

万家新利灵活配置混合型证券投资基金 2015 年半年度报告摘要

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 26 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	万家新利
基金主代码	519191
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 1 月 24 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	4,645,433,114.08 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注经营状况良好、财务健康、具备成长性的上市公司，通过有效配置股票、债券投资比例，控制投资风险，谋取基金资产的长期稳定增值。
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	本基金的业绩比较基准为：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，属与中高风险、中高预期收益的证券投资基金。

注：基金份额持有人大会于 2015 年 5 月 19 日表决通过了《关于修改万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，《万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金合同》修订为《万家新利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，详情请参阅相关公告。

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
----	--------------	--------------

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.wjasset.com
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区浦电路 360 号陆家嘴投资大厦 9 楼 基金管理人办公场所

§ 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	4,389,526.06
本期利润	2,131,932.33
加权平均基金份额本期利润	0.0032
本期基金份额净值增长率	5.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.0154
期末基金资产净值	4,716,990,786.23
期末基金份额净值	1.0154

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

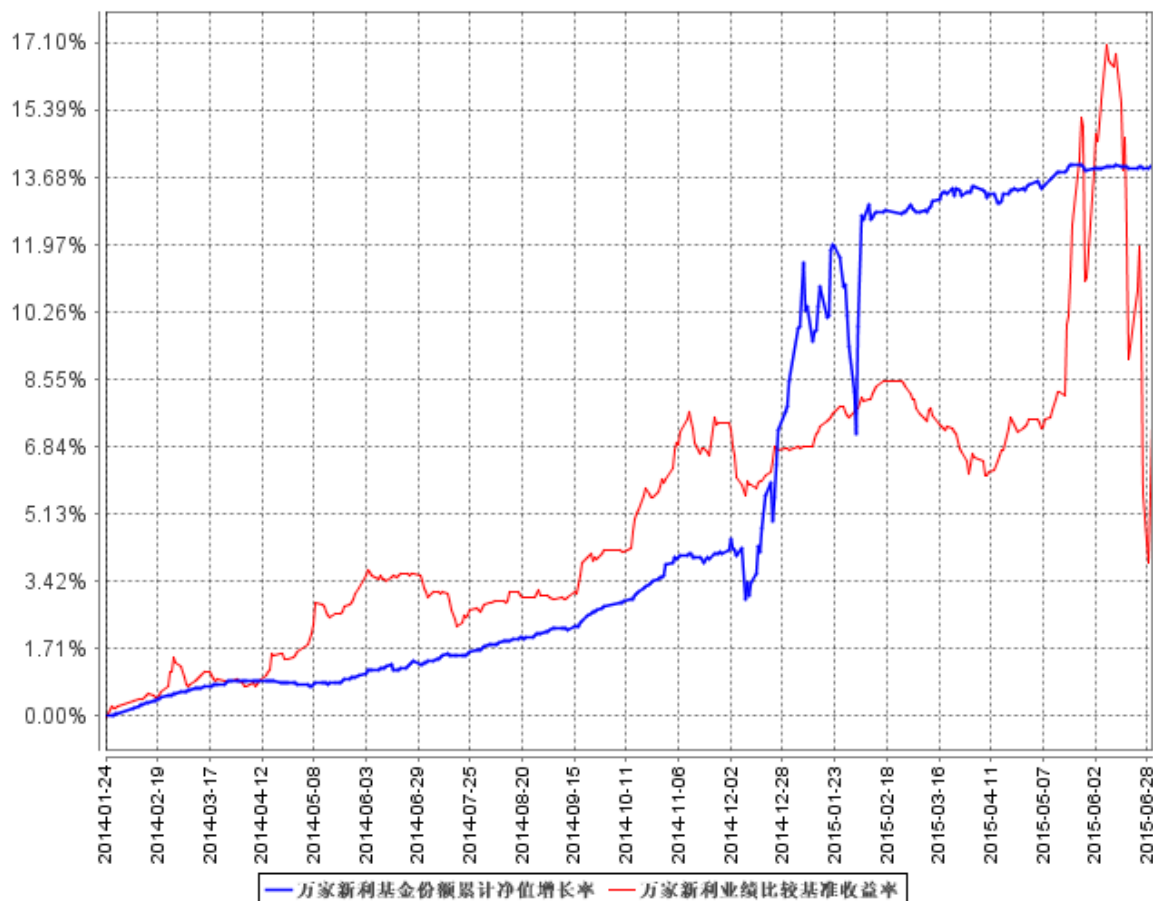
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.13%	0.02%	-3.36%	1.74%	3.49%	-1.72%
过去三个月	0.62%	0.06%	1.17%	1.16%	-0.55%	-1.10%
过去六个月	5.07%	0.47%	0.60%	0.84%	4.47%	-0.37%

过去一年	12.52%	0.36%	3.71%	0.59%	8.81%	-0.23%
自基金合同生效起至今	14.01%	0.31%	7.40%	0.50%	6.61%	-0.19%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%

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

万家新利基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2015 年 5 月 19 日修改了基金合同，根据基金合同规定修改基金投资目标、投资范围、投资策略、收益分配方式，基金合同生效后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		
苏谋东	本基金基金经理、万家强化收益定期开放债券基金基金经理、万家添利债券型证券投资基金(LOF)基金经理,万家信用恒利债券基金基金经理、万家日日薪货币市场基金基金经理	2014 年 5 月 24 日	-	5 年	经济学硕士, CFA, 2008 年 7 月至 2013 年 2 月在宝钢集团财务有限公司从事固定收益投资研究工作,担任投资经理职务。
高翰昆	本基金基金经理、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家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。

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

上半年各项经济数据持续震荡走低,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由去杠杆推动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 1.0154 元, 本报告期份额净值增长率为 5.07%, 业绩比较基准收益率 0.60%。

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

根据基金合同规定：“在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 90%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配”。2015 年 3 月 27 日，本基金进行了利润分配，每 10 份基金份额分红 1.00 元，共计分配利润 1,737,473.43 元。符合基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

自 1 月 5 日至 5 月 13 日，基金资产净值连续 60 个工作日以上低于五千万元。2015 年 5 月 19 日，万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会通过通讯方式召开，表决通过了《关于修改万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，将万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金变更为万家新利灵活配置混合型证券投资基金，并按照相关法律法规及中国证监会的有关规定对本基金的名称、投资目标、投资范围、投资策略、收益分配方式等事项进行相应修改。本次大会决议自 2015 年 5 月 19 日起生效，基金管理人已将表决通过的事项报中国证券监督管理委员会备案。

§ 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，万家新利灵活配置混合型证券投资基金实施利润分配的金额为 1,737,473.43 元。

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：万家新利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	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	2,607,542,843.67	653,301.75
结算备付金	4,640,077.39	41,455.82
存出保证金	61,449.01	2,292.95
交易性金融资产	313,488,869.35	45,186,411.20
其中：股票投资	37,747,051.35	-
基金投资	-	-
债券投资	275,741,818.00	45,186,411.20
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	1,785,006,597.50	200,000.00
应收证券清算款	5,084,376.18	-
应收利息	6,848,529.50	762,260.31
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,722,672,742.60	46,845,722.03
负债和所有者权益	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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	460,711.18
应付赎回款	2,075.85	211,360.09
应付管理人报酬	4,399,049.56	26,949.08
应付托管费	733,174.94	7,699.74
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	433,600.01	4,278.71

应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	114,056.01	350,158.68
负债合计	5,681,956.37	1,061,157.48
所有者权益：		
实收基金	4,645,433,114.08	43,102,533.10
未分配利润	71,557,672.15	2,682,031.45
所有者权益合计	4,716,990,786.23	45,784,564.55
负债和所有者权益总计	4,722,672,742.60	46,845,722.03

6.2 利润表

会计主体：万家新利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	上年度可比期间 2014 年 1 月 24 日(基 金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
一、收入	8,725,558.97	4,808,965.56
1.利息收入	4,863,511.66	4,679,619.32
其中：存款利息收入	2,831,015.88	4,278,137.29
债券利息收入	484,051.84	244,225.09
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,548,443.94	157,256.94
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	6,097,257.21	54,028.69
其中：股票投资收益	3,384,523.64	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,563,516.95	54,028.69
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	149,216.62	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-2,257,593.73	-30,685.85
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	22,383.83	106,003.40
减：二、费用	6,593,626.64	919,032.39
1. 管理人报酬	4,899,139.92	597,910.41
2. 托管费	823,489.03	170,831.53

3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	716,022.92	1,178.98
5. 利息支出	12,359.95	1,385.98
其中：卖出回购金融资产支出	12,359.95	1,385.98
6. 其他费用	142,614.82	147,725.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	2,131,932.33	3,889,933.17
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	2,131,932.33	3,889,933.17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家新利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）	43,102,533.10	2,682,031.45	45,784,564.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,131,932.33	2,131,932.33
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）	4,602,330,580.98	68,481,181.80	4,670,811,762.78
其中：1.基金申购款	4,657,628,974.18	71,298,873.83	4,728,927,848.01
2.基金赎回款	-55,298,393.20	-2,817,692.03	-58,116,085.23
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）	-	-1,737,473.43	-1,737,473.43
五、期末所有者权益（基金净值）	4,645,433,114.08	71,557,672.15	4,716,990,786.23
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 24 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益(基金净值)	434,903,358.43	-	434,903,358.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,889,933.17	3,889,933.17
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-342,074,404.62	-2,848,368.22	-342,074,404.62
其中：1.基金申购款	78,411,600.28	677,480.26	79,089,080.54
2.基金赎回款	-420,486,004.90	-3,525,848.48	-424,011,853.38
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)	-	-211,410.61	-211,410.61
五、期末所有者权益(基金净值)	92,828,953.81	830,154.34	93,659,108.15

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金，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[2013] 1110 号文《关于核准万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人万家基金管理有限公司作为发起人于 2013 年 12 月 26 日至 2014 年 1 月 21 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)验证并出具安永华明(2014)验字第 60778298_B01 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 2014 年 1 月 24 日生效。

基金份额持有人大会于 2015 年 5 月 19 日表决通过了《关于修改万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，《万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金合同》修订为《万家新利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，本基金的基金管理人为万家基金管理有限公司，基金注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

万家新利灵活配置混合型证券投资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（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债、证券公司短期公司债券）、货币市场工具、权证、股指期货、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（但须符合中国证监会相关规定）。

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，属与中高风险、中高预期收益的证券投资基金。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《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》、《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》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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

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。

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。

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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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，基金代销机构
齐鲁证券有限公司	基金管理人股东，基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月24日(基金合同生效日)至2014年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
齐鲁证券	45,675,697.96	9.64%	-	-

债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月24日(基金合同生效日)至2014年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例
齐鲁证券	47,164,762.87	77.68%	39,210,524.89	87.82%

债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月24日(基金合同生效日)至2014年6月30日
-------	----------------------------	---

	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
齐鲁证券	816,800,000.00	93.66%	288,800,000.00	98.47%

6.4.8.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
齐鲁证券	41,582.83	9.64%	36,994.08	8.70%

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月24日(基金合同生效日) 至2014年6月30日
当期发生的基金应支付 的管理费	4,899,139.92	597,910.41
其中：支付销售机构的客 户维护费	6,045.20	272,472.64

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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 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、休息日,支付日期顺延。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月24日(基金合同生效日)至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	823,489.03	170,831.53

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提, 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, 经基金托管人复核后于次月首日起 5 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, 支付日期顺延。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期和上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期和上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末未投资本基金。

6.4.8.5 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 24 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	57,542,843.67	667,422.86	3,187,955.82	153,480.32

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司, 2015 年 1 月 1 日至 6 月 30 日获得的利息收入为人民币 8,121.32 元(2014 年 1 月 24 日(合同生效日)至 6 月 30 日为人民币 1,770.62 元)，2015 年 6 月 30 日结算备付金余额为人民币 4,640,077.39 元(2014 年 6 月 30 日余额为人民币 807,003.66 元)。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.9 期末（ 2015 年 6 月 30 日 ）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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 2 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 2 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 2 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	-

6.4.9.2 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
002353	杰瑞股份	2015 年 5 月 27 日	重大事项	44.35	-	-	48,200	2,119,976.84	2,137,670.00	-
000543	皖能电力	2015 年 6 月	重大事项	21.36	2015 年 7 月	19.22	10,800	218,916.00	230,688.00	-

		15 日			14 日					
002191	劲嘉股份	2015 年 6 月 18 日	重大事项	19.22	-	-	11,500	220,225.00	221,030.00	-
000066	长城电脑	2015 年 6 月 18 日	临时停牌重大事项	21.54	-	-	10,100	222,402.00	217,554.00	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.9.3.2 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正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

§ 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	37,747,051.35	0.80
	其中：股票	37,747,051.35	0.80
2	固定收益投资	275,741,818.00	5.84
	其中：债券	275,741,818.00	5.84
	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	1,785,006,597.50	37.80
	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	2,612,182,921.06	55.31
7	其他各项资产	11,994,354.69	0.25
8	合计	4,722,672,742.60	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	726,505.00	0.02
C	制造业	17,127,924.72	0.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	406,776.00	0.01
E	建筑业	875,116.92	0.02
F	批发和零售业	179,264.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	1,018,722.22	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,465,540.88	0.03
J	金融业	12,842,202.00	0.27
K	房地产业	589,652.78	0.01
L	租赁和商务服务业	841,379.40	0.02
M	科学研究和技术服务业	823,611.68	0.02
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	38,140.00	0.00
S	综合	327,936.10	0.01
	合计	37,747,051.35	0.80

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	243,400	2,419,396.00	0.05
2	002353	杰瑞股份	48,200	2,137,670.00	0.05
3	002142	宁波银行	100,000	2,115,000.00	0.04
4	603116	红蜻蜓	65,334	1,831,965.36	0.04
5	300485	赛升药业	17,372	1,164,097.72	0.02
6	600109	国金证券	46,500	1,134,600.00	0.02
7	002776	柏堡龙	20,296	823,611.68	0.02
8	600999	招商证券	30,000	793,800.00	0.02

9	002241	歌尔声学	20,032	719,148.80	0.02
10	601818	光大银行	100,000	536,000.00	0.01

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

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	000338	潍柴动力	6,238,744.57	13.63
2	000528	柳 工	6,212,821.00	13.57
3	000728	国元证券	5,268,777.00	11.51
4	000425	徐工机械	4,678,859.60	10.22
5	002142	宁波银行	4,290,125.00	9.37
6	000401	冀东水泥	4,239,785.00	9.26
7	000100	TCL 集团	3,987,558.00	8.71
8	000028	国药一致	3,232,313.00	7.06
9	000002	万 科 A	2,994,988.00	6.54
10	000750	国海证券	2,993,879.75	6.54
11	000625	长安汽车	2,993,244.84	6.54
12	002241	歌尔声学	2,967,243.60	6.48
13	000001	平安银行	2,799,520.00	6.11
14	000725	京东方 A	2,792,946.00	6.10
15	601988	中国银行	2,614,406.30	5.71
16	000400	许继电气	2,410,386.00	5.26
17	000541	佛山照明	2,407,939.00	5.26
18	002408	齐翔腾达	2,372,373.36	5.18
19	000078	海王生物	2,342,434.20	5.12
20	000417	合肥百货	2,330,857.00	5.09
21	000539	粤电力 A	2,327,266.00	5.08
22	000501	鄂武商 A	2,319,100.10	5.07
23	000012	南 玻 A	2,315,287.61	5.06
24	000550	江铃汽车	2,312,612.99	5.05
25	000333	美的集团	2,311,496.86	5.05
26	000858	五 粮 液	2,310,304.90	5.05

27	000428	华天酒店	2,310,004.89	5.05
28	000623	吉林敖东	2,309,629.98	5.04
29	000596	古井贡酒	2,307,941.29	5.04
30	000783	长江证券	2,307,661.86	5.04
31	002456	欧菲光	2,304,932.00	5.03
32	002030	达安基因	2,304,669.00	5.03
33	000402	金 融 街	2,303,175.00	5.03
34	000600	建投能源	2,301,610.00	5.03
35	000407	胜利股份	2,300,133.68	5.02
36	000792	盐湖股份	2,298,699.00	5.02
37	300058	蓝色光标	2,298,078.00	5.02
38	000651	格力电器	2,298,037.00	5.02
39	000157	中联重科	2,297,798.75	5.02
40	002029	七 匹 狼	2,296,437.50	5.02
41	000538	云南白药	2,294,745.00	5.01
42	300070	碧水源	2,293,567.11	5.01
43	000027	深圳能源	2,292,447.00	5.01
44	000566	海南海药	2,292,314.00	5.01
45	002204	大连重工	2,292,136.00	5.01
46	000061	农 产 品	2,291,932.00	5.01
47	000046	泛海控股	2,291,268.00	5.00
48	002024	苏宁云商	2,291,066.00	5.00
49	000513	丽珠集团	2,285,065.00	4.99
50	300104	乐视网	2,280,915.52	4.98
51	300002	神州泰岳	2,277,809.00	4.98
52	000060	中金岭南	2,271,992.00	4.96
53	600016	民生银行	2,271,852.00	4.96
54	000031	中粮地产	2,270,151.00	4.96
55	000009	中国宝安	2,269,239.80	4.96
56	000516	国际医学	2,269,081.00	4.96
57	000488	晨鸣纸业	2,267,861.00	4.95
58	002191	劲嘉股份	2,263,628.00	4.94
59	000540	中天城投	2,260,802.00	4.94
60	000581	威孚高科	2,260,764.00	4.94
61	300027	华谊兄弟	2,252,784.00	4.92
62	000800	一汽轿车	2,252,376.90	4.92

63	000598	兴蓉环境	2,251,772.00	4.92
64	000507	珠海港	2,251,310.00	4.92
65	000543	皖能电力	2,248,602.00	4.91
66	000876	新希望	2,247,880.00	4.91
67	000895	双汇发展	2,244,057.00	4.90
68	000572	海马汽车	2,240,635.00	4.89
69	000422	湖北宜化	2,238,389.00	4.89
70	000039	中集集团	2,237,635.00	4.89
71	002304	洋河股份	2,237,381.00	4.89
72	000088	盐田港	2,233,660.00	4.88
73	000423	东阿阿胶	2,232,729.00	4.88
74	000049	德赛电池	2,225,502.00	4.86
75	300253	卫宁软件	2,222,347.00	4.85
76	000970	中科三环	2,221,116.00	4.85
77	000616	海航投资	2,207,176.51	4.82
78	000551	创元科技	2,205,932.00	4.82
79	002450	康得新	2,183,374.00	4.77
80	002415	海康威视	2,169,427.84	4.74
81	002353	杰瑞股份	2,119,976.84	4.63
82	002202	金风科技	2,025,403.00	4.42
83	002008	大族激光	2,003,172.00	4.38
84	000063	中兴通讯	1,998,850.31	4.37
85	002385	大北农	1,997,820.00	4.36
86	000686	东北证券	1,955,965.49	4.27
87	000680	山推股份	1,493,165.50	3.26
88	600000	浦发银行	1,461,884.00	3.19
89	600109	国金证券	1,459,221.79	3.19
90	601318	中国平安	1,327,032.32	2.90
91	600028	中国石化	1,325,131.47	2.89
92	601398	工商银行	1,163,344.97	2.54
93	603116	红蜻蜓	1,156,411.80	2.53
94	000776	广发证券	997,787.00	2.18
95	000069	华侨城A	995,848.00	2.18
96	002230	科大讯飞	994,853.00	2.17
97	600031	三一重工	989,230.00	2.16
98	601818	光大银行	967,132.00	2.11

99	600030	中信证券	961,904.00	2.10
100	600406	国电南瑞	957,410.95	2.09
101	600999	招商证券	922,872.00	2.02

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	000338	潍柴动力	6,025,452.00	13.16
2	000528	柳 工	5,934,972.60	12.96
3	000728	国元证券	4,982,661.00	10.88
4	000401	冀东水泥	4,215,896.00	9.21
5	000425	徐工机械	4,003,472.60	8.74
6	000100	TCL 集团	3,995,646.00	8.73
7	000002	万 科 A	3,016,994.00	6.59
8	000028	国药一致	3,012,646.00	6.58
9	000625	长安汽车	2,982,132.66	6.51
10	000750	国海证券	2,972,234.00	6.49
11	002408	齐翔腾达	2,848,538.42	6.22
12	000541	佛山照明	2,476,163.75	5.41
13	000539	粤电力 A	2,391,949.00	5.22
14	000400	许继电气	2,366,380.00	5.17
15	000078	海王生物	2,351,540.00	5.14
16	300070	碧水源	2,344,965.00	5.12
17	002456	欧菲光	2,341,433.00	5.11
18	000333	美的集团	2,338,512.12	5.11
19	000157	中联重科	2,328,366.00	5.09
20	000858	五 粮 液	2,327,759.58	5.08
21	002241	歌尔声学	2,324,952.17	5.08
22	000428	华天酒店	2,322,474.00	5.07
23	000566	海南海药	2,318,603.00	5.06
24	000501	鄂武商 A	2,315,708.00	5.06
25	000046	泛海控股	2,315,668.00	5.06
26	000001	平安银行	2,314,624.00	5.06
27	000012	南 玻 A	2,313,130.00	5.05
28	002142	宁波银行	2,312,344.00	5.05
29	000596	古井贡酒	2,311,276.00	5.05

30	000060	中金岭南	2,307,941.40	5.04
31	000651	格力电器	2,306,033.00	5.04
32	000402	金 融 街	2,305,762.00	5.04
33	000600	建投能源	2,304,895.00	5.03
34	000417	合肥百货	2,302,151.00	5.03
35	000407	胜利股份	2,301,731.00	5.03
36	000792	盐湖股份	2,298,700.70	5.02
37	000623	吉林敖东	2,296,839.00	5.02
38	000725	京东方 A	2,295,336.00	5.01
39	000538	云南白药	2,292,105.54	5.01
40	000550	江铃汽车	2,291,568.00	5.01
41	000783	长江证券	2,288,767.00	5.00
42	002024	苏宁云商	2,281,385.00	4.98
43	000027	深圳能源	2,268,538.00	4.95
44	000513	丽珠集团	2,266,627.00	4.95
45	000800	一汽轿车	2,260,765.60	4.94
46	002030	达安基因	2,259,806.60	4.94
47	000031	中粮地产	2,256,407.00	4.93
48	300002	神州泰岳	2,256,199.26	4.93
49	300058	蓝色光标	2,247,691.76	4.91
50	002204	大连重工	2,234,317.00	4.88
51	300027	华谊兄弟	2,218,470.00	4.85
52	000516	国际医学	2,201,866.81	4.81
53	002029	七 匹 狼	2,188,506.00	4.78
54	300253	卫宁软件	2,185,630.00	4.77
55	300104	乐视网	2,177,322.00	4.76
56	000039	中集集团	2,144,054.00	4.68
57	000061	农 产 品	2,139,704.22	4.67
58	002415	海康威视	2,094,089.00	4.57
59	002385	大北农	2,090,921.00	4.57
60	000009	中国宝安	2,072,777.84	4.53
61	002191	劲嘉股份	2,072,768.00	4.53
62	002304	洋河股份	2,071,311.00	4.52
63	601988	中国银行	2,064,337.54	4.51
64	000581	威孚高科	2,048,062.00	4.47
65	000507	珠海港	2,044,809.00	4.47
66	000488	晨鸣纸业	2,035,962.78	4.45
67	000540	中天城投	2,034,146.00	4.44

68	000422	湖北宜化	2,030,108.00	4.43
69	000895	双汇发展	2,028,859.08	4.43
70	000423	东阿阿胶	2,025,092.00	4.42
71	000876	新希望	2,024,133.00	4.42
72	000598	兴蓉环境	2,017,730.00	4.41
73	000088	盐田港	2,012,300.00	4.40
74	000063	中兴通讯	2,004,116.00	4.38
75	000572	海马汽车	2,003,643.00	4.38
76	002008	大族激光	2,002,958.00	4.37
77	002202	金风科技	2,002,765.70	4.37
78	000543	皖能电力	2,001,663.14	4.37
79	002450	康得新	1,975,335.00	4.31
80	000970	中科三环	1,971,145.00	4.31
81	000551	创元科技	1,966,335.00	4.29
82	000049	德赛电池	1,941,509.00	4.24
83	000686	东北证券	1,936,797.00	4.23
84	000616	海航投资	1,923,316.00	4.20
85	300473	德尔股份	1,853,617.95	4.05
86	600000	浦发银行	1,431,514.00	3.13
87	002767	先锋电子	1,232,726.00	2.69
88	000776	广发证券	1,002,274.00	2.19
89	000069	华侨城A	1,000,616.00	2.19
90	002230	科大讯飞	994,750.00	2.17
91	000680	山推股份	988,283.00	2.16
92	600028	中国石化	986,073.81	2.15
93	600031	三一重工	976,722.00	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	262,937,286.42
卖出股票收入（成交）总额	227,932,631.54

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	1,143,318.00	0.02

2	央行票据	-	-
3	金融债券	252,280,000.00	5.35
	其中：政策性金融债	252,280,000.00	5.35
4	企业债券	7,193,500.00	0.15
5	企业短期融资券	15,125,000.00	0.32
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	275,741,818.00	5.85

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	130411	13 农发 11	1,000,000	101,080,000.00	2.14
2	120239	12 国开 39	1,000,000	100,330,000.00	2.13
3	140431	14 农发 31	500,000	50,870,000.00	1.08
4	041459072	14 桐乡城建 CP001	100,000	10,096,000.00	0.21
5	011599124	15 包钢集 SCP002	50,000	5,029,000.00	0.11

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

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,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 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	61,449.01
2	应收证券清算款	5,084,376.18
3	应收股利	—
4	应收利息	6,848,529.50
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	11,994,354.69

7.12.3 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。

7.12.4 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	002353	杰瑞股份	2,137,670.00	0.05	重大事项停牌

§ 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

103	45,101,292.37	4,603,716,857.79	99.10%	41,716,256.29	0.90%
-----	---------------	------------------	--------	---------------	-------

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	0.00	0.0000%

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（2014年1月24日）基金份额总额	434,903,358.43
本报告期期初基金份额总额	43,102,533.10
本报告期基金总申购份额	4,657,628,974.18
减：本报告期基金总赎回份额	55,298,393.20
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	4,645,433,114.08

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

2015年5月19日召开基金份额持有人大会，会议通过将万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金变更为万家新利灵活配置混合型证券投资基金，并按照相关法律法规及中国证监会的有关规定对本基金的名称、投资目标、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

基金管理人

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。

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 19 日，由《万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《万家新利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，删除城市建设相关债券投资策略，增加资产支持证券、证券公司短期公司债券、股票、权证的投资策略。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同成立即 2014 年 1 月 24 日起聘请安永华明会计师事务所为本基金提供审计服务，本报告期末改聘会计师事务所。

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

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
宏源证券	1	428,010,846.23	90.36%	389,661.65	90.36%	-
齐鲁证券	1	45,675,697.96	9.64%	41,582.83	9.64%	-

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
宏源证券	13,555,166.75	22.32%	55,327,000.00	6.34%	-	-
齐鲁证券	47,164,762.87	77.68%	816,800,000.00	93.66%	-	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48 号）的有关规定要求，我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

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

§11 影响投资者决策的其他重要信息

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

万家基金管理有限公司
2015 年 8 月 26 日