

# 万家颐和保本混合型证券投资基金 2016 年 年度报告

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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 31 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2017 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本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 6 月 23 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b>                       | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b>                          | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料                              | 7         |
| <b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>          | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| 3.3 其他指标                                | 错误!未定义书签。 |
| 3.4 过去三年基金的利润分配情况                       | 9         |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 13        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 13        |
| 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             | 14        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 15        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 15        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 16        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 16        |
| 4.9 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       | 16        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>17</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 17        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 17        |
| 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      | 17        |
| <b>§6 审计报告</b>                          | <b>17</b> |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 17        |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 17        |
| <b>§7 年度财务报表</b>                        | <b>18</b> |
| 7.1 资产负债表                               | 18        |
| 7.2 利润表                                 | 19        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 21        |
| 7.4 报表附注                                | 21        |
| <b>§8 投资组合报告</b>                        | <b>45</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况                          | 45        |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合                      | 46        |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 46        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 47        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 49        |
| 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      | 49        |

|                                             |                  |
|---------------------------------------------|------------------|
| 8.7 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 ..... | 49               |
| 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 ..... | 50               |
| 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 .....    | 50               |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....             | 50               |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 50               |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                         | 50               |
| <b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>                   | <b>51</b>        |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 51               |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 51               |
| 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 .....     | 51               |
| <b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>51</b>        |
| <b>§11 重大事件揭示 .....</b>                     | <b>52</b>        |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 52               |
| 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 .....      | 52               |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 52               |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 52               |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 52               |
| 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 .....         | 53               |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 53               |
| 11.8 其他重大事件 .....                           | 错误!未定义书签。        |
| <b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>             | <b>错误!未定义书签。</b> |
| <b>§13 备查文件目录 .....</b>                     | <b>54</b>        |
| 13.1 备查文件目录 .....                           | 54               |
| 13.2 存放地点 .....                             | 54               |
| 13.3 查阅方式 .....                             | 54               |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                  |
|------------|------------------|
| 基金名称       | 万家颐和本保混合型证券投资基金  |
| 基金简称       | 万家颐和             |
| 基金主代码      | 519198           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2016 年 6 月 23 日  |
| 基金管理人      | 万家基金管理有限公司       |
| 基金托管人      | 中国邮政储蓄银行股份有限公司   |
| 报告期末基金份额总额 | 863,920,543.39 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金严格控制风险，在确保保本周期到期时本金安全的基础上，力争实现基金资产的稳定增值。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 投资策略   | <p>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（包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、证券公司短期公司债、中小企业私募债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、国债期货、股指期货、期权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。本基金可以参与融资交易。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金按照 CPPI 和 TIPP 策略对各类金融工具的投资比例进行动态调整。其中，股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于 40%；债券、银行存款等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 60%。每个交易日日终在除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p> |
| 业绩比较基准 | <p>本基金业绩比较基准为：三年期银行定期存款收益率（税后）。</p> <p>本基金是保本型基金，保本周期原则上为三年，以三年期定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准，在投资期限上较为类似，并且能够使本基金投资</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>者判断本基金的风险收益特征。</p> <p>三年期银行定期存款收益率（税后）采用中国人民银行公布的金融机构人民币三年期存款基准利率计算。若中国人民银行调整利率，则本基金自调整生效之日起使用新的利率。</p> <p>如果今后法律法规发生变化，或者中国人民银行调整或停止该基准利率的发布，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时，基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，确定变更基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更需经基金管理人与基金托管人协商一致。基金管理人应在取得基金托管人同意后，报中国证监会备案，并应及时在指定媒介上刊登公告，而无需召开基金份额持有人大会。</p> |
| 风险收益特征 | <p>本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其长期平均预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金，高于货币市场基金和债券型基金。</p> <p>投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款放在银行或存款类金融机构，保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。</p>                                                                                                                                                                                    |

## 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                           | 中国邮政储蓄银行股份有限公司       |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 兰剑                                   | 田东辉                  |
|         | 联系电话 | 021-38909626                         | 010-68858112         |
|         | 电子邮箱 | lanj@wjasset.com                     | tiantonghui@psbc.com |
| 客户服务电话  |      | 95538 转 6、4008880800                 | 95580                |
| 传真      |      | 021-38909627                         | 010-68858120         |
| 注册地址    |      | 中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层） | 北京市西城区金融大街 3 号       |
| 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） | 北京市西城区金融大街 3 号 A 座   |
| 邮政编码    |      | 200122                               | 100808               |
| 法定代表人   |      | 方一天                                  | 李国华                  |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                                                             |
|---------------------|-------------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》                                      |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.wjasset.com">http://www.wjasset.com</a> |
| 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               |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称             | 办公地址                             |
|--------|----------------|----------------------------------|
| 会计师事务所 | 安永华明会计师事务所     | 北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层 |
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号                 |
| 基金保证人  | 深圳市高新投集团有限公司   | 深圳市深南大道 7028 号时代科技大厦 22 层、23 层   |

## § 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 6 月 23 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 8,193,298.87                              |
| 本期利润          | -7,043,745.26                             |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0081                                   |
| 本期加权平均净值利润率   | -0.80%                                    |
| 本期基金份额净值增长率   | -0.82%                                    |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016 年末                                   |
| 期末可供分配利润      | -7,108,011.73                             |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0082                                   |
| 期末基金资产净值      | 856,812,531.66                            |
| 期末基金份额净值      | 0.9918                                    |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2016 年末                                   |
| 基金份额累计净值增长率   | -0.82%                                    |

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。

(4) 本基金合同生效于 2016 年 6 月 23 日，截至 2016 年 12 月 31 日成立未满一年。

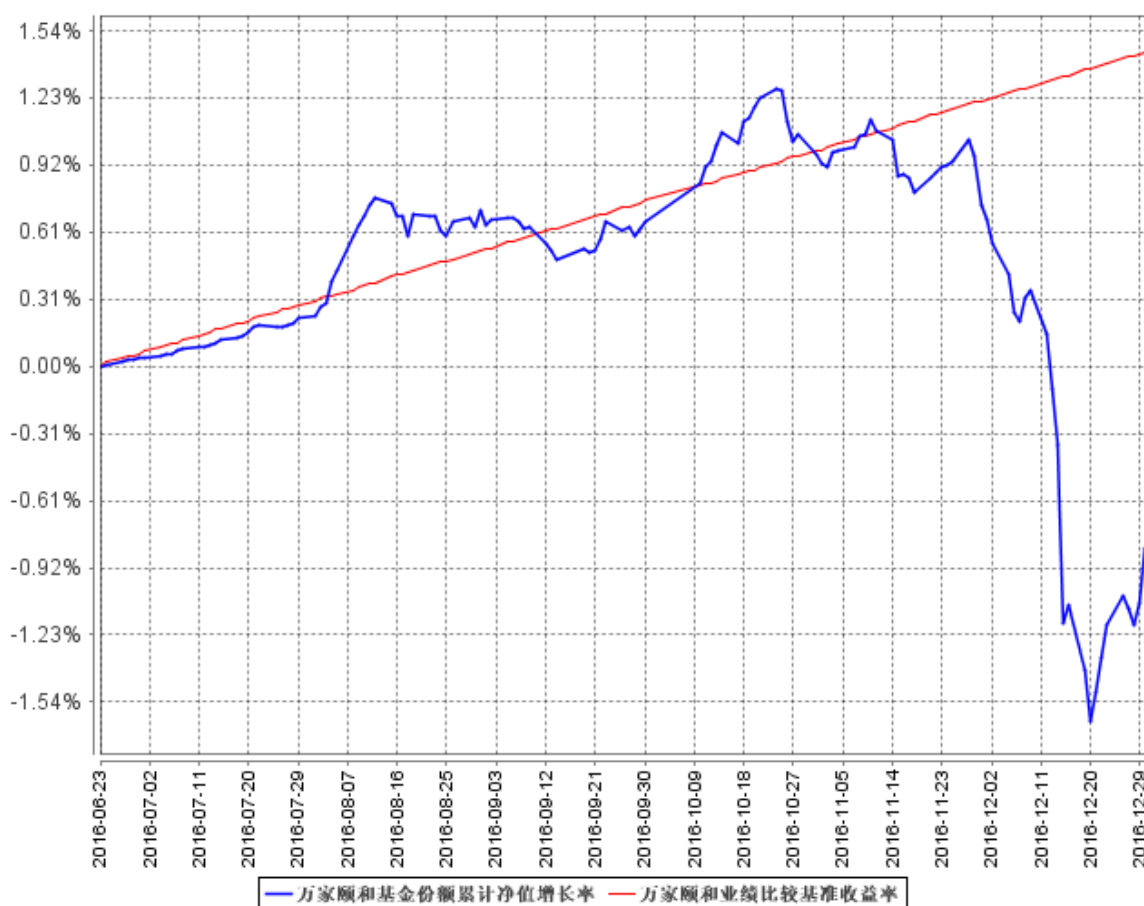
## 3.2 基金净值表现

### 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<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | -1.47%       | 0.15%               | 0.69%              | 0.00%                 | -2.16% | 0.14% |
| 过去六个月          | -0.86%       | 0.11%               | 1.39%              | 0.00%                 | -2.25% | 0.10% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -0.82%       | 0.11%               | 1.45%              | 0.00%                 | -2.27% | 0.10% |

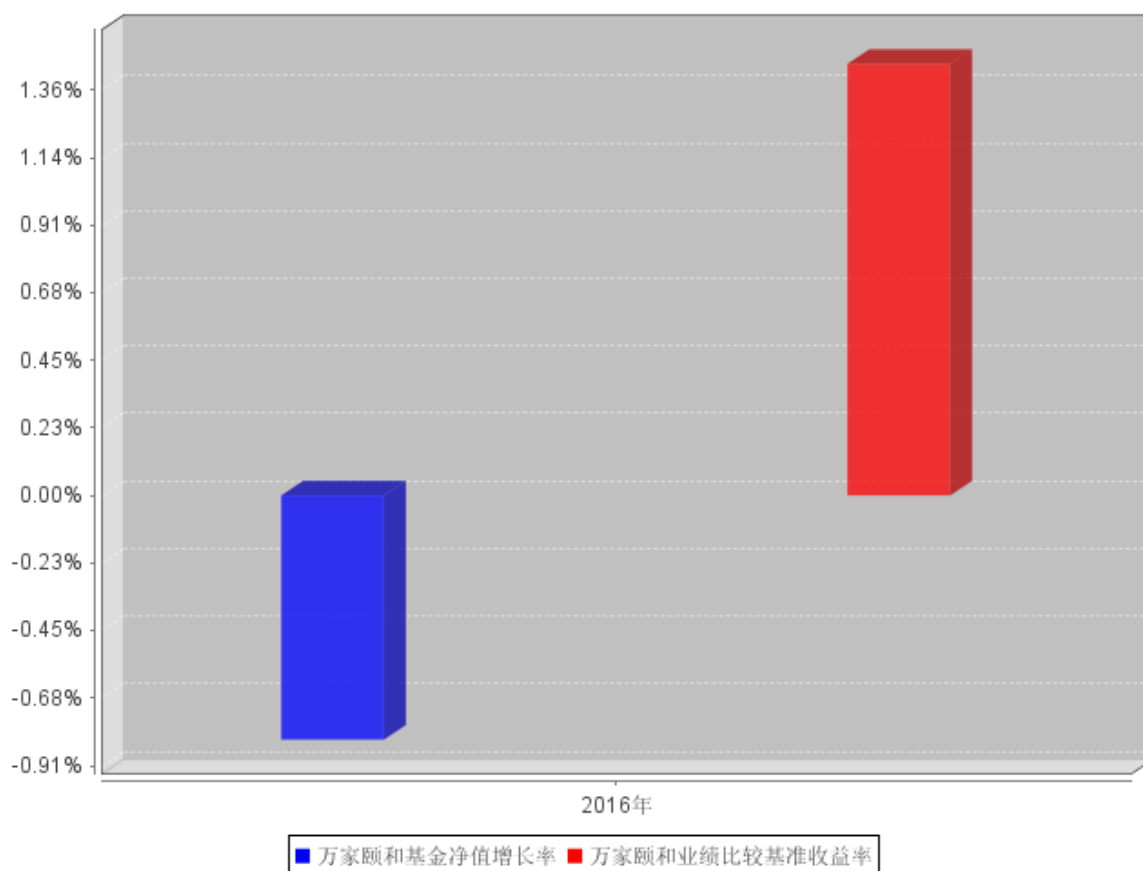
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

万家颐和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



### 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

万家颐和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：本基金合同生效日为 2016 年 6 月 23 日，截至 2016 年 12 月 31 日未满一年，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

本基金过去三年未分配利润。

## § 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（LOF）、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金（LOF）、万家添利债券型证券投资基金（LOF）、万家中证创业成长指数分级证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家上证 50 交易型开放式指数证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞和灵活配置混合型证券投资基金、万家颐达保本混合型证券投资基金、万家颐和保本混合型证券投资基金、万家恒瑞 18 个月定期开放债券型证券投资基金、万家年年恒祥定期开放债券型证券投资基金、万家鑫安纯债债券型证券投资基金、万家鑫璟纯债债券型证券投资基金、万家瑞旭灵活配置混合型证券投资基金、万家家享纯债债券型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、万家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期限     |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                     |
|-----|------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|------|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                                                                                    | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                                                                        |
| 唐俊杰 | 本基金基金经理，万家货币基金基金经理、万家稳健增利债券基金基金、万家恒利债券基金、万家颐达保本混合型证券投资基金、万家鑫安纯债债券型基金、万家鑫璟纯债债券型基金、万 | 2016 年 6 月 23 日 | -    | 8 年    | 基金经理，硕士。2008 年 7 月至 2011 年 9 月在金元证券股份有限公司固定收益总部从事固定收益投资研究工作，担任投资经理职务。2011 年 9 月加入万家基金管理有限公司，现任固定收益部总监。 |

|     |                                                                                                                                                                                                                           |                 |   |     |                                                                                                     |
|-----|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|---|-----|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     | 家家享纯债债券型证券投资基金基金经理。                                                                                                                                                                                                       |                 |   |     |                                                                                                     |
| 苏谋东 | 本基金基金经理、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家添利分级债券型证券投资基金、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、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、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、万家恒景 18 个月定期开放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基金经理 | 2016 年 7 月 16 日 | - | 8 年 | 复旦大学经济学硕士，CFA，2008 年 7 月至 2013 年 2 月在宝钢集团财务有限公司从事固定收益投资研究工作，担任投资经理职务。2013 年加入万家基金管理有限公司，现任固定收益部副总监。 |
| 高翰昆 | 本基金基金                                                                                                                                                                                                                     | 2016 年 6 月      | - | 7 年 | 英国诺丁汉大学硕                                                                                            |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                        |             |  |  |                                                             |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------|--|--|-------------------------------------------------------------|
|  | <p>经理、万家新利灵活配置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、万家瑞旭灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞隆灵活配置混合型证</p> | <p>23 日</p> |  |  | <p>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。</p> |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------|--|--|-------------------------------------------------------------|

|  |                |  |  |  |  |
|--|----------------|--|--|--|--|
|  | 券投资基金<br>基金经理。 |  |  |  |  |
|--|----------------|--|--|--|--|

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

##### 1、宏观经济分析

2016 年国内经济总体企稳复苏。经济企稳复苏的主要动能来自于基建和房地产投资，以及再库存周期的叠加拉动。当年 GDP 增速 6.7%，基本符合预期。其中消费基本保持平稳增长，基建投资维持较高水平，地产开放投资消费反弹，进出口同比增速受益于人民币贬值有所反弹。海外方面，美国经济复苏相对较为强劲，日欧复苏力度仍然较弱。由于美日欧等发达国家停止继续加码量化宽松政策，全球流动性拐点出现，海外各国国债收益率出现显著的反弹，这对国内的货币政策和汇率政策形成较大的影响。

##### 2、市场回顾

2016 年债市波动较大，收益率先下后上。上半年受流动性中性宽松、大资管行业蓬勃发展等影响，大量配置型需求推动收益率下行较多，并在三季度创下本轮下行周期的最低水平。三季度后，一方面央行货币政策由松转紧，另一方面，经济企稳复苏预期进一步得到验证，且通胀预期前之前有所提高。银行间资金面大幅紧张，在去杠杆的压力下，债券收益率上行较多。2016 年周期性行业显著复苏，导致多数周期性行业的盈利状况、现金流状况明显改善，下半年周期性行业的信用利差有所收窄，信用环境也有所改善。权益市场方面，盈利的改善叠加监管环境的趋严，利好蓝筹股。风格上，大盘蓝筹股显著好于中小盘成长风格股票。

##### 3、运行分析

基于市场收益率整体处于较低水平，且自三季度开始国内货币政策和监管政策有对债市不利的迹象的情况，本基金采取了较为谨慎的配置策略。在收益率下行过程中，降低了组合的久期，并且调整本基金持仓债券的流动性，因而，本基金在四季度市场极端下跌情况下，相对比较较好。四季度国内信用债市场仍然有较多的违约事件，本基金继续提高信用风险的识别能力，提高风险防范意识，确保组合没有遭受违约的风险。权益方面，本基金谨慎参与股票投资，持仓在风格上主要是大盘蓝筹个股，板块上集中于食品饮料、化工、金融等。

#### 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 0.9918 元，本报告期份额净值增长率为-0.82%，业绩比较基准收益率 1.45%。

#### 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 年宏观经济、库存、周期品价格以及行业盈利的波动率会大幅降低。一方面，强监管抑制了市场参与主体的活跃度，另一方面，经过剧烈波动的一年后，供需和预期均达到一个新的均衡。从中央经济工作会议的精神看，稳增长的重要性相对下降，供给侧改革和金融去杠杆则相对更加突出。货币政策方面，配合金融去杠杆，央行会保持中性偏紧的格局。经济短期仍然有支撑，但是往后，下行的压力会逐步增大。经济何时回再度改变国内的政策组合以及货币政策的取向则仍需要观察等待。2017 年信用环境依然较为复杂，供给侧改革背景下，行业整合是大趋势，寻找大而强的行业和个券发行人将是较好的选择。本基金将继续做好信用债的信用风险管理，同时，做好流动性管理，洞悉市场机会，为持有人获取较好的投资回报。

#### 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、专户业务相关的制度流程及后台部门相关制度进行了修订；

##### （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，进一步完善了每日风险监控工作；改进基金业绩评价工作，辅助基金经理投资决策，提供风险评估意见等；针对由于市场流动性紧张的情况，加大了对固定收益产品的风险管理，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

基金合同约定:“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, 每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%, 若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。”2016 年本基金未进行利润分配。

### 4.9 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

本报告期内, 本基金没有出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情况。

## § 5 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

本报告期内,本托管人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、基金合同和托管协议的规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本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

本报告期内,本托管人依据国家相关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、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,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

|            |                              |
|------------|------------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                            |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见                      |
| 审计报告编号     | 安永华明(2017)审字第 60778298_B29 号 |

### 6.2 审计报告的基本内容

| 审计报告标题       | 审计报告                                                                                                                  |
|--------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 审计报告收件人      | 万家颐和本混合型基金全体基金份额持有人:                                                                                                  |
| 引言段          | 我们审计了后附的万家颐和本混合型基金财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。                                  |
| 管理层对财务报表的责任段 | 编制和公允列报财务报表是基金管理人万家基金管理有限公司的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。      |
| 注册会计师的责任段    | 我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 |

|           |                                                                                                                                                                                                                                                       |    |
|-----------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|
|           | <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> |    |
| 审计意见段     | 我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了万家颐和本保混合型证券投资基金 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。                                                                                                                                                     |    |
| 注册会计师的姓名  | 陈露                                                                                                                                                                                                                                                    | 朱昀 |
| 会计师事务所的名称 | 安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)                                                                                                                                                                                                                                    |    |
| 会计师事务所的地址 | 中国 北京                                                                                                                                                                                                                                                 |    |
| 审计报告日期    | 2017 年 3 月 29 日                                                                                                                                                                                                                                       |    |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：万家颐和本保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<br>2016 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|-------------------------|
| <b>资 产：</b> |         |                         |
| 银行存款        | 7.4.7.1 | 82,014,670.26           |
| 结算备付金       |         | 14,577,649.98           |
| 存出保证金       |         | 106,396.69              |
| 交易性金融资产     | 7.4.7.2 | 921,266,255.57          |
| 其中：股票投资     |         | 32,636,739.37           |
| 基金投资        |         | —                       |
| 债券投资        |         | 888,629,516.20          |
| 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 | 338,228,107.34          |

|                 |            |                                 |
|-----------------|------------|---------------------------------|
| 应收证券清算款         |            | -                               |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 12,069,998.36                   |
| 应收股利            |            | -                               |
| 应收申购款           |            | -                               |
| 递延所得税资产         |            | -                               |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               |
| 资产总计            |            | 1,368,263,078.20                |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2016 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债:</b>     |            |                                 |
| 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       |            | 510,000,000.00                  |
| 应付证券清算款         |            | 18,734.30                       |
| 应付赎回款           |            | 22,227.32                       |
| 应付管理人报酬         |            | 875,849.51                      |
| 应付托管费           |            | 145,974.92                      |
| 应付销售服务费         |            | -                               |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 86,586.52                       |
| 应交税费            |            | -                               |
| 应付利息            |            | 30,835.03                       |
| 应付利润            |            | -                               |
| 递延所得税负债         |            | -                               |
| 其他负债            | 7.4.7.8    | 270,338.94                      |
| 负债合计            |            | 511,450,546.54                  |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                                 |
| 实收基金            | 7.4.7.9    | 863,920,543.39                  |
| 未分配利润           | 7.4.7.10   | -7,108,011.73                   |
| 所有者权益合计         |            | 856,812,531.66                  |
| 负债和所有者权益总计      |            | 1,368,263,078.20                |

注：1、报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9918 元，基金份额总额 863,920,543.39 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2016 年 6 月 23 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日。

3、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

## 7.2 利润表

会计主体：万家颐和保本混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 6 月 23 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                        | 附注号        | 本期<br>2016 年 6 月 23 日(基金合同生效日)至 2016<br>年 12 月 31 日 |
|----------------------------|------------|-----------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>                |            | 5,402,529.22                                        |
| 1. 利息收入                    |            | 17,453,257.57                                       |
| 其中：存款利息收入                  | 7.4.7.11   | 1,923,325.57                                        |
| 债券利息收入                     |            | 11,454,243.03                                       |
| 资产支持证券利息收入                 |            | -                                                   |
| 买入返售金融资产收入                 |            | 4,075,688.97                                        |
| 其他利息收入                     |            | -                                                   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |            | 3,001,090.55                                        |
| 其中：股票投资收益                  | 7.4.7.12   | 4,942,939.29                                        |
| 基金投资收益                     |            | -                                                   |
| 债券投资收益                     | 7.4.7.13   | -2,104,839.75                                       |
| 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   | 162,991.01                                          |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.17   | -15,237,044.13                                      |
| 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   | 185,225.23                                          |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 12,446,274.48                                       |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 5,488,494.92                                        |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 914,749.16                                          |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | -                                                   |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.19   | 240,423.96                                          |
| 5. 利息支出                    |            | 5,526,006.44                                        |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 5,526,006.44                                        |
| 6. 其他费用                    | 7.4.7.20   | 276,600.00                                          |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -7,043,745.26                                       |
| 减：所得税费用                    |            | -                                                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -7,043,745.26                                       |

注：1、本财务报表的实际编制期间为 2016 年 6 月 23 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家颐和保本混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 6 月 23 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2016 年 6 月 23 日(基金合同生效日)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）                        | 878,580,628.34                                   | -             | 878,580,628.34 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                                | -7,043,745.26 | -7,043,745.26  |
| 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）      | -14,660,084.95                                   | -64,266.47    | -14,724,351.42 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 1,144,328.89                                     | 7,426.16      | 1,151,755.05   |
| 2. 基金赎回款                               | -15,804,413.84                                   | -71,692.63    | -15,876,106.47 |
| 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）                        | 863,920,543.39                                   | -7,108,011.73 | 856,812,531.66 |

注：1、本财务报表的实际编制期间为 2016 年 6 月 23 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

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：

|            |            |            |
|------------|------------|------------|
| <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

万家颐和保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]680 号文《关于准予万家颐和保本混合型证券投资基金注册的批复》的批准，由万家基金管理有限公司作为基金管理人于 2016 年 5 月 23 日向社会公开募

集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具（2016）验字第 60778298\_B06 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2016 年 6 月 23 日正式生效，本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为 878,393,850.24 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 186,778.10 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 878,580,628.34 元，折合 878,580,628.34 份基金份额。本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，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、证券公司短期公司债、中小企业私募债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、国债期货、股指期货、期权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。本基金可以参与融资交易。本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款收益率（税后）。

#### 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 6 月 23 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值

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。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2016 年 6 月 23 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

###### (2) 金融负债分类

本基金目前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主要包括股票投资和债券投资等；

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债

的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### （1）股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### （2）债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### （3）权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### （4）分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付

的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (5) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

#### (1) 存在活跃市场的金融工具

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

#### (2) 不存在活跃市场的金融工具

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益-(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益-(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 衍生工具收益-(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(10) 公允价值变动收益-(损失) 系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 的年费率逐日计提，到期操作期间及过渡期不计提管理费。

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率逐日计提，到期操作期间及过渡期不计提托管费。

(3) 若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人将所持有本基金份额转为变更后的“万家颐和灵活配置混合型证券投资基金”的基金份额，管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 的年费率计提，托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。

(4) 根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 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，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 保本周期内，本基金仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资。转型为“万家颐和灵活配置混合型证券投资基金”后，本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人选择采取红利再投资形式的，分红资金将按红利发放日的基金份额净值转成基金份额，红利再投资的份额免收申购费；同一投资者持有的基金份额只能选择一种分红方式，如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### 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

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

#### 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[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<br>2016 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|
| 活期存款           | 2,014,670.26            |
| 定期存款           | 80,000,000.00           |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | 48,000,000.00           |
| 存款期限 3 个月-1 年  | 32,000,000.00           |
| 其他存款           | -                       |
| 合计：            | 82,014,670.26           |

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目     |       | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 |                |                |
|--------|-------|-------------------------|----------------|----------------|
|        |       | 成本                      | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票     |       | 30,568,634.91           | 32,636,739.37  | 2,068,104.46   |
| 债券     | 交易所市场 | 696,915,576.10          | 683,264,516.20 | -13,651,059.90 |
|        | 银行间市场 | 209,019,088.69          | 205,365,000.00 | -3,654,088.69  |
|        | 合计    | 905,934,664.79          | 888,629,516.20 | -17,305,148.59 |
| 资产支持证券 |       | -                       | -              | -              |
| 基金     |       | -                       | -              | -              |
| 其他     |       | -                       | -              | -              |
| 合计     |       | 936,503,299.70          | 921,266,255.57 | -15,237,044.13 |

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 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均无衍生金融资产/负债余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目         |  | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 |           |
|------------|--|-------------------------|-----------|
|            |  | 账面余额                    | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返售证券_银行间 |  | 338,228,107.34          | -         |
| 合计         |  | 338,228,107.34          | -         |

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期期末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<br>2016 年 12 月 31 日 |
|-----------|-------------------------|
| 应收活期存款利息  | 3,882.61                |
| 应收定期存款利息  | 251,333.37              |
| 应收其他存款利息  | -                       |
| 应收结算备付金利息 | 7,215.89                |

|            |               |
|------------|---------------|
| 应收债券利息     | 11,287,986.06 |
| 应收买入返售证券利息 | 519,527.74    |
| 应收申购款利息    | —             |
| 应收黄金合约拆借孳息 | —             |
| 其他         | 52.69         |
| 合计         | 12,069,998.36 |

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 66,069.10               |
| 银行间市场应付交易费用 | 20,517.42               |
| 合计          | 86,586.52               |

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | —                       |
| 应付赎回费       | 338.94                  |
| 预提费用        | 270,000.00              |
| 合计          | 270,338.94              |

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2016 年 6 月 23 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |                |
|---------------|--------------------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额(份)                                          | 账面金额           |
| 基金合同生效日       | 878,580,628.34                                   | 878,580,628.34 |
| 本期申购          | 1,144,328.89                                     | 1,144,328.89   |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -15,804,413.84                                   | -15,804,413.84 |
| — 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           | 863,920,543.39 | 863,920,543.39 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 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       |
|----------------|--------------|----------------|---------------|
| 基金合同生效日        | -            | -              | -             |
| 本期利润           | 8,193,298.87 | -15,237,044.13 | -7,043,745.26 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -67,182.35   | 2,915.88       | -64,266.47    |
| 其中：基金申购款       | 2,804.06     | 4,622.10       | 7,426.16      |
| 基金赎回款          | -69,986.41   | -1,706.22      | -71,692.63    |
| 本期已分配利润        | -            | -              | -             |
| 本期末            | 8,126,116.52 | -15,234,128.25 | -7,108,011.73 |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2016年6月23日(基金合同生效日)至2016年12月31日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 64,673.61                             |
| 定期存款利息收入  | 1,796,555.60                          |
| 其他存款利息收入  | -                                     |
| 结算备付金利息收入 | 61,671.57                             |
| 其他        | 424.79                                |
| 合计        | 1,923,325.57                          |

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 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<br>2016年6月23日(基金合同生效日)至2016年12月31日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 70,461,011.98                         |
| 减：卖出股票成本总额 | 65,518,072.69                         |
| 买卖股票差价收入   | 4,942,939.29                          |

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

### 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<br>2016年6月23日(基金合同生效日)至2016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 | -2,104,839.75                         |
| 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                            | -2,104,839.75                         |

本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 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<br>2016年6月23日(基金合同生效日)至2016年12月31日 |
|-------------------------|---------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 151,746,495.83                        |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 151,798,403.04                        |
| 减：应收利息总额                | 2,052,932.54                          |
| 买卖债券差价收入                | -2,104,839.75                         |

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2016年6月23日(基金合同生效日)至2016年12月31日 |
|-------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 162,991.01                            |
| 基金投资产生的股利收益 | -                                     |
| 合计          | 162,991.01                            |

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2016 年 6 月 23 日(基金合同生效日)至 2016<br>年 12 月 31 日 |
|------------|-----------------------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -15,237,044.13                                      |
| ——股票投资     | 2,068,104.46                                        |
| ——债券投资     | -17,305,148.59                                      |
| ——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         | -15,237,044.13                                      |

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2016 年 6 月 23 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |
|---------|--------------------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 183,229.63                                       |
| 转换费     | 77.79                                            |
| 其他      | 1,917.81                                         |
| 合计      | 185,225.23                                       |

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2016 年 6 月 23 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |
|-----------|--------------------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 237,148.96                                       |
| 银行间市场交易费用 | 3,275.00                                         |
| 合计        | 240,423.96                                       |

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2016 年 6 月 23 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |
|-------|--------------------------------------------------|
| 审计费用  | 90,000.00                                        |
| 信息披露费 | 180,000.00                                       |
| 其他    | 600.00                                           |
| 帐户维护费 | 6,000.00                                         |

|    |            |
|----|------------|
| 合计 | 276,600.00 |
|----|------------|

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

## 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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的重大日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

### 7.4.10 7.4.9.1 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    |
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司     | 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”） | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 新疆国际实业股份有限公司       | 基金管理人的股东        |
| 山东省国有资产投资控股有限公司    | 基金管理人的股东        |
| 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：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.11 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.11.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金于 2016 年 6 月 23 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间未有通过关联方交易单元进行的交易。

### 7.4.11.2 关联方报酬

#### 7.4.11.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期                                         |
|-----------------|--------------------------------------------|
|                 | 2016 年 6 月 23 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 5,488,494.92                               |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 465,627.31                                 |

注：1、基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

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。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划拨指令,基金托管人复核无误后于 2 个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

保本周期内,保证费由基金管理人从基金管理费收入中列支。到期操作期间及过渡期不计提管理费。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金,无上年度可比期间数据。

#### 7.4.11.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                                         |
|----------------|--------------------------------------------|
|                | 2016 年 6 月 23 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 914,749.16                                 |

1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划拨指令,基金托管人复核无误后于 2 个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

到期操作期间及过渡期不计提托管费。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金,无上年度可比期间数据。

#### 7.4.11.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**7.4.11.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.11.4.1 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末运用固有资金投资本基金。

**7.4.11.4.2 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本报告期末运用固有资金投资本基金。

**7.4.11.5 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 6 月 23 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |           |
|                | 期末余额                                       | 当期利息收入    |
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | 2,014,670.26                               | 64,673.61 |

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 6 月 23 日至 2016 年 12 月 31 日获得的利息收入为人民币 61,671.57 元，2016 年末结算备付金余额为人民币 14,577,649.98 元。

**7.4.11.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金于 2016 年 6 月 23 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间未在承销期内参与关联方承销证券。

**7.4.12 利润分配情况****7.4.12.1 利润分配情况——非货币市场基金**

本基金于 2016 年 6 月 23 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间未进行利润分配。

**7.4.13 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券****7.4.13.1 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 |
| 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 | -  |
| 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 | -  |

|  |  |   |   |  |  |  |  |  |  |  |
|--|--|---|---|--|--|--|--|--|--|--|
|  |  | 日 | 日 |  |  |  |  |  |  |  |
|--|--|---|---|--|--|--|--|--|--|--|

#### 7.4.13.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

基金本报告期末未持暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.13.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.13.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 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证券款余额。

##### 7.4.13.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 510,000,000.00 元，其中 360,000,000.00 元于 2017 年 1 月 3 日到期，100,000,000.00 元于 2017 年 1 月 5 日到期，50,000,000.00 元于 2016 年 1 月 12 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.14 金融工具风险及管理

##### 7.4.14.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理融入各业务层面，建立了三道防线：以各岗位目标责任制为基础，形成第一道防线；通过相关部门、相关岗位之间相互监督制衡，形成第二道防线；由监察稽核部门、督察长对各岗位、各部门、各机构、各项业务实施监督反馈，形成第三道防线。

##### 7.4.14.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发

行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 7.4.14.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|
| A-1    | -                       |
| A-1 以下 | -                       |
| 未评级    | 73,966,500.00           |
| 合计     | 73,966,500.00           |

注：1、未评级债券为政策性金融债。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.14.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|
| AAA    | 772,213,623.20          |
| AAA 以下 | 13,210,393.00           |
| 未评级    | 29,239,000.00           |
| 合计     | 814,663,016.20          |

注：1、未评级债券为政策性金融债。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.14.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易；因此，除在附注 7.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 7.4.14.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.14.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。生息负债为卖出回购金融资产款等。

##### 7.4.14.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本<br>期<br>末<br>201<br>6 年<br>12<br>月<br>31<br>日 | 1 个月以内        | 1-3 个月        | 3 个月-1 年       | 1-5 年          | 5 年以上         | 不计息           | 合计             |
|-------------------------------------------------|---------------|---------------|----------------|----------------|---------------|---------------|----------------|
| 资<br>产                                          |               |               |                |                |               |               |                |
| 银<br>行<br>存<br>款                                | 2,014,670.26  | 48,000,000.00 | 32,000,000.00  | -              | -             | -             | 82,014,670.26  |
| 结<br>算<br>备<br>付<br>金                           | 14,577,649.98 | -             | -              | -              | -             | -             | 14,577,649.98  |
| 存<br>出<br>保<br>证<br>金                           | 106,396.69    | -             | -              | -              | -             | -             | 106,396.69     |
| 交<br>易                                          |               | 29,025,000.00 | 485,748,500.00 | 361,785,123.20 | 12,070,893.00 | 32,636,739.37 | 921,266,255.57 |

|           |                |                |                |                |               |               |                  |
|-----------|----------------|----------------|----------------|----------------|---------------|---------------|------------------|
| 性金融资产     |                |                |                |                |               |               |                  |
| 买入返售金融资产  | 247,627,411.44 | 490,600,695.90 | -              | -              | -             | -             | 338,228,107.34   |
| 应收利息      | -              | -              | -              | -              | -             | 12,069,998.36 | 12,069,998.36    |
| 其他资产      | -              | -              | -              | -              | -             | -             | -                |
| 资产总计      | 264,326,128.37 | 167,625,695.90 | 517,748,500.00 | 361,785,123.20 | 12,070,893.00 | 44,706,737.73 | 1,368,263,078.20 |
| 负债        |                |                |                |                |               |               |                  |
| 卖出回购金融资产款 | 510,000,000.00 | -              | -              | -              | -             | -             | 510,000,000.00   |
| 应付证券清算款   | -              | -              | -              | -              | -             | 18,734.30     | 18,734.30        |
| 应付        | -              | -              | -              | -              | -             | 22,227.32     | 22,227.32        |

|         |                 |                |                |                |               |               |                |
|---------|-----------------|----------------|----------------|----------------|---------------|---------------|----------------|
| 赎回款     |                 |                |                |                |               |               |                |
| 应付管理人报酬 | -               | -              | -              | -              | -             | 875,849.51    | 875,849.51     |
| 应付托管费   | -               | -              | -              | -              | -             | 145,974.92    | 145,974.92     |
| 应付交易费用  | -               | -              | -              | -              | -             | 86,586.52     | 86,586.52      |
| 应付利息    | -               | -              | -              | -              | -             | 30,835.03     | 30,835.03      |
| 其他负债    | -               | -              | -              | -              | -             | 270,338.94    | 270,338.94     |
| 负债总计    | 510,000,000.00  | -              | -              | -              | -             | 1,450,546.54  | 511,450,546.54 |
| 利率敏感度缺口 | -245,673,871.63 | 167,625,695.90 | 517,748,500.00 | 361,785,123.20 | 12,070,893.00 | 43,256,191.19 | 856,812,531.66 |

注：1、上表统计了本基金资产和负债的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.14.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                                                                                                                      |                                                          |
|----|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------|
| 假设 | 1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；                                                                                      |                                                          |
|    | 2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；                                                                |                                                          |
|    | 3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；                                                                               |                                                          |
|    | 4. 银行存款、结算备付金和存出保证金以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；买入返售金融资产利息收益/卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响； |                                                          |
| 分析 | 相关风险变量的变动                                                                                                            | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元）<br>本期末（2016 年 12 月 31 日） |
|    | 1. 市场利率下降 25 个基点                                                                                                     | 7,345,335.80                                             |
|    | 2. 市场利率上升 25 个基点                                                                                                     | -7,256,748.03                                            |
|    |                                                                                                                      |                                                          |

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

#### 7.4.14.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.14.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 7.4.14.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金按照 CPPI 和 TIPP 策略对各类金融工具的投资比例进行动态调整。其中，股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于 40%；债券、银行存款等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 60%。每个交易日日终在除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。于 2016 年 12 月 31 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 |               |
|---------------|-------------------------|---------------|
|               | 公允价值                    | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 32,636,739.37           | 3.81          |
| 交易性金融资产—基金投资  | —                       | —             |
| 交易性金融资产—债券投资  | 888,629,516.20          | 103.71        |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | —                       | —             |
| 衍生金融资产—权证投资   | —                       | —             |
| 其他            | —                       | —             |
| 合计            | 921,266,255.57          | 107.52        |

#### 7.4.14.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

|    |                                                                                        |
|----|----------------------------------------------------------------------------------------|
| 假设 | 1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； |
|    | 2. 以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。                                                 |

| 分析 | 相关风险变量的变动      | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |
|----|----------------|---------------------------------|
|    |                | 本期末（2016 年 12 月 31 日）           |
|    | 沪深 300 指数上涨 1% | 231,555.29                      |
|    | 沪深 300 指数下跌 1% | -231,555.29                     |

#### 7.4.15 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、买入返售金融资产、卖出回购金融资产、应收款项及其他金融负债，因其剩余期限不长，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 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 44,615,719.33 元，属于第二层次的余额为人民币 876,654,536.24 元，无属于第三层次的余额。

#### 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。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承诺事项。

#### 7.4.14.3 其他事项

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              | 32,636,739.37  | 2.39          |
|    | 其中：股票             | 32,636,739.37  | 2.39          |
| 2  | 固定收益投资            | 888,629,516.20 | 64.95         |
|    | 其中：债券             | 888,629,516.20 | 64.95         |
|    | 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          | 338,228,107.34 | 24.72         |
|    | 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 | 96,592,320.24    | 7.06   |
| 7 | 其他各项资产       | 12,176,395.05    | 0.89   |
| 8 | 合计           | 1,368,263,078.20 | 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         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | 7,950,000.00  | 0.93         |
| C  | 制造业              | 14,635,147.14 | 1.71         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -            |
| E  | 建筑业              | 15,592.23     | 0.00         |
| F  | 批发和零售业           | -             | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -             | -            |
| J  | 金融业              | 10,036,000.00 | 1.17         |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -             | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -             | -            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -            |
| P  | 教育               | -             | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -             | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -             | -            |
| S  | 综合               | -             | -            |
|    | 合计               | 32,636,739.37 | 3.81         |

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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  | 600519 | 贵州茅台 | 25,000    | 8,353,750.00 | 0.97         |
| 2  | 601857 | 中国石油 | 1,000,000 | 7,950,000.00 | 0.93         |
| 3  | 601988 | 中国银行 | 2,000,000 | 6,880,000.00 | 0.80         |
| 4  | 600089 | 特变电工 | 450,000   | 4,108,500.00 | 0.48         |
| 5  | 601997 | 贵阳银行 | 200,000   | 3,156,000.00 | 0.37         |
| 6  | 600600 | 青岛啤酒 | 30,000    | 883,200.00   | 0.10         |
| 7  | 603660 | 苏州科达 | 26,007    | 837,945.54   | 0.10         |
| 8  | 603298 | 杭叉集团 | 3,641     | 88,403.48    | 0.01         |
| 9  | 603878 | 武进不锈 | 2,000     | 80,000.00    | 0.01         |
| 10 | 603218 | 日月股份 | 1,652     | 68,805.80    | 0.01         |
| 11 | 603877 | 太平鸟  | 3,180     | 67,734.00    | 0.01         |
| 12 | 603416 | 信捷电气 | 1,076     | 53,886.08    | 0.01         |
| 13 | 603886 | 元祖股份 | 2,242     | 39,683.40    | 0.00         |
| 14 | 603239 | 浙江仙通 | 924       | 29,059.80    | 0.00         |
| 15 | 603035 | 常熟汽饰 | 2,316     | 24,179.04    | 0.00         |
| 16 | 603929 | 亚翔集成 | 2,193     | 15,592.23    | 0.00         |

## 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末基金资产净值 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      | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 601857 | 中国石油 | 28,548,906.86 | 3.33           |
| 2  | 601988 | 中国银行 | 24,348,000.00 | 2.84           |
| 3  | 600519 | 贵州茅台 | 7,769,601.00  | 0.91           |
| 4  | 600089 | 特变电工 | 6,288,536.98  | 0.73           |
| 5  | 600030 | 中信证券 | 3,609,245.00  | 0.42           |
| 6  | 600837 | 海通证券 | 3,279,231.97  | 0.38           |
| 7  | 601997 | 贵阳银行 | 3,211,773.00  | 0.37           |
| 8  | 601186 | 中国铁建 | 3,114,145.00  | 0.36           |
| 9  | 601669 | 中国电建 | 2,652,400.00  | 0.31           |
| 10 | 002343 | 慈文传媒 | 2,093,225.00  | 0.24           |
| 11 | 000596 | 古井贡酒 | 1,401,798.00  | 0.16           |
| 12 | 300351 | 永贵电器 | 1,390,000.00  | 0.16           |
| 13 | 601229 | 上海银行 | 1,387,570.45  | 0.16           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 14 | 002643 | 万润股份 | 1,236,600.00 | 0.14 |
| 15 | 000728 | 国元证券 | 1,020,177.96 | 0.12 |
| 16 | 300244 | 迪安诊断 | 986,691.00   | 0.12 |
| 17 | 000928 | 中钢国际 | 924,000.00   | 0.11 |
| 18 | 600600 | 青岛啤酒 | 878,565.00   | 0.10 |
| 19 | 600909 | 华安证券 | 256,169.24   | 0.03 |
| 20 | 603858 | 步长制药 | 244,195.60   | 0.03 |

注：本项买入金额均按买入成交金额(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末基金资产净值 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      | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 601857 | 中国石油 | 21,657,822.64 | 2.53           |
| 2  | 601988 | 中国银行 | 17,101,000.00 | 2.00           |
| 3  | 601186 | 中国铁建 | 3,627,000.00  | 0.42           |
| 4  | 600030 | 中信证券 | 3,288,847.00  | 0.38           |
| 5  | 600837 | 海通证券 | 3,190,562.16  | 0.37           |
| 6  | 601669 | 中国电建 | 2,834,000.00  | 0.33           |
| 7  | 601229 | 上海银行 | 2,263,009.70  | 0.26           |
| 8  | 002343 | 慈文传媒 | 2,253,394.00  | 0.26           |
| 9  | 600089 | 特变电工 | 2,231,000.00  | 0.26           |
| 10 | 000596 | 古井贡酒 | 1,467,057.00  | 0.17           |
| 11 | 300351 | 永贵电器 | 1,340,324.00  | 0.16           |
| 12 | 000728 | 国元证券 | 1,237,398.01  | 0.14           |
| 13 | 002643 | 万润股份 | 1,162,629.00  | 0.14           |
| 14 | 300244 | 迪安诊断 | 1,081,520.00  | 0.13           |
| 15 | 000928 | 中钢国际 | 863,882.00    | 0.10           |
| 16 | 603858 | 步长制药 | 594,426.00    | 0.07           |
| 17 | 600909 | 华安证券 | 567,490.88    | 0.07           |
| 18 | 603556 | 海兴电力 | 405,657.40    | 0.05           |
| 19 | 603888 | 新华网  | 379,634.20    | 0.04           |
| 20 | 603160 | 汇顶科技 | 373,197.74    | 0.04           |

注：本项卖出金额均按卖出成交金额(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 | 96,086,707.60 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 70,461,011.98 |

注：本项买入金额均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。本项卖出金额均按卖出成交金额（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      | 44,941,500.00  | 5.25         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 29,239,000.00  | 3.41         |
|    | 其中：政策性金融债 | 29,239,000.00  | 3.41         |
| 4  | 企业债券      | 616,384,000    | 71.94        |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | 147,101,000.00 | 17.17        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 21,939,016.2   | 2.56         |
| 8  | 同业存单      | 29,025,000.00  | 3.39         |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 888,629,516.20 | 103.71       |

### 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  | 101654057 | 16 沪国际 MTN001 | 800,000 | 78,536,000.00 | 9.17         |
| 2  | 136519    | 16 陆嘴 01      | 800,000 | 78,520,000.00 | 9.16         |
| 3  | 136544    | 16 联通 03      | 800,000 | 78,480,000.00 | 9.16         |
| 4  | 136529    | 16 中车 G3      | 800,000 | 78,264,000.00 | 9.13         |
| 5  | 136533    | G16 能新 1      | 800,000 | 78,016,000.00 | 9.11         |

### 8.7 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。

**8.8 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投资。

**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股指期货交易情况说明**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.12 投资组合报告附注****8.12.1**

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

**8.12.2**

基金投资的前十名股票中, 不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位: 人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 106,396.69    |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 12,069,998.36 |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 12,176,395.05 |

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位: 人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值         | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1  | 110032 | 三一转债 | 9,604,188.00 | 1.12         |
| 2  | 127003 | 海印转债 | 2,269,200.00 | 0.26         |

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未有存在流动受限的情况。

## § 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 |
| 3,164        | 273,046.95    | 700,087,000.00 | 81.04%     | 163,833,543.39 | 18.96%     |

### 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 | 99.13     | 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（2016年6月23日）基金份额总额 | 878,580,628.34 |
| 本报告期期初基金份额总额              | -              |

|                                    |                |
|------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额              | 1,144,328.89   |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额            | 15,804,413.84  |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 863,920,543.39 |

## § 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：

总经理变更：2016 年 7 月 29 日，本公司发布公告，聘任经晓云为万家基金管理有限公司总经理，同时方一天不再兼任本公司总经理，继续担任本公司董事长。

基金经理变更：2016 年 7 月 16 日本公司发布公告，聘任苏谋东为本基金基金经理。与原基金经理唐俊杰、高翰昆共同管理本基金。

基金托管人：

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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

本基金自基金合同成立即 2016 年 6 月 23 日起聘请安永华明会计师事务所为本基金提供审计服务。 本基金 2016 年度需向安永华明会计师事务所支付审计费 90,000.00 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

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 |    |
| 东方证券 | 2      | 163,213,908.75 | 100.00%      | 152,000.62 | 100.00%    | -  |

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

2、基金专用交易席位的选择程序如下:

- (1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。
- (2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

3、基金专用交易席位的变更情况:

无。

### 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 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |

|      |                |         |                   | 的比例     |   |   |
|------|----------------|---------|-------------------|---------|---|---|
| 东方证券 | 112,674,510.40 | 100.00% | 16,231,800,000.00 | 100.00% | - | - |

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准万家颐和本混合型证券投资基金发行及募集的文件。
- 2、《万家颐和本混合型证券投资基金合同》。
- 3、《万家颐和本混合型证券投资基金托管协议》。
- 4、万家基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金净值、季度报告、更新招募说明书及其他临时公告。
- 6、万家颐和本混合型证券投资基金 2016 年年度报告原文。

### 12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人网站：[www.wjasset.com](http://www.wjasset.com)

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司  
2017 年 3 月 31 日