万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金

2017 第二季度 报告

2017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:2017年7月21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2017年7月20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。

本报告中的财务数据未经审计。

本报告期自2017年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家双引擎灵活配置混合
基金主代码	519183
交易代码	519183
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年6月27日
报告期末基金份额总额	469,308,743.72份
投资目标	本基金通过股票、债券的有效配置,把握价值、成长风格特征,精选个股,构造风格类资产组合。在有效控制风险的前提下,谋求基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金根据对宏观经济环境、经济增长前景及证券市场发展状况的综合分析,确定大类资产的动态配置。本基金股票投资组合采取自下而上的策略,以量化指标分析为基础,结合定性分析,精选具有明显价值、成长风格特征且具备估值优势的股票,构建投资组合,在有效控制风险的前提下,谋求基金资产的持续稳健增值。
业绩比较基准	60%×沪深300指数收益率+40%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金是混合型基金,风险高于货币市场基金和债券型基金,属于中高风险、中高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	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(2017年4月1日－2017年6月30日)
1.本期已实现收益	9,341,895.59
2.本期利润	3,578,678.48
3.加权平均基金份额本期利润	0.0061
4.期末基金资产净值	677,412,086.75
5.期末基金份额净值	1.4434

注:1、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。

2、上表中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。

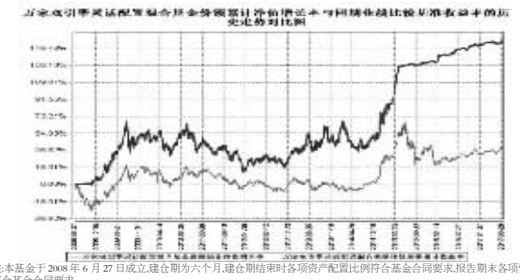
3.2 基金净值表现

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	0.58%	0.13%	3.70%	0.37%	-3.12%	-0.24%

注:业绩比较基准=60%×沪深300指数收益率+40%×上证国债指数收益率

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:本基金于2008年6月27日成立,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		
高翰昆	本基金基金经理,万家现金宝货币市场证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞益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、万家瑞丽灵活配置混合型证券投资基金、万家顺达保本混合型证券投资基金、万家顺和保本混合型证券投资基金、万家瑞旭灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、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、万家瑞隆灵活配置混合型证券投资基金、万家家泰债券型证券投资基金、万家盛债券型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金基金经理。	2015年5月5日	-	8年	英国诺丁汉大学硕士。2009年7月加入万家基金管理有限公司,历任研究部助理、交易员、交易部总监助理、交易部副总监。

注:1.此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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

二季度市场的关键问应该是超预期。本基金上并没有出现市场此前预期的快速下行反而进出口超预期、pmi超预期、地产销售超预期、高品价格超预期,凡此总总皆显示经济自身具有较强的韧性。同时基本面的稳定也给监管及货币政策带来了较大的政策空间,于是我们看到了在货币政策及监管政策上的超预期。二会竞争性监管力度空前大超市场预期加之对流动性的担忧引发了4-5月的一轮股债双杀。但行至6月份,在强监管对市场价格反映较为充分后监管层在流动性预期管理上释放了较为温和的信号,抵此股债两市均出现了一轮超跌反弹。

本基金二季度虽然预期到强监管对市场的不利影响却低估这种冲击的力度没能完全躲避开4-5月份的这轮回调,但此后在市场预期出现极度悲观及监管释放善意信号后积极布局加大仓位参与了股债的这轮反弹,最终为客户创造了较好的收益。

4.5 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1.4434元;本报告期基金份额净值增长率为0.58%,业绩比较基准收益率为3.70%。

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	128,347,144.05	18.88
	其中:股票	128,347,144.05	18.88
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	422,452,460.90	62.16
	其中:债券	422,452,460.90	62.16
	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	119,926,499.89	17.65
	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	1,162,319.90	0.17
8	其他资产	7,767,066.10	1.14
9	合计	679,655,490.84	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	2,118,832.00	0.31
C	制造业	34,420,502.68	5.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	30,912,230.16	4.56
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	33,865,345.01	5.00
K	房地产业	12,363,417.24	1.83
L	租赁和商务服务业	3,506,048.00	0.52
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	10,992,862.80	1.62
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	167,906.16	0.02
S	综合	-	-
	合计	128,347,144.05	18.95

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末沪港通投资股票投资组合。

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	600340	华夏幸福	368,178	12,363,417.24	1.83
2	600491	龙元建设	922,200	9,895,206.00	1.46
3	000826	启迪桑德	219,440	7,706,732.80	1.14
4	601997	贵阳银行	440,467	6,963,783.27	1.03
5	002310	东方园林	412,050	6,889,476.00	1.02
6	002103	广博股份	518,539	6,865,456.36	1.01
7	600966	博汇纸业	1,237,127	6,420,689.13	0.95
8	600584	长电科技	378,242	6,070,784.10	0.90
9	601328	交通银行	757,599	4,666,809.84	0.69
10	002717	岭南园林	151,500	4,060,200.00	0.60

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	15,583,916.40	2.30
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,885,000.00	4.41
	其中:政策性金融债	29,885,000.00	4.41
4	企业债券	2,419,718.50	0.36
5	企业短期融资券	330,929,000.00	48.85
6	中期票据	40,187,000.00	5.93
7	可转债(可交换债)	3,447,826.00	0.51
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	422,452,460.90	62.36

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	011698701	16物产中大SCP006	400,000	40,124,000.00	5.92
2	011698714	16粤珠江SCP004	400,000	40,120,000.00	5.92
3	011698719	16振华SCP001	400,000	40,120,000.00	5.92
4	011698765	16建发SCP006	400,000	40,116,000.00	5.92
5	011698720	16苏城投SCP001	400,000	40,108,000.00	5.92
5	1382177	13沙钢MTN1	300,000	30,111,000.00	4.45

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

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

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

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	72,806.40
2	应收证券清算款	1,200,562.19
3	应收股利	-
4	应收利息	6,489,696.57
5	应收申购款	4,000.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,767,066.10

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	120001	16以岭EB	1,169,151.00	0.17
2	128013	洪涛转债	177,275.00	0.03

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	628,653,466.14
报告期期间基金总申购份额	2,081,640.87
减:报告期期间基金总赎回份额	161,426,363.29
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	469,308,743.72

§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

本报告期,基金管理人未运用固有资金投资本理基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期,基金管理人未运用固有资金投资本理基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况						报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比	
机构								
	1	20170621-20170630	106,193,982.30	-	-	106,193,982.30	22.63	
产品持有风险								

报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过20%的情况。

未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回,基金管理人可能无法及时变现基金资产,可能对基金份额净值产生一定的影响;极端情况下可能引发基金的流动性风险,发生暂停赎回或延缓支付赎回款项;若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元,还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

§9 备查文件目录

9.1 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.《万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

3.万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。

4.本报告期内在中国证监会指定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。

5.万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金2017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。

7.《万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。

9.2 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

9.3 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
2017年7月21日

万家双利债券型证券投资基金

2017 第二季度 报告

2017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
报告送出日期:2017年7月21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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017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2017年04月01日起至06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家双利
基金主代码	519190
交易代码	519190
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年3月6日
报告期末基金份额总额	38,799,146.84份
投资目标	在严格控制风险并保持良好流动性的基础上,力争通过主动的组合管理实现超过业绩比较基准的收益。
投资策略	在严格控制风险并保持良好流动性的基础上,力争通过主动的组合管理实现超越业绩比较基准的收益。基金管理人在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上,采取积极主动地投资管理策略,通过定性与定量分析,对利率变化趋势、债券收益率曲线移动方向、信用利差等影响固定收益投资品价格的因素进行评估,对不同投资品种运用不同的投资策略,并充分利用市场的非有效性,把握各类套利的机会。在信用风险可控的前提下,寻求组合流动性与收益的最佳配比,力求持续取得达到或超过业绩比较基准的收益。
业绩比较基准	中债总全价指数(总值)
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低风险的品种,其预期的风险收益水平低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。
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

§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(2017年4月1日－2017年6月30日)
1.本期已实现收益	117,019.45
2.本期利润	550,976.70
3.加权平均基金份额本期利润	0.0193
4.期末基金资产净值	42,184,923.39
5.期末基金份额净值	1.0873

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。

3.2 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	1.39%	0.32%	-1.04%	0.11%	2.43%	0.21%

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2013年3月6日,建仓期为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,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		
高翰昆	本基金基金经理,万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞和灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞丽灵活配置混合型证券投资基金、万家顺达保本混合型证券投资基金、万家顺和保本混合型证券投资基金、万家瑞旭灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、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、万家瑞隆灵活配置混合型证券投资基金、万家家泰债券型证券投资基金、万家盛债券型证券投资基金、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金基金经理。	2015年3月17日	-	8年	英国诺丁汉大学硕士。2009年7月加入万家基金管理有限公司,历任研究部助理、交易员、交易部总监助理、交易部副总监。
李文宾	本基金基金经理,万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家家盛债券型证券投资基金、万家家泰债券型证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金基金经理。	2017年2月3日	-	7年	2010年7月至2014年4月在中银国际证券有限责任公司工作,担任研究员职务。2014年5月至2015年11月在华泰资产管理有限公司工作,担任研究员职务。2015年11月进入我公司工作。

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》、《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

2017年第二季度之初,雄安新区的横空出世带动A股市场延续一季度的上涨行情,但随着后续热点不足以及监管政策升级,市场进行了迅速调整,直至5月中下旬逐步企稳后开始反弹。风格方面分化明显,随着ipo提速,打击炒壳并购重组,以及加入MSCI,股市估值体系正在全面重构。价值投资复兴,大盘蓝筹表现抢眼,小盘股估值回归,整体较为暗淡。宏观层面,2017是世界政治大年,但目前看主要大选均平稳度过,没有出现此前市场担心的黑天鹅事件。发达国家和主要新兴国家经济增速均超预期。外汇市场上,人民币对美元的贬值压力有了较大缓解,资本流出和外汇占款下降压力有所缓和。受益于外部市场向好以及供给侧改革取动,国内经济总体稳定。货币政策维持中性,M2增速下降,金融监管趋严。展望第三季度,地产和基建投资料将继续放缓,但改革将进一步推进,改革红利落地可期。对于符合改革目标、基本面和盈利均有改善的标的有望获得较好的市场表现。

本基金作为被动投资型的ETF基金,其投资目标是通过跟踪、复制上证50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成分股分红、各类费用等因素所造成。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为2.0143元;本报告期基金份额净值增长率为10.11%,业绩比较基准收益率为8.06%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况。

本报告期内,本基金自4月1日至5月18日连续31个工作日基金份额持有人数量不满两百人。

§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	124,903,442.35	98.86
	其中:股票	124,903,442.35	98.86
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	1,303,472.47	1.03
8	其他资产	142,876.25	0.11
9	合计	126,349,791.07	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	0.00	0.00
B	采矿业	4,750,691.00	3.77
C	制造业	21,523,768.00	17.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,051,226.00	0.83
E	建筑业	8,337,547.00	6.62
F	批发和零售业	0.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	2,316,777.00	1.84
H	住宿和餐饮业	0.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,786,824.00	1.42
J	金融业	80,916,394.50	64.25
K	房地产业	4,010,810.00	3.18
L	租赁和商务服务业	0.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	0.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	0.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
P	教育	0.00	0.00
Q	卫生和社会工作	0.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	0.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	124,694,037.50	99.01

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	209,404.85	0.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
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	209,404.85	0.17

5.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本报告期末本基金未通过沪港通投资股票。

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	312,000	15,478,320.00	12.29
2	600036	招商银行	297,100	7,103,661.00	5.64
3	600519	贵州茅台	14,500	6,841,825.00	5.43
4	601166	兴业银行	359,100	6,054,426.00	4.81
5	600016	民生银行	680,900	5,596,998.00	4.44
6	601328	交通银行	791,500	4,875,640.00	3.87
7	601668	中国建筑	432,000	4,181,760.00	3.32
8	600000	浦发银行	323,770	4,095,690.50	3.25
9	601288	农业银行	1,101,200	3,876,224.00	3.08
10	600030	中信证券	226,700	3,858,434.00	3.06

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

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	600884	杉杉股份	60,600	998,082.00	2.37
2	600392	盛和资源	68,200	899,558.00	2.13
3	601377	兴业证券	113,900	846,277.00	2.01
4	600340	华夏幸福	23,000	772,340.00	1.83
5	601211	国泰君安	31,100	637,861.00	1.51
6	300271	华宇软件	36,700	608,853.00	1.44
7	600114	东睦股份	32,300	565,250.00	1.34
8	002142	宁波银行	23,400	451,620.00	1.07
9	601166	兴业银行	25,800	434,988.00	1.03
10	601997	贵阳银行	26,500	418,965.00	0.99

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	1,141,599.90	2.71
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,005,000.00	4.75
	其中:政策性金融债	2,005,000.00	4.75
4	企业债券	30,848,884.58	73.13
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	659,904.70	1.56
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	34,655,389.18	82.15

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112118	12金蝶01	25,100	2,510,251.00	5.95
2	122207	12陆能集	21,000	2,106,510.00	4.99
3	112168	12三维德	20,770	2,073,884.50	4.92
4	112172	13晋邦债	20,700	2,070,828.00	4.91
5	112137	12康得债	20,550	2,066,302.50	4.90

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投资。

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,本基金暂不可投资于股指期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,114.19
2	应收证券清算款	100,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	565,489.16
5	应收申购款	59.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	669,663.29

5.10.4 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处于转股期的可转换债券。

5.10.5 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	300271	华宇软件	608,853.00	1.44	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	19,356,010.86
报告期期间基金总申购份额	25,278,497.53
减:报告期期间基金总赎回份额	5,835,361.55
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-