

# 万家中证创业成长指数分级证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	42

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
8.4 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.....	45
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>45</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>47</b>
11.1 备查文件目录.....	47
11.2 存放地点.....	48
11.3 查阅方式.....	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	万家中证创业成长指数分级证券投资基金		
基金简称	万家中创指数分级		
场内简称	成长分级		
基金主代码	161910		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012 年 8 月 2 日		
基金管理人	万家基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	37,539,846.73 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012 年 10 月 12 日		
下属分级基金的基金简称	成长 A	成长 B	成长分级
下属分级基金的交易代码	150090	150091	161910
报告期末下属分级基金份额总额	14,177,454.00 份	14,177,454.00 份	9,184,938.73 份

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

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

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

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

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

申请合并为万家创业成长份额后赎回。

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

## 2.2 基金产品说明

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

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		万家基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	洪渊
	联系电话	021-38909626	010-66105799
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95538 转 6、4008880800	95588
传真		021-38909627	010-66105798
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层(名义楼层 9 层)	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		中国(上海)自由贸易试验	北京市西城区复兴门内大街 55

	区浦电路 360 号 8 层(名义 楼层 9 层)	号
邮政编码	200122	100140
法定代表人	方一天	易会满

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网 网址	<a href="http://www.wjasset.com">http://www.wjasset.com</a>
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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-4,629,558.61
本期利润	-5,364,245.04
加权平均基金份额本期利润	-0.1299
本期加权平均净值利润率	-12.51%
本期基金份额净值增长率	-17.71%
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	-6,661,997.07
期末可供分配基金份额利润	-0.1775
期末基金资产净值	40,293,856.85
期末基金份额净值	1.0734
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	37.12%

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

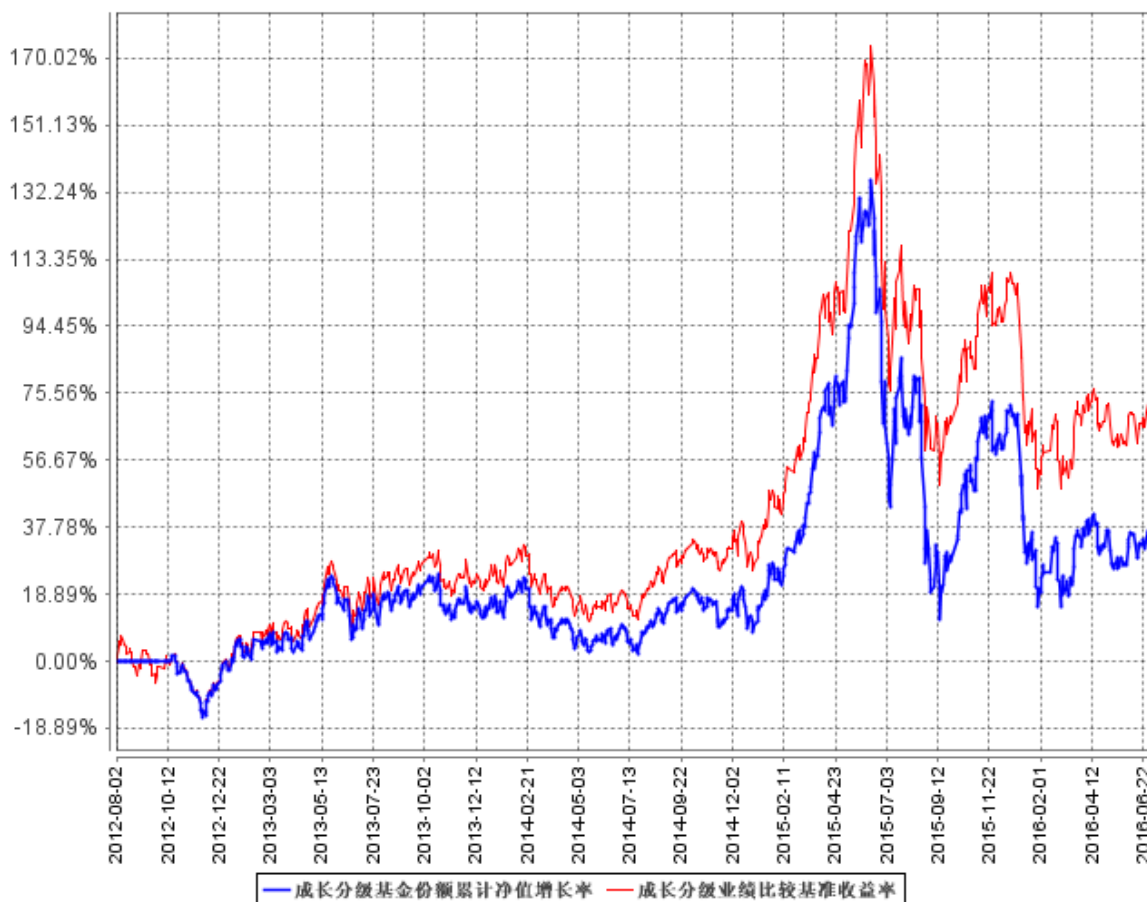
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.46%	1.62%	3.49%	1.54%	-0.03%	0.08%
过去三个月	-0.07%	1.73%	0.70%	1.54%	-0.77%	0.19%
过去六个月	-17.71%	2.63%	-14.82%	2.31%	-2.89%	0.32%
过去一年	-23.25%	3.00%	-18.64%	2.53%	-4.61%	0.47%
过去三年	25.70%	2.22%	53.02%	2.00%	-27.32%	0.22%
自基金合同生效起至今	37.12%	2.05%	73.06%	1.89%	-35.94%	0.16%

注：业绩比较基准为 95%×中证创业成长指数收益率+5%×银行同业存款利率

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

成长分级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





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

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44 号文批准设立。公司现股东为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(L0F)、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(L0F)、万家添利债券型证券投资基金(L0F)、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		
卞勇	本基金基金经理、万家 180	2015 年 8 月 18 日	-	8 年	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

	指数证券投资基金、万家中证红利指数型证券投资基金(LOF)、万家上证50交易型开放式指数证券投资基金基金经理。			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。
--	---	--	--	---

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,执行交易系统中的公平交易程序;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易,按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;对于银行间交易,按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。为保证公平交易原则的实现,通过制度规范、流程审批、系统风控参数设置等进行事前控制,通过对投资交易系统的实时监控进行事中控制,通过对异常交易的监控和分析实现事后控制。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内无下列情况:所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2016 年上半年,受经济增速放缓、出口增长疲软、人民币贬值预期等多重利空因素叠加影响,市场自开年伊始便快速下跌,成交量大幅萎缩。后随着稳增长政策趋于明朗和对利空的逐渐消化,市场在震荡筑底中伴随着小幅反弹并逐渐企稳。尽管宏观及其他实体经济数据显示国内经济仍然存在下行压力,但市场对于经济短期内继续筑底的可能已有较为充分的预期。反映在指数上,整体呈现区间震荡格局,以存量资金博弈为主,市场热点切换、板块轮动加快。报告期本基金投资标的指数——中证创业成长指数收益率为-15.70%。

本基金作为被动投资的指数基金,其投资目标是通过跟踪、复制中证创业成长指数,为投资者获取市场长期的平均收益。报告期内我们严格按照基金合同规定,原则上采取完全复制的方法进行投资管理,努力拟合标的指数,减小跟踪误差,将基金跟踪误差控制在较低范围之内。同时,本基金采用有效的量化跟踪技术,降低管理成本。导致跟踪误差的主要原因是基金频繁大额申购赎回、标的指数成分股调整、指数调出非成分股长期停牌、成分股分红和基金费用等因素。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日,本基金份额净值为 1.0734 元,本报告期份额净值增长率为-17.71%,业绩比较基准收益率-14.82%。本基金报告期内日跟踪误差为 0.24%,年化跟踪误差为 5.69%,与标的指数产生偏离的主要原因为个别交易日巨额申购赎回、成分股和非成分股长期停牌且占比较大、成份股分红、成份股定期调整、日常运作费用等产生的差异。

## 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 2016 年下半年,政策重心将持续由稳增长向调结构转变,积极财政政策和稳健的货币政策也明确了下半年资金脱虚向实的趋势。全球总体保持宽松预期,人民币的贬值压力有所缓和。在民间投资持续减速、房地产拐点隐现的背景下,基建以及国企改革或成为下半年提升市场风险偏好的驱动因素。随着供给侧改革的逐步落实以及外部环境的缓和,投资者信心将有所恢复、市场风险偏好上升,部分行业景气度高、基本面良好及估值合理的企业有望取得较好的市场表现。

本基金将继续贯彻被动投资理念,恪守基金合同规定的投资目标和投资策略,一如既往地规

范、勤勉运作, 将本基金打造为稳定有效的指数投资工具, 为基金份额持有人谋求长期、稳定回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

##### 2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论, 但不介入基金日常估值业务。

##### 3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

##### 4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金合同》的约定, 存续期内, 本基金不进行收益分配。

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

本报告期内本基金自 1 月 4 日至 6 月 30 日基金资产净值连续 91 个工作日低于五千万元。我公司已经将该基金情况向证监会报备, 下一步公司将进行持续营销, 力争基金净值尽快回升并稳定在五千万以上。

本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满两百人的情况。

## § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

本托管人依法对万家基金管理有限公司编制和披露的万家中证创业成长指数分级证券投资基金 2016 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

# § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：万家中证创业成长指数分级证券投资基金

报告截止日：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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,176,960.97	1,761,054.42
结算备付金		-	55,430.25
存出保证金		40,800.20	118,739.47
交易性金融资产	6.4.7.2	39,061,501.32	30,934,483.89
其中：股票投资		39,061,501.32	30,934,483.89
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		83,509.93	-
应收利息	6.4.7.5	412.66	444.71
应收股利		-	-
应收申购款		358.85	3,505.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-

资产总计		41,363,543.93	32,873,658.66
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	7.66
应付赎回款		747,780.43	97,063.50
应付管理人报酬		34,810.75	33,840.63
应付托管费		7,658.37	7,444.96
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	77,442.98	63,999.21
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	201,994.55	300,365.80
负债合计		1,069,687.08	502,721.76
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	29,111,966.62	19,398,669.09
未分配利润	6.4.7.10	11,181,890.23	12,972,267.81
所有者权益合计		40,293,856.85	32,370,936.90
负债和所有者权益总计		41,363,543.93	32,873,658.66

注:报告截止日 2016 年 6 月 30 日,万家中证创业成长指数分级证券投资基金之基础(以下简称“成长分级”)份额净值 1.0734 元,万家中证创业成长指数分级证券投资基金之稳健收益类(以下简称“成长 A”)份额净值 1.0249 元,万家中证创业成长指数分级证券投资基金之积极收益类(以下简称“成长 B”)份额净值 1.1219;成长分级基金份额 9,184,938.73 份,成长 A 基金份额 14,177,454.00 份,成长 B 基金份额 14,177,454.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体:万家中证创业成长指数分级证券投资基金

本报告期: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
<b>一、收入</b>		-4,559,328.68	-11,398,871.62
1.利息收入		12,667.24	38,020.79

其中：存款利息收入	6.4.7.11	12,667.24	38,020.79
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）		-3,921,597.08	15,239,838.45
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-4,140,673.56	15,003,097.30
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	219,076.48	236,741.15
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-734,686.43	-26,886,289.94
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	84,287.59	209,559.08
<b>减：二、费用</b>		804,916.36	1,395,129.27
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	212,149.83	287,999.86
2. 托管费	6.4.10.2.2	46,673.00	63,359.91
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	240,656.23	785,785.60
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	305,437.30	257,983.90
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-5,364,245.04	-12,794,000.89
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-5,364,245.04	-12,794,000.89

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家中证创业成长指数分级证券投资基金

本报告期：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）	19,398,669.09	12,972,267.81	32,370,936.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,364,245.04	-5,364,245.04
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）	9,713,297.53	3,573,867.46	13,287,164.99
其中：1.基金申购款	59,127,709.83	21,906,059.74	81,033,769.57
2.基金赎回款	-49,414,412.30	-18,332,192.28	-67,746,604.58
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）	29,111,966.62	11,181,890.23	40,293,856.85
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）	24,561,092.40	2,612,876.58	27,173,968.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-12,794,000.89	-12,794,000.89
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	56,319,949.61	73,481,917.63	129,801,867.24
其中：1.基金申购款	162,638,932.56	138,597,240.42	301,236,172.98
2.基金赎回款	-106,318,982.95	-65,115,322.79	-171,434,305.74
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	80,881,042.01	63,300,793.32	144,181,835.33

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  
基金管理人负责人

方一天  
主管会计工作负责人

陈广益  
会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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

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

投资者可选择将其场内申购的万家创业成长份额按 1:1 的比例分拆成风险和收益特性不同的万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额。投资者可按 1:1 的配比将其持有的万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额申请合并为万家创业成长份额后赎回。投资者在场外申购的万家创业成长份额不得申请进行分拆（《基金合同》另有规定的除外），但可通过跨系统转托管至场内并申请将其按 1:1 的比例分拆为万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额。

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

万家创业成长份额的基金份额净值将相应调整。

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

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

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

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制, 同时, 对于在具体会计核算和信息披露方面, 也参考了中国证券投资基金业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 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 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的说明

本半年度报告所采用的会计政策、会计估计与上年度报告相一致。

### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错。

### 6.4.6 税项

#### 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	2,176,960.97
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	2,176,960.97

### 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	38,611,872.36	39,061,501.32	449,628.96

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	38,611,872.36	39,061,501.32	449,628.96

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	396.19
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	-
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	16.47
合计	412.66

### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	77,442.98
银行间市场应付交易费用	-
合计	77,442.98

**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	2,818.25
应付信息披露费	89,505.78
应付审计费	29,835.26
应付指数使用费	50,000.00
上市费	29,835.26
合计	201,994.55

**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	24,788,136.98	19,398,669.09
本期申购	2,449.60	1,917.01
本期赎回(以“-”号填列)	-197,840.19	-154,825.00
2016年1月4日 基金拆分/份额折算前	24,592,746.39	19,245,761.10
基金拆分/份额折算变动份额	224,650.34	-
本期申购	76,242,171.79	59,125,792.82
本期赎回(以“-”号填列)	-63,519,721.79	-49,259,587.30
本期末	37,539,846.73	29,111,966.62

注：1. 根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所（以下简称“深交所”）和中国证券登记结算有限责任公司的规定，本基金以2013年1月4日为份额折算基准日，对万家创业成长份额的场外份额、场内份额以及万家创业成长A份额实施定期份额折算。

2. 根据《基金合同》规定，投资者可申购、赎回万家创业成长份额，万家创业成长A份额和万家

创业成长 B 份额只可在深圳证券交易所上市交易，因此上表不再单独披露万家创业成长 A 份额和万家创业成长 B 份额的情况。

3. 申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,473,161.51	14,445,429.32	12,972,267.81
本期利润	-4,629,558.61	-734,686.43	-5,364,245.04
本期基金份额交易产生的变动数	-559,276.95	4,133,144.41	3,573,867.46
其中：基金申购款	-7,240,838.85	29,146,898.59	21,906,059.74
基金赎回款	6,681,561.90	-25,013,754.18	-18,332,192.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,661,997.07	17,843,887.30	11,181,890.23

#### 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	11,271.95
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,004.55
其他	390.74
合计	12,667.24

注：上表中其他为直销申购款利息收入及证券结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	76,660,582.59
减：卖出股票成本总额	80,801,256.15
买卖股票差价收入	-4,140,673.56

**6.4.7.13 债券投资收益**

本基金本报告期末未持有债券投资。

**6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	219,076.48
基金投资产生的股利收益	-
合计	219,076.48

**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	-734,686.43
——股票投资	-734,686.43
——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	-734,686.43

**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	84,272.89



转出费收入	14.70
合计	84,287.59

#### 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	240,656.23
银行间市场交易费用	-
合计	240,656.23

#### 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	29,835.26
信息披露费	89,505.78
上市费	29,835.26
银行汇划费用	261.00
指数使用费	150,000.00
债券帐户维护费	6,000.00
合计	305,437.30

注：1. 在通常情况下，指数许可使用基点费按前一日基金资产净值的 0.02% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的指数许可使用基点费

E 为前一日基金资产净值

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

2. 其他为上交所 CFCA 数字证书服务费。

### 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者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司	基金管理人，基金销售机构
工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人，基金代销机构
中泰证券股份有限公司（“中泰证券”）	基金管理人股东，基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	152,665,014.92	91.79%	525,056,807.28	92.65%

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本报告期间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

本报告期间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

本报告期间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 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	136,834.38	91.69%	70,508.80	91.05%

关联方名称	上年度可比期间 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
中泰证券	459,634.89	92.55%	386,046.53	92.14%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	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管理费	212,149.83	287,999.86
其中：支付销售机构的客户维护费	18,905.38	17,778.70

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

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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	46,673.00	63,359.91

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

$$H = E \times 0.22\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

成长 A				
关联方名称	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例

份额单位：份

成长 B				
关联方名称	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例

份额单位：份

成长分级				
关联方名称	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
中泰证券股份有 限公司	1.00	0.00%	1.00	0.00%

##### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
工商银行	2,176,960.97	11,271.95	13,160,704.64	35,816.95

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,2016年1月1日至2016年6月30日获得的利息收入为人民币1,004.55元,2016年6月30日结算备付金余额为人民币0;2015年1月1日至2015年6月30日获得的利息收入为1,828.68元,2015年6月30日结算备付金余额为人民币100,616.20元。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

根据本基金基金合同,本基金不进行利润分配。

#### 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

报告期末本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002280	联络互动	2016年4月25日	重大事项停牌	19.71	-	-	40,050	905,226.13	789,385.50	-
300208	恒顺众昇	2016年5月18日	重大事项停牌	13.87	2016年7月8日	15.26	28,400	466,120.04	393,908.00	-
002373	千方科技	2016年5月12日	重大事项停牌	14.94	2016年8月16日	16.43	21,228	364,283.42	317,146.32	-
000553	沙隆达A	2015年8月5日	重大事项停牌	9.84	-	-	28,536	517,827.73	280,794.24	-
300032	金龙机电	2016年6月28日	重大事项停牌	20.10	2016年7月7日	19.80	11,700	245,390.61	235,170.00	-

600173	卧龙地产	2016年4月25日	重大事项停牌	8.28	-	-	26,700	189,317.11	221,076.00	-
002555	三七互娱	2016年3月10日	重大事项停牌	18.10	2016年8月16日	19.91	9,400	226,527.33	170,140.00	-
002071	长城影视	2016年6月15日	重大事项停牌	13.64	-	-	11,800	187,187.80	160,952.00	-
300450	先导智能	2016年3月14日	重大事项停牌	37.81	2016年7月20日	41.59	2,700	82,074.10	102,087.00	-
000546	金圆股份	2016年6月16日	重大事项停牌	10.54	2016年7月12日	10.95	8,600	85,140.00	90,644.00	-
000018	神州长城	2016年6月24日	重大事项停牌	12.17	2016年7月11日	12.88	7,340	82,517.83	89,327.80	-
600843	上工申贝	2016年2月18日	重大事项停牌	13.71	2016年7月26日	15.08	4,800	86,090.66	65,808.00	-

注:本基金截至2016年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末2016年6月30日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016年6月30日止,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人将风险管理融入各业务层面,建立了三道防线:以各岗位目标责任制为基础,

形成第一道防线；通过相关部门、相关岗位之间相互监督制衡，形成第二道防线；由监察稽核部门、督察长对各岗位、各部门、各机构、各项业务实施监督反馈，形成第三道防线。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	--------	--------	--------	-------	-------	-----	----

2016 年 6 月 30 日			年				
资产							
银行存款	2,176,960.97	-	-	-	-	-	2,176,960.97
存出保证金	40,800.20	-	-	-	-	-	40,800.20
交易性金融资产	-	-	-	-	-	39,061,501.32	39,061,501.32
应收证券清算款	-	-	-	-	-	83,509.93	83,509.93
应收利息	-	-	-	-	-	412.66	412.66
应收申购款	-	-	-	-	-	358.85	358.85
资产总计	2,217,761.17	-	-	-	-	39,145,782.76	41,363,543.93
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	747,780.43	747,780.43
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	34,810.75	34,810.75
应付托管费	-	-	-	-	-	7,658.37	7,658.37
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	77,442.98	77,442.98
其他负债	-	-	-	-	-	201,994.55	201,994.55
负债总计	-	-	-	-	-	1,069,687.08	1,069,687.08
利率敏感度缺口	2,217,761.17	-	-	-	-	38,076,095.68	40,293,856.85
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	1,761,054.42	-	-	-	-	-	1,761,054.42
结算备付金	55,430.25	-	-	-	-	-	55,430.25
存出保证金	118,739.47	-	-	-	-	-	118,739.47
交易性金融资产	-	-	-	-	-	30,934,483.89	30,934,483.89
应收利息	-	-	-	-	-	444.71	444.71
应收申购款	-	-	-	-	-	3,505.92	3,505.92
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,935,224.14	-	-	-	-	30,938,434.52	32,873,658.66
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	7.66	7.66
应付赎回款	-	-	-	-	-	97,063.50	97,063.50
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	33,840.63	33,840.63
应付托管费	-	-	-	-	-	7,444.96	7,444.96
应付交易费用	-	-	-	-	-	63,999.21	63,999.21
其他负债	-	-	-	-	-	300,365.80	300,365.80
负债总计	-	-	-	-	-	502,721.76	502,721.76
利率敏感度缺口	1,935,224.14	-	-	-	-	30,435,712.76	32,370,936.90

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



#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	39,061,501.32	96.94	30,934,483.89	95.56
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	39,061,501.32	96.94	30,934,483.89	95.56

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

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	若股票基准指数发生变动而其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年6月 30日）	上年度末（2015年12月 31日）
	股票基准指数下降 100 个基点	-498,096.34	-375,023.62
股票基准指数上升 100 个基点	498,096.34	375,023.62	

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

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	39,061,501.32	94.43
	其中：股票	39,061,501.32	94.43
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	2,176,960.97	5.26
7	其他各项资产	125,081.64	0.30
8	合计	41,363,543.93	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	470,932.44	1.17
B	采矿业	-	-
C	制造业	20,395,056.37	50.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	374,075.00	0.93
E	建筑业	854,779.80	2.12
F	批发和零售业	913,162.00	2.27
G	交通运输、仓储和邮政业	91,037.00	0.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,591,927.96	21.32
J	金融业	3,605,180.25	8.95
K	房地产业	221,076.00	0.55
L	租赁和商务服务业	1,518,538.82	3.77
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	404,388.00	1.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	922,339.68	2.29
R	文化、体育和娱乐业	699,008.00	1.73
S	综合	-	-
	合计	39,061,501.32	96.94

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 7.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300059	东方财富	79,103	1,756,086.60	4.36

2	300104	乐视网	33,084	1,750,474.44	4.34
3	002450	康得新	95,468	1,632,502.80	4.05
4	002736	国信证券	90,925	1,568,456.25	3.89
5	002415	海康威视	67,761	1,454,151.06	3.61
6	002673	西部证券	51,800	1,339,548.00	3.32
7	300017	网宿科技	17,426	1,171,027.20	2.91
8	002466	天齐锂业	21,745	928,294.05	2.30
9	002202	金风科技	58,500	885,105.00	2.20
10	002280	联络互动	40,050	789,385.50	1.96
11	002252	上海莱士	20,600	776,208.00	1.93
12	002500	山西证券	42,100	697,176.00	1.73
13	002475	立讯精密	34,574	679,379.10	1.69
14	002183	怡亚通	45,800	655,856.00	1.63
15	300072	三聚环保	22,032	608,964.48	1.51
16	002085	万丰奥威	33,880	582,397.20	1.45
17	002572	索菲亚	9,734	545,298.68	1.35
18	300144	宋城演艺	21,600	538,056.00	1.34
19	300253	卫宁健康	20,167	498,124.90	1.24
20	002400	省广股份	35,114	496,160.82	1.23
21	002508	老板电器	13,475	495,475.75	1.23
22	300136	信维通信	23,240	487,110.40	1.21
23	002179	中航光电	10,969	475,177.08	1.18
24	300498	温氏股份	13,002	470,932.44	1.17
25	300296	利亚德	14,100	446,406.00	1.11
26	300156	神雾环保	21,600	444,528.00	1.10
27	002573	清新环境	23,900	404,388.00	1.00
28	300244	迪安诊断	12,116	399,585.68	0.99
29	300208	恒顺众昇	28,400	393,908.00	0.98
30	002074	国轩高科	9,800	386,806.00	0.96
31	002595	豪迈科技	17,649	377,159.13	0.94
32	300101	振芯科技	13,456	375,826.08	0.93
33	300367	东方网力	14,950	371,208.50	0.92
34	002221	东华能源	30,200	368,138.00	0.91
35	002027	分众传媒	22,200	366,522.00	0.91
36	300207	欣旺达	14,100	361,947.00	0.90
37	000048	康达尔	10,100	360,873.00	0.90
38	300274	阳光电源	14,400	351,360.00	0.87
39	000957	中通客车	7,600	345,040.00	0.86
40	002195	二三四五	27,900	342,891.00	0.85

41	300115	长盈精密	16,469	339,261.40	0.84
42	002268	卫士通	9,300	332,382.00	0.82
43	300199	翰宇药业	16,300	331,705.00	0.82
44	300182	捷成股份	19,100	326,801.00	0.81
45	002517	恺英网络	7,200	317,376.00	0.79
46	002373	千方科技	21,228	317,146.32	0.79
47	300267	尔康制药	21,764	311,660.48	0.77
48	300347	泰格医药	10,600	307,612.00	0.76
49	002019	亿帆鑫富	19,697	302,939.86	0.75
50	300085	银之杰	9,900	296,010.00	0.73
51	300118	东方日升	15,000	282,900.00	0.70
52	002437	誉衡药业	32,400	281,880.00	0.70
53	000553	沙隆达 A	28,536	280,794.24	0.70
54	002624	完美环球	7,300	275,575.00	0.68
55	002099	海翔药业	28,200	268,464.00	0.67
56	300297	蓝盾股份	15,600	248,508.00	0.62
57	300252	金信诺	7,500	248,475.00	0.62
58	600856	中天能源	12,700	245,999.00	0.61
59	002640	跨境通	13,600	239,632.00	0.59
60	300032	金龙机电	11,700	235,170.00	0.58
61	300011	鼎汉技术	9,700	227,659.00	0.56
62	600173	卧龙地产	26,700	221,076.00	0.55
63	002635	安洁科技	5,700	218,766.00	0.54
64	600763	通策医疗	6,900	215,142.00	0.53
65	002411	必康股份	11,400	203,490.00	0.51
66	002581	未名医药	7,400	201,650.00	0.50
67	002036	联创电子	8,300	194,303.00	0.48
68	300219	鸿利光电	12,200	190,076.00	0.47
69	300100	双林股份	4,300	188,383.00	0.47
70	002717	岭南园林	6,000	179,160.00	0.44
71	300222	科大智能	6,400	175,296.00	0.44
72	600273	嘉化能源	19,500	173,745.00	0.43
73	002555	三七互娱	9,400	170,140.00	0.42
74	002169	智光电气	7,100	161,525.00	0.40
75	002071	长城影视	11,800	160,952.00	0.40
76	002658	雪迪龙	9,072	157,762.08	0.39
77	300376	易事特	5,600	152,824.00	0.38
78	000928	中钢国际	11,900	149,702.00	0.37
79	002504	弘高创意	6,100	147,620.00	0.37

80	002568	百润股份	6,700	147,400.00	0.37
81	002542	中化岩土	19,400	147,052.00	0.36
82	002323	雅百特	10,900	141,918.00	0.35
83	002602	世纪华通	7,600	140,828.00	0.35
84	600310	桂东电力	15,600	128,076.00	0.32
85	002669	康达新材	5,100	123,420.00	0.31
86	002270	法因数控	7,300	118,552.00	0.29
87	600891	秋林集团	9,200	117,484.00	0.29
88	600814	杭州解百	10,500	111,195.00	0.28
89	600876	洛阳玻璃	4,000	108,480.00	0.27
90	002107	沃华医药	6,700	107,200.00	0.27
91	300450	先导智能	2,700	102,087.00	0.25
92	601567	三星医疗	6,900	101,775.00	0.25
93	300482	万孚生物	1,800	95,310.00	0.24
94	002357	富临运业	5,900	91,037.00	0.23
95	000546	金圆股份	8,600	90,644.00	0.22
96	000018	神州长城	7,340	89,327.80	0.22
97	300443	金雷风电	1,300	86,723.00	0.22
98	002054	德美化工	7,800	84,474.00	0.21
99	600981	汇鸿集团	9,100	76,713.00	0.19
100	600381	ST 春天	4,900	67,081.00	0.17
101	600843	上工申贝	4,800	65,808.00	0.16
102	300436	广生堂	1,000	61,420.00	0.15

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300059	东方财富	4,231,887.86	13.07
2	002450	康得新	3,551,806.96	10.97
3	002415	海康威视	3,351,640.00	10.35
4	002673	西部证券	2,776,045.05	8.58

5	002736	国信证券	2,438,810.13	7.53
6	300017	网宿科技	2,363,172.80	7.30
7	300027	华谊兄弟	2,352,523.00	7.27
8	002202	金风科技	2,222,547.00	6.87
9	002252	上海莱士	1,847,903.00	5.71
10	002292	奥飞娱乐	1,806,394.00	5.58
11	300315	掌趣科技	1,702,627.00	5.26
12	300124	汇川技术	1,580,155.48	4.88
13	002475	立讯精密	1,412,090.10	4.36
14	002280	联络互动	1,338,762.00	4.14
15	600682	南京新百	1,263,321.50	3.90
16	002500	山西证券	1,173,569.00	3.63
17	002400	省广股份	1,151,721.49	3.56
18	300253	卫宁健康	1,146,661.90	3.54
19	300136	信维通信	1,124,481.00	3.47
20	300324	旋极信息	1,119,672.50	3.46
21	300072	三聚环保	1,102,623.41	3.41
22	300367	东方网力	1,093,087.00	3.38
23	002466	天齐锂业	1,061,319.85	3.28
24	002572	索菲亚	959,546.80	2.96
25	002019	亿帆鑫富	958,770.50	2.96
26	002508	老板电器	955,676.00	2.95
27	002179	中航光电	912,811.74	2.82
28	300244	迪安诊断	905,696.46	2.80
29	600565	迪马股份	899,458.00	2.78
30	002104	恒宝股份	891,509.00	2.75
31	600687	刚泰控股	889,041.00	2.75
32	300001	特锐德	866,914.75	2.68
33	300207	欣旺达	851,015.00	2.63
34	300101	振芯科技	828,567.00	2.56
35	002074	国轩高科	825,167.00	2.55
36	002271	东方雨虹	822,263.66	2.54
37	300182	捷成股份	819,545.00	2.53
38	300208	恒顺众昇	813,402.00	2.51
39	300055	万邦达	808,636.00	2.50
40	300267	尔康制药	802,901.68	2.48

41	002595	豪迈科技	798,223.00	2.47
42	002437	誉衡药业	733,720.00	2.27
43	300274	阳光电源	727,530.00	2.25
44	002047	宝鹰股份	700,895.34	2.17
45	300296	利亚德	693,838.00	2.14
46	300347	泰格医药	677,506.32	2.09
47	300115	长盈精密	672,239.00	2.08
48	600562	国睿科技	668,844.00	2.07
49	300216	千山药机	651,247.47	2.01

#### 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	300059	东方财富	3,329,328.06	10.28
2	002450	康得新	3,134,208.52	9.68
3	300027	华谊兄弟	3,019,270.88	9.33
4	002415	海康威视	2,825,494.39	8.73
5	300017	网宿科技	2,115,451.00	6.54
6	300315	掌趣科技	2,002,865.97	6.19
7	300124	汇川技术	1,974,161.74	6.10
8	002292	奥飞娱乐	1,946,959.58	6.01
9	002673	西部证券	1,903,799.42	5.88
10	002202	金风科技	1,854,426.57	5.73
11	002252	上海莱士	1,522,980.00	4.70
12	002736	国信证券	1,420,977.54	4.39
13	600682	南京新百	1,214,674.00	3.75
14	300324	旋极信息	1,203,094.96	3.72
15	600687	刚泰控股	1,151,772.88	3.56
16	600565	迪马股份	1,091,121.75	3.37
17	002500	山西证券	1,070,503.51	3.31
18	002271	东方雨虹	1,067,803.51	3.30
19	002104	恒宝股份	1,045,629.29	3.23
20	300072	三聚环保	1,042,128.90	3.22
21	300001	特锐德	1,040,205.50	3.21
22	300055	万邦达	1,020,671.00	3.15
23	002475	立讯精密	1,000,179.50	3.09



24	002400	省广股份	995,152.40	3.07
25	300253	卫宁健康	981,053.00	3.03
26	300136	信维通信	976,577.00	3.02
27	002219	恒康医疗	969,439.62	2.99
28	002572	索菲亚	926,100.00	2.86
29	002047	宝鹰股份	900,707.00	2.78
30	002217	合力泰	891,432.00	2.75
31	002508	老板电器	891,081.87	2.75
32	300216	千山药机	876,301.20	2.71
33	300367	东方网力	860,969.74	2.66
34	600562	国睿科技	853,198.20	2.64
35	002179	中航光电	828,389.55	2.56
36	002019	亿帆鑫富	760,349.21	2.35
37	300244	迪安诊断	746,720.00	2.31
38	300207	欣旺达	732,201.00	2.26
39	002130	沃尔核材	723,343.75	2.23
40	300101	振芯科技	722,341.23	2.23
41	000902	新洋丰	719,688.20	2.22
42	300267	尔康制药	715,965.64	2.21
43	300054	鼎龙股份	709,479.00	2.19
44	002280	联络互动	702,511.47	2.17
45	300182	捷成股份	701,496.00	2.17
46	002595	豪迈科技	700,200.05	2.16
47	002074	国轩高科	697,220.00	2.15
48	300274	阳光电源	671,491.00	2.07
49	300098	高新兴	647,813.50	2.00

注:卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票,“卖出金额”按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	89,662,960.01
卖出股票收入(成交)总额	76,660,582.59

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

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

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投资。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

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

根据基金合同，本基金暂不可投资于股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同，本基金暂不可投资于国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的,在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.12.2

基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	40,800.20
2	应收证券清算款	83,509.93
3	应收股利	-
4	应收利息	412.66
5	应收申购款	358.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	125,081.64

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	002280	联络互动	789,385.50	1.96	重大事项停牌

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
成长 A	219	64,737.23	7,283,919.00	51.38%	6,893,535.00	48.62%
成长 B	1,703	8,324.99	1,057,717.00	7.46%	13,119,737.00	92.54%
成长分级	1,520	6,042.72	459,102.89	5.00%	8,725,835.84	95.00%

合计	3,442	10,906.41	8,800,738.89	23.44%	28,739,107.84	76.56%
----	-------	-----------	--------------	--------	---------------	--------

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

### 成长 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	李怡名	2,300,000.00	16.22%
2	黄松友	1,250,000.00	8.82%
3	嘉实资本—民生银行—嘉实资本惠金 33 号专项资产管理计划	1,000,000.00	7.05%
4	嘉实资本—中国银行—粤享财富 3 号—嘉实资本分级基金 A 份额	997,994.00	7.04%
5	嘉实资本—建设银行—嘉实资本绝对收益策略 1 号专项资产管理	856,800.00	6.04%
6	华泰长城资本管理有限公司	766,130.00	5.40%
7	上海明泐投资管理有限公司—明泐全天候一号基金	655,941.00	4.63%
8	华安基金—招商银行—光大证券股份有限公司	640,800.00	4.52%
9	华泰期货有限公司—华泰期货 1 期资产管理计划	574,900.00	4.06%
10	郑文颖	399,199.00	2.82%

### 成长 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	李筱丽	8,000,000.00	5.64%
2	刁成芳	687,500.00	4.85%
3	济南市人民政府国有资产监督管理委员会	500,000.00	3.53%
4	上海明泐投资管理有限公司—明泐CTA 一号基金	453,810.00	3.20%
5	耿丽华	445,078.00	3.14%
6	杨建华	361,292.00	2.55%
7	王鸿	360,100.00	2.54%
8	彭伟明	360,074.00	2.54%
9	李育林	326,746.00	2.30%
10	李新民	300,000.00	2.12%

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	成长 A	-	-
	成长 B	-	-
	成长分级	63,835.57	0.70%
	合计	63,835.57	0.17%

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

**§ 9 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	成长 A	成长 B	成长分级
基金合同生效日（2012 年 8 月 2 日）	74,051,084.00	74,051,085.00	264,321,715.23
基金份额总额			
本报告期期初基金份额总额	7,567,101.00	7,567,101.00	9,653,934.98
本报告期基金总申购份额	-	-	76,244,621.39
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	63,717,561.98
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	6,610,353.00	6,610,353.00	-12,996,055.66
本报告期末基金份额总额	14,177,454.00	14,177,454.00	9,184,938.73

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

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

基金托管人：

报告期内本基金基金托管人的专门托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期期内基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内, 本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	1	152,665,014.92	91.79%	136,834.38	91.69%	-
华宝证券	1	13,658,527.68	8.21%	12,405.98	8.31%	-

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。

3、基金专用交易席位的变更情况:

本期席位未变更。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

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

## § 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中证创业成长指数分级证券投资基金发行及募集的文件。
- 2、《万家中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家中证创业成长指数分级证券投资基金托管协议》。
- 4、万家基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。

5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金净值、季度报告、更新招募说明书及其他临时公告。

6、万家中证创业成长指数分级证券投资基金 2016 年半年度报告原文。

### **11.2 存放地点**

基金管理人的办公场所，并登载于基金管理人网站：[www.wjasset.com](http://www.wjasset.com)

### **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