

# 万家行业优选混合型证券投资基金(LOF)

## 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：交通银行股份有限公司

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、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。

基金托管人交通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、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 2018 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>6</b>  |
| 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         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>                 | <b>8</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 8         |
| 3.2 基金净值表现                              | 8         |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>10</b> |
| 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              | 11        |
| 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                 | 13        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 14        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>15</b> |
| 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        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>               | <b>16</b> |
| 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        |
| <b>§7 投资组合报告.....</b>                      | <b>37</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                        | 37        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 37        |
| 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.....     | 38        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 39        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 41        |
| 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>44</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 44        |
| 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.....              | 44        |
| 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.....     | 44        |
| <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>45</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 45        |
| 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.....      | 45        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 45        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                        | 45        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 45        |
| 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 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>             | <b>47</b> |
| 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.....    | 47        |

**§12 备查文件目录.....48**

12.1 备查文件目录.....48

12.2 存放地点.....48

12.3 查阅方式.....48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                       |
|--------------|-----------------------|
| 基金名称         | 万家行业优选混合型证券投资基金 (LOF) |
| 基金简称         | 万家行业优选                |
| 场内简称         | 万家优选                  |
| 基金主代码        | 161903                |
| 基金运作方式       | 上市契约型开放式 (LOF)        |
| 基金合同生效日      | 2005 年 7 月 15 日       |
| 基金管理人        | 万家基金管理有限公司            |
| 基金托管人        | 交通银行股份有限公司            |
| 报告期末基金份额总额   | 156,751,059.46 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         | 2005 年 8 月 15 日       |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                  |
|--------|------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金主要投资景气行业或预期景气度向好的行业股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。            |
| 投资策略   | 本基金采取优选行业和精选个股相结合的主动投资管理模式，并适度动态配置大类资产。                          |
| 业绩比较基准 | $80\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 20\% \times \text{上证国债指数收益率}$ |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金，风险低于股票型基金，高于货币市场基金、债券型基金，属于中等风险、中等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           | 交通银行股份有限公司        |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 兰剑                   | 陆志俊               |
|         | 联系电话 | 021-38909626         | 95559             |
|         | 电子邮箱 | lanj@wjasset.com     | luzj@bankcomm.com |
| 客户服务电话  |      | 95538 转 6、4008880800 | 95559             |
| 传真      |      | 021-38909627         | 021-62701216      |
| 注册地址    |      | 中国（上海）自由贸易试验         | 上海市浦东新区银城中路 188   |

|       |                                      |                   |
|-------|--------------------------------------|-------------------|
|       | 区浦电路 360 号 8 层(名义楼层 9 层)             | 号                 |
| 办公地址  | 中国(上海)自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层(名义楼层 9 层) | 上海市浦东新区银城中路 188 号 |
| 邮政编码  | 200122                               | 200120            |
| 法定代表人 | 方一天                                  | 彭纯                |

## 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)自由贸易实验区浦电路 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       | -8,276,235.82                          |
| 本期利润          | -1,246,045.78                          |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0079                                |
| 本期加权平均净值利润率   | -0.97%                                 |
| 本期基金份额净值增长率   | -1.85%                                 |
| 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      | -663,224.42                            |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0042                                |
| 期末基金资产净值      | 115,713,502.75                         |
| 期末基金份额净值      | 0.7382                                 |
| 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   | 229.50%                                |

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

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

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

#### 3.2 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

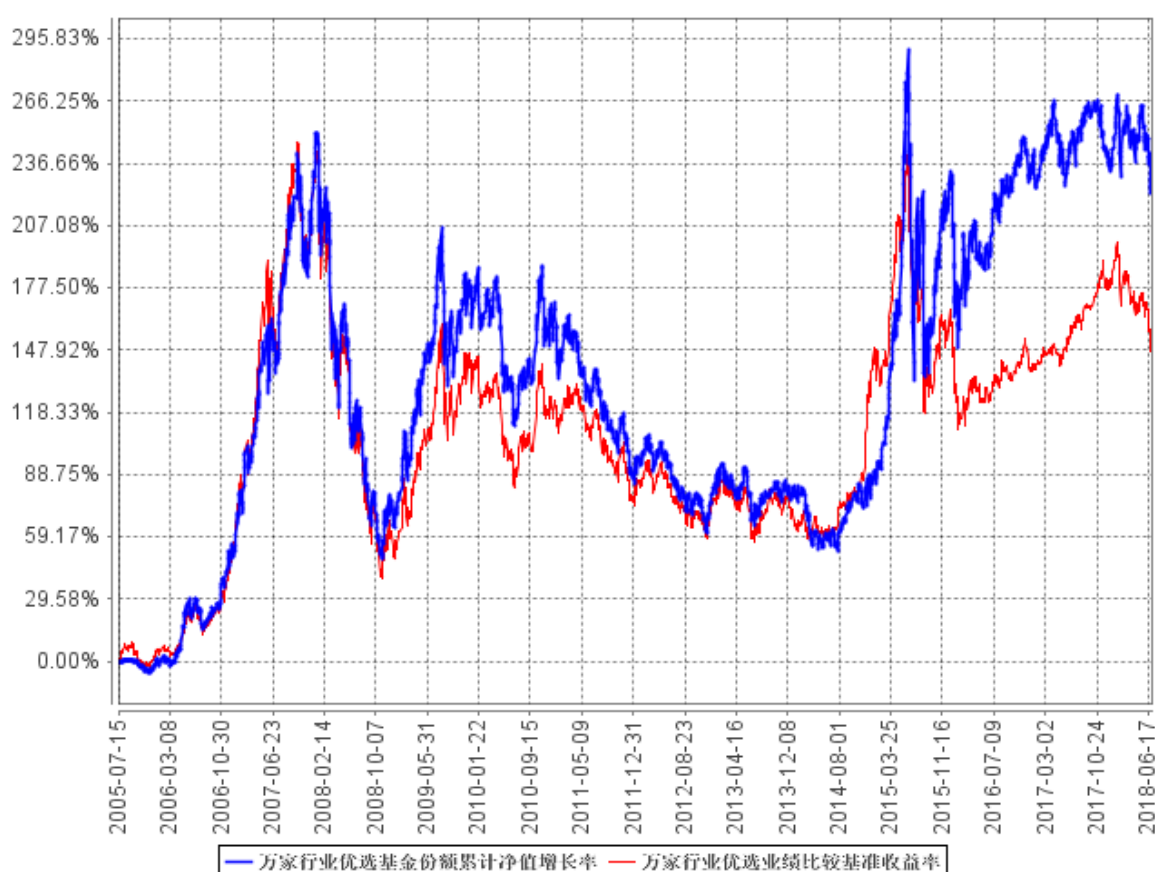
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | -6.08%   | 1.31%       | -6.07%     | 1.03%         | -0.01% | 0.28% |
| 过去三个月      | -6.40%   | 1.20%       | -7.70%     | 0.91%         | 1.30%  | 0.29% |
| 过去六个月      | -1.85%   | 1.20%       | -9.83%     | 0.92%         | 7.98%  | 0.28% |
| 过去一年       | -5.07%   | 0.97%       | -2.64%     | 0.76%         | -2.43% | 0.21% |
| 过去三年       | 9.69%    | 1.74%       | -14.81%    | 1.19%         | 24.50% | 0.55% |
| 自基金合同生效起至今 | 229.50%  | 1.59%       | 152.15%    | 1.41%         | 77.35% | 0.18% |



注：基金业绩比较基准增长率=80%×沪深 300 指数收益率+20%×上证国债指数收益率

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

万家行业优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：本基金于 2013 年 7 月 11 日召开持有人大会，会议审议通过了《关于修改万家公用事业行业股票型证券投资基金（LOF）基金合同有关事项的议案》，该议案已于 2013 年 8 月 28 日通过并完成向中国证监会的备案。根据基金份额持有人大会决议，原“万家公用事业行业股票型证券投资基金（LOF）”更名为“万家行业优选股票型证券投资基金（LOF）”。更名后基金的建仓期为持有人大会决议生效日起 6 个月。建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同要求。2015 年 7 月 31 日，“万家行业优选股票型证券投资基金（LOF）”更名为“万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）”。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 |        |                                                                                                                                                                               |
| 孙远慧 | 本基金基金经理、万家增强收益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基金经理。                                          | 2016 年 3 月 23 日 | -    | 8 年    | 2010 年在长城基金担任研究员职务，2012 年在中欧基金先后担任研究员、基金经理助理、投资经理等职务，2016 年 2 月进入我公司，从事投资研究工作。现任投资研究部副总监。                                                                                     |
| 高源  | 本基金基金经理、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家消费成长股票型证券投资基金、万家潜力价值灵活配置混合型证券投资基金、万家新机遇龙头企业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 | 2018 年 3 月 15 日 | -    | 12 年   | 2005 年 10 月至 2007 年 3 月在光大证券股份有限公司研究所工作，担任研究员；2007 年 4 月至 2010 年 6 月在安信证券股份有限公司工作，担任研究部高级研究员；于 2010 年 7 月至 2017 年 4 月在申万菱信基金管理有限公司工作，先后担任投资管理部高级研究员、基金经理等职。2017 年 4 月进入我公司工作。 |

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律、

法规和监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金持有人谋取最大利益,没有损害基金持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理办法》和《异常交易监控及报告管理办法》等规章制度,涵盖了研究、授权、投资决策和交易执行等投资管理活动的各个环节,确保公平对待不同投资组合,防范导致不公平交易以及利益输送的异常交易发生。

公司制订了明确的投资授权制度,并建立了统一的投资管理平台,确保不同投资组合获得公平的投资决策机会。实行集中交易制度,对于交易所公开竞价交易,执行交易系统内的公平交易程序;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易,按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;对于银行间交易,按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。为保证公平交易原则的实现,通过制度规范、流程审批、系统风控参数设置等进行事前控制,通过对投资交易系统的实时监控进行事中控制,通过对异常交易的监控和分析实现事后控制。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年上半年,宏观数据走出 U 字型, PMI 和 PPI 数据显示年初经济处在放缓的过程中,而三 四月份前后各项指标(包括企业盈利数据)开始触底上升,显示经济小周期企稳。市场方面:一 季度,股票市场在经历年初的大金融白马行情之后,风格向中小创和成长股偏移;而在二季度末期,由于贸易战等因素对市场的负面压力,指数出现了较大幅度的下跌,消费股相对来说较为抗跌。

目前来看,我们认为市场仍然需要一段时间来消化贸易战等因素带来的负面情绪,包括对未来经济增速和企业盈利水平的不确定性的担忧。经济小周期可能在三季度见顶,之后市场的走势

一定程度上受到宏观政策的影响较大。目前货币和财政政策都有环比提升的迹象，从央行的表态来看，政府也在帮助银行信贷资金寻找投资项目从而引导信贷资金流入实体经济。因此我们认为有了政府放松政策做为经济托底的保障，后续经济增长失速的风险较小。

#### 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 0.7382 元；本报告期基金份额净值增长率为-1.85%，业绩比较基准收益率为-9.83%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从价值投资者的角度来看，市场在经历前期大幅下跌后，整体的估值水平并不高，已经进入价值投资的区间。我们下阶段的投资重点将主要集中在医药、白酒等我们认为盈利确定性较高的个股、部分我们认为估值和盈利性相匹配的成长股，以及在三季度初的中上游行业旺季中寻找一些投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

##### 2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不介入基金日常估值业务。

##### 3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

##### 4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中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

根据基金合同规定：“基金收益分配后基金份额净值不能低于基金面值；基金当期收益应先

弥补前期亏损后,才可进行当期收益分配;在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益每年至少分配一次,最多 6 次,基金每次收益分配比例最低不低于已实现收益的 60%”。

本基金本报告期内进行了 1 次收益分配,分配金额为 11,932,702.75 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**

本报告期内本基金未出现连续二十个工作日出现基金资产净值低于五千万元或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

2018 年上半年度，基金托管人在万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2018 年上半年度，万家基金管理有限公司在万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本基金本报告期内进行了 1 次收益分配，分配金额为 11,932,702.75 元，符合基金合同的规定。

### 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

2018 年上半年度，由万家基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：万家行业优选混合型证券投资基金 (LOF)

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<br>2018 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 14,333,702.30                  | 26,377,650.49                    |
| 结算备付金           |            | 69,689.91                      | 121,853.27                       |
| 存出保证金           |            | 43,975.61                      | 77,325.94                        |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 102,303,403.43                 | 107,997,636.14                   |
| 其中：股票投资         |            | 102,303,403.43                 | 107,997,636.14                   |
| 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    | -                              | 17,200,000.00                    |
| 应收证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 2,361.79                       | 4,724.26                         |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 150,176.14                     | 40,657.22                        |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 116,903,309.18                 | 151,819,847.32                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2018 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2017 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         |            | 581.10                         | 17,200,000.00                    |
| 应付赎回款           |            | 112,700.79                     | 282,214.24                       |
| 应付管理人报酬         |            | 128,570.58                     | 149,815.10                       |
| 应付托管费           |            | 19,780.07                      | 23,048.46                        |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 189,684.33                     | 174,467.69                       |



|               |          |                |                |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 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  | 738,489.56     | 638,530.34     |
| 负债合计          |          | 1,189,806.43   | 18,468,075.83  |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |                |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 88,358,705.66  | 91,709,501.48  |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 27,354,797.09  | 41,642,270.01  |
| 所有者权益合计       |          | 115,713,502.75 | 133,351,771.49 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 116,903,309.18 | 151,819,847.32 |

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7382 元，基金份额总额 156,751,059.46 份。

## 6.2 利润表

会计主体：万家行业优选混合型证券投资基金 (LOF)

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<br>2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至<br>2017 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           |            | 545,997.39                               | 7,590,336.52                                  |
| 1.利息收入                |            | 69,833.80                                | 72,449.71                                     |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 62,011.33                                | 72,449.71                                     |
| 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            |            | 7,822.47                                 | -                                             |
| 其他利息收入                |            | -                                        | -                                             |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | -6,576,513.76                            | 12,328,974.61                                 |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | -7,184,696.83                            | 10,313,712.30                                 |
| 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            | 6.4.7.13.1 | -                                        | -                                             |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.14   | -                                        | -                                             |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.15   | -                                        | -                                             |
| 股利收益                  | 6.4.7.16   | 608,183.07                               | 2,015,262.31                                  |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | 7,030,190.04                             | -4,836,860.62                                 |
| 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   | 22,487.31                                | 25,772.82                                     |
| <b>减：二、费用</b>         |            | 1,792,043.17                             | 2,254,032.28                                  |

|                     |            |               |              |
|---------------------|------------|---------------|--------------|
| 1. 管理人报酬            | 6.4.10.2.1 | 829,303.29    | 1,284,989.84 |
| 2. 托管费              | 6.4.10.2.2 | 127,585.14    | 197,690.75   |
| 3. 销售服务费            | 6.4.10.2.3 | -             | -            |
| 4. 交易费用             | 6.4.7.19   | 668,316.16    | 537,627.69   |
| 5. 利息支出             |            | -             | -            |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |            | -             | -            |
| 6. 税金及附加            |            | -             | -            |
| 7. 其他费用             | 6.4.7.20   | 166,838.58    | 233,724.00   |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |            | -1,246,045.78 | 5,336,304.24 |
| 减：所得税费用             |            | -             | -            |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |            | -1,246,045.78 | 5,336,304.24 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家行业优选混合型证券投资基金 (LOF)

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<br>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）                        | 91,709,501.48                         | 41,642,270.01  | 133,351,771.49 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                     | -1,246,045.78  | -1,246,045.78  |
| 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）      | -3,350,795.82                         | -1,108,724.39  | -4,459,520.21  |
| 其中：1.基金申购款                             | 14,826,707.96                         | 7,142,403.24   | 21,969,111.20  |
| 2.基金赎回款                                | -18,177,503.78                        | -8,251,127.63  | -26,428,631.41 |
| 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） | -                                     | -11,932,702.75 | -11,932,702.75 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 88,358,705.66                         | 27,354,797.09  | 115,713,502.75 |

| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 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)                        | 107,733,361.26                             | 63,354,432.58  | 171,087,793.84 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                          | 5,336,304.24   | 5,336,304.24   |
| 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)      | 45,021,124.93                              | 28,729,639.07  | 73,750,764.00  |
| 其中：1.基金申购款                             | 63,930,958.48                              | 39,585,419.31  | 103,516,377.79 |
| 2.基金赎回款                                | -18,909,833.55                             | -10,855,780.24 | -29,765,613.79 |
| 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) | -                                          | -20,540,834.28 | -20,540,834.28 |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 152,754,486.19                             | 76,879,541.61  | 229,634,027.80 |

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：

|              |             |              |
|--------------|-------------|--------------|
| _____<br>方一天 | _____<br>李杰 | _____<br>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

万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），原天同公用事业行业股票型证券投资基金，系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2005]83号文《关于同意天同公用事业行业股票型开放式证券投资基金募集的批复》的核准，由天同基金管理有限公司（系万家基金管理有限公司的前身）作为发起人向社会公开发行募集，基金合同于2005年7月15日正式生效，首次设立募集规模为309,958,613.24份基金份额。经中国证监会证监基金字[2006]13号文《关于同意天同基金管理有限公司变更名称及修改公司章程的批复》的核准，天同基金管理有限公司于2006年2月更名为万家基金管理有限公司；另经基金管理人董事会

审议通过，基金托管人同意，中国证监会基金部核准，本基金于 2006 年 2 月更名为万家公用事业行业股票型证券投资基金（LOF）。本基金为契约型上市开放式（LOF），存续期限不定。本基金经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2005]66 号文审核同意，于 2005 年 8 月 15 日在深交所挂牌交易。万家公用事业行业股票型证券投资基金（LOF）自 2013 年 6 月 7 日至 2013 年 7 月 10 日以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会讨论通过了关于修改基金名称及投资细节的议案。在基金管理人向中国证监会履行相应备案手续，并经中国证监会书面确认后，基金份额持有人大会决议生效。2013 年 8 月 28 日，中国证监会基金部函[2013]753 号文《关于万家公用事业行业股票型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会决议备案的回函》书面确认后，原《万家公用事业行业股票型证券投资基金（LOF）基金合同》失效，《万家行业优选股票型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，“万家公用事业行业股票型证券投资基金（LOF）”更名为“万家行业优选股票型证券投资基金（LOF）”，同时基金投资目标、投资范围等投资细节相应调整。根据中国证券监督管理委员会于 2014 年 8 月 8 日实行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及相关基金合同的有关规定，经与基金托管人协商一致，自 2015 年 7 月 31 日起将本基金变更为万家行业优选混合型证券投资基金，并相应修改本基金的《基金合同》。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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金主要投资景气行业或预期景气度向好的行业股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。本基金采取优选行业和精选个股相结合的主动投资管理方式，并适度动态配置大类资产。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金股票资产占基金资产的 60%-95%；债券、现金类资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%，其中，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，权证占基金资产净值的 0-3%。

本基金将依据证券市场的阶段性变化，动态调整基金财产在股票、债券和现金类资产的配置比例。本基金的业绩比较基准为： $80\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 20\% \times \text{上证国债指数收益率}$ 。

2008 年 3 月 3 日（拆分日），本基金管理人万家基金管理有限公司对本基金进行了基金份额拆分。拆分前，本基金的基金份额净值为人民币 1.7741 元，根据基金份额拆分公式，计算精确到小数点后第 9 位（第 9 位以后舍去）为人民币 1.774103626 元。本基金管理人于拆分日，按照 1:1.774103626 的拆分比例对本基金进行拆分。拆分后，基金份额净值为人民币 1.0000 元，基金份额面值为人民币 0.5637 元。

### 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 年上半年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

#### 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<br>2018 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 14,333,702.30          |
| 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： | 14,333,702.30 |
|-----|---------------|

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2018 年 6 月 30 日 |                |               |
|---------------|------------------------|----------------|---------------|
|               | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            | 109,035,773.85         | 102,303,403.43 | -6,732,370.42 |
| 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            | 109,035,773.85         | 102,303,403.43 | -6,732,370.42 |

#### 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<br>2018 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 2,315.71               |
| 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  | 28.26                  |
| 应收债券利息     | -                      |
| 应收资产支持证券利息 | -                      |



|            |          |
|------------|----------|
| 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         | 17.82    |
| 合计         | 2,361.79 |

#### 6.4.7.6 其他资产

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<br>2018 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 189,684.33             |
| 银行间市场应付交易费用 | -                      |
| 合计          | 189,684.33             |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2018 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 135.14                 |
| 其他          | 292,959.48             |
| 预提费用        | 445,394.94             |
| 合计          | 738,489.56             |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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          | 162,695,301.46                        | 91,709,501.48  |
| 本期申购          | 26,302,480.05                         | 14,826,707.96  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -32,246,722.05                        | -18,177,503.78 |
| - 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           | 156,751,059.46 | 88,358,705.66 |

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           | 19,288,872.19  | 22,353,397.82 | 41,642,270.01  |
| 本期利润           | -8,276,235.82  | 7,030,190.04  | -1,246,045.78  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 256,841.96     | -1,365,566.35 | -1,108,724.39  |
| 其中：基金申购款       | 1,020,102.26   | 6,122,300.98  | 7,142,403.24   |
| 基金赎回款          | -763,260.30    | -7,487,867.33 | -8,251,127.63  |
| 本期已分配利润        | -11,932,702.75 | -             | -11,932,702.75 |
| 本期末            | -663,224.42    | 28,018,021.51 | 27,354,797.09  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 58,441.37                             |
| 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 | 2,871.66                              |
| 其他        | 698.30                                |
| 合计        | 62,011.33                             |

#### 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<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 221,992,220.79                        |
| 减：卖出股票成本总额 | 229,176,917.62                        |
| 买卖股票差价收入   | -7,184,696.83                         |

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.13.1 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收益。

#### 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

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<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 608,183.07                            |
| 基金投资产生的股利收益 | -                                     |
| 合计          | 608,183.07                            |

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产                 | 7,030,190.04                          |
| ——股票投资                     | 7,030,190.04                          |
| ——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                      | -                                     |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估<br>增值税 | -                                     |
| 合计                         | 7,030,190.04                          |

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 22,335.60                             |
| 转换费     | 151.71                                |
| 合计      | 22,487.31                             |

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 668,316.16                            |
| 银行间市场交易费用 | -                                     |
| 合计        | 668,316.16                            |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目     | 本期<br>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  | 93,326.67                             |
| 其他     | 2,600.00                              |
| 上市年费   | 29,752.78                             |
| 银行汇划费用 | 843.64                                |
| 结算服务费  | 18,000.00                             |
| 合计     | 166,838.58                            |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日,本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称              | 与本基金的关系      |
|--------------------|--------------|
| 万家基金管理有限公司         | 基金管理人、基金销售机构 |
| 交通银行股份有限公司（“交通银行”） | 基金托管人、基金代销机构 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.9.3 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.9.3.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.9.3.2 债券交易

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债券交易。

#### 6.4.9.3.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.9.3.4 权证交易

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。

#### 6.4.9.3.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期末及上年度可比期间未产生关联方佣金。

### 6.4.9.4 关联方报酬

#### 6.4.9.4.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月<br>30 日 | 上年度可比期间<br>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  | 829,303.29                               | 1,284,989.84                               |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 230,847.56                               | 299,428.01                                 |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.30% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.30\% \div \text{当年天数}$$

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,逐日累计至每个月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送管理费划付指令,基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支付,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

#### 6.4.9.4.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目             | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间<br>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 | 127,585.14                 | 197,690.75                      |

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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,逐日累计至每个月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

#### 6.4.9.5 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.9.6 各关联方投资本基金的情况

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

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.9.6.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.9.7 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<br>名称 | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间<br>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    |
|------|---------------|-----------|---------------|-----------|
| 交通银行 | 14,333,702.30 | 58,441.37 | 19,537,776.37 | 62,274.09 |

注：本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2018 年 1 月 1 日至 6 月 30 日获得的利息为人民币 2,871.66 元（2017 年 1 月 1 日至 6 月 30 日为人民币 4,921.56 元），2018 年 6 月 30 日结算备付金余额为人民币 69,689.91 元（2017 年 6 月 30 日余额为人民币 27,412.62 元）。

#### 6.4.9.8 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均不存在在承销期内直接购入关联方所承销证券的情况。

#### 6.4.10 利润分配情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 权益<br>登记日       | 除息日             |                 | 每 10 份<br>基金份额<br>分红数 | 现金形式<br>发放总额 | 再投资形式<br>发放总额 | 本期利润分配<br>合计  | 备注 |
|----|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------------|--------------|---------------|---------------|----|
|    |                 | 场内              | 场外              |                       |              |               |               |    |
| 1  | 2018 年 3 月 21 日 | 2018 年 3 月 22 日 | 2018 年 3 月 21 日 | 0.7200                | 7,712,098.43 | 4,220,604.32  | 11,932,702.75 |    |
| 合计 | -               | -               |                 | 0.7200                | 7,712,098.43 | 4,220,604.32  | 11,932,702.75 |    |

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

##### 6.4.11.1 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

| 6.4.11.1.1 受限证券类别：股票 |          |                       |                      |            |          |            |                  |            |            |    |
|----------------------|----------|-----------------------|----------------------|------------|----------|------------|------------------|------------|------------|----|
| 证券<br>代码             | 证券<br>名称 | 成功<br>认购日             | 可流<br>通日             | 流通受<br>限类型 | 认购<br>价格 | 期末估<br>值单价 | 数量<br>(单位：<br>股) | 期末<br>成本总额 | 期末估值<br>总额 | 备注 |
| 603105               | 芯能<br>科技 | 2018 年<br>6 月 29<br>日 | 2018<br>年 7 月<br>9 日 | 新股流<br>通受限 | 4.83     | 4.83       | 3,410            | 16,470.30  | 16,470.30  | -  |
| 603693               | 江苏<br>新能 | 2018 年<br>6 月 25<br>日 | 2018<br>年 7 月<br>3 日 | 新股流<br>通受限 | 9.00     | 9.00       | 5,384            | 48,456.00  | 48,456.00  | -  |
| 603706               | 东方<br>环宇 | 2018 年<br>6 月 29<br>日 | 2018<br>年 7 月<br>9 日 | 新股流<br>通受限 | 13.09    | 13.09      | 1,765            | 23,103.85  | 23,103.85  | -  |

#### 6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

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

##### 6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

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

#### 6.4.12 金融工具风险及管理

##### 6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括: 信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险, 并设定适当的风险限额及内部控制流程, 通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

##### 6.4.12.2 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。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程, 通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险, 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%, 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发行的证券, 不得超过该证券的 10%。本基金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; 本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。

于 2018 年 6 月 30 日, 本基金未持有债券投资 (2017 年 6 月 30 日: 同)。



### 6.4.12.3 流动性风险

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

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

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

#### 6.4.12.3.1 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。

### 6.4.12.4 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。

#### 6.4.12.4.1 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、存出保证金等。

##### 6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2018 年 6 月 30 日 | 1 个月以内        | 1-3 个月 | 3 个月<br>-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计            |
|------------------------|---------------|--------|--------------|-------|-------|-----|---------------|
| 资产                     |               |        |              |       |       |     |               |
| 银行存款                   | 14,333,702.30 | -      | -            | -     | -     | -   | 14,333,702.30 |

|                          |               |        |          |       |       |                |                |
|--------------------------|---------------|--------|----------|-------|-------|----------------|----------------|
| 结算备付金                    | 69,689.91     | -      | -        | -     | -     | -              | 69,689.91      |
| 存出保证金                    | 43,975.61     | -      | -        | -     | -     | -              | 43,975.61      |
| 交易性金融资产                  | -             | -      | -        | -     | -     | 102,303,403.43 | 102,303,403.43 |
| 应收利息                     | -             | -      | -        | -     | -     | 2,361.79       | 2,361.79       |
| 应收申购款                    | -             | -      | -        | -     | -     | 150,176.14     | 150,176.14     |
| 资产总计                     | 14,447,367.82 | -      | -        | -     | -     | 102,455,941.36 | 116,903,309.18 |
| 负债                       | -             | -      | -        | -     | -     | -              | -              |
| 应付证券清算款                  | -             | -      | -        | -     | -     | 581.10         | 581.10         |
| 应付赎回款                    | -             | -      | -        | -     | -     | 112,700.79     | 112,700.79     |
| 应付管理人报酬                  | -             | -      | -        | -     | -     | 128,570.58     | 128,570.58     |
| 应付托管费                    | -             | -      | -        | -     | -     | 19,780.07      | 19,780.07      |
| 应付交易费用                   | -             | -      | -        | -     | -     | 189,684.33     | 189,684.33     |
| 其他负债                     | -             | -      | -        | -     | -     | 738,489.56     | 738,489.56     |
| 负债总计                     | -             | -      | -        | -     | -     | 1,189,806.43   | 1,189,806.43   |
| 利率敏感度缺口                  | 14,447,367.82 | -      | -        | -     | -     | 101,266,134.93 | 115,713,502.75 |
| 上年度末<br>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                     | 26,377,650.49 | -      | -        | -     | -     | -              | 26,377,650.49  |
| 结算备付金                    | 121,853.27    | -      | -        | -     | -     | -              | 121,853.27     |
| 存出保证金                    | 77,325.94     | -      | -        | -     | -     | -              | 77,325.94      |
| 交易性金融资产                  | -             | -      | -        | -     | -     | 107,997,636.14 | 107,997,636.14 |
| 买入返售金融资产                 | 17,200,000.00 | -      | -        | -     | -     | -              | 17,200,000.00  |
| 应收利息                     | -             | -      | -        | -     | -     | 4,724.26       | 4,724.26       |
| 应收申购款                    | -             | -      | -        | -     | -     | 40,657.22      | 40,657.22      |
| 资产总计                     | 43,776,829.70 | -      | -        | -     | -     | 108,043,017.62 | 151,819,847.32 |
| 负债                       | -             | -      | -        | -     | -     | -              | -              |
| 应付证券清算款                  | -             | -      | -        | -     | -     | 17,200,000.00  | 17,200,000.00  |
| 应付赎回款                    | -             | -      | -        | -     | -     | 282,214.24     | 282,214.24     |
| 应付管理人报酬                  | -             | -      | -        | -     | -     | 149,815.10     | 149,815.10     |
| 应付托管费                    | -             | -      | -        | -     | -     | 23,048.46      | 23,048.46      |
| 应付交易费用                   | -             | -      | -        | -     | -     | 174,467.69     | 174,467.69     |
| 其他负债                     | -             | -      | -        | -     | -     | 638,530.34     | 638,530.34     |
| 负债总计                     | -             | -      | -        | -     | -     | 18,468,075.83  | 18,468,075.83  |
| 利率敏感度缺口                  | 43,776,829.70 | -      | -        | -     | -     | 89,574,941.79  | 133,351,771.49 |

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

#### 6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，银行存款、结算备付金以及存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其

本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。（2017 年 12 月 31 日：同）

#### 6.4.12.4.2 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。

#### 6.4.12.4.3 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，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

##### 6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2018 年 6 月 30 日 |               | 上年度末<br>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  | 102,303,403.43         | 88.41         | 107,997,636.14           | 80.99         |
| 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            | 102,303,403.43         | 88.41         | 107,997,636.14           | 80.99         |

注：本基金投资组合中投资于股票资产的比例为 60%-95 债券、现金类资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%，其中，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，权证占基金资产净值的 0-3%。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如表中数据。

##### 6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 1. 若股票基准指数发生变动而其他市场变量保持不变 |                             |                        |
|----|---------------------------|-----------------------------|------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动                 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                           | 本期末（2018 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2017 年 12 月 31 日） |

|                     |                  |                  |
|---------------------|------------------|------------------|
| 1. 股票基准指数下降 100 个基点 | -1, 143, 253. 22 | -1, 005, 167. 31 |
| 2. 股票基准指数上升 100 个基点 | 1, 143, 253. 22  | 1, 005, 167. 31  |

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。

#### 6.4.13 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              | 102,303,403.43 | 87.51         |
|    | 其中：股票             | 102,303,403.43 | 87.51         |
| 2  | 基金投资              | —              | —             |
| 3  | 固定收益投资            | —              | —             |
|    | 其中：债券             | —              | —             |
|    | 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          | —              | —             |
|    | 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      | 14,403,392.21  | 12.32         |
| 8  | 其他各项资产            | 196,513.54     | 0.17          |
| 9  | 合计                | 116,903,309.18 | 100.00        |

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | —             | —             |
| B  | 采矿业              | 20,524,456.00 | 17.74         |
| C  | 制造业              | 40,224,465.09 | 34.76         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 71,559.85     | 0.06          |
| E  | 建筑业              | —             | —             |
| F  | 批发和零售业           | —             | —             |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | —             | —             |
| H  | 住宿和餐饮业           | —             | —             |

|   |                 |                |       |
|---|-----------------|----------------|-------|
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | -              | -     |
| J | 金融业             | 28,864,737.38  | 24.95 |
| K | 房地产业            | 4,719,454.00   | 4.08  |
| L | 租赁和商务服务业        | -              | -     |
| M | 科学研究和技术服务业      | -              | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 81,226.14      | 0.07  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   | -              | -     |
| P | 教育              | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作         | 7,817,504.97   | 6.76  |
| R | 文化、体育和娱乐业       | -              | -     |
| S | 综合              | -              | -     |
|   | 合计              | 102,303,403.43 | 88.41 |

### 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

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  | 600809 | 山西汾酒 | 110,700   | 6,961,923.00 | 6.02         |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 8,821     | 6,452,208.66 | 5.58         |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 231,857   | 6,130,299.08 | 5.30         |
| 4  | 600031 | 三一重工 | 575,800   | 5,164,926.00 | 4.46         |
| 5  | 601225 | 陕西煤业 | 609,100   | 5,006,802.00 | 4.33         |
| 6  | 000983 | 西山煤电 | 639,600   | 4,803,396.00 | 4.15         |
| 7  | 600740 | 山西焦化 | 453,200   | 4,658,896.00 | 4.03         |
| 8  | 601398 | 工商银行 | 871,705   | 4,637,470.60 | 4.01         |
| 9  | 002044 | 美年健康 | 205,164   | 4,636,706.40 | 4.01         |
| 10 | 601699 | 潞安环能 | 498,000   | 4,611,480.00 | 3.99         |
| 11 | 601939 | 建设银行 | 697,786   | 4,570,498.30 | 3.95         |
| 12 | 600362 | 江西铜业 | 284,500   | 4,509,325.00 | 3.90         |
| 13 | 601688 | 华泰证券 | 272,600   | 4,080,822.00 | 3.53         |
| 14 | 601666 | 平煤股份 | 885,600   | 3,701,808.00 | 3.20         |
| 15 | 601988 | 中国银行 | 959,200   | 3,462,712.00 | 2.99         |
| 16 | 601288 | 农业银行 | 1,002,400 | 3,448,256.00 | 2.98         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 17 | 300347 | 泰格医药 | 51,411  | 3,180,798.57 | 2.75 |
| 18 | 600867 | 通化东宝 | 116,841 | 2,800,678.77 | 2.42 |
| 19 | 601012 | 隆基股份 | 146,240 | 2,440,745.60 | 2.11 |
| 20 | 600048 | 保利地产 | 199,700 | 2,436,340.00 | 2.11 |
| 21 | 600348 | 阳泉煤业 | 335,800 | 2,400,970.00 | 2.07 |
| 22 | 600585 | 海螺水泥 | 69,000  | 2,310,120.00 | 2.00 |
| 23 | 600606 | 绿地控股 | 349,100 | 2,283,114.00 | 1.97 |
| 24 | 000060 | 中金岭南 | 389,250 | 1,891,755.00 | 1.63 |
| 25 | 600426 | 华鲁恒升 | 100,500 | 1,767,795.00 | 1.53 |
| 26 | 600030 | 中信证券 | 77,800  | 1,289,146.00 | 1.11 |
| 27 | 002142 | 宁波银行 | 76,460  | 1,245,533.40 | 1.08 |
| 28 | 600352 | 浙江龙盛 | 100,304 | 1,198,632.80 | 1.04 |
| 29 | 601330 | 绿色动力 | 4,971   | 81,226.14    | 0.07 |
| 30 | 603650 | 彤程新材 | 2,376   | 50,988.96    | 0.04 |
| 31 | 603693 | 江苏新能 | 5,384   | 48,456.00    | 0.04 |
| 32 | 603706 | 东方环宇 | 1,765   | 23,103.85    | 0.02 |
| 33 | 603105 | 芯能科技 | 3,410   | 16,470.30    | 0.01 |

## 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  | 601398 | 工商银行  | 13,102,594.00 | 9.83           |
| 2  | 600036 | 招商银行  | 11,921,103.28 | 8.94           |
| 3  | 601939 | 建设银行  | 10,305,114.80 | 7.73           |
| 4  | 002142 | 宁波银行  | 10,208,028.42 | 7.65           |
| 5  | 600519 | 贵州茅台  | 10,007,997.00 | 7.50           |
| 6  | 300347 | 泰格医药  | 7,041,104.80  | 5.28           |
| 7  | 601012 | 隆基股份  | 6,783,862.00  | 5.09           |
| 8  | 000858 | 五 粮 液 | 6,650,392.00  | 4.99           |
| 9  | 600809 | 山西汾酒  | 6,462,263.81  | 4.85           |
| 10 | 000063 | 中兴通讯  | 6,052,364.00  | 4.54           |
| 11 | 002044 | 美年健康  | 5,946,958.00  | 4.46           |
| 12 | 600362 | 江西铜业  | 5,749,477.72  | 4.31           |
| 13 | 601988 | 中国银行  | 5,734,594.00  | 4.30           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 14 | 601699 | 潞安环能 | 5,431,814.00 | 4.07 |
| 15 | 600867 | 通化东宝 | 5,397,410.41 | 4.05 |
| 16 | 000983 | 西山煤电 | 5,276,737.00 | 3.96 |
| 17 | 600740 | 山西焦化 | 5,180,499.00 | 3.88 |
| 18 | 601225 | 陕西煤业 | 5,058,350.00 | 3.79 |
| 19 | 600031 | 三一重工 | 4,898,009.00 | 3.67 |
| 20 | 601688 | 华泰证券 | 4,842,713.00 | 3.63 |
| 21 | 000513 | 丽珠集团 | 4,834,633.00 | 3.63 |
| 22 | 601666 | 平煤股份 | 4,506,829.00 | 3.38 |
| 23 | 601166 | 兴业银行 | 4,112,827.00 | 3.08 |
| 24 | 600029 | 南方航空 | 4,059,349.00 | 3.04 |
| 25 | 600000 | 浦发银行 | 4,052,407.53 | 3.04 |
| 26 | 601288 | 农业银行 | 3,411,498.00 | 2.56 |
| 27 | 600352 | 浙江龙盛 | 2,786,977.00 | 2.09 |
| 28 | 600048 | 保利地产 | 2,778,820.00 | 2.08 |
| 29 | 002024 | 苏宁易购 | 2,704,882.00 | 2.03 |
| 30 | 600426 | 华鲁恒升 | 2,700,025.76 | 2.02 |
| 31 | 600606 | 绿地控股 | 2,668,212.96 | 2.00 |

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。

#### 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  | 600021 | 上海电力 | 10,553,225.34 | 7.91           |
| 2  | 002142 | 宁波银行 | 9,887,259.34  | 7.41           |
| 3  | 601398 | 工商银行 | 8,708,006.36  | 6.53           |
| 4  | 300347 | 泰格医药 | 7,521,627.86  | 5.64           |
| 5  | 000858 | 五粮液  | 6,555,575.16  | 4.92           |
| 6  | 002635 | 安洁科技 | 6,522,350.30  | 4.89           |
| 7  | 600340 | 华夏幸福 | 6,423,479.38  | 4.82           |
| 8  | 601939 | 建设银行 | 6,266,010.20  | 4.70           |
| 9  | 601288 | 农业银行 | 6,169,858.38  | 4.63           |
| 10 | 601336 | 新华保险 | 5,956,800.10  | 4.47           |
| 11 | 600958 | 东方证券 | 5,550,334.99  | 4.16           |
| 12 | 600036 | 招商银行 | 5,431,615.53  | 4.07           |



|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 13 | 603968 | 醋化股份 | 5,378,766.00 | 4.03 |
| 14 | 001979 | 招商蛇口 | 5,065,020.87 | 3.80 |
| 15 | 300109 | 新开源  | 4,862,331.22 | 3.65 |
| 16 | 000513 | 丽珠集团 | 4,795,739.94 | 3.60 |
| 17 | 601377 | 兴业证券 | 4,696,592.20 | 3.52 |
| 18 | 600029 | 南方航空 | 4,693,367.16 | 3.52 |
| 19 | 300083 | 劲胜智能 | 4,397,188.25 | 3.30 |
| 20 | 601600 | 中国铝业 | 4,237,920.00 | 3.18 |
| 21 | 600436 | 片仔癀  | 3,946,649.61 | 2.96 |
| 22 | 000078 | 海王生物 | 3,892,266.00 | 2.92 |
| 23 | 601166 | 兴业银行 | 3,888,732.00 | 2.92 |
| 24 | 000063 | 中兴通讯 | 3,783,060.00 | 2.84 |
| 25 | 002369 | 卓翼科技 | 3,776,960.28 | 2.83 |
| 26 | 600000 | 浦发银行 | 3,751,980.00 | 2.81 |
| 27 | 601997 | 贵阳银行 | 3,653,125.40 | 2.74 |
| 28 | 601688 | 华泰证券 | 3,622,358.00 | 2.72 |
| 29 | 600491 | 龙元建设 | 3,515,576.44 | 2.64 |
| 30 | 300203 | 聚光科技 | 3,453,176.00 | 2.59 |
| 31 | 600867 | 通化东宝 | 3,402,431.19 | 2.55 |
| 32 | 300115 | 长盈精密 | 3,324,978.00 | 2.49 |
| 33 | 000776 | 广发证券 | 3,286,531.00 | 2.46 |
| 34 | 600138 | 中青旅  | 3,181,741.00 | 2.39 |
| 35 | 600519 | 贵州茅台 | 3,100,526.80 | 2.33 |
| 36 | 002024 | 苏宁易购 | 2,917,665.72 | 2.19 |
| 37 | 002044 | 美年健康 | 2,781,606.89 | 2.09 |

注：本项卖出金额均按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 216,452,494.87 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 221,992,220.79 |

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

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金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

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1 基金投资的前十大持仓证券中招商银行（600036.SH）在 2018 年 5 月 4 日因违规行为被中国银行保险监督管理委员会公开处罚，违规行为主要涉及理财、存贷款、同业等业务。**

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额        |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | 43,975.61 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |

|   |       |            |
|---|-------|------------|
| 3 | 应收股利  | -          |
| 4 | 应收利息  | 2,361.79   |
| 5 | 应收申购款 | 150,176.14 |
| 6 | 其他应收款 | -          |
| 7 | 待摊费用  | -          |
| 8 | 其他    | -          |
| 9 | 合计    | 196,513.54 |

#### 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

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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 |
| 12,480       | 12,560.18     | 3,170.06 | 0.00%      | 156,747,889.40 | 100.00%    |

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份）      | 占上市总份额<br>比例 |
|----|-------|--------------|--------------|
| 1  | 王明瑞   | 1,504,299.00 | 14.58%       |
| 2  | 高德荣   | 404,045.00   | 3.92%        |
| 3  | 陈明杰   | 289,368.00   | 2.81%        |
| 4  | 胡培安   | 200,000.00   | 1.94%        |
| 5  | 杨易    | 160,000.00   | 1.55%        |
| 6  | 唐进宇   | 151,402.00   | 1.47%        |
| 7  | 钱霞琴   | 129,495.00   | 1.26%        |
| 8  | 冯海燕   | 121,109.00   | 1.17%        |
| 9  | 毛静    | 109,965.00   | 1.07%        |
| 10 | 戴华    | 108,871.00   | 1.06%        |

注：上述持有人为场内持有人

### 8.3 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 | 24,391.25 | 0.0156%  |

### 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                             | 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（ 2005 年 7 月 15 日 ）基金份额总额 | 309,958,613.24 |
| 本报告期期初基金份额总额                     | 162,695,301.46 |
| 本报告期基金总申购份额                      | 26,302,480.05  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                    | 32,246,722.05  |
| 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                     | 156,751,059.46 |

## § 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：2018 年 3 月 15 日，公司增聘高源为万家优选基金的基金经理，与孙远慧共同管理该基金。

基金托管人：本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 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事项。

### 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

报告期内, 本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
|      |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 东方证券 | 2      | 157,346,241.84 | 35.99%       | 146,866.73 | 36.04%     | -  |
| 申万宏源 | 1      | 131,060,306.64 | 29.98%       | 122,056.70 | 29.95%     | -  |
| 兴业证券 | 2      | 127,174,886.68 | 29.09%       | 118,438.09 | 29.06%     | -  |
| 华福证券 | 1      | 18,872,530.61  | 4.32%        | 17,575.98  | 4.31%      | -  |
| 中银国际 | 1      | 2,738,571.93   | 0.63%        | 2,605.21   | 0.64%      | -  |
| 江南证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 广发证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 西部证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 华西证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 国泰君安 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 中泰证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 银河证券 | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 海通证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |

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。

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：

无。

### **10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

本基金本报告期内未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

## **§ 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**

本基金本报告期内不存在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行业优选混合型证券投资基金（LOF）发行及募集的文件。
- 2、《万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）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、万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）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、《万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）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](http://www.wjasset.com)

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司

2018 年 8 月 28 日