万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金

2018年半年度报告摘要

基金管理人：万家基金管理有限公司
基金托管人：华夏银行股份有限公司
送出日期：2018年8月28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。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。

基金托管人华夏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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	万家瑞益	
基金主代码	001635	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年12月7日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	华夏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	550,115,165.05份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称：	万家瑞益A	万家瑞益C
下属分级基金的交易代码：	001635	001636
报告期末下属分级基金的份额总额	807,542.00份	549,307,623.05份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过灵活运用资产配置策略及多种股票市场、债券市场投资策略，充分挖掘潜在的投资机会，追求基金资产长期稳定增值。
投资策略	基金管理人在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上，采取积极主动地的投资管理策略，通过定性与定量分析，对利率变化趋势、债券收益率曲线移动方向、信用利差等影响固定收益投资品价格的因素进行评估，对不同投资品种运用不同的投资策略，并充分利用市场的非有效性，把握各类套利的机会。在信用风险可控的前提下，寻求组合流动性与收益的最佳配比，力求持续取得达到或超过业绩比较基准的收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%
风险收益特征	本基金是混合型基金，风险高于货币市场基金和债券型基金但低于股票型基金，属于中高风险、中高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	华夏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	郑鹏
	联系电话	021-38909626	010-85238667
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	zhengpeng@hxb.com.cn
客户服务电话		95538转6、4008880800	95577
传真		021-38909627	010-85238680

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.wjasset.com
基金半年度报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区浦电路360号8层（名义楼层9层）基金管理人办公场所

§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

基金级别	万家瑞益A	万家瑞益C
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)	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	35,242.41	18,803,381.45
本期利润	-8,191.07	-3,939,422.71
加权平均基金份额本期利润	-0.0095	-0.0078
本期基金份额净值增长率	1.31%	0.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.2103	0.1855
期末基金资产净值	977,397.03	651,226,215.71
期末基金份额净值	1.2103	1.1855

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(为期末余额，不是当期发生数)。

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

万家瑞益A

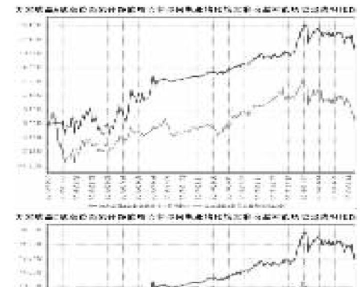
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.80%	0.56%	-3.54%	0.64%	2.74%	-0.08%
过去三个月	-2.58%	0.42%	-3.98%	0.57%	1.40%	-0.15%
过去六个月	1.31%	0.45%	-4.46%	0.58%	5.77%	-0.13%
过去一年	5.23%	0.35%	0.18%	0.47%	5.05%	-0.12%
自基金合同生效起至今	21.03%	0.51%	2.30%	0.56%	18.73%	-0.05%

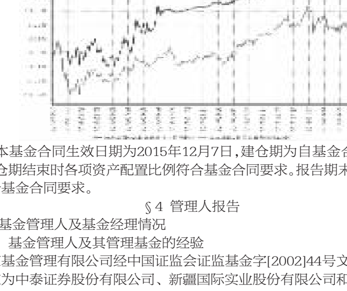
万家瑞益C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.82%	0.56%	-3.54%	0.64%	2.72%	-0.08%
过去三个月	-2.67%	0.42%	-3.98%	0.57%	1.31%	-0.15%
过去六个月	0.95%	0.45%	-4.46%	0.58%	5.41%	-0.13%
过去一年	4.33%	0.35%	0.18%	0.47%	4.15%	-0.12%
自基金合同生效起至今	18.55%	0.51%	2.30%	0.56%	16.25%	-0.05%

注：基金业绩比较基准=沪深300指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%

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





注：本基金合同生效日期为2015年12月7日，建仓期为自基金合同生效日起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。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		
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、万家双利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、万家瑞隆混合型证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家成长优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2017年4月14日	-	8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。
高翰昆	本基金基金经理，万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家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、万家鑫瑞纯债债券型证券投资基金、万家家乐债券型证券投资基金、万家家裕债券型证券投资基金、万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2015年12月7日	-	9年	基金经理，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》、《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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾市场，2018年上半年股市相对于2017年出现了非常显著的变化：市场风格趋于均衡，指数和个股的波动加大，同时成交量有所降低。

从宏观上来看，年初我们对国内经济持谨慎乐观的态度，因而我们采取了防御性的投资思路。上半年外部最大的变化是贸易战的持续升温，而内部的变化则是金融去杠杆。贸易战的升级以及对市场的影响超出了我们的预期，上半年股市走熊与此高度相关。

在上半年的投资，出于防守考虑，我们主要布局了低估值、防御性的品种，包括地产、银行等等。同时我们阶段性的参与了成长股及周期股的行情。从上半年的行情来看，我们持仓的品种受到贸易战、金融去杠杆以及调控政策加剧的影响，出现了一定的波动。

国内上半年宏观经济保持平稳，新常态下经济内生动力逐步代替投资拉动。通胀维持在低位，货币政策中性偏紧，后期略有缓解。整体来看，基本面仍有一定的不确定因素，有利于债券市场的稳定。短期内，债券市场仍受到各类政策影响，存在一定的波动。

上半年债券市场的波动，对于本组合净值影响不大，组合净值主要跟随权益市场的波动。当前市场对于低评级信用债风险偏好较低，本组合也在密切关注信用风险的变化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家瑞益A基金份额净值为1.2103元，本报告期基金份额净值增长率为1.31%；截至本报告期末万家瑞益C基金份额净值为1.1855元，本报告期基金份额净值增长率为0.95%；同期业绩比较基准收益率为-4.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

放眼2018年下半年，我们认为目前股市较大概率处在中长期的历史底部区域。

从基本面上看，我国主要宏观调控指标都处在合理区间，经济结构转型升级成效正在显现，经济依然有韧性。虽然当前市场整体依然低迷，且不断创出阶段新低，成交量进一步萎缩，中美贸易摩擦不断对市场情绪形成负面。但市场也有积极的一面，从召开的首次金融稳定发展委员会会议，明确了持续推进金融领域的改革开放，强调了维护金融市场流动性的合理充裕，并在监管的节奏和力度上做好控制，确保不发生系统性金融风险。到央行及银监会发布的资管及理财新规的细则，释放出监管层稳定市场预期的意图，从投资范围、估值方法到过渡期安排均有所放松，确保市场平稳过渡。再到国常会和政治局会议提到的提到要求财政政策将更加积极，稳健货币政策要松紧适度。显示出在当前的宏观环境的不确定性和国内经济形势之下，官方层面明确了政策调整的信号。

从估值上看，目前A的整体估值处于历史底部区域，与2005年6月份、2008年10月份、2013年6月份以及2016年的1月份四次底部时的市盈率水平相近。而且外资也一直在持续加大对A股市场的配置，在6月份A股正式被纳入MSCI后，这一趋势有所加速。反映的是海外投资机构对中国经济基本面的稳定和成长预期，以及当前低市盈率水平下的A股投资机会。

综合以上因素，预计2018年下半年股市走势将会优于上半年。

随着经济下行的压力增大，我们倾向于年初以来过严的金融政策上将会逐步放松，行政化的手段也会边际收敛，同时利率也会逐步下行，这更有利于低估值的价值蓝筹股。随着年底估值切换的时点日益临近，我们看好沪深300中有一定成长性的低估值公司的机会，主要集中在金融、地产及消费板块中的优质个股。我们认为这些低估值板块个股在下半年会迎来估值修复的行情。成长股我们认为仍然是结构性的行情，可以阶段性的布局和参与。

下半年市场的分歧逐步加大，各类基本面不确定因素，都可能对于市场产生较大的扰动。继续关注货币政策的变化，以及地方债的供给节奏，预计下半年的市场会有一定的起伏。

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：“本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的90%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；”

结合法律法规及基金合同的规定，本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未发生连续20个工作日基金份额持有人数量不满200人或基金资产净值低于5000万的情况。

§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

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，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份额持有人利益的行为。

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

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

本基金本报告期内未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金2018年半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日：2018年6月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产：		
银行存款	6,864,224.26	46,236,134.28
结算备付金	1,048,885.97	723,600.10
存出保证金	270,933.42	239,947.71
交易性金融资产	632,708,919.17	386,812,483.42
其中：股票投资	160,036,107.97	101,132,236.42
基金投资	-	-
债券投资	472,672,811.20	285,680,247.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	5,997,723.00	13,000,000.00
应收证券清算款	6,580,325.43	4,422,236.97
应收利息	11,701,366.50	4,149,145.17
应收股利	-	-
应收申购款	1,849,067.94	605,070.50
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	667,021,445.69	456,188,618.15
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	21,995,857.51
应付证券清算款	3,252,716.58	4,870,412.74
应付赎回款	10,224,007.34	5,628,842.25
应付管理人报酬	389,008.44	263,059.01
应付托管费	111,145.27	75,159.75
应付销售服务费	110,978.09	75,052.88
应付交易费用	255,043.83	206,018.93
应交税费	3,845.47	-
应付利息	-	18,200.58
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	471,087.93	345,008.29
负债合计	14,817,832.95	33,477,611.94
所有者权益：		
实收基金	550,115,165.05	359,949,710.92
未分配利润	102,088,447.69	62,761,295.29
所有者权益合计	652,203,612.74	422,711,006.21
负债和所有者权益总计	667,021,445.69	456,188,618.15

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额总额550,115,165.05份，其中万家瑞益A份额净值1.2103元，份额总额807,542.00份；万家瑞益C份额净值1.1855元，份额总额549,307,623.05份。

6.2 利润表

会计主体：万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金
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 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	749,898.03	31,421,957.82
1.利息收入	10,371,666.56	17,724,257.23
其中：存款利息收入	512,302.01	7,669,983.32
债券利息收入	9,417,920.40	4,439,612.50
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	441,444.15	5,614,661.41
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	12,232,474.76	7,800,761.11
其中：股票投资收益	10,770,114.80	6,879,576.07
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-68,234.06	-121,527.30
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,530,594.02	1,042,712.34
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-22,786,237.64	5,418,176.62
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	931,994.35	478,762.86
减：二、费用	4,697,511.81	5,867,121.97
1．管理人报酬	2,106,760.62	3,232,226.13
2．托管费	601,931.59	923,493.19
3．销售服务费	600,866.07	922,067.86
4．交易费用	1,044,355.40	437,032.79
5．利息支出	150,578.83	160,141.10
其中：卖出回购金融资产支出	150,578.83	160,141.10
6．税金及附加	3,338.10	-
7．其他费用	189,681.20	192,160.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-3,947,613.78	25,554,835.85
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-3,947,613.78	25,554,835.85

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金
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 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）	359,949,710.92	62,761,295.29	422,711,006.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,947,613.78	-3,947,613.78
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）	190,165,454.13	43,274,766.18	233,440,220.31
其中：1.基金申购款	626,375,777.48	135,173,279.99	761,549,057.47
2.基金赎回款	-436,210,323.35	-91,898,513.81	-528,108,837.16
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	550,115,165.05	102,088,447.69	652,203,612.74
项目	上年度可比期间 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）	988,845,250.13	102,968,504.34	1,091,813,754.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	25,554,835.85	25,554,835.85
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）	-428,131,484.36	-52,075,580.78	-480,207,065.14
其中：1.基金申购款	571,925,177.24	64,282,512.50	636,207,689.74
2.基金赎回款	-1,000,056,661.60	-116,358,093.28	-1,116,414,754.88
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	560,713,765.77	76,447,759.41	637,161,525.18

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

______方一天______ ______李杰______ ____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

万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会证监许可[2015]133号文《关于准予万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的批准，由基金管理人万家基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于2015年12月7日生效，首次设立募集规模为201,710,223.12份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为万家基金管理有限公司，注册登记机构为万家基金管理有限公司，基金托管人为华夏银行股份有限公司。

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（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债、证券公司短期公司债券）、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。股票投资占基金资产的0%-95%。其中，基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金通过灵活运用资产配置策略及多种股票市场、债券市场投资策略，充分挖掘潜在的投资机会，追求基金资产长期稳定增值。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

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1月1日至6月30日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

本半年度报告所采用的会计政策、会计估计与上年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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重大日后事项。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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
华夏银行股份有限公司（“华夏银行”）	基金托管人、基金代销机构

注：以下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 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

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交易。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 关联方报酬

6.4.9.3.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 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	2,106,760.62	3,232,226.13
其中：支付销售机构的客户维护费	929,121.84	1,495,432.64

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.70%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.70%/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

6.4.9.3.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 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	601,931.59	923,493.19

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×0.20%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

6.4.9.3.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家瑞益A	万家瑞益C	合计
万家基金管理有限公司	-	1,395.78	1,395.78
合计	-	1,395.78	1,395.78
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家瑞益A	万家瑞益C	合计
万家基金管理有限公司	-	114.04	114.04
合计	-	114.04	114.04

注：销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及C类基金份额持有人服务等各项费用。本基金份额分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A类不收取销售服务费，C类销售服务费年费率为0.20%。C类基金份额的销售服务费计算方法如下：

H=E×0.20%/当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

6.4.9.4 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。

6.4.9.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.9.5.2 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。

6.4.9.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 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
华夏银行股份有限公司	6,864,224.26	35,709.45	8,972,330.85	54,270.70

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日获得的利息收入为人民币5,392.41元(2017年1月1日至6月30日为人民币4,534.02元)，2018年6月30日结算备付金余额为人民币1,048,885.97元(2017年6月30日为人民币353,086.68元)。

6.4.9.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.10 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.10.1 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

6.4.10.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603105	芯能科技	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-
603693	江苏新能	2018年6月25日	2018年7月3日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-

6.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300197	铁汉生态	2018年5月28日	重大资产重组	4.71	-	-	394,680	3,254,690.83	1,858,942.80	-
002310	东方园林	2018年5月25日	重大资产重组	13.07	2018年8月27日	13.47	283,400	5,273,443.00	3,704,038.00	

6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购。

6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购。

6.4.11 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	160,036,107.97	23.99
	其中：股票	160,036,107.97	23.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	472,672,811.20	70.86
	其中：债券	472,672,811.20	70.86
	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	5,997,723.00	0.90
	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	7,913,110.23	1.19
8	其他各项资产	20,401,693.29	3.06
9	合计	667,021,445.69	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	-	-
C	制造业	5,298,381.44	0.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.01
E	建筑业	5,562,980.80	0.85
F	批发和零售业	48,229.12	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	5,435,501.10	0.83
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	43,307,058.08	6.64
K	房地产业	100,231,171.44	15.37
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	0.01
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	160,036,107.97	24.54

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601155	新城控股	800,931	24,804,833.07	3.80
2	600606	绿地控股	2,757,834	18,036,234.36	2.77
3	600048	保利地产	1,269,968	15,493,609.60	2.38
4	601997	贵阳银行	1,061,197	13,116,394.92	2.01
5	000002	万 科A	441,100	10,851,060.00	1.66
6	001979	招商蛇口	530,256	10,101,376.80	1.55
7	600383	金地集团	836,760	8,526,584.40	1.31
8	600340	华夏幸福	276,305	7,114,853.75	1.09
9	000001	平安银行	689,113	6,264,037.17	0.96
10	002142	宁波银行	349,100	5,686,839.00	0.87

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

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600606	绿地控股	35,589,319.81	8.42
2	601155	新城控股	35,060,439.06	8.29
3	600383	金地集团	19,787,912.56	4.68
4	600048	保利地产	15,881,500.10	3.76
5	000001	平安银行	15,853,008.00	3.75
6	002839	张家港行	15,524,358.91	3.67
7	000002	万 科A	12,829,470.97	3.04
8	601229	上海银行	12,092,736.63	2.86
9	000932	华菱钢铁	10,629,542.00	2.51
10	601688	华泰证券	9,529,492.00	2.25
11	600782	新钢股份	9,031,811.17	2.14
12	601998	中信银行	8,972,482.00	2.12
13	601009	南京银行	8,955,514.00	2.12
14	600340	华夏幸福	8,161,682.04	1.93
15	300059	东方财富	7,974,348.69	1.89
16	001979	招商蛇口	7,448,840.00	1.76
17	002310	东方园林	7,392,565.72	1.75
18	601668	中国建筑	7,029,450.00	1.66
19	600068	葛洲坝	6,929,495.53	1.64
20	600115	东方航空	6,676,890.41	1.58

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	601155	新城控股	15,696,579.82	3.71
2	600383	金地集团	14,997,423.70	3.55
3	600606	绿地控股	13,808,527.97	3.27
4	601229	上海银行	12,716,181.68	3.01
5	600340	华夏幸福	11,478,931.74	2.72
6	000932	华菱钢铁	11,135,527.11	2.63
7	601688	华泰证券	9,742,134.43	2.30
8	002839	张家港行	9,181,153.34	2.17
9	300059	东方财富	9,173,005.35	2.17
10	601998	中信银行	8,607,401.29	2.04
11	600048	保利地产	8,284,737.47	1.96
12	000001	平安银行	8,179,035.63	1.93
13	600967	内蒙一机	7,691,995.00	1.82
14	600491	龙元建设	7,519,799.38	1.78
15	600782	新钢股份	7,227,007.56	1.71
16	601668	中国建筑	7,058,448.00	1.67
17	001979	招商蛇口	6,582,200.68	1.56
18	600068	葛洲坝	6,488,581.20	1.53
19	002024	苏宁易购	6,199,591.88	1.47
20	000069	华侨城A	5,692,900.88	1.35

注：“卖出金额”按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	403,575,980.76
卖出股票收入（成交）总额	328,398,704.22

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	5,086,508.60	0.78
2	央行票据	-	-
3	金融债券	141,079,929.60	21.63
	其中：政策性金融债	141,079,929.60	21.63
4	企业债券	2,898,914.20	0.44
5	企业短期融资券	29,990,000.00	4.60
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,818,458.80	0.43
8	同业存单	290,799,000.00	44.59
9	其他	-	-
10	合计	472,672,811.20	72.47

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	170215	17国开15	500,000	49,710,000.00	7.62
2	111719304	17恒丰银行CD304	500,000	47,835,000.00	7.33
3	111821101	18渤海银行CD101	400,000	39,116,000.00	6.00
4	180206	18国开06	300,000	30,702,000.00	4.71
5	170208	17国开08	300,000	30,018,000.00	4.60

7.7 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。

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

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

7.12.2 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	270,933.42
2	应收证券清算款	6,580,325.43
3	应收股利	-
4	应收利息	11,701,366.50
5	应收申购款	1,849,067.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,401,693.29

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113011	光大转债	2,513,659.60	0.39

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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
万家瑞益A	215	3,756.01	0.00	0.00%	807,542.00	100.00%
万家瑞益C	228,550	2,403.45	1,033,188.93	0.19%	548,274,434.12	99.81%
合计	228,722	2,405.17	1,033,188.93	0.19%	549,081,976.12	99.81%

注：本基金存在同时持有A级和C级的客户。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	万家瑞益A	895.75	0.1109%
	万家瑞益C	13,198.29	0.0024%
	合计	14,094.04	0.0026%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	万家瑞益A	0
	万家瑞益C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	万家瑞益A	0~10
	万家瑞益C	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家瑞益A	万家瑞益C
基金合同生效日（2015年12月7日）基金份额总额	190,777.09	201,519,446.03
本报告期期初基金份额总额	514,145.87	359,435,565.05
本报告期基金总申购份额	1,034,707.84	625,341,069.64
减：本报告期基金总赎回份额	741,311.71	435,469,011.64
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	807,542.00	549,307,623.05

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：
报告期内无涉及基金管理人的重大人事变动。
基金托管人：
本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	468,484,180.04	64.13%	408,002.21	62.78%	-
招商证券	1	220,759,023.41	30.22%	205,593.10	31.63%	-
浙商证券	1	41,312,519.09	5.65%	36,309.65	5.59%	-

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、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。

(2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

3、基金专用交易席位的变更情况：

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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	29,416,336.20	77.48%	348,700,000.00	67.85%	-	-
招商证券	7,896,985.70	20.80%	143,000,000.00	27.82%	-	-
浙商证券	651,000.00	1.71%	22,243,000.00	4.33%	-	-

§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。

万家基金管理有限公司
2018年8月28日