

万家新利灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告摘要

2016 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：2017 年 3 月 31 日

§ 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 2017 年 3 月 30 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 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

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。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家新利灵活配置混合型证券投资基金
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	644,607,110.81 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。

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	上海市浦东新区浦电路 360 号陆家嘴投资大厦 9 楼 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	2016 年	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	73,805,675.73	14,056,780.97	5,664,545.58
本期利润	68,275,696.89	6,279,154.95	7,413,087.25
本期加权平均净值利润率	9.14%	0.55%	6.12%
本期基金份额净值增长率	9.05%	5.66%	8.50%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.1135	0.0211	0.0247
期末基金资产净值	717,740,649.15	638,993,854.55	45,784,564.55
期末基金份额净值	1.1135	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

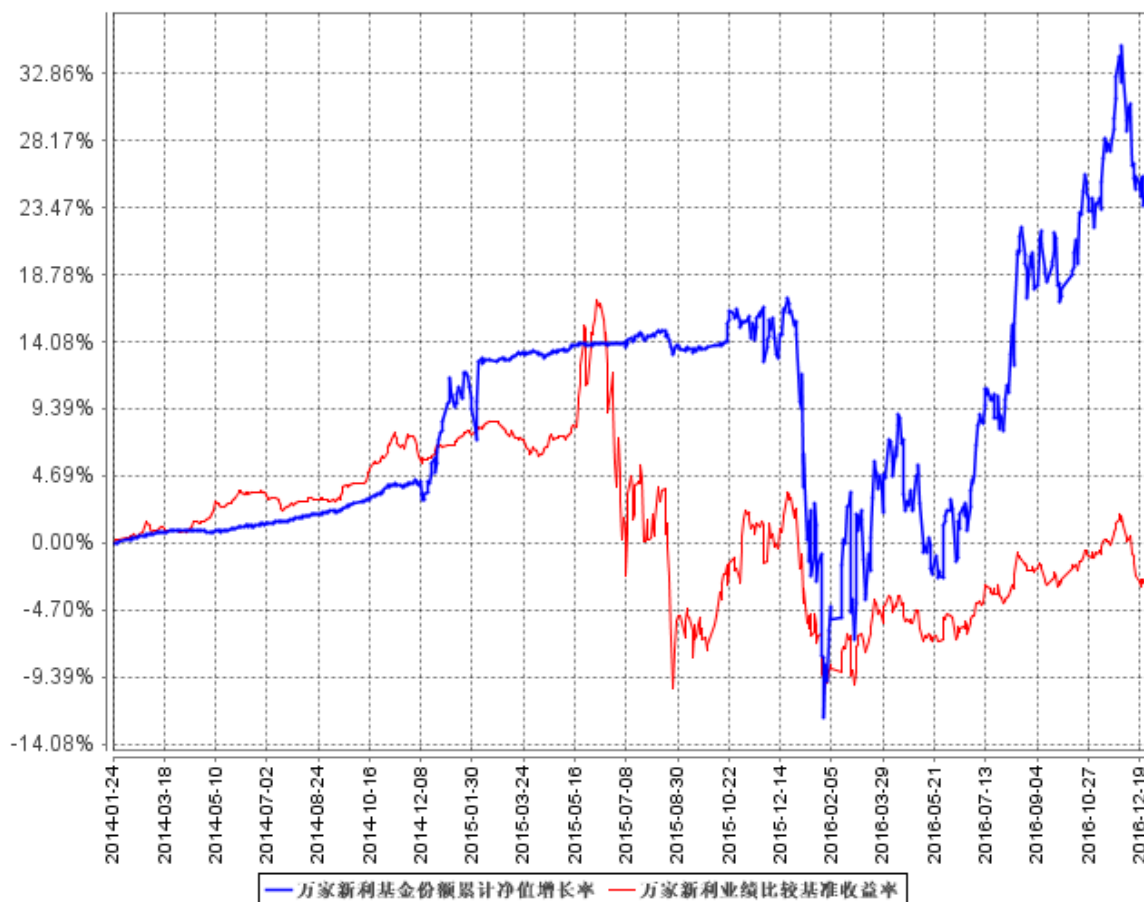
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	6.16%	1.05%	0.00%	0.39%	6.16%	0.66%

过去六个月	19.96%	1.14%	2.72%	0.40%	17.24%	0.74%
过去一年	9.05%	1.78%	-4.29%	0.71%	13.34%	1.07%
自基金合同生效起至今	25.02%	1.08%	-2.51%	0.77%	27.53%	0.31%

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

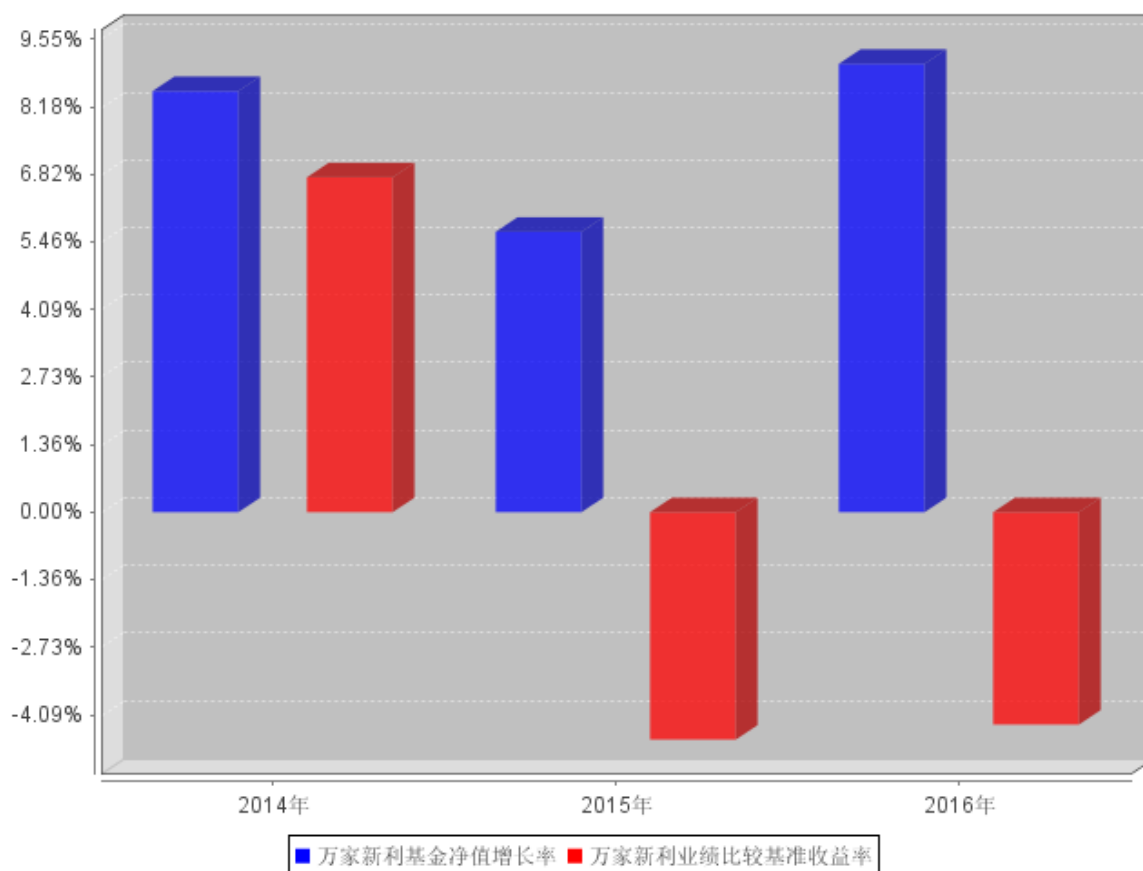
万家新利基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2015 年 5 月 19 日修改了基金合同，根据基金合同规定修改基金投资目标、投资范围、投资策略、收益分配方式，基金合同生效后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 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
2016	-	-	-	-	
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。目前管理四十只开放式基金,分别万家 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(L0F)、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(L0F)、万家添利债券型证券投资基金(L0F)、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、万家鑫通纯债债券型证券投资基金、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、万家恒景 18 个月定期开放债券型证券投资基金。

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, 万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家现金宝货币型证券投资基金、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、万家瑞旭灵活配置混合型证	2014 年 12 月 1 日	-	8 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

	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和万家瑞隆灵活配置混合型证券投资基金基金经理。				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、万家精选混合型证券投资基金、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2015 年 12 月 24 日	-	6 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，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》、《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，公司执行交易系统内的公平交易程序；（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

2016 年 A 股市场行情整体偏向低估值蓝筹，上证综指走势要强于中小板和创业板指数。家用电器、食品饮料和银行等防御性板块受到资金的青睐，有较为明显的绝对收益。从 16 年年底的中央经济工作会议来看，强调供给侧改革和风险，货币政策基调趋紧。纵观 16 年全年，28 个申万

一级行业指数全年多数下跌，仅有 4 个行业（食品饮料、家电、采掘和银行）出现逆势上涨。在下跌行业中，传媒、计算机和社会服务处于领跌位置。截止四季度末，产品配置中持仓比例最大的是银行、房地产和 PPP 等行业。另外在操作方面同三季度相比，我们逐步减少了大建筑的仓位，增加了银行在产品中的配置。

自去年四季度以来的市场走好的逻辑是基于经济企稳下企业盈利出现修复改善，而这一趋势在 16 年四季度的数据中相继得到验证。目前不仅中国的宏观读数继续保持在企稳扩张状态，其他主要经济体的经济也处于扩张改善状态，说明国内经济整体没有大幅下滑的风险。证监会去年四季度以来多次在不同场合强调从严监管的工作总基调。市场稳定运行仍然是监管基础要求，通过监管沟通加强对于市场预期的引导。从 17 年以来对于保险资金入市规范以及再融资规则完善等措施来看，证监会一直致力于构建监管工作立法、执行与监督全程，深化依法全面从严监管，维护市场秩序，提升监管能力。这也与中央经济工作会议特别强调“稳中求进”、“防控资产泡沫”等提法相一致。另外股指期货松绑以及养老金投资运营有助于提升市场的风险偏好，整体对市场影响偏正面。

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 1.1135 元，本报告期份额净值增长率为 9.05%，业绩比较基准收益率-4.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年我们判断市场风格将大概率不会一面倒向价值蓝筹股，待成长股估值回到合理区间后将会出现投资机会，纵观全年采取价值蓝筹和成长股之间均衡配置的策略将会更佳。我们预测，上半年市场投资主线会围绕两会政策重点展开，从年前的政策密集期转入经济确认期，如国企混改、一带一路、农业供给侧改革、区域发展等。此外 PPP 和基建领域等依然会是中央重点发力稳定经济的优先手段。下半年，长期看以成长股为代表的中小创会迎来比较好的配置机会，国内经济的企稳有利于改革创新以及消费升级。“十三五”期间中央重点扶持的“新一代信息技术、高端制造、生物、绿色低碳和数字创意”等五大战略性新兴产业将会逐步进入快速发展期，我们认为这些领域中待估值调整后将会出现投资机会。另外中央可能会寄希望于多种渠道，重启内需和消费，相关新消费领域，例如：教育、医疗及服务、泛娱乐、体育等值得重视。

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:“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。

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

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 1,115,071.95 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 2016 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安永华明(2017)审字第 60778298_B15 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: 2016 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	40,106,322.72	405,197,172.99
结算备付金		2,387,419.86	1,142,851.54
存出保证金		204,986.17	160,572.23
交易性金融资产	7.4.7.2	678,989,580.92	259,046,900.87
其中: 股票投资		678,989,580.92	259,046,900.87
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		189,287.25	-
应收利息	7.4.7.5	10,933.13	90,733.91
应收股利		-	-
应收申购款		687,371.12	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-

资产总计		722,575,901.17	665,638,231.54
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,515,032.49	25,402,201.07
应付赎回款		977,565.59	-
应付管理人报酬		980,475.07	537,653.59
应付托管费		163,412.52	89,608.94
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	968,212.39	384,913.39
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	230,553.96	230,000.00
负债合计		4,835,252.02	26,644,376.99
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	644,607,110.81	625,815,007.56
未分配利润	7.4.7.10	73,133,538.34	13,178,846.99
所有者权益合计		717,740,649.15	638,993,854.55
负债和所有者权益总计		722,575,901.17	665,638,231.54

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净 1.1135 元，基金份额总额 644,607,110.81 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		86,767,756.58	27,867,020.43
1. 利息收入		462,580.62	21,728,527.56
其中：存款利息收入	7.4.7.11	462,580.62	13,039,612.06
债券利息收入		-	4,840,582.91
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	3,848,332.59
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		90,434,797.45	-1,678,590.68

其中：股票投资收益	7.4.7.12	81,918,964.17	-5,088,740.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	2,172,854.35
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	8,515,833.28	1,237,295.18
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-5,529,978.84	-7,777,626.02
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,400,357.35	15,594,709.57
减：二、费用		18,492,059.69	21,587,865.48
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	11,204,797.94	16,602,804.15
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,867,466.32	2,774,099.76
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	5,134,156.70	1,846,202.96
5. 利息支出		-	42,981.41
其中：卖出回购金融资产支出		-	42,981.41
6. 其他费用	7.4.7.20	285,638.73	321,777.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		68,275,696.89	6,279,154.95
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		68,275,696.89	6,279,154.95

注：本财务报表的实际编制期间为 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日。

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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	625,815,007.56	13,178,846.99	638,993,854.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	68,275,696.89	68,275,696.89
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	18,792,103.25	-8,321,005.54	10,471,097.71

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	683,383,734.20	32,772,544.57	716,156,278.77
2. 基金赎回款	-664,591,630.95	-41,093,550.11	-705,685,181.06
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）	644,607,110.81	73,133,538.34	717,740,649.15
项目	上年度可比期间 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
五、期末所有者权益（基金净值）	625,815,007.56	13,178,846.99	638,993,854.55

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 - 至 - 财务报表由下列负责人签署：

<u>方一天</u>	<u>经晓云</u>	<u>陈广益</u>
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

万家新利灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），原万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金，系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]1110号文关于《核准万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人

万家基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2014 年 1 月 24 日正式生效，首次设立募集规模为 434,903,358.43 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，注册登记机构为中国登记结算股份有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

2015 年 5 月 19 日，万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 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

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 营业税、增值税

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；

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]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 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。

7.4.6.3 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。

7.4.6.4 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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	40,106,322.72	405,197,172.99
定期存款	—	—
其中：存款期限 1-3 个月	—	—
其他存款	—	—
合计：	40,106,322.72	405,197,172.99

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	690,548,644.11	678,989,580.92	-11,559,063.19
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	690,548,644.11	678,989,580.92	-11,559,063.19
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	265,075,985.22	259,046,900.87	-6,029,084.35

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	265,075,985.22	259,046,900.87	-6,029,084.35

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	9,649.68	87,888.82
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	1,181.73	565.73
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.30	2,199.94
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	101.42	79.42
合计	10,933.13	90,733.91

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	968,212.39	373,374.89
银行间市场应付交易费用	-	11,538.50

合计	968,212.39	384,913.39
----	------------	------------

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	553.96	-
预提费用	230,000.00	230,000.00
合计	230,553.96	230,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	625,815,007.56	625,815,007.56
本期申购	683,383,734.20	683,383,734.20
本期赎回（以“-”号填列）	-664,591,630.95	-664,591,630.95
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	644,607,110.81	644,607,110.81

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	45,106,840.02	-31,927,993.03	13,178,846.99
本期利润	73,805,675.73	-5,529,978.84	68,275,696.89
本期基金份额交易产生的变动数	-1,751,691.93	-6,569,313.61	-8,321,005.54
其中：基金申购款	67,380,222.13	-34,607,677.56	32,772,544.57
基金赎回款	-69,131,914.06	28,038,363.95	-41,093,550.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	117,160,823.82	-44,027,285.48	73,133,538.34

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	416,469.88	1,564,074.86
定期存款利息收入	-	11,330,627.78
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	26,185.72	14,374.88
其他	19,925.02	130,534.54
合计	462,580.62	13,039,612.06

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,577,734,328.16	530,174,537.12
减：卖出股票成本总额	1,495,815,363.99	535,263,277.33
买卖股票差价收入	81,918,964.17	-5,088,740.21

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-	2,172,854.35
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-	2,172,854.35

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年
----	----------------------	----------------------------

	年12月31日	12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	-	519,664,545.61
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	-	507,816,871.68
减：应收利息总额	-	9,674,819.58
买卖债券差价收入	-	2,172,854.35

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	8,515,833.28	1,237,295.18
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	8,515,833.28	1,237,295.18

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	-5,529,978.84	-7,777,626.02
——股票投资	-5,529,978.84	-6,029,084.35
——债券投资	-	-1,748,541.67
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-

3. 其他	-	-
合计	-5, 529, 978. 84	-7, 777, 626. 02

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	1, 356, 572. 86	15, 360, 812. 91
转换费收入	43, 784. 49	125, 164. 72
其他	-	108, 731. 94
合计	1, 400, 357. 35	15, 594, 709. 57

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	5, 134, 156. 70	1, 841, 505. 46
银行间市场交易费用	-	4, 697. 50
合计	5, 134, 156. 70	1, 846, 202. 96

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	50, 000. 00	50, 000. 00
信息披露费	180, 000. 00	180, 000. 00
其他	600. 00	25, 000. 00
账户维护费	41, 300. 00	32, 050. 00
银行汇划费用	13, 738. 73	34, 727. 20
合计	285, 638. 73	321, 777. 20

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除 7.4.6.2 营业税、增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。据《万家新利灵活配置混合型证券投资基金》，本基金 3 月 28 日分红，每 10 份分 1.6 元。

7.4.9 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”）	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	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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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	562, 205, 717. 71	16. 10%	633, 533, 371. 44	49. 07%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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%

注：本基金本年度未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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%

注：本基金本年度未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	523,583.39	16.13%	341,684.37	35.29%
关联方名称	上年度可比期间 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%

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	11,204,797.94	16,602,804.15
其中：支付销售机构的客户维护费	125,274.04	9,428.85

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延至最近可支付日。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,867,466.32	2,774,099.76

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延至最近可支付日。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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	40,106,322.72	416,469.88	405,197,172.99	1,564,074.86

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，2016 年度获得的利息收入为人民币 26,185.72 元（2015 年度：人民币 1,142,851.54 元），2016 年末结算备付金余额为人民币 2,387,419.86 元（2015 年末：人民币 41,455.82 元）。

7.4.10.6 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。

7.4.11 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.11.1 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

7.4.12.1.1 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
603032	德新交运	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股发行	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
603035	常熟汽饰	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股发行	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603186	华正新材	2016 年 12 月 26 日	2017 年 1 月 3 日	新股发行	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603228	景旺电子	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股发行	23.16	23.16	3,428	79,392.48	79,392.48	-
603877	太平鸟	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 9 日	新股发行	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
002838	道恩股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股发行	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96	-
002840	华统股份	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 10 日	新股发行	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-

300583	赛托生物	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 6 日	新股发 行	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
300586	美联新材	2016 年 12 月 26 日	2017 年 1 月 4 日	新股发 行	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300587	天铁股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 5 日	新股发 行	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
300588	熙菱信息	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股发 行	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-
300591	万里马	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股发 行	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
603266	天龙股份	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股发 行	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
603689	皖天然气	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股发 行	7.87	7.87	4,819	37,925.53	37,925.53	-

7.4.11.2 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
603986	兆易创新	2016 年 9 月 19 日	重大资产重组	177.97	2017 年 3 月 13 日	199.75	1,133	26,353.58	201,640.01	-

7.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事银行间正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事交易所正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.12.1 公允价值

7.4.12.1.1 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、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。

7.4.12.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.12.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2016 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 678,406,472.33 元，属于第二层次的余额为人民币 583,108.59 元，无第三层次余额。（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 246,513,938.87 元，属于第二层次的余额为人民币 12,532,962.00 元，无属于第三层次的余额。）

7.4.12.1.2.2 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，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，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.12.1.2.3 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。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 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。

7.4.12.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 3 月 30 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	678,989,580.92	93.97
	其中：股票	678,989,580.92	93.97
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	42,493,742.58	5.88
7	其他各项资产	1,092,577.67	0.15
8	合计	722,575,901.17	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	16,756,240.00	2.33
B	采矿业	—	—
C	制造业	88,858,425.02	12.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,925.53	0.01
E	建筑业	202,661,508.03	28.24
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	0.00
H	住宿和餐饮业	—	—

I	信息传输、软件和信息技术服务业	241,692.20	0.03
J	金融业	93,246,482.52	12.99
K	房地产业	252,724,172.15	35.21
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	11,257,396.80	1.57
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	13,196,279.99	1.84
S	综合	—	—
	合计	678,989,580.92	94.60

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本报告期末未持有沪港通股票。

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	601997	贵阳银行	4,359,644	68,795,182.32	9.58
2	600048	保利地产	4,896,379	44,703,940.27	6.23
3	001979	招商蛇口	2,698,257	44,224,432.23	6.16
4	600068	葛洲坝	4,615,274	42,414,368.06	5.91
5	300197	铁汉生态	3,321,681	42,118,915.08	5.87
6	300351	永贵电器	1,523,877	39,117,922.59	5.45
7	600325	华发股份	3,005,220	38,466,816.00	5.36
8	601155	新城控股	2,828,968	33,240,374.00	4.63
9	600491	龙元建设	2,774,247	32,014,810.38	4.46
10	600376	首开股份	2,361,900	27,894,039.00	3.89

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	601997	贵阳银行	84,257,579.35	13.19
2	600068	葛洲坝	83,860,814.39	13.12
3	600491	龙元建设	65,729,234.52	10.29
4	601800	中国交建	60,745,905.59	9.51
5	002146	荣盛发展	60,006,327.01	9.39
6	600048	保利地产	57,343,451.99	8.97
7	001979	招商蛇口	54,752,327.89	8.57
8	002458	益生股份	54,343,482.25	8.50
9	300351	永贵电器	53,303,685.97	8.34
10	300197	铁汉生态	53,217,408.39	8.33
11	002586	围海股份	49,076,914.81	7.68
12	600325	华发股份	48,748,952.87	7.63
13	600820	隧道股份	46,195,812.23	7.23
14	000503	海虹控股	45,910,586.22	7.18
15	601669	中国电建	45,204,793.71	7.07
16	000402	金融街	42,403,608.74	6.64
17	601009	南京银行	42,142,999.34	6.60
18	002047	宝鹰股份	42,113,784.33	6.59
19	600266	北京城建	40,814,014.28	6.39
20	601766	中国中车	40,424,197.31	6.33
21	600169	太原重工	38,584,913.43	6.04
22	600418	江淮汽车	37,853,214.83	5.92
23	601155	新城控股	36,853,281.36	5.77
24	002070	众和股份	35,154,833.32	5.50
25	002594	比亚迪	33,328,957.27	5.22
26	600376	首开股份	32,233,792.97	5.04
27	000157	中联重科	28,884,039.60	4.52
28	000800	一汽轿车	28,441,078.40	4.45
29	000060	中金岭南	26,140,707.53	4.09
30	002343	慈文传媒	25,545,040.50	4.00
31	600318	新力金融	24,615,344.37	3.85

32	300284	苏交科	24,405,307.36	3.82
33	601186	中国铁建	22,821,365.32	3.57
34	601390	中国中铁	22,659,829.90	3.55
35	600392	盛和资源	22,533,668.35	3.53
36	300450	先导智能	21,915,116.13	3.43
37	601618	中国中冶	21,124,431.00	3.31
38	000488	晨鸣纸业	20,610,666.73	3.23
39	601989	中国重工	20,609,203.79	3.23
40	600340	华夏幸福	20,376,586.61	3.19
41	000065	北方国际	19,384,220.50	3.03
42	002612	朗姿股份	18,933,570.02	2.96
43	600240	华业资本	18,205,735.20	2.85
44	600373	中文传媒	18,060,594.01	2.83
45	300278	华昌达	18,031,527.70	2.82
46	600497	驰宏锌锗	16,005,606.54	2.50
47	601106	中国一重	15,178,115.00	2.38
48	000928	中钢国际	13,813,213.03	2.16
49	000998	隆平高科	13,439,734.00	2.10
50	600884	杉杉股份	13,276,282.56	2.08
51	002655	共达电声	13,028,422.40	2.04

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	601800	中国交建	84,261,307.09	13.19
2	600068	葛洲坝	67,457,177.75	10.56
3	002146	荣盛发展	66,487,174.91	10.40
4	600491	龙元建设	60,637,503.34	9.49
5	601669	中国电建	54,825,431.80	8.58
6	601766	中国中车	51,405,968.63	8.04
7	000503	海虹控股	48,361,281.50	7.57
8	002070	众和股份	46,252,532.64	7.24
9	002594	比亚迪	46,214,615.13	7.23
10	002458	益生股份	40,589,426.41	6.35
11	600048	保利地产	39,343,716.86	6.16

12	000402	金 融 街	39,079,318.36	6.12
13	000488	晨鸣纸业	38,688,236.83	6.05
14	600169	太原重工	36,809,862.86	5.76
15	600318	新力金融	32,127,609.00	5.03
16	600820	隧道股份	30,618,047.94	4.79
17	601186	中国铁建	29,955,367.09	4.69
18	600418	江淮汽车	29,852,577.44	4.67
19	601390	中国中铁	29,018,622.82	4.54
20	300284	苏交科	28,518,388.78	4.46
21	002047	宝鹰股份	26,286,325.30	4.11
22	000060	中金岭南	25,795,348.56	4.04
23	000157	中联重科	25,313,114.15	3.96
24	600392	盛和资源	24,955,080.38	3.91
25	300450	先导智能	24,819,162.10	3.88
26	000928	中钢国际	23,129,999.58	3.62
27	600497	驰宏锌锗	23,098,818.28	3.61
28	300278	华昌达	21,871,979.73	3.42
29	002103	广博股份	21,310,142.75	3.33
30	600340	华夏幸福	21,305,320.79	3.33
31	002586	围海股份	21,176,644.49	3.31
32	601618	中国中冶	21,046,046.85	3.29
33	601989	中国重工	19,572,225.80	3.06
34	001979	招商蛇口	19,285,151.18	3.02
35	600373	中文传媒	18,452,015.50	2.89
36	000910	大亚圣象	18,361,434.84	2.87
37	300197	铁汉生态	17,919,719.90	2.80
38	002612	朗姿股份	17,467,665.81	2.73
39	000568	泸州老窖	16,395,818.59	2.57
40	000800	一汽轿车	15,105,490.35	2.36
41	601009	南京银行	14,979,571.69	2.34
42	600266	北京城建	14,705,439.82	2.30
43	000530	大冷股份	14,598,419.90	2.28
44	002343	慈文传媒	13,684,537.66	2.14
45	002655	共达电声	13,648,370.98	2.14

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	1,921,288,022.88
卖出股票收入（成交）总额	1,577,734,328.16

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

8.10.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同,本基金暂不可投资于国债期货。

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	204,986.17
2	应收证券清算款	189,287.25
3	应收股利	—

4	应收利息	10,933.13
5	应收申购款	687,371.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,092,577.67

8.11.4 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§ 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

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
9,413	68,480.52	494,470,710.54	76.71%	150,136,400.27	23.29%

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	203,392.87	0.0316%

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（ 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	625,815,007.56
本报告期基金总申购份额	683,383,734.20
减:本报告期基金总赎回份额	664,591,630.95
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	644,607,110.81

万家基金管理有限公司
2017 年 3 月 31 日