

万家新利灵活配置混合型证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 25 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 24 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。

本年度报告摘要自年度报告正文，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	万家新利
基金主代码	519191
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 1 月 24 日
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	625,815,007.56 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注经营状况良好、财务健康、具备成长性的上市公司，通过有效配置股票、债券投资比例，控制投资风险，谋取基金资产的长期稳定增值。
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	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%
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，属与中高风险、中高预期收益的证券投资基金。

注：基金份额持有人大会于 2015 年 5 月 19 日表决通过了《关于修改万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，《万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金合同》修订为《万家新利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，详情请参阅相关公告。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	田青
	联系电话	021-38909626	010-67595096
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		95538 转 6、4008880800	010-67595096
传真		021-38909627	010-66275853

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 1 月 24 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	14,056,780.97	5,664,545.58
本期利润	6,279,154.95	7,413,087.25
加权平均基金份额本期利润	0.0056	0.0618
本期基金份额净值增长率	5.66%	8.50%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	13,178,846.99	1,064,897.78
期末可供分配基金份额利润	0.0211	0.0247
期末基金资产净值	638,993,854.55	45,784,564.55
期末基金份额净值	1.0211	1.0622

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、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。

4、基金份额持有人大会于 2015 年 5 月 19 日表决通过了《关于修改万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》,《万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金合同》修订为《万家新利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》,详情请参阅相关公告。

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

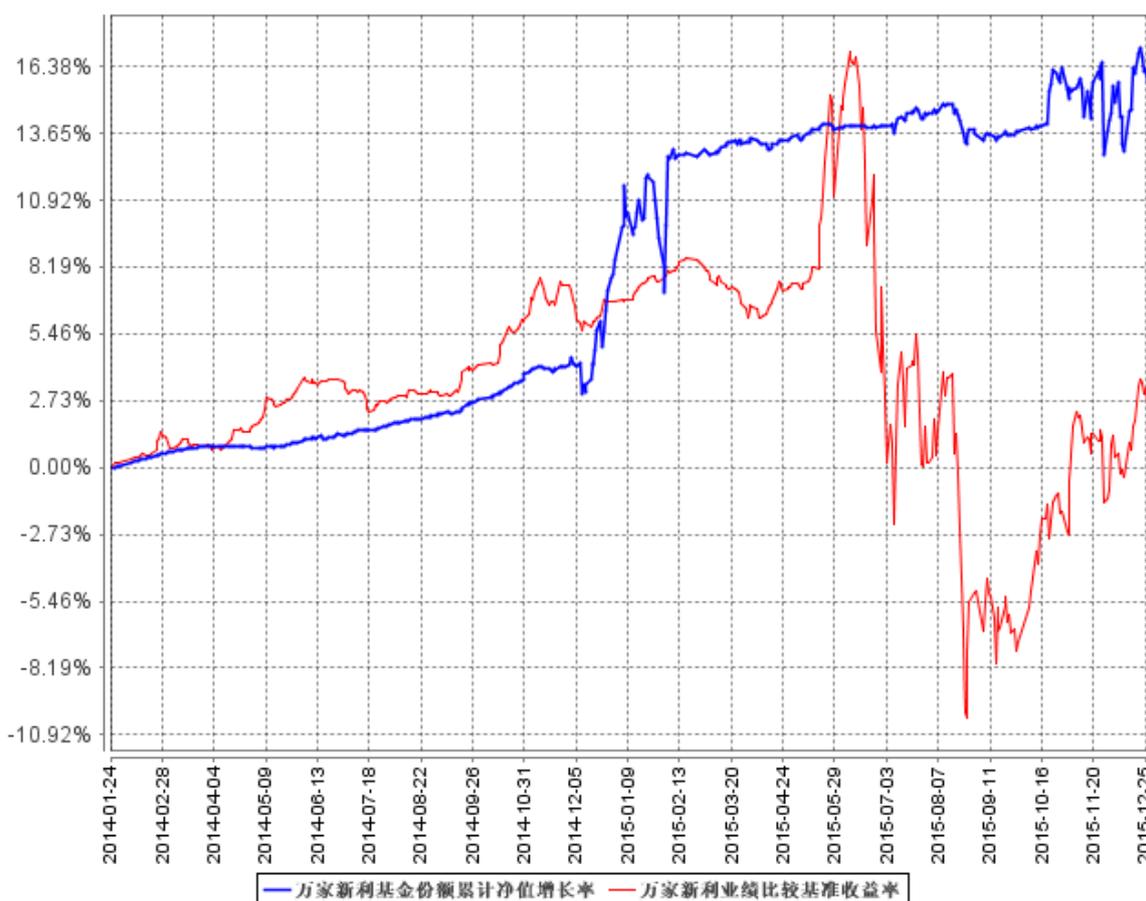
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.79%	0.69%	9.64%	0.83%	-8.85%	-0.14%

过去六个月	0.56%	0.49%	-5.16%	1.33%	5.72%	-0.84%
过去一年	5.66%	0.48%	-4.59%	1.12%	10.25%	-0.64%
自基金合同生效起至今	14.65%	0.36%	1.86%	0.81%	12.79%	-0.45%

注：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%

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

万家新利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

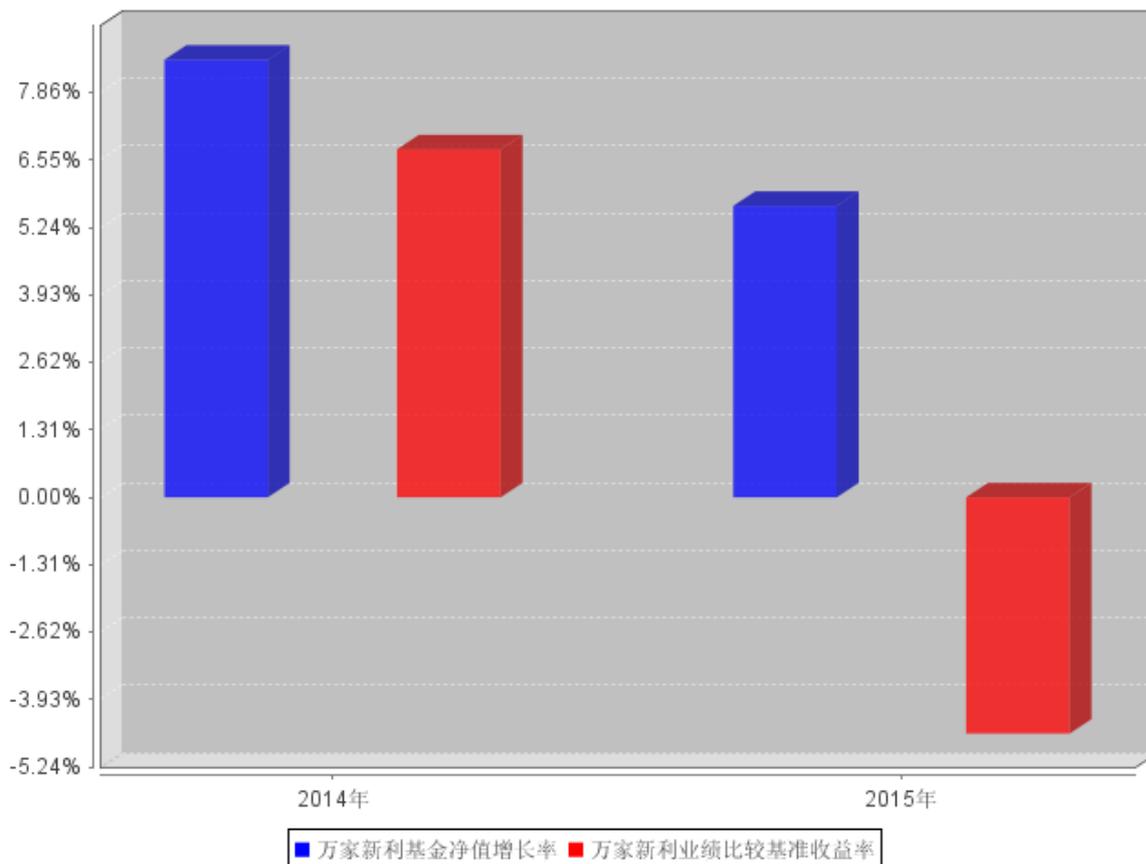


注：1、本基金合同生效日期为 2014 年 1 月 24 日，基金合同生效起至披露时点未满一年。

2、本基金的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。

3.2.3 自基金合同生效以来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

万家新利自基金合同生效以来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



注：本基金合同于 2014 年 1 月 24 日生效，按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

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	1.0000	1,718,936.85	18,536.58	1,737,473.43	
2014	0.2160	1,110,023.47	5,048.48	1,115,071.95	
合计	1.2160	2,828,960.32	23,585.06	2,852,545.38	

§ 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: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: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和万家品质生活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。

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、万家现金宝货币市场证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家双利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、万家增强收益债券型证券投资基金基金经理。	2014 年 12 月 1 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、交易部副总监。
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基金经理、万家精选混合型证券投资基金基金经理和万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、投资研究部总监。	2015 年 12 月 24 日	-	5 年	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
--	--	--	--	--	----------------

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降息，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，并积极参与打新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，本基金份额净值为 1.0211 元，本报告期份额净值增长率为 5.66%，业绩比较基准收益率-4.59%。

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。权益市场在快速下跌调整到位后可能会迎来一定的投资机会，债券市场由于较低的绝对

收益率水平制约了收益率的进一步下行全年应该会表现的较为平稳。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内,基金管理人为防范和化解经营风险,确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整,主要做了以下工作:

(一)加强风控文化建设

不断梳理和优化制度流程、防范操作风险、加强对员工的合规培训和加深员工对合规风控工作的理解,确保公司各项业务合法合规。

(二)制度流程建设

为加强内控管理,保证公司各项制度流程的有效性、及时性、完备性,本年度对投资、销售相关的制度流程及后台部门相关制度进行了修订;本年度还制订了多项 ETF 相关管理制度和流程。

(三)定期和临时稽核工作

报告期内,监察稽核部门按计划完成了各项定期稽核和专项稽核,检查内容覆盖公司各业务部门和业务环节,检查完成后出具监察稽核报告和建议书,并对整改情况进行跟踪。

(四)绩效评估和风险管理工作

报告期内,优化并形成了较为完善的每日风险监控;改进基金业绩评价工作,辅助基金经理投资决策;针对专户量化投资产品、股指期货产品等新业务进行合规、风险分析和系统测试,提供风险评估意见等;针对由于市场流动性紧张的情况,加大了对货币基金的风险管理,防范资金交收风险。

(五)员工行为管理与防控内幕交易

报告期内,公司进一步完善防控内幕交易制度和从业人员投资申报等制度,强化员工行为管理工作,防范内幕交易和利益输送。

4.7 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》。

4.8 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:“在符合有关基金分红条件的前提下,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”。2015 年 3 月 25 日,本基金进行了利润分配,每 10 份基金份额分红 1.00 元,共计分配利润 1,737,473.43 元。符合基金合同的规定。

§ 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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,该基金实施利润分配的金额为 1,737,473.43 元。

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

本托管人复核审查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。

§ 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_B18 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: 万家新利灵活配置混合型证券投资基金

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	405,197,172.99	653,301.75
结算备付金	1,142,851.54	41,455.82
存出保证金	160,572.23	2,292.95
交易性金融资产	259,046,900.87	45,186,411.20
其中: 股票投资	259,046,900.87	-
基金投资	-	-
债券投资	-	45,186,411.20
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	-	200,000.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	90,733.91	762,260.31
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	665,638,231.54	46,845,722.03
负债和所有者权益	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 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	-	-

应付证券清算款	25,402,201.07	460,711.18
应付赎回款	-	211,360.09
应付管理人报酬	537,653.59	26,949.08
应付托管费	89,608.94	7,699.74
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	384,913.39	4,278.71
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	230,000.00	350,158.68
负债合计	26,644,376.99	1,061,157.48
所有者权益：		
实收基金	625,815,007.56	43,102,533.10
未分配利润	13,178,846.99	2,682,031.45
所有者权益合计	638,993,854.55	45,784,564.55
负债和所有者权益总计	665,638,231.54	46,845,722.03

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净 1.0211 元，基金份额总额 625,815,007.56 份。

7.2 利润表

会计主体：万家新利灵活配置混合型证券投资基金

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 24 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	27,867,020.43	9,040,189.35
1. 利息收入	21,728,527.56	6,362,134.92
其中：存款利息收入	13,039,612.06	4,284,034.45
债券利息收入	4,840,582.91	1,856,302.09
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,848,332.59	221,798.38
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-1,678,590.68	810,805.42
其中：股票投资收益	-5,088,740.21	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,172,854.35	810,805.42
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	1,237,295.18	-

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-7,777,626.02	1,748,541.67
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	15,594,709.57	118,707.34
减：二、费用	21,587,865.48	1,627,102.10
1. 管理人报酬	16,602,804.15	813,653.75
2. 托管费	2,774,099.76	232,472.55
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,846,202.96	2,353.74
5. 利息支出	42,981.41	200,207.21
其中：卖出回购金融资产支出	42,981.41	200,207.21
6. 其他费用	321,777.20	378,414.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	6,279,154.95	7,413,087.25
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	6,279,154.95	7,413,087.25

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家新利灵活配置混合型证券投资基金

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）	43,102,533.10	2,682,031.45	45,784,564.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,279,154.95	6,279,154.95
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）	582,712,474.46	5,955,134.02	588,667,608.48
其中：1. 基金申购款	5,281,824,122.34	88,225,141.44	5,370,049,263.78
2. 基金赎回款	-4,699,111,647.88	-82,270,007.42	-4,781,381,655.30
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）	-	-1,737,473.43	-1,737,473.43

方式召开，大会审议并通过了《关于修改万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，内容包括万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金变更名称、修改基金投资目标、投资范围、投资策略、收益分配方式和修订基金合同等事项。自持有人大会决议生效之日起，《万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金合同》失效且《万家新利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同时生效。基金管理人已将大会表决通过的事项报中国证券监督管理委员会备案。

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。本基金重点关注经营状况良好、财务健康、具备成长性的上市公司，通过有效配置股票、债券投资比例，控制投资风险，谋取基金资产的长期稳定增值。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%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《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 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金报告期内无需说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

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(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

7.4.5.3 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

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。

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。

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
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	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
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：报告期内，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：报告期内，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

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

金额单位：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 24 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
中泰证券	633,533,371.44	49.07%	-	-

注：本基金上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

债券交易

金额单位：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 24 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日	
	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 成交总额的比 例
中泰证券	59,140,650.06	81.09%	100,954,124.61	83.77%

债券回购交易

金额单位：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 24 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日

	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
中泰证券	881,800,000.00	94.10%	448,200,000.00	94.95%

7.4.8.1.2 权证交易

注：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。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
中泰证券	582,446.51	49.12%	191,345.86	51.25%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月24日(基金合同生效日)至2014年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例

注：本基金上年度可比期间未产生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24日(基金合同生效日) 至2014年12月31日
	当期发生的基金应支付 的管理费	16,602,804.15
其中：支付销售机构的客 户维护费	9,428.85	303,727.38

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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,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 5 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 24 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,774,099.76	232,472.55

注: 基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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, 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 5 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。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期与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与上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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		上年度可比期间	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		2014 年 1 月 24 日 (基金合同生效日) 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
中国建设银行股份有限公司	405,197,172.99	1,564,074.86	653,301.75	158,217.98

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 14,374.88 元 (2014 年度: 人民币

2,904.31 元), 2015 年末结算备付金余额为人民币 1,142,851.54 元(2014 年末: 人民币 41,455.82 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

7.4.9 利润分配情况

7.4.9.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位: 人民币元

序号	权益登记日	除息日		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	本期利润分 配 合计	备注
		场内	场外					
1	2015 年 3 月 25 日	-	2015 年 3 月 25 日	1.0000	1,718,936.85	18,536.58	1,737,473.43	
合计	-	-		1.0000	1,718,936.85	18,536.58	1,737,473.43	

有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.9.2 公允价值

7.4.9.2.1 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、应收款项以及其他金融负债, 其因剩余期限不长, 公允价值与账面价值相若。

7.4.9.2.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.9.2.2.1 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工具中属于第一层次的余额为人民币 246,513,938.87 元, 属于第二层次的余额为人民币 12,532,962.00 元, 无第三层次余额。(于 2014 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 24,341,061.20 元, 属于第二层次的余额为人民币 20,845,350.00 元, 无属于第三层次的余额。)

7.4.9.2.2.2 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(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)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级转入第二层级。

7.4.9.2.3 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。

7.4.9.3 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。

7.4.9.4 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。

§ 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	259,046,900.87	38.92
	其中:股票	259,046,900.87	38.92
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	-	-
	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	406,340,024.53	61.05
7	其他各项资产	251,306.14	0.04
8	合计	665,638,231.54	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	9,388,416.00	1.47
C	制造业	82,076,362.26	12.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	59,257,771.97	9.27
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	9,540,016.00	1.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,541,301.00	1.49
J	金融业	2,780,422.00	0.44
K	房地产业	76,134,476.44	11.91
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	10,328,135.20	1.62
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	259,046,900.87	40.54

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

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	600048	保利地产	3,394,800	36,120,672.00	5.65
2	000402	金融街	1,944,300	22,417,779.00	3.51
3	000488	晨鸣纸业	1,788,621	15,954,499.32	2.50
4	002594	比亚迪	230,524	14,845,745.60	2.32

5	000928	中钢国际	818,800	14,484,572.00	2.27
6	601669	中国电建	1,700,420	13,654,372.60	2.14
7	002103	广博股份	390,000	12,140,700.00	1.90
8	300284	苏交科	476,390	10,328,135.20	1.62
9	000910	大亚科技	619,776	10,251,095.04	1.60
10	000503	海虹控股	284,900	9,541,301.00	1.49

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	600048	保利地产	46,131,122.33	100.76
2	000402	金融街	24,667,195.17	53.88
3	601669	中国水电	18,486,004.88	40.38
4	000488	晨鸣纸业	18,134,719.51	39.61
5	601318	中国平安	17,704,706.32	38.67
6	600837	海通证券	16,670,946.00	36.41
7	002594	比亚迪	14,664,542.40	32.03
8	000928	中钢吉炭	14,571,605.16	31.83
9	000910	大亚科技	12,485,013.86	27.27
10	300284	苏交科	11,861,634.00	25.91
11	600497	驰宏锌锗	11,513,855.25	25.15
12	601988	中国银行	11,192,835.30	24.45
13	001979	招商蛇口	11,114,391.20	24.28
14	601989	中国重工	10,962,690.30	23.94
15	601668	中国建筑	10,353,359.42	22.61
16	002103	广博股份	10,247,590.00	22.38
17	601800	中国交建	10,114,115.83	22.09
18	601288	农业银行	10,066,390.00	21.99
19	000024	招商地产	10,015,831.19	21.88
20	600018	上港集团	9,973,523.34	21.78
21	600000	浦发银行	9,856,936.00	21.53
22	601766	中国中车	9,766,109.00	21.33
23	000503	海虹控股	9,534,879.00	20.83

24	000530	大冷股份	9,520,165.24	20.79
25	601390	中国中铁	9,501,778.04	20.75
26	600887	伊利股份	9,184,876.30	20.06
27	601398	工商银行	8,740,426.97	19.09
28	002146	荣盛发展	8,614,548.14	18.82
29	600418	江淮汽车	8,414,610.00	18.38
30	600028	中国石化	8,307,446.47	18.14
31	002179	中航光电	8,000,647.83	17.47
32	002047	成霖股份	7,990,988.11	17.45
33	600068	葛洲坝	7,484,264.89	16.35
34	000060	中金岭南	7,247,932.79	15.83
35	000776	广发证券	6,992,555.00	15.27
36	600050	中国联通	6,762,222.00	14.77
37	600373	中文传媒	6,404,889.75	13.99
38	000338	潍柴动力	6,238,744.57	13.63
39	000528	柳工	6,212,821.00	13.57
40	600518	康美药业	6,000,729.00	13.11
41	601601	中国太保	5,990,585.00	13.08
42	600109	国金证券	5,989,529.79	13.08
43	601998	中信银行	5,947,058.00	12.99
44	002133	广宇集团	5,745,660.15	12.55
45	600999	招商证券	5,621,400.58	12.28
46	000728	国元证券	5,268,777.00	11.51
47	600017	日照港	4,970,732.00	10.86
48	000425	徐工机械	4,678,859.60	10.22
49	600392	盛和资源	4,477,692.50	9.78
50	601328	交通银行	4,353,511.00	9.51
51	002142	宁波银行	4,290,125.00	9.37
52	000401	冀东水泥	4,239,785.00	9.26
53	600519	贵州茅台	4,233,154.00	9.25
54	002241	歌尔声学	4,112,243.60	8.98
55	600583	海油工程	4,108,132.40	8.97
56	600406	国电南瑞	4,021,812.95	8.78
57	601588	北辰实业	4,005,765.01	8.75
58	000100	TCL 集团	3,987,558.00	8.71
59	601857	中国石油	3,943,332.00	8.61

60	601818	光大银行	3,939,033.00	8.60
61	600016	民生银行	3,693,561.00	8.07
62	002589	瑞康医药	3,430,031.00	7.49
63	601169	北京银行	3,392,733.52	7.41
64	000028	国药一致	3,232,313.00	7.06
65	600717	天津港	3,203,942.99	7.00
66	600317	营口港	2,995,175.85	6.54
67	000002	万科 A	2,994,988.00	6.54
68	000750	国海证券	2,993,879.75	6.54
69	000625	长安汽车	2,993,244.84	6.54
70	601008	连云港	2,982,263.00	6.51
71	601880	大连港	2,970,760.00	6.49
72	601088	中国神华	2,847,001.00	6.22
73	600190	锦州港	2,844,399.00	6.21
74	000001	平安银行	2,799,520.00	6.11
75	000725	京东方 A	2,792,946.00	6.10
76	600150	中国船舶	2,787,257.32	6.09
77	601186	中国铁建	2,743,762.00	5.99
78	601006	大秦铁路	2,498,524.00	5.46
79	000400	许继电气	2,410,386.00	5.26
80	000541	佛山照明	2,407,939.00	5.26
81	002408	齐翔腾达	2,372,373.36	5.18
82	000078	海王生物	2,342,434.20	5.12
83	000417	合肥百货	2,330,857.00	5.09
84	000539	粤电力 A	2,327,266.00	5.08
85	000501	鄂武商 A	2,319,100.10	5.07
86	000012	南玻 A	2,315,287.61	5.06
87	000550	江铃汽车	2,312,612.99	5.05
88	000333	美的集团	2,311,496.86	5.05
89	000858	五粮液	2,310,304.90	5.05
90	000428	华天酒店	2,310,004.89	5.05
91	000623	吉林敖东	2,309,629.98	5.04
92	000596	古井贡酒	2,307,941.29	5.04
93	000783	长江证券	2,307,661.86	5.04
94	002456	欧菲光	2,304,932.00	5.03
95	002030	达安基因	2,304,669.00	5.03

96	000600	建投能源	2,301,610.00	5.03
97	000407	胜利股份	2,300,133.68	5.02
98	000792	盐湖股份	2,298,699.00	5.02
99	300058	蓝色光标	2,298,078.00	5.02
100	000651	格力电器	2,298,037.00	5.02
101	000157	中联重科	2,297,798.75	5.02
102	002029	七匹狼	2,296,437.50	5.02
103	000538	云南白药	2,294,745.00	5.01
104	300070	碧水源	2,293,567.11	5.01
105	000027	深圳能源	2,292,447.00	5.01
106	000566	海南海药	2,292,314.00	5.01
107	002204	大连重工	2,292,136.00	5.01
108	000061	农产品	2,291,932.00	5.01
109	000046	泛海控股	2,291,268.00	5.00
110	002024	苏宁云商	2,291,066.00	5.00
111	000513	丽珠集团	2,285,065.00	4.99
112	300104	乐视网	2,280,915.52	4.98
113	300002	神州泰岳	2,277,809.00	4.98
114	000031	中粮地产	2,270,151.00	4.96
115	000009	中国宝安	2,269,239.80	4.96
116	000516	国际医学	2,269,081.00	4.96
117	002191	劲嘉股份	2,263,628.00	4.94
118	000540	中天城投	2,260,802.00	4.94
119	000581	威孚高科	2,260,764.00	4.94
120	300027	华谊兄弟	2,252,784.00	4.92
121	000800	一汽轿车	2,252,376.90	4.92
122	000598	兴蓉投资	2,251,772.00	4.92
123	000507	珠海港	2,251,310.00	4.92
124	000543	皖能电力	2,248,602.00	4.91
125	000876	新希望	2,247,880.00	4.91
126	000895	双汇发展	2,244,057.00	4.90
127	000572	海马汽车	2,240,635.00	4.89
128	000422	湖北宣化	2,238,389.00	4.89
129	000039	中集集团	2,237,635.00	4.89
130	002304	洋河股份	2,237,381.00	4.89
131	000088	盐田港	2,233,660.00	4.88

132	000423	东阿阿胶	2,232,729.00	4.88
133	000049	德赛电池	2,225,502.00	4.86
134	300253	卫宁软件	2,222,347.00	4.85
135	000970	中科三环	2,221,116.00	4.85
136	000616	海航投资	2,207,176.51	4.82
137	000551	创元科技	2,205,932.00	4.82
138	002450	康得新	2,183,374.00	4.77
139	002415	海康威视	2,169,427.84	4.74
140	600585	海螺水泥	2,168,091.00	4.74
141	002353	杰瑞股份	2,119,976.84	4.63
142	002202	金风科技	2,025,403.00	4.42
143	002008	大族激光	2,003,172.00	4.38
144	000063	中兴通讯	1,998,850.31	4.37
145	002385	大北农	1,997,820.00	4.36
146	000686	东北证券	1,955,965.49	4.27
147	600637	广电信息	1,950,253.52	4.26
148	600104	上汽集团	1,923,598.00	4.20
149	600256	广汇能源	1,889,618.85	4.13
150	601901	方正证券	1,869,284.00	4.08
151	600690	青岛海尔	1,794,882.00	3.92
152	600036	招商银行	1,770,264.00	3.87
153	000680	山推股份	1,493,165.50	3.26
154	600015	华夏银行	1,433,147.23	3.13
155	600030	中信证券	1,366,401.00	2.98
156	600893	中航动力	1,345,273.00	2.94
157	601688	华泰证券	1,217,686.00	2.66
158	603116	红蜻蜓	1,156,411.80	2.53
159	000069	华侨城 A	995,848.00	2.18
160	002230	科大讯飞	994,853.00	2.17
161	600031	三一重工	989,230.00	2.16

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	601318	中国平安	17,625,063.15	38.50
2	601988	中国银行	12,616,497.54	27.56
3	600837	海通证券	11,925,999.00	26.05
4	601288	农业银行	10,662,576.00	23.29
5	601989	中国重工	10,373,732.00	22.66
6	600048	保利地产	10,266,538.82	22.42
7	601390	中国中铁	10,096,749.75	22.05
8	600000	浦发银行	9,520,310.59	20.79
9	600018	上港集团	9,351,864.00	20.43
10	600887	伊利股份	8,429,992.55	18.41
11	600028	中国石化	8,319,859.81	18.17
12	000060	中金岭南	8,203,972.40	17.92
13	002179	中航光电	8,167,857.55	17.84
14	601398	工商银行	7,709,630.33	16.84
15	000776	广发证券	6,974,510.00	15.23
16	600373	中文传媒	6,703,354.60	14.64
17	002133	广宇集团	6,408,479.74	14.00
18	600050	中国联通	6,405,764.00	13.99
19	000338	潍柴动力	6,128,341.00	13.39
20	000528	柳 工	6,032,577.60	13.18
21	600518	康美药业	5,317,923.96	11.62
22	601601	中国太保	5,252,784.12	11.47
23	000728	国元证券	5,126,867.66	11.20
24	000425	徐工机械	4,453,034.60	9.73
25	000401	冀东水泥	4,215,896.00	9.21
26	601857	中国石油	4,085,467.00	8.92
27	600999	招商证券	4,059,225.28	8.87
28	601328	交通银行	4,030,483.45	8.80
29	601818	光大银行	3,997,175.00	8.73
30	000100	TCL 集团	3,995,646.00	8.73
31	601588	北辰实业	3,976,165.92	8.68
32	600519	贵州茅台	3,952,573.00	8.63
33	002241	歌尔声学	3,882,991.57	8.48
34	600016	民生银行	3,715,150.00	8.11
35	600109	国金证券	3,714,207.92	8.11
36	002142	宁波银行	3,679,348.02	8.04
37	600406	国电南瑞	3,659,331.33	7.99
38	002589	瑞康医药	3,394,239.15	7.41

39	601998	中信银行	3,291,653.70	7.19
40	601169	北京银行	3,273,834.29	7.15
41	601669	中国电建	3,207,124.52	7.00
42	000028	国药一致	3,142,246.00	6.86
43	600583	海油工程	3,111,709.62	6.80
44	601186	中国铁建	3,024,935.41	6.61
45	000002	万 科 A	3,016,994.00	6.59
46	600717	天津港	3,000,773.52	6.55
47	000625	长安汽车	2,982,132.66	6.51
48	000750	国海证券	2,972,234.00	6.49
49	002408	齐翔腾达	2,849,282.46	6.22
50	600317	营口港	2,692,712.00	5.88
51	601800	中国交建	2,680,712.00	5.86
52	000001	平安银行	2,651,311.78	5.79
53	601008	连云港	2,617,497.96	5.72
54	601088	中国神华	2,605,882.00	5.69
55	000725	京东方 A	2,576,636.00	5.63
56	000541	佛山照明	2,476,163.75	5.41
57	600150	中国船舶	2,474,238.42	5.40
58	000539	粤电力 A	2,391,949.00	5.22
59	601006	大秦铁路	2,382,408.54	5.20
60	000400	许继电气	2,366,380.00	5.17
61	000078	海王生物	2,351,776.80	5.14
62	300070	碧水源	2,344,965.00	5.12
63	002456	欧菲光	2,341,433.00	5.11
64	000333	美的集团	2,338,512.12	5.11
65	000858	五 粮 液	2,329,196.52	5.09
66	000157	中联重科	2,328,366.00	5.09
67	603116	红蜻蜓	2,323,937.00	5.08
68	000428	华天酒店	2,322,474.00	5.07
69	000566	海南海药	2,318,603.00	5.06
70	000501	鄂武商 A	2,315,708.00	5.06
71	000046	泛海控股	2,315,668.00	5.06
72	000012	南 玻 A	2,313,806.86	5.05
73	000596	古井贡酒	2,311,276.00	5.05
74	000651	格力电器	2,306,033.00	5.04
75	000402	金 融 街	2,305,762.00	5.04
76	000600	建投能源	2,304,895.00	5.03

77	000417	合肥百货	2,302,151.00	5.03
78	000407	胜利股份	2,301,731.00	5.03
79	000792	盐湖股份	2,298,700.70	5.02
80	000623	吉林敖东	2,296,839.00	5.02
81	000538	云南白药	2,292,105.54	5.01
82	000550	江铃汽车	2,291,568.00	5.01
83	000783	长江证券	2,288,767.00	5.00
84	002024	苏宁云商	2,281,385.00	4.98
85	000039	中集集团	2,272,576.00	4.96
86	000027	深圳能源	2,268,538.00	4.95
87	000513	丽珠集团	2,266,627.00	4.95
88	000800	一汽轿车	2,260,765.60	4.94
89	002030	达安基因	2,259,806.60	4.94
90	300027	华谊兄弟	2,259,314.00	4.93
91	002029	七匹狼	2,257,333.50	4.93
92	000031	中粮地产	2,256,407.00	4.93
93	300002	神州泰岳	2,256,199.26	4.93
94	300058	蓝色光标	2,247,691.76	4.91
95	000061	农产品	2,246,348.22	4.91
96	002191	劲嘉股份	2,237,678.00	4.89
97	002304	洋河股份	2,234,916.60	4.88
98	002204	大连重工	2,234,317.00	4.88
99	000516	国际医学	2,201,866.81	4.81
100	300253	卫宁软件	2,185,630.00	4.77
101	000423	东阿阿胶	2,178,983.88	4.76
102	300104	乐视网	2,177,322.00	4.76
103	000540	中天城投	2,173,506.00	4.75
104	000895	双汇发展	2,171,155.08	4.74
105	000581	威孚高科	2,164,262.00	4.73
106	002415	海康威视	2,163,629.00	4.73
107	000009	中国宝安	2,161,540.74	4.72
108	000488	晨鸣纸业	2,157,911.97	4.71
109	000422	湖北宜化	2,144,979.00	4.68
110	000507	珠海港	2,139,861.00	4.67
111	000543	皖能电力	2,136,752.14	4.67
112	000088	盐田港	2,122,643.00	4.64
113	000598	兴蓉环境	2,118,562.00	4.63
114	002450	康得新	2,111,424.00	4.61

115	000572	海马汽车	2,110,454.00	4.61
116	600585	海螺水泥	2,106,875.00	4.60
117	002385	大北农	2,090,921.00	4.57
118	000970	中科三环	2,061,209.00	4.50
119	000049	德赛电池	2,058,289.00	4.50
120	000551	创元科技	2,055,519.00	4.49
121	000876	新希望	2,024,133.00	4.42
122	000616	海航投资	2,011,939.72	4.39
123	600104	上汽集团	2,010,710.00	4.39
124	000063	中兴通讯	2,004,116.00	4.38
125	002202	金风科技	2,003,715.60	4.38
126	002008	大族激光	2,002,958.00	4.37
127	600392	盛和资源	2,001,730.64	4.37
128	600497	驰宏锌锗	1,996,296.43	4.36
129	000910	大亚科技	1,993,821.40	4.35
130	000686	东北证券	1,936,797.00	4.23
131	300473	德尔股份	1,853,617.95	4.05
132	600256	广汇能源	1,740,181.00	3.80
133	600036	招商银行	1,692,845.00	3.70
134	600690	青岛海尔	1,635,880.00	3.57
135	600637	东方明珠	1,560,877.84	3.41
136	601901	方正证券	1,467,356.00	3.20
137	002353	杰瑞股份	1,398,229.97	3.05
138	600015	华夏银行	1,377,296.00	3.01
139	300485	赛升药业	1,236,017.48	2.70
140	002767	先锋电子	1,232,726.00	2.69
141	002770	科迪乳业	1,220,904.35	2.67
142	000680	山推股份	1,179,693.36	2.58
143	601668	中国建筑	1,164,256.00	2.54
144	600893	中航动力	1,129,932.00	2.47
145	603117	万林股份	1,089,953.80	2.38
146	000069	华侨城A	1,000,616.00	2.19
147	002230	科大讯飞	994,750.00	2.17
148	300284	苏交科	994,315.50	2.17
149	600031	三一重工	976,722.00	2.13
150	002773	康弘药业	955,413.00	2.09
151	002776	柏堡龙	951,281.76	2.08
152	601688	华泰证券	940,016.70	2.05

153	600030	中信证券	925,144.00	2.02
-----	--------	------	------------	------

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	800,339,262.55
卖出股票收入（成交）总额	530,174,537.12

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

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

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	160,572.23

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	90,733.91
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	251,306.14

8.11.4 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002103	广博股份	12,140,700.00	1.90	重大事项停牌

§ 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
90	6,953,500.08	623,088,597.71	99.56%	2,726,409.85	0.44%

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	0.00	0.0000%

注：本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

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	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	万家新利灵活配置混 合型证券投资基金	-	-
	合计	-	-

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年1月24日）基金份额总额	434,903,358.43
本报告期期初基金份额总额	43,102,533.10
本报告期基金总申购份额	5,281,824,122.34
减：本报告期基金总赎回份额	4,699,111,647.88
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	625,815,007.56

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

2015年5月19日召开基金份额持有人大会，会议通过将万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金变更为万家新利灵活配置混合型证券投资基金，并按照相关法律法规及中国证监会的有关规定对本基金名称、投资目标、投资范围、投资策略、收益分配方式等事项进行相应修改。

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，聘任莫海波为本基金基金经理，原基金经理苏谋东，不再担任本基金基金经理。

基金托管人：

本基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

本基金托管人 2015 年 9 月 18 日发布任免通知，解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

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

2015 年 5 月 19 日，由《万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《万家新利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，删除城市建设相关债券投资策略，增加资产支持证券、证券公司短期公司债券、股票、权证的投资策略。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同成立即 2014 年 1 月 24 日起聘请安永华明会计师事务所为本基金提供审计服务，本报告期未改聘会计师事务所。

本基金 2015 年度需向安永华明会计师事务所支付审计费 50,000.00 元，本报告期未改聘会计师事务所。

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

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。

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	
申万宏源	1	657,568,272.06	50.93%	603,419.41	50.88%	-
中泰证券	1	633,533,371.44	49.07%	582,446.51	49.12%	-

兴业证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	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，本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；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。

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
申万宏源	13,790,909.16	18.91%	55,327,000.00	5.90%	-	-
中泰证券	59,140,650.06	81.09%	881,800,000.00	94.10%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

国泰君安	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

万家基金管理有限公司
2016 年 3 月 25 日