

万家增强收益债券型证券投资基金 2015 年年度报告摘要

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 25 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2016 年 3 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计,安永华明会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	万家增强收益债券
基金主代码	161902
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 9 月 28 日
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1, 254, 143, 781. 47 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在满足基金资产良好流动性的前提下, 谋求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金在构建债券投资组合时合理评估收益性、流动性和信用风险, 追求基金资产的长期稳定增值。并通过新股申购和投资于相对价值被低估的成长型股票谋取增强收益。
业绩比较基准	中证全债指数
风险收益特征	本基金为债券型基金, 其长期平均风险和预期收益率低于股票型和混合型基金, 高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		万家基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	林葛
	联系电话	021-38909626	010-66060069
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95538 转 6、4008880800	95599
传真		021-38909627	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.wjasset.com
基金年度报告备置地点	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、基金净值表现及利润分配情况

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	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	38,781,517.64	34,644,336.76	43,902,483.11
本期利润	27,889,173.07	60,726,593.33	25,908,268.08
加权平均基金份额本期利润	0.0843	0.1667	0.0316
本期基金份额净值增长率	8.20%	22.75%	2.13%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	0.3126	0.1802	0.0126
期末基金资产净值	1,616,566,125.92	221,343,217.66	639,801,723.88
期末基金份额净值	1.2890	1.1913	0.9705

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

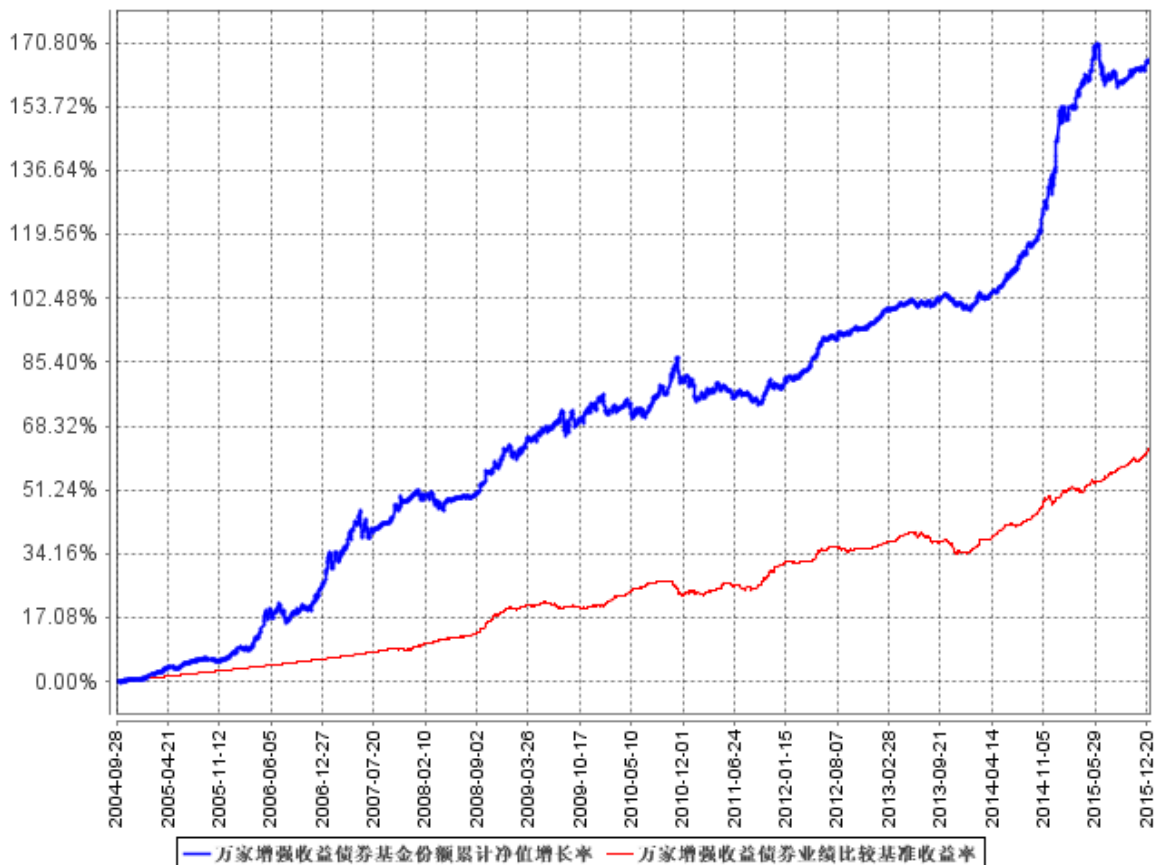
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	2.02%	0.15%	2.75%	0.07%	-0.73%	0.08%
过去六个月	0.70%	0.19%	5.39%	0.07%	-4.69%	0.12%
过去一年	8.20%	0.31%	8.74%	0.08%	-0.54%	0.23%
过去三年	35.65%	0.25%	19.21%	0.09%	16.44%	0.16%
过去五年	47.82%	0.22%	30.66%	0.10%	17.16%	0.12%
自基金合同生效起至今	165.90%	0.27%	62.12%	0.08%	103.78%	0.19%

注：基金业绩比较基准中证全债指数

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

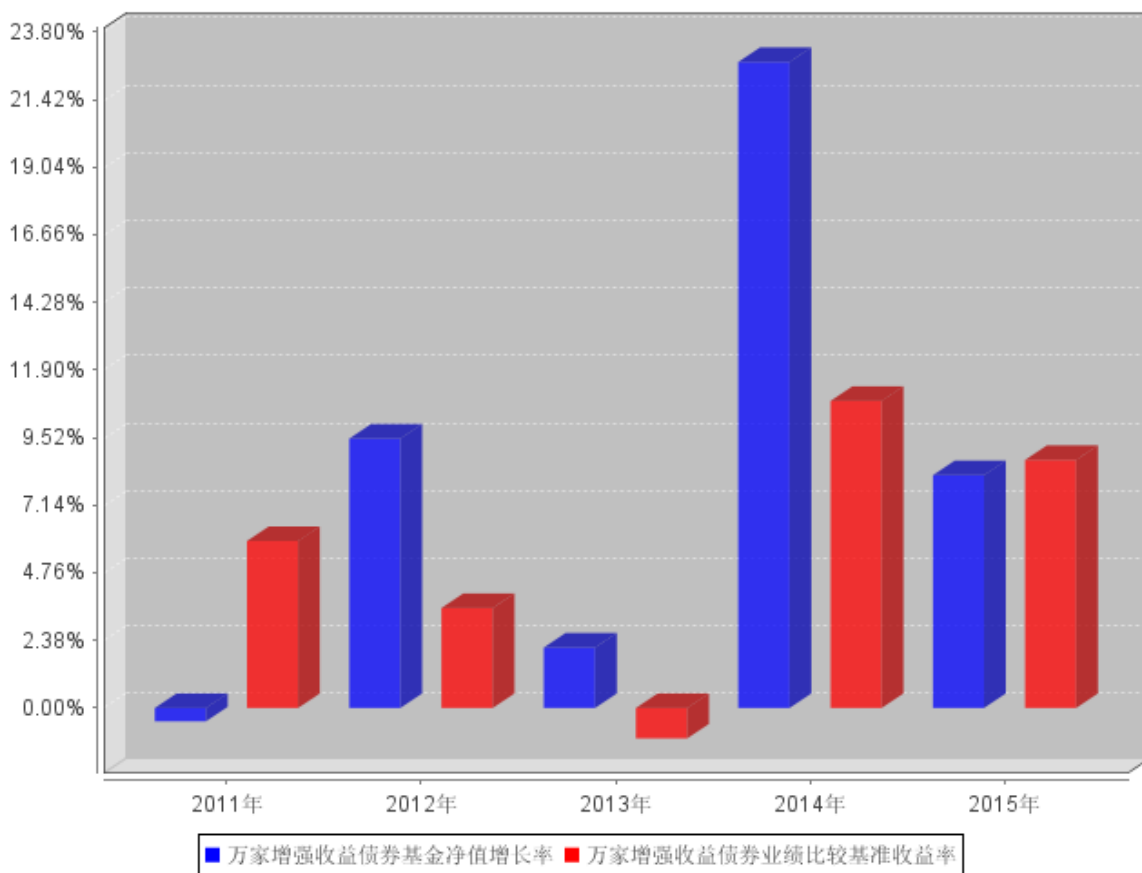
万家增强收益债券基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金成立于2004年9月28日，于2007年9月29日转型为债券型基金，转型后建仓期为半年，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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家增强收益债券过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015	-	-	-	-	
2014	-	-	-	-	
2013	0.9000	82,398,505.65	6,706,002.70	89,104,508.35	
合计	0.9000	82,398,505.65	6,706,002.70	89,104,508.35	

§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。目前管理二十三只基金,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、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、万家中证红利指数型证券投资基金(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和万家新兴蓝筹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		
高翰昆	本基金基金经理、万家新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、万家双利债券型证券投资基金基金经理、万家瑞丰灵活配置	2015 年 10 月 17 日	-	5 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

	混合型证券投资基金基金经理、万家现金宝货币市场证券投资基金基金经理、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金基金经理。				监。
孙驰	本基金基金经理、万家货币基金经理、万家日日薪货币基金基金经理、万家双利债券型基金基金经理、万家强化收益定期开放债券型基金基金经理、万家现金宝货币市场基金经理、固定收益部总监	2011年3月19日	2015年10月17日	8年	硕士学位，曾任中海信托股份有限公司投资经理。2010年4月加入万家基金管理有限公司，曾担任固定收益研究员、基金经理助理。

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合规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律、法规和监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金持有人谋取最大利益,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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《万家基金管理有限公司公平交易管理办法》,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,严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送,确保公平对待不同投资组合。

在投资决策上:(1)公司对不同类别的投资组合分别设定独立的投资部门,公募基金经理和特定客户资产管理投资经理不得互相兼任。(2)公司投资管理实行分层次决策,投资决策委员会下设的公募基金投资决策小组和专户投资决策小组分别根据公募基金和专户投资组合的规模、风格特征等因素合理确定各投资组合经理的投资权限,投资组合经理在授权范围内自主决策,超过投资权限的操作需经过严格的逐级审批程序。(3)公司接受的外部研究报告、研究员撰写的研究报告等均通过统一的投研管理平台发布,确保各投资组合经理在获得投资信息、投资建议和实施决策方面享有公平的机会。

在交易执行上:(1)公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离,实行集中交易制度;(2)对于交易公开竞价交易,所有指令必须通过系统下达,公司执行交易系统中的公平交易程序;(3)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,各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量,公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;(4)对于银行间交易,交易部按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。

在行为监控上,公司定期对不同投资组合的同向交易价差、反向交易,场外交易对手议价的价格公允性及其他异常交易情况进行监控及分析,基金经理对异常交易情况进行合理性解释并留存记录,并定期编制公平交易分析报告,由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司定期进行同向交易价差分析,即采集公司旗下管理的所有组合,连续四个季度期间内,不

同时间窗下(日内、3日内、5日内)的同向交易样本,对两两组合之间的同向交易价差均值进行原假设为 0,95%的置信水平下的 t 检验,并对结论进行跟踪分析,分析结果显示在样本数量大于 30 的前提下,组合之间在同向交易方面不存在违反公平交易行为。

4.3.3 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

2015 年全年,各项宏观数据依然疲弱,ppi 继续下跌 cpi 低位徘徊通缩压力逐步加大,央行全年不断降准降息实施宽松的货币政策。811 汇改后,外汇市场出现明显波动并直接影响到国内的股票及债券市场,面对持续的资本流出压力及不稳定的金融市场,12 月央行并没有再次降准,表明央行的宽松货币政策是比较审慎的。资本市场方面,全年动荡加剧。债券市场由于对基本面的担忧叠加宽松的货币政策,总体呈现一个较强的牛市格局,收益率曲线平坦化发展。权益市场在上半年杠杆牛资金牛改革牛预期下走出一波牛市,但年中叠加去杠杆及基本面背离等情况出现快速杀跌,全年波动巨大。

本基金在兼顾流动性的同时,根据大类资产配置灵活调整各类资产比例,抓住了纯债和权益的投资机会,获得了一定的绝对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,该基金份额净值为 1.2890 元,报告期基金份额净值增长率为 8.20%,同期业绩比较基准增长率 8.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望来年,决策层提出了供给侧改革的新思路,短期可能会造成全社会的阶段性阵痛。加之外汇占款流出,基本面筑底,通缩压力加大等因素,央行必然会继续实施宽松的货币政策,很可能会继续降准降息为经济保驾护航,但这会是一个反复的过程。资金可能会继续大量淤积在资本市场,全年资本市场可能会出现一个比较效应,资金在各类资产之间不断切换寻找相对估值便宜的资产。

基于以上判断,本基金会更灵活的操作在债券类资产和权益类资产间做切换,仓位控制会

更趋灵活，努力为持有人获得良好回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

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

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不介入基金日常估值业务。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同规定:“本基金收益每年最多分配 6 次,每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 50%”,2015 年末进行利润分配。

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

在托管万家增强收益债券型证券投资基金的过程中,本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《万家增强收益债券型证券投资基金合同》、《万家增强收益债券型证券投资基金托管协议》的约定,对万家增强收益债券型证券投资基金管理人—万家基金管理有限公司 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损

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

本托管人认为, 万家基金管理有限公司在万家增强收益债券型证券投资基金的投资运作、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、利润分配等问题上, 不存在损害基金份额持有人利益的行为; 在报告期内, 严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规, 在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为, 万家基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定, 基金管理人所编制和披露的万家增强收益债券型证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整, 未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

本基金 2015 年年度财务会计报告已经安永华明会计师事务所审计, 注册会计师签字出具了安永华明(2016) 审字第 60778298_B03 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 万家增强收益债券型证券投资基金

报告截止日: 2015 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产:		
银行存款	590,378,268.35	2,735,141.45
结算备付金	572,225.51	1,574,444.78
存出保证金	410,630.62	371,771.08
交易性金融资产	437,447,578.34	239,333,089.84
其中: 股票投资	32,302,035.44	22,509,230.00
基金投资	-	-
债券投资	405,145,542.90	216,823,859.84

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	951,741,869.61	33,840,170.76
应收证券清算款	-	7,051,905.26
应收利息	9,299,389.33	3,742,162.08
应收股利	-	-
应收申购款	199,550.00	2,890,461.27
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,990,049,511.76	291,539,146.52
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2015年12月31日	2014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	-	57,099,710.70
应付证券清算款	372,000,000.00	8,006,996.23
应付赎回款	119,460.20	3,939,360.22
应付管理人报酬	315,066.23	138,100.21
应付托管费	90,018.89	39,457.22
应付销售服务费	180,037.87	78,914.40
应付交易费用	133,760.87	197,123.10
应交税费	-	-
应付利息	-	51,225.00
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	645,041.78	645,041.78
负债合计	373,483,385.84	70,195,928.86
所有者权益:		
实收基金	1,201,291,769.47	177,973,540.53
未分配利润	415,274,356.45	43,369,677.13
所有者权益合计	1,616,566,125.92	221,343,217.66
负债和所有者权益总计	1,990,049,511.76	291,539,146.52

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2890 元，基金份额总额

1,254,143,781.47 份。

7.2 利润表

会计主体：万家增强收益债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	35,381,105.21	67,973,886.33
1. 利息收入	18,075,817.66	17,455,652.79
其中：存款利息收入	143,379.13	94,441.65
债券利息收入	17,497,087.95	16,888,643.23
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	435,350.58	472,567.91
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	28,185,422.87	24,435,976.97
其中：股票投资收益	3,423,605.78	8,839,925.41
基金投资收益	-	-
债券投资收益	24,461,407.02	15,288,087.29
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	300,410.07	307,964.27
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-10,892,344.57	26,082,256.57
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	12,209.25	-
减：二、费用	7,491,932.14	7,247,293.00
1. 管理人报酬	2,891,509.51	2,589,542.83
2. 托管费	826,145.48	739,869.42
3. 销售服务费	1,652,291.14	1,479,738.75
4. 交易费用	1,022,661.22	646,972.74
5. 利息支出	662,406.43	1,354,053.10
其中：卖出回购金融资产支出	662,406.43	1,354,053.10
6. 其他费用	436,918.36	437,116.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	27,889,173.07	60,726,593.33
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	27,889,173.07	60,726,593.33

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家增强收益债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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）	177,973,540.53	43,369,677.13	221,343,217.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	27,889,173.07	27,889,173.07
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）	1,023,318,228.94	344,015,506.25	1,367,333,735.19
其中：1. 基金申购款	1,350,681,531.56	449,911,106.96	1,800,592,638.52
2. 基金赎回款	-327,363,302.62	-105,895,600.71	-433,258,903.33
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）	1,201,291,769.47	415,274,356.45	1,616,566,125.92
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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）	631,483,460.19	8,318,263.69	639,801,723.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	60,726,593.33	60,726,593.33
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）	-453,509,919.66	-25,675,179.89	-479,185,099.55
其中：1. 基金申购款	513,263,027.65	30,634,803.90	543,897,831.55
2. 基金赎回款	-966,772,947.31	-56,309,983.79	-1,023,082,931.10
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）	177,973,540.53	43,369,677.13	221,343,217.66
-----------------	----------------	---------------	----------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

方一天	方一天	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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

万家增强收益债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)由万家保本增值证券投资基金转型而成。万家保本增值证券投资基金,原名天同保本增值证券投资基金,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[2004]86号文《关于同意天同保本增值证券投资基金设立的批复》的核准,由天同基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集,基金合同于2004年9月28日正式生效,首次设立的募集规模为2,193,790,610.57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月更名为万家保本增值证券投资基金。

依据万家保本增值证券投资基金基金份额持有人大会决议,并经中国证监会批准,万家保本增值证券投资基金取消保本保证、调整投资目标、范围和策略,修订基金合同,转型为债券型基金,并更名为“万家增强收益债券型证券投资基金”。自2007年9月29日起,《万家增强收益债券型证券投资基金基金合同》生效,原《万家保本增值证券投资基金基金合同》失效。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,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(原名:中国农业银行)。

基金管理人于2007年11月1日至11月16日向社会开放集中申购,集中申购结束经上海众华沪银会计师事务所有限公司验证并出具沪众会字(2007)第2867号验资报告。集中申购扣除申购费后的净申购金额为人民币242,944,327.33元,在集中申购期间产生的利息为人民币138,128.43元,以上实收基金合计为人民币243,082,455.76元,折合243,082,455.76份基金份额。集中申购结束后,本基金管理人于11月21日按照1:1.068726189的比例对集中申购前原有基金份额进行了拆分,使得验资结束当日基金份额净值为1.00元,再根据当日基金份额净值

(1.00 元) 计算投资者集中申购应获得的基金份额，并由注册登记机构根据基金管理人进行投资者集中申购份额的登记确认。

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、现金、短期金融工具、资产支持证券、权证、中小企业私募债券、中期票据、银行存款及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在满足基金资产良好流动性的前提下，谋求基金资产的稳健增值。2009 年 4 月 1 日前，本基金的业绩比较基准为新华巴克莱资本中国综合债券指数；经基金管理人和托管人协商一致，自 2009 年 4 月 1 日起，本基金业绩比较基准由新华巴克莱资本中国综合债券指数变更为中证全债指数。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》的规定，自 2015 年 3 月 30 日起，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

除上述会计估计变更外，本基金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。

7.4.5 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。

7.4.6 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、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2、营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金

等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 关联方关系

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
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人、基金代销机构
中泰证券股份有限公司（“中泰证券”） （原齐鲁证券有限公司）	基金管理人股东、基金代销机构
新疆国际实业股份有限公司	基金管理人股东
山东省国有资产投资控股有限公司	基金管理人股东
万家共赢资产管理有限公司	基金管理人的子公司
上海承方股权投资管理有限公司（原上海承方投资管理有限公司）	基金管理人控制的公司
天津万家财富资产管理有限公司	基金管理人的子公司
深圳前海万家股权投资管理有限公司	基金管理人控制的公司
上海万家朴智投资管理有限公司	基金管理人控制的公司

注 1：报告期内，天津万家财富资产管理有限公司于 2015 年 9 月 11 日由万家基金管理有限公司和自然人李修辞共同出资组建，为基金管理人的子公司。

注 2：深圳前海万家股权投资管理有限公司于 2015 年 11 月 27 日由天津万家财富资产管理有限公司全资设立，受基金管理人间接控制。

注 3：上海万家朴智投资管理有限公司于 2015 年 11 月 20 日由天津万家财富资产管理有限公司与上海灏济投资管理中心（有限合伙）共同出资组建，受基金管理人间接控制。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期及上年度均未有通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

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股票交易。

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 债券回购交易

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回购交易。

7.4.8.1.4 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。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,891,509.51	2,589,542.83
其中：支付销售机构的客户维护费	314,587.46	340,598.97

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：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提, 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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	826,145.48	739,869.42

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 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，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。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
万家基金管理有限公司	1,014,387.57
中国农业银行	356,432.63
合计	1,370,820.20
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
万家基金管理有限公司	794,868.56
中国农业银行	379,737.97
合计	1,174,606.53

注：基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。本基金销售服务年费率为 0.40%，计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据基金管理人指令于次月前 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人支付给各代销机构，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	590,378,268.35	82,117.03	2,735,141.45	50,065.29

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2015 年度获得的利息收入为人民币 21,735.12 元(2014 年度:人民币 28,267.75 元), 2015 年末结算备付金余额为人民币 572,225.51 元(2014 年末:人民币 1,574,444.78 元)。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本年度及上年度末均未在承销期内直接购入关联方所承销的证券。

7.4.9 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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

7.4.9.1 受限证券类别：债券										
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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123001	蓝标转债	2015年12月23日	2016年1月8日	重大事项	100.00	100.00	5,190	519,000.00	519,000.00	-

7.4.9.2 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
002065	东华软件	2015 年 12 月 21 日	重大事项	25.10	-	-	50,000	1,027,366.50	1,255,000.00	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收款项、卖出回购金融资产款以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 31,047,035.44 元，属于第二层次的余额为人民币 406,400,542.90 元，无属于第三层次的余额。（于 2014 年 12 月 31 日，第一层次的余额为人民币 125,195,093.84 元，属于第二层次的余额为人民币 114,137,996.00 元，无属于第三层次余额）。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行

等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》的规定，自2015年3月30日起，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值所属层级从第一层次转入第二层次。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具本期末和上期末均不以第三层次公允价值计量。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大承诺事项。

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于2016年3月15日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 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	32,302,035.44	1.62
	其中：股票	32,302,035.44	1.62
2	固定收益投资	405,145,542.90	20.36
	其中：债券	405,145,542.90	20.36
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	951,741,869.61	47.83
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

6	银行存款和结算备付金合计	590,950,493.86	29.70
7	其他各项资产	9,909,569.95	0.50
8	合计	1,990,049,511.76	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	21,676,984.44	1.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,901,600.00	0.24
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,831,962.00	0.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,255,000.00	0.08
J	金融业	1,929,439.00	0.12
K	房地产业	1,399,650.00	0.09
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	307,400.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	32,302,035.44	2.00

8.3 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	000910	大亚科技	200,000	3,308,000.00	0.20
2	600089	特变电工	176,272	2,074,721.44	0.13
3	000598	兴蓉环境	280,000	1,993,600.00	0.12
4	601985	中国核电	200,000	1,908,000.00	0.12
5	600270	外运发展	67,700	1,831,962.00	0.11
6	300032	金龙机电	60,000	1,824,000.00	0.11
7	002013	中航机电	80,000	1,812,800.00	0.11
8	600172	黄河旋风	70,100	1,774,231.00	0.11
9	600372	中航电子	70,000	1,724,100.00	0.11
10	600388	龙净环保	97,900	1,691,712.00	0.10

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

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600089	特变电工	15,653,035.38	7.07
2	600219	南山铝业	14,098,590.26	6.37
3	002202	金风科技	13,272,309.11	6.00
4	002241	歌尔声学	12,561,130.23	5.67
5	300072	三聚环保	12,030,075.86	5.44
6	601006	大秦铁路	11,804,458.65	5.33
7	601668	中国建筑	10,440,456.00	4.72
8	002447	壹桥海参	10,305,682.05	4.66
9	300032	金龙机电	10,056,280.65	4.54
10	000776	广发证券	9,953,586.66	4.50
11	000728	国元证券	9,767,757.92	4.41
12	601336	新华保险	9,487,385.55	4.29
13	600587	新华医疗	9,153,455.35	4.14
14	601318	中国平安	8,668,081.47	3.92
15	600886	国投电力	8,622,538.00	3.90
16	000910	大亚科技	8,341,146.00	3.77
17	601555	东吴证券	7,874,976.48	3.56
18	601688	华泰证券	7,624,433.75	3.44

19	600999	招商证券	6,561,721.00	2.96
20	300064	豫金刚石	5,642,318.02	2.55
21	000725	京东方A	5,565,000.00	2.51
22	600172	黄河旋风	5,542,407.49	2.50
23	002736	国信证券	5,135,816.00	2.32
24	601009	南京银行	4,654,098.91	2.10
25	600066	宇通客车	4,559,793.75	2.06

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。

8.4.2 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	600089	特变电工	16,230,248.72	7.33
2	601006	大秦铁路	15,084,380.24	6.81
3	600219	南山铝业	14,108,584.47	6.37
4	002202	金风科技	12,414,344.44	5.61
5	002447	壹桥海参	12,246,744.00	5.53
6	601668	中国建筑	11,550,184.99	5.22
7	000728	国元证券	11,104,576.60	5.02
8	300072	三聚环保	10,608,564.59	4.79
9	000776	广发证券	10,270,432.23	4.64
10	002241	歌尔声学	9,447,895.20	4.27
11	600886	国投电力	8,987,957.00	4.06
12	601336	新华保险	8,379,697.08	3.79
13	300032	金龙机电	8,346,570.65	3.77
14	000725	京东方A	8,143,000.00	3.68
15	600587	新华医疗	8,119,113.90	3.67
16	601318	中国平安	7,943,922.69	3.59
17	601555	东吴证券	7,666,919.00	3.46
18	601688	华泰证券	7,564,266.00	3.42
19	000792	盐湖股份	6,852,864.70	3.10
20	600837	海通证券	5,885,073.67	2.66
21	600999	招商证券	5,820,715.00	2.63
22	002736	国信证券	5,763,181.08	2.60
23	601800	中国交建	5,423,580.74	2.45
24	000910	大亚科技	5,104,162.00	2.31
25	601009	南京银行	4,761,020.00	2.15

26	300064	豫金刚石	4,717,586.77	2.13
27	601988	中国银行	4,480,000.00	2.02
28	300017	网宿科技	4,442,830.00	2.01

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。

8.4.3 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	338,876,427.59
卖出股票收入（成交）总额	328,322,790.28

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

8.5 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	25,212,500.00	1.56
2	央行票据	-	-
3	金融债券	41,302,000.00	2.56
	其中：政策性金融债	41,302,000.00	2.56
4	企业债券	102,217,966.90	6.32
5	企业短期融资券	130,516,000.00	8.07
6	中期票据	101,871,000.00	-
7	可转债	4,026,076.00	0.25
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	405,145,542.90	25.06

8.6 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	150205	15 国开 05	300,000	31,293,000.00	1.94
2	101452009	14 浙农资 MTN001	300,000	31,119,000.00	1.93
3	1382062	13 鲁路桥 MTN1	300,000	30,357,000.00	1.88
4	041553013	15 广新 CP001	300,000	30,330,000.00	1.88
5	1382194	13 哈供热	300,000	30,276,000.00	1.87

		MTN1			
--	--	------	--	--	--

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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, 本基金暂不可投资于国债期货。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1

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。

8.11.2

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。

8.11.3 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	410,630.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,299,389.33
5	应收申购款	199,550.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,909,569.95

8.11.4 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	128009	歌尔转债	1,404,700.00	0.09
2	113008	电气转债	1,376,700.00	0.09

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况

§9 基金份额持有人信息

9.1 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 (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
9,168	136,795.79	1,143,755,508.05	91.20%	110,388,273.42	8.80%

9.2 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	7.76	0.00%

9.3 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	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
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2004 年 9 月 28 日) 基金份额总额	2,193,790,610.57
------------------------------------	------------------

本报告期期初基金份额总额	185,806,031.50
本报告期基金总申购份额	1,410,108,796.40
减:本报告期基金总赎回份额	341,771,046.43
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	1,254,143,781.47

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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:

董事长变更: 2015年7月25日, 本公司发布公告, 聘任方一天为万家基金管理有限公司董事长, 毕玉国先生工作原因不再担任本公司董事长职务。

总经理变更: 2015年2月17日, 本公司发布公告, 聘任方一天为万家基金管理有限公司总经理。

督察长变更: 2015年4月11日, 本公司发布公告, 聘任兰剑为万家基金管理有限公司督察长。

副总经理变更: 2015年2月3日, 本公司发布公告, 聘任李修辞为万家基金管理有限公司副总经理。2015年3月11日, 本公司发布公告, 詹志令因个人原因离职, 不再担任公司副总经理。2015年10月9日, 本公司发布公告, 李修辞因个人原因离职, 不再担任公司副总经理。

基金经理变更:

2015年10月17日本公司发布公告, 聘任高翰昆为本基金基金经理, 原基金经理孙驰因个人原因离职, 不再担任本基金基金经理。

基金托管人:

无。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自2009年4月起,本基金聘请安永华明会计师事务所为本基金提供审计服务。

本基金 2015 年度需向安永华明会计师事务所支付审计费 80,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人、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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
海通证券	1	327,805,043.47	50.78%	327,045.38	52.88%	-
广发证券	1	317,762,192.44	49.22%	291,411.80	47.12%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

注：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;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。

11.7.2 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
海通证券	312,005,434.07	64.89%	1,460,800,000.00	78.66%	-	-
广发证券	117,756,538.57	24.49%	396,219,000.00	21.34%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	51,044,295.89	10.62%	-	-	-	-

万家基金管理有限公司
2016年3月25日