万家180指数证券投资基金

2016 第二季度 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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2016年7月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年4月1日起至2016年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家180指数
基金主代码	519180
交易代码	519180
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年3月17日
报告期末基金份额总额	2,067,259,928.89份
投资目标	本基金通过运用指数化投资方法,力求基金的股票组合收益率拟合上证180指数的增长率。伴随中国经济增长和资本市场的发展,实现利用指数化投资方法谋求基金资产长期增值的目标。
投资策略	本基金以跟踪目标指数为原则,实现与市场同步成长为基本理念,指数化投资是一种充分考虑投资者利益的投资方法,采取拟合目标指数收益率的投资策略,分散投资于目标指数所包含的股票中,力求股票组合的收益率拟合目标指数所代表的资本市场的平均收益率。
业绩比较基准	95%×上证180指数收益率+5%×银行同业存款利率
风险收益特征	本基金追踪上证180指数,是一种风险适中、长期资本收益稳健的投资产品,并具有长期稳定的投资风格。
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年4月1日—2016年6月30日)
1.本期已实现收益	-5,479,452.88
2.本期利润	-26,465,954.16
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0128
4.期末基金资产净值	1,509,830,931.75
5.期末基金份额净值	0.7304

注:1、上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(例如,开放式基金的申购、赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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。

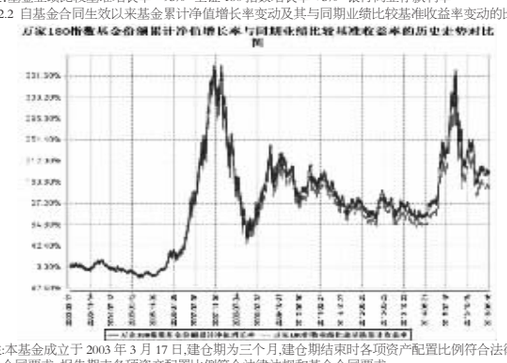
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	-1.71%	0.89%	-2.53%	0.89%	0.82%	0.00%

注:基金业绩比较基准增长率=95%*上证180指数增长率+5%*银行同业存款利率

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注:本基金成立于2003年3月17日,建仓期为三个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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,万家上证50交易型开放式指数证券投资基金、万家中证红利指数型证券投资基金(LOF)、万家中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理	2015年8月18日	-	7	量化投资部总监,基金经理,硕士研究生。2008年进入上海双隆投资管理有限公司,任金融工程师;2010年进入上海鹏投资管理有限公司,从事高级量化分析师工作;2010年10月进入在国泰基金管理有限公司,历任产品开发、专户投资经理助理等职务;2014年4月进入广发证券担任投资经理职务;2014年11月进入中融基金管理有限公司担任产品开发部总监职务;2015年4月加入本公司,现任量化投资部总监

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遵规守信情况的说明

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》、《公开募集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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年第二季度,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。市场对于经济短期内继续筑底的预期也较为充分。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、成交量持续低迷、反弹有限,投资者观望情绪较浓。展望后市,政策重心将持续由稳增长向调结构转变,注重稳健、松紧适度的货币政策。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。

本基金作为被动投资型的指数基金,其投资目标是通过跟踪、复制上证180指数,为投资者获取股票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,采取了完全复制方法进行投资管理,努力拟合标的指数,减小跟踪误差。

报告期内,本基金采用有效的量化跟踪技术,将基金跟踪误差控制在较低范围内。跟踪误差主要是由于基金申购赎回、标的指数成分股定期调整、各类费用等因素所造成。

4.5 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0.7304元,本报告期份额净值增长率为-1.71%,业绩比较基准收益率-2.53%。本基金本报告期跟踪偏离度为0.04%,与标的指数产生偏离的主要原因为成份股分红、申购赎回、标的指数成分股定期调整、日常运作费用等产生的差异。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金没有出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情况。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,432,133,203.11	94.68
	其中:股票	1,432,133,203.11	94.68
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	80,176,121.17	5.30
8	其他资产	369,876.86	0.02
9	合计	1,512,679,201.14	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按数投资按行业分类的股票投资组合

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	3,530,146.82	0.23
B	采矿业	61,390,500.33	4.07
C	制造业	338,618,826.27	22.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	64,512,869.24	4.27
E	建筑业	62,177,315.62	4.12
F	批发和零售业	31,377,910.64	2.08
G	交通运输、仓储和邮政业	57,162,486.57	3.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,710,468.73	3.09
J	金融业	667,299,665.86	44.20
K	房地产业	79,586,699.01	5.27
L	租赁和商务服务业	9,364,253.34	0.62
M	科学研究和技术服务业	2,702,476.84	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,231,930.24	0.28
S	综合	3,467,653.60	0.23
	合计	1,432,133,203.11	94.85

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	2,688,134	86,127,813.36	5.70
2	600016	民生银行	5,824,725	52,014,794.25	3.45
3	601166	兴业银行	3,263,197	49,731,122.28	3.29
4	600036	招商银行	2,542,525	44,494,187.50	2.95
5	601398	工商银行	9,732,423	43,211,958.12	2.86
6	601328	交通银行	6,710,362	37,779,338.06	2.50
7	600519	贵州茅台	123,021	35,912,290.32	2.38
8	600000	浦发银行	2,152,677	33,517,180.89	2.22
9	600030	中信证券	1,949,246	31,636,262.58	2.10
10	600837	海通证券	1,997,315	30,798,597.30	2.04

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据基金合同,本基金暂不能投资于股指期货。

5.9.1 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同,本基金暂不能投资于股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同,本基金暂不能投资于国债期货。

5.10.1 本期国债期货投资评价

根据基金合同,本基金暂不可投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	156,476.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,360.56
5	应收申购款	199,039.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	369,876.86

5.11.4 报告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可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,085,044,079.59
报告期期间基金总申购份额	12,564,199.79
减:报告期期间基金总赎回份额	30,348,350.49
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	2,067,259,928.89

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,792,228.82
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,792,228.82
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.52

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内,基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准万家180指数证券投资基金发行及募集的文件

2、《万家180指数证券投资基金基金合同》

3、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程

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

5、万家180指数证券投资基金2016年第2季度报告原文

6、万家基金管理有限公司董事会决议

8.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所,并登载于基金管理人网站:www.wjasset.com

8.3 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7月19日

万家行业优选混合型证券投资基金(LOF)

2016 第二季度 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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2016年7月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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2016年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家行业优选混合型
基金主代码	161903
交易代码	161903
基金运作方式	契约型上市开放式基金(LOF)
基金合同生效日	2005年7月15日
报告期末基金份额总额	426,899,630.18份
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方式,并适度动态配置大类资产。
业绩比较基准	80%×沪深300指数收益率+20%×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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年4月1日—2016年6月30日)
1.本期已实现收益	1,663,029.25
2.本期利润	2,189,269.55
3.加权平均基金份额本期利润	0.0050
4.期末基金资产净值	347,479,400.30
5.期末基金份额净值	0.8140

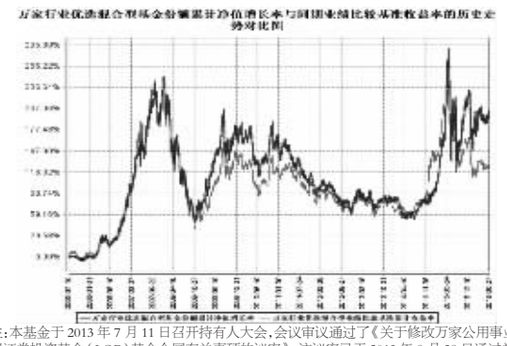
注:(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;(2)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	0.68%	1.10%	-1.42%	0.81%	2.10%	0.29%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
莫海波	本基金基金经理、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家精选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基金经理、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2015年5月6日	-	5	投资研究部总监,MBA,2010年进入财富证券责任有限公司,任分析师,投资经理助理;2011年进入中银国际证券有限责任公司基金,任分析师、环保行业研究员、策略分析师、投资经理,2015年3月加入本公司,现任投资研究部总监。
孙远慧	本基金基金经理、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2016年3月23日	-	6	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。

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遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年2季度股票市场经历了横盘-快速下跌-震荡上行为主基调,沪深300整体收跌约2%,国内外的宏观经济/政治形势异常复杂,权威人士对宏观经济未来发展L型定调、美国加息、A股闯关MSCI失败、英国脱欧、南海军事升温等等事件。2季度本基金在稳健操作的投资思路,在市场下跌前做到了降低仓位,在逐步震荡上行中逐步加仓,期间主要加大对景气向上行业配置力度,坚持自己的风格,不追热点,寻找市场关注度低升温未来有潜在机会的细分板块与公司,耐心持有,本产品未来的目标是把本基金打造成在控制回撤幅度上优于同行,净值保持稳健、长期增长的精品。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.8140元,本报告期份额净值增长率为0.68%,业绩比较基准收益率为-1.42%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

截至报告期末,本基金没有出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情况。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	310,039,472.41	83.37
	其中:股票	310,039,472.41	83.37
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	15,300,122.50	4.11
	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	46,194,100.79	12.42
8	其他资产	339,379.12	0.09
9	合计	371,873,074.82	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	20,535,857.75	5.91
B	采矿业	10,449,136.00	3.01
C	制造业	158,267,573.68	45.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,677,650.00	2.79
E	建筑业	34,814,234.69	10.02
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	9,306.30	0.00
J	金融业	25,527,167.00	7.35
K	房地产业	50,738,420.89	14.60
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	310,039,472.41	89.23

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601669	中国电建	3,650,591	20,844,874.61	6.00
2	002068	黑猫股份	2,060,100	16,068,780.00	4.62
3	600318	新力金融	538,000	14,477,580.00	4.17
4	002450	康得新	832,810	14,241,051.00	4.10
5	600160	巨化股份	1,272,000	13,521,360.00	3.89
6	601198	东兴证券	545,900	13,341,796.00	3.84
7	002481	双塔食品	1,809,500	13,209,350.00	3.80
8	001979	招商蛇口	914,967	13,038,279.75	3.75
9	000568	泸州老窖	428,794	12,735,181.80	3.67
10	600965	福成股份	929,100	12,059,718.00	3.47

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

5.5 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债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

5.7 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

本报告期末本基金未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

报告期末本基金未持有股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

报告期末本基金未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	292,671.55
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,458.34
5	应收申购款	35,249.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	339,379.12

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600318	新力金融	14,477,580.00	4.17	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	436,340,962.70
报告期期间基金总申购份额	44,302,816.08
减:报告期期间基金总赎回份额	53,744,148.60
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	426,899,630.18

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购及买卖本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。

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报纸上公开披露的基金净值及其他临时公告。

5、万家行业优选混合型证券投资基金(LOF)2016年第二季度报告原文。

6、万家基金管理有限公司董事会决议。

8.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所,并登载于基金管理人网站:http://www.wjasset.com。

8.3 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7月19日

万家和谐增长混合型证券投资基金

2016 第二季度 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:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年7月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年4月1日起至2016年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家和谐增长混合
基金主代码	519181
前端交易代码	519181
后端交易代码	519182
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月30日
报告期末基金份额总额	1,700,046,928.07份
投资目标	本基金通过有效配置股票、债券投资比例,平衡长期买入持有和事件驱动投资的优化选择策略,控制投资风险,谋取基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金最大特点是突出和谐增长,主要包含二层含义:一,资产配置的和谐,通过有效配置股票、债券资产比例,谋求基金资产在股票、债券投资中风险、收益的和谐平衡;二,长期买入持有和事件驱动投资的和谐,通过对不同行业、不同股票内在价值与市场价格的偏离程度和其市场价格向内在价值的回归速度的分析,谋求基金资产在不同行业和不同股票投资中长期投资和事件驱动投资的和谐平衡。
业绩比较基准	沪深300指数×65%+中证全债指数×30%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金是混合型基金,其预期收益及风险水平介于股票型基金与债券型基金之间,属于中等风险收益水平基金。
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年4月1日—2016年6月30日)
1.本期已实现收益	-8,005,590.38
2.本期利润	-77,127,318.28
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0476
4.期末基金资产净值	1,441,097,110.18
5.期末基金份额净值	0.8477

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。

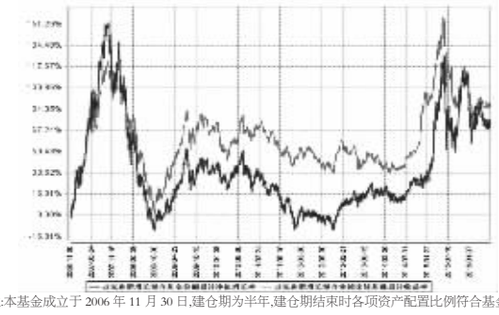
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	-5.49%	1.39%	-1.12%	0.66%	-4.37%	0.73%

注:业绩比较基准=沪深300指数×65%+中证全债指数×30%+同业存款利率×5%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注:本基金成立于2006年11月30日,建仓期为半年,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同要求。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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
莫海波	本基金基金经理、万家精选混合型证券投资基金、万家行业优选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、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴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基金经理。	2015年5月6日	-	6	投资研究部总监,MBA,2010年进入财富证券责任有限公司,任分析师,投资经理助理;2011年进入中银国际证券有限责任公司基金,任分析师、环保行业研究员、策略分析师、投资经理,2015年3月加入本公司,现任投资研究部总监。万家精选股票型证券投资基金基金经理和万家行业优选股票型证券投资基金基金经理。

注:1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

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