
5	应收申购款	9,814.19

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,461,914.37

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128024	宁行转债	377,955.93	0.29

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§ 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
3,734	36,862.78	0.00	0.00%	137,645,634.65	100.00%

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	5,012.87	0.0036%

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	0~10
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（2017年8月4日）基金份额总额	937,449,452.68
本报告期期初基金份额总额	394,232,193.83
本报告期基金总申购份额	7,613,130.39
减：本报告期基金总赎回份额	264,199,689.57
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	137,645,634.65

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

报告期内无涉及基金管理人的重大人事变动。

基金托管人：

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

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

本报告期内管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或者处罚。

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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
国信证券	1	247,491,839.10	26.02%	230,489.04	26.02%	-
长江证券	1	224,778,014.55	23.63%	209,336.08	23.63%	-
川财证券	1	131,747,214.08	13.85%	122,695.56	13.85%	-
西部证券	2	85,034,101.84	8.94%	79,191.89	8.94%	-
兴业证券	2	80,198,188.61	8.43%	74,688.44	8.43%	-
华创证券	2	56,736,836.23	5.96%	52,839.14	5.96%	-
东兴证券	1	41,228,241.97	4.33%	38,396.06	4.33%	-
中信证券	4	22,265,090.46	2.34%	20,735.67	2.34%	-
民生证券	1	13,478,243.64	1.42%	12,552.68	1.42%	-
中泰证券	2	13,374,426.35	1.41%	12,455.61	1.41%	-
光大证券	1	12,654,711.77	1.33%	11,785.23	1.33%	-
东北证券	1	9,586,392.11	1.01%	8,928.01	1.01%	-
方正证券	1	8,439,286.66	0.89%	7,859.43	0.89%	-
申万宏源	1	4,176,319.30	0.44%	3,889.45	0.44%	-
中银国际	2	24,500.00	0.00%	22.82	0.00%	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范, 内控制度健全, 在业内有良好的声誉;
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设施满足基金进行证券交易的需要;
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平, 包括但不限于: 有较好的研究能力和行业分析能力, 能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信

息服务;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、基金专用交易席位的变更情况:

本基金本报告期内新增国金证券交易席位 1 个、华泰证券交易席位 2 个、信达证券交易席位 2 个、中信证券交易席位 2 个、中银国际交易席位 1 个。

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
国信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	414,300,000.00	32.60%	-	-
川财证券	-	-	529,500,000.00	41.66%	-	-
西部证券	-	-	9,300,000.00	0.73%	-	-
兴业证券	-	-	30,300,000.00	2.38%	-	-
华创证券	626,650.00	100.00%	17,000,000.00	1.34%	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	30,100,000.00	2.37%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	17,700,000.00	1.39%	-	-
东北证券	-	-	222,700,000.00	17.52%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 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量化睿选灵活配置混合型证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《万家量化睿选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媒介上公开披露的基金净值、季度报告、更新招募说明书及其他临时公告
- 5、万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金 2018 年半年度报告原文
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议
- 7、《万家量化睿选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

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：www.wjasset.com

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司

2018 年 8 月 28 日