万家精选混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30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
报告送出日期:2015年10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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2015年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务数据未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家精选混合
场内简称	-
基金主代码	519185
交易代码	519185
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年5月18日
报告期末基金份额总额	64,531,098.86份
投资目标	本基金在坚持并不断深化价值投资理念的基础上,充分发挥专业研究优势,通过多层面研究精选出具备持续竞争优势的企业,并结合估值等因素,对投资组合进行积极有效的管理。在有效控制风险的前提下,谋求实现基金财产的长期稳健增值。
投资策略	本基金以“自下而上”精选证券的策略为主,并适度动态配置大类资产。通过定性与定量分析相结合的方法,精选出具备持续竞争优势且价值被低估的企业进行重点投资。
业绩比较基准	80%×沪深300指数收益率+20%×上证国债指数收益率。
风险收益特征	本基金是混合型基金,风险低于股票型基金,高于货币市场基金和债券型基金,属于中等风险、中等预期收益的证券投资基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-12,988,288.88
2.本期利润	-21,533,662.47
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3332
4.期末基金资产净值	98,338,561.36
5.期末基金份额净值	1.5239

注:1、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。

2、上表中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。

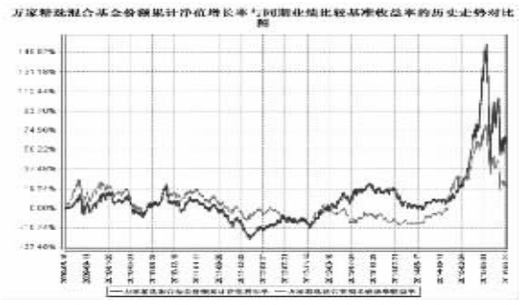
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-16.36%	3.97%	-22.79%	2.67%	6.43%	1.30%

注:业绩比较基准为80%×沪深300指数收益率+20%×上证国债指数收益率

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



注:本基金于2009年5月18日成立,根据基金合同规定,基金合同生效后六个月内为建仓期,建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求,报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
莫海波	本基金基金经理、万家行业优选混合型证券投资基金、万家行业优选混合型证券投资基金、万家品质生活股票型证券投资基金基金经理、投资研究部总监	2015年5月6日	-	5年	投资研究部总监,MBA,2010年进入财富证券责任有限公司,任分析师、投资经理助理;2011年进入中银国际证券有限责任公司基金,任分析师、环保行业研究员、策略分析师、投资经理。2015年3月加入本公司,现任投资研究部总监
章恒	本基金基金经理、万家行业优选混合型证券投资基金基金经理	2014年11月4日	-	7	基金经理,清华大学硕士。2007年5月进入东方基金任研究员,2009年9月进入天弘基金任研究员,2011年5月进入万家基金,历任研究员、基金经理助理等职务。

注:1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年三季度,上证指数在经历了连续的震荡探底之后,最终在3000点附近企稳;两融数据从最高点2.3万亿下跌至0.9万亿;而两市的每日成交量也由最高点1.8万亿,迅速萎缩至季末的0.5万亿附近。从这三个数据来观察,目前的市场环境几乎已经恢复到了年初的水平上。

报告期内,本基金一直在利用基金规模小的灵活优势,不断的在仓位上做着大比例的波段操作,但在8月中旬的大跌中没有及时撤退,使得7月8日以后积累的微薄收益尽归于零,总体看单季度下跌16%,略优于基准。

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1.5239元,本报告期份额净值增长率为-16.36%,同期业绩比较基准增长率为-22.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国庆节的时候,我感觉身边的房价又继续拉涨了一些,北京和上海的房价兴许很快将超过香港了,这真是应了那句老话“十年河东、十年河西”。

通过不断的降息降准,市场中流动着的货币越来越多;而与之相反的却是经济实体中能够盈利的项目越来越少,经济增长的模式已经到了不得不有所转变的时刻,近期恒隆主席陈启宗致股东的公开信、马云致投资者的公开信开始在坊间流传,一种对中国经济整体更深层次的担忧开始蔓延。这个时候,货币的安全开始成为了比增值更为重要的一件事情。

抛开中短期中国经济增长速度这个命题,单纯的看待经济转型的增长点,结合目前过剩的货币、股票市场参与者整体低杠杆低仓位的特征,我们认为还是存在局部泡沫的可能性的。同时,从更长的一个时间周期看,那些适应经济转型、甚至能够帮助经济转型的行业和企业,是有足够多的能力在这轮新的经济周期中成长为全球级别的巨头,那么我们从现在这个时候去投资他们大概率会获得丰厚的回报。再或者,换个角度看,降息降准后释放出来的货币,以及传统产业中流出来的货币,在不断的进入这些有成长性的行业时,很难让这些行业出现一个合理的甚至是便宜的购买价格。

简单地说,我们认为目前的股票市场中,至少是出现了一批可以买入并长期持有的股票,因此,即使市场未来不出现趋势性的牛市行情,而只是震荡或者慢牛,我们也希望能够通过自身在传媒、医药等领域的专注研究,挖掘出符合我们逻辑的个股,为基金业绩带来稳定回报。

最后,非常感谢这一年来伴随我们成长的投资者们,希望我们的努力可以不断获得您的信任。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	63,273,144.77	63.65
	其中:股票	63,273,144.77	63.65
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	35,991,285.18	36.20
7	其他资产	149,972.56	0.15
8	合计	99,414,402.51	100.00

注:其他资产包括存出保证金,应收利息及应收申购款。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	29,005,924.77	29.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,640,400.00	2.69
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	9,736,750.00	9.90
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,135,000.00	2.17
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	19,755,070.00	20.09
S	综合	-	-
	合计	63,273,144.77	64.34

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000513	丽珠集团	195,000	7,798,050.00	7.93
2	002174	游族网络	105,000	6,916,350.00	7.03
3	000530	大冷股份	399,901	5,406,661.52	5.50
4	600373	中文传媒	230,000	4,818,500.00	4.90
5	002071	长城影视	300,000	4,083,000.00	4.15
6	300026	红日药业	250,000	4,080,000.00	4.15
7	002104	恒宝股份	245,000	3,824,450.00	3.89
8	300463	迈克生物	45,000	3,660,750.00	3.72
9	002624	完美环球	160,000	3,160,000.00	3.21
10	300210	森远股份	220,000	3,146,000.00	3.20

5.4 报告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。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.6 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。

5.7 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 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

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同,本基金暂不可投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中,没有出现被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	109,753.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,776.49
5	应收申购款	32,442.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	149,972.56

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000513	丽珠集团	7,798,050.00	7.93	重大事项停牌
2	002174	游族网络	6,916,350.00	7.03	重大事项停牌
3	002624	完美环球	3,160,000.00	3.21	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	63,221,133.00
报告期期间基金总申购份额	31,118,806.40
减:报告期期间基金总赎回份额	29,808,840.54
报告期期间基金分拆变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	64,531,098.86

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申赎及买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

2015年7月31日,万家基金管理有限公司发布关于万家精选股票型证券投资基金变更基金名称及类别的公告,万家基金管理有限公司经与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,现将万家精选股票型证券投资基金更名为万家精选混合型证券投资基金,基金类别变更为混合型证券投资基金,法律文件中的相关条款亦做相应修订。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。

2、《万家精选混合型证券投资基金基金合同》。

3、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。

4、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、更新招募说明书及其他临时公告。

5、万家精选混合型证券投资基金2015年第三季度报告原文。

6、万家基金管理有限公司董事会决议。

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所,并登载于基金管理人网站:www.wjasset.com。

9.3 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
2015年10月26日

万家日日薪货币市场证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

基金管理人:万家基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家日日薪		
基金主代码	519511		
交易代码	519511		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013年1月15日		
报告期末基金份额总额	172,697,713.86份		
投资目标	本基金在力保本金安全性和基金资产流动性的基础上,追求超过业绩比较基准的稳定收益。		
投资策略	本基金主要为投资者提供短期现金管理工具,因此本基金最主要的投资策略是在保持安全性和流动性的前提下尽可能提升组合的收益。基金管理人根据对宏观经济走势、国家货币政策、资金供求、利率期限结构变动趋势等的研究与判断,预测货币市场利率水平,确定投资组合的平均剩余期限。本基金控制整个投资组合的平均剩余期限不得超过120天。		
业绩比较基准	银行活期存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。		
基金管理人	万家基金管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	万家日日薪A	万家日日薪B	万家日日薪R
下属分级基金的交易代码	519511	519512	519513
报告期末下属分级基金的份额总额	58,805,669.27份	113,892,044.59份	0.00份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)		
	万家日日薪A	万家日日薪B	万家日日薪R
1. 本期已实现收益	646,854.25	1,018,121.63	0.00
2.本期利润	646,854.25	1,018,121.63	0.00
3.期末基金资产净值	58,805,669.27	113,892,044.59	0.00

注: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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家日日薪A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8156%	0.0131%	0.0882%	0.0000%	0.7274%	0.0131%

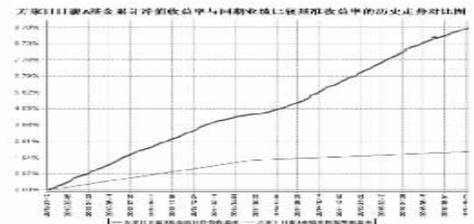
万家日日薪B

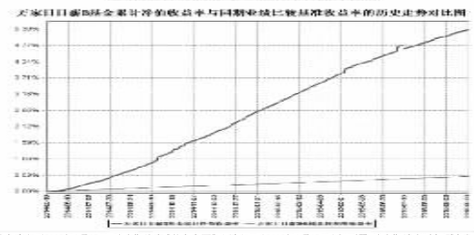
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8765%	0.0131%	0.0882%	0.0000%	0.7883%	0.0131%

万家日日薪R

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注:1、本基金成立于2013年1月15日,建仓期为本《基金合同》生效之日(2013年1月15日)起两周,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同要求,报告期末各项资产配置比例符合基金合同要求。

2、2014年5月16日,本基金转型为货币市场基金,转型后本基金设三类基金份额:A类基金份额、B类基金份额和R类基金份额,其中B类基金份额的指标计算自分类实施日(2014年5月16日)算起,R类基金份额为0,因此无收益数据。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
孙驰	本基金基金经理、万家货币市场基金、万家双利债券型证券投资基金、万家增强收益债券基金、万家强化收益定期开放债券基金、万家现金宝货币市场基金基金经理、固定收益部总监	2013年4月17日	-	8年	硕士学位,曾任中海信托股份有限公司投资经理。2010年4月加入万家基金管理有限公司,曾担任固定收益研究员、基金经理助理。
苏谋东	本基金基金经理、万家强化收益定期开放债券基金、万家添利债券型基金(LOF)基金经理、万家信用利债券基金基金经理、万家新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2013年8月8日	-	5年	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。

注:①任职日期以公告为准。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年三季度,宏观经济继续面临较大的下行压力,经济数据表现依然比较差,同时股市在经历了两轮快速下跌后面临震荡走势,人民币汇率市场在8月中旬汇改事件的带动下在经历了较大的波动后也逐渐走向震荡调整的态势,在这种环境下,宽松货币政策依然持续,债市面临着比较有利的发展环境,风险偏好的降低使得大量资金涌入债市推动了债券市场的上涨,“缺资产”成为市场的共识,这种局面使得债市“三季度魔咒”被打破,债券市场在供给压力不小的情况下依然实现了较大幅度的上涨,整体来看债券长短期品种均呈现出较好的表现,相对来讲长端的上涨趋势性更强,而短端在受到8月中旬汇改事件的影响收益有所回调后一定程度上受到本身绝对收益较低同时短端资金成本下不去等因素影响呈现震荡调整的走势。

报告期内,本基金继续以控制信用风险和流动性风险为前提,基于市场环境,一方面在整体宽松的资金局面下,继续在保证流动性的情况下,适度加长资金融出的期限并且提前市局季末前中长期资金的融出;另一方面利用短融收益的波动抓住短融配置的有利时机,同时捕捉短融的交易性机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期万家日日薪A基金净值收益率为0.8156%,同期业绩比较基准收益率为0.0882%;万家日日薪B基金净值收益率为0.8765%,同期业绩比较基准收益率为0.0882%;万家日日薪R类基金份额本报告期基金份额为0,因此无收益数据。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前宏观经济依然面临疲弱的走势,生产依然低迷,投资难见起色,经济下行压力依然比较大,而且这种情况短期内难以改善,接下来央行采取降准等货币政策给予支持的可能性比较大,货币宽松环境依然可以持续,股市或有反弹但对债市短期内尚不构成威胁,缺资产的现状还会继续,债市依然面临比较有利的发展环境,债券收益率进一步下行依然可以期待,接下来四季度在供给压力相比三季度减弱的情况下,债市上涨的趋势和确定性相比三季度可能会更明显。

基于此判断,本基金在2015年四季度在以流动性风险控制为前提的情况下,继续适度加强资金的融出期限;同时在以信用风险控制为前提的情况下,择机抓住有利时点进行短融的配置和波段操作。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	83,189,346.19	47.12
	其中:债券	83,189,346.19	47.12
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	55,780,803.67	31.60
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	35,662,686.83	20.20
4	其他资产	1,899,320.68	1.08
5	合计	176,532,157.37	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	2.28
	其中:买断式回购融资	0.00
序号	项目	金额 / 占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	3,399,874.90 / 1.97
	其中:买断式回购融资	- / -

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金合同约定:“本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的20%”,本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	102
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	112
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	56

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金合同约定:“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天”,本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告期末按组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	42.24	1.97
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	9.79	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	12.51	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	7.60	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	28.98	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		101.12	1.97

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	13,027,711.40	7.54
	其中:政策性金融债	13,027,711.40	7.54
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	70,161,634.79	40.63
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	83,189,346.19	48.17
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	041552001	15科达洁能CP001	100,000	10,121,885.86	5.86
2	041558053	15友阿CP001	100,000	10,032,459.98	5.81
3	150211	15国开11	100,000	10,029,040.64	5.81
4	041477001	14蓝色光标CP001	100,000	10,010,973.65	5.80
5	011599530	15云能投SCP005	100,000	9,997,232.54	5.79
6	041571006	15岚桥CP001	100,000	9,996,544.92	5.79
7	041576003	15新海连CP001	100,000	9,996,156.45	5.79
8	041466004	14海大CP001	50,000	5,006,515.29	2.90
9	041454067	14红狮CP001	50,000	4,999,866.10	2.90
10	150202	15国开02	30,000	2,998,670.76	1.74

5.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	4
报告期内偏离度的最高值	0.3288%
报告期内偏离度的最低值	0.0636%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1755%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

本基金估值采用摊余成本法计价,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提利息,并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销,每日计提损益。

本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.00元。

5.8.2

本报告期内本基金未发生持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 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情况,在报告编制日前一年内不存在受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,899,320.68
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,899,320.68

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	万家日日薪A	万家日日薪B	万家日日薪R
报告期期初基金份额总额	46,997,296.79	75,723,586.36	-
报告期期间基金总申购份额	161,668,840.72	140,608,051.65	-
减:报告期期间基金总赎回份额	149,860,468.24	102,439,593.42	-
报告期末基金份额总额	58,805,669.27	113,892,044.59	-

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利发放	2015年7月16日	20,565.17	20,565.17	0.00%
2	红利发放	2015年8月18日	13,515.86	13,515.86	0.00%
3	红利发放	2015年9月16日	11,801.29	11,801.29	0.00%
合计			45,882.32	45,882.32	

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。

2、《万家日日薪货币市场证券投资基金基金合同》。

3、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。

4、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、更新招募说明书及其他临时公告。

5、万家日日薪货币市场证券投资基金2015年第三季度报告原文。

6、万家基金管理有限公司董事会决议。

8.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所,并登载于基金管理人网站:www.wjasset.com。

8.3 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
2015年10月26日

万家强化收益定期开放债券型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

基金管理人:万家基金管理有限公司
基金托管人:华夏银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家强债
场内简称	万家强债
基金主代码	161911
交易代码	161911
基金运作方式	契约型开放式,本基金自基金合同生效后,每三年开放一次申购和赎回,申购和赎回的开放起始日为基金合同生效日的年度对日(如该日为非工作日,则顺延至下一工作日),每次开放时间最长不超过20个工作日,最短不少于5个工作日,在基金合同约定的开放期之外的日期不