万家180指数证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人:万家基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月22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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月21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10月1日起至2015年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家180指数
基金主代码	519180
交易代码	519180
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年3月17日
报告期末基金份额总额	2,214,963,014.47份
投资目标	本基金通过运用指数化投资方法,力求基金的股票组合收益率拟合上证180指数的增长率,伴随中国经济增长和资本市场的发展,实现利用指数化投资方法谋求基金资产长期增值的目标。
投资策略	本基金以跟踪目标指数为原则,实现与市场同步成长为基本理念,指数化投资是一种充分考虑投资者利益的投资方法,采取拟合目标指数收益率的投资策略,分散投资于目标指数所包含的股票中,力求股票组合的收益率拟合目标指数所代表的资本市场的平均收益率。
业绩比较基准	95%×上证180指数收益率+5%×银行同业存款利率
风险收益特征	本基金追踪上证180指数,是一种风险适中、长期资本收益稳健的投资产品,并具有长期稳定的投资风格。
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§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10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	2,412,109.72
2.本期利润	224,673,324.10
3.加权平均基金份额本期利润	0.0998
4.期末基金资产净值	1,886,844,800.52
5.期末基金份额净值	0.8519

注:1、上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(例如,开放式基金的申购、赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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。

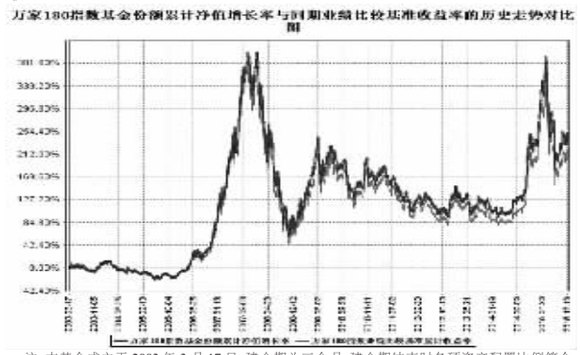
3.2 基金净值表现

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	13.07%	1.52%	13.05%	1.52%	0.02%	0.00%

注:基金业绩比较基准增长率=95%*上证180指数增长率+5%*银行同业存款利率

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:本基金成立于2003年3月17日,建仓期为三个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

3.3 其他指标

§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		
卞勇	本基金基金经理、万家上证50交易型开放式指数证券投资基金、万家中证红利指数型证券投资基金(LOF)、万家中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理、量化投资部总监	2015年8月18日	-	7	硕士研究生,2008年进入上海双隆投资管理有限公司,任金融工程师;2010年进入上海尚雅投资管理有限公司,从事高级量化分析师工作;2010年10月进入在国泰基金管理有限公司,历任产品开发、专户投资经理助理等职务;2014年4月进入广发证券担任投资经理职务;2014年11月进入中融基金管理有限公司担任产品开发部总监职务;2015年4月加入本公司,现任量化投资部总监。

注:1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 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 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年四季度股票市场经历8月大幅下跌和9月的筑底后出现了较为明显的回升,投资者的信心和风险偏好有较大的提高,整体来看前期跌幅较大的中小创标的上涨更为明显。四季度沪深300指数上涨16.49%、创业板指数上涨30.32%。

四季度本基金在前期稳健的思路下加大了进攻的力度,九月下旬和十月上旬大幅提升了基金的仓位,在四季度市场的大幅上涨中取得了相对较好的效果。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本基金份额净值为0.8519元,本报告期份额净值增长率为13.07%,业绩比较基准收益率13.05%。本基金本报告期跟踪误差为0.07%,与标的指数产生偏离的主要原因为基金申购赎回、成份股定期调整、日常运作费用等产生的差异。

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	1,787,078,143.03	94.50
	其中:股票	1,787,078,143.03	94.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	102,504,662.04	5.42
8	其他资产	1,498,413.70	0.08
9	合计	1,891,081,218.77	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	5,388,173.16	0.29
B	采矿业	72,706,682.25	3.85
C	制造业	422,787,218.27	22.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	80,889,052.66	4.29
E	建筑业	90,173,274.04	4.78
F	批发和零售业	35,449,744.58	1.88
G	交通运输、仓储和邮政业	69,725,044.38	3.70
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	69,410,346.02	3.68
J	金融业	816,782,025.44	43.29
K	房地产业	96,341,548.87	5.11
L	租赁和商务服务业	6,704,867.77	0.36
M	科学研究和技术服务业	6,416,877.06	0.34
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	6,764,387.68	0.36
S	综合	7,538,900.85	0.40
	合计	1,787,078,143.03	94.71

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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

5.3.1 报告期末指数投资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	601318	中国平安	2,886,174	103,902,264.00	5.51
2	600016	民生银行	7,988,325	77,007,453.00	4.08
3	600036	招商银行	3,916,325	70,454,686.75	3.73
4	600000	浦发银行	3,056,415	55,840,702.05	2.96
5	601398	工商银行	11,706,323	53,614,959.34	2.84
6	601166	兴业银行	3,110,497	53,096,183.79	2.81
7	600030	中信证券	2,138,646	41,382,800.10	2.19
8	601328	交通银行	5,339,684	34,387,564.96	1.82
9	600837	海通证券	2,141,515	33,878,767.30	1.80
10	601766	中国中车	2,441,669	31,375,446.65	1.66

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据基金合同,本基金暂不能投资于股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同,本基金暂不能投资于国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,398,887.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	21,572.67
5	应收申购款	77,954.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,498,413.70

5.11.4 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可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,281,338,419.93
报告期期间基金总申购份额	14,864,209.02
减:报告期期间基金总赎回份额	81,239,614.48
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	2,214,963,014.47

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,792,228.82
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,792,228.82
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.49

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内,基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准万家180指数证券投资基金发行及募集的文件

2、《万家180指数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180指数证券投资基金2015年第4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
2016年1月22日

万家行业优选混合型证券投资基金(LOF)

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人:万家基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月22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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月20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,投资者在做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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家行业优选混合型
基金主代码	161903
交易代码	161903
基金运作方式	契约型上市开放式基金(LOF)
基金合同生效日	2005年7月15日
报告期末基金份额总额	390,488,864.71份
投资目标	本基金主要投资景气行业或预期景气度向好的行业股票,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采取优选行业和精选个股相结合的主动投资管理方式,并适度动态配置大类资产。
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、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	交通银行股份有限公司

§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10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	37,334,225.42
2.本期利润	90,194,847.20
3.加权平均基金份额本期利润	0.2225
4.期末基金资产净值	390,327,606.20
5.期末基金份额净值	0.9996

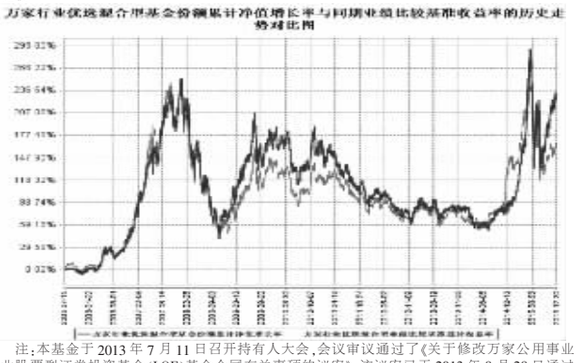
注:(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;(2)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 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	28.09%	1.70%	13.57%	1.34%	14.52%	0.36%

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2013年7月11日召开持有人大会,会议审议通过了《关于修改万家公用事业行业股票型证券投资基金(LOF)基金合同有关事项的议案》,该议案已于2013年8月28日通过并完成向中国证监会的备案。根据基金份额持有人大会决议,原"万家公用事业行业股票型证券投资基金(LOF)"更名为"万家行业优选股票型证券投资基金(LOF)"。更名后基金的建仓期为持有人大会决议生效日起6个月。建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合基金合同要求。

§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、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家品质生活股票型证券投资基金基金经理、万家新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、万家瑞兴灵活配置混合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	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、万家精选混合型证券投资基金基金经理	2015年2月12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》、《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 报告期内基金投资策略和运作分析

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年四季度股票市场经历8月大幅下跌和9月的筑底后出现了较为明显的回升,投资者的信心和风险偏好有较大的提高,整体来看前期跌幅较大的中小创标的上涨更为明显。四季度沪深300指数上涨16.49%、创业板指数上涨30.32%。

四季度本基金在前期稳健的思路下,加大了前期滞涨且估值合理的个股标的的配置力度,在四季度市场的大幅上涨中取得了相对较好的效果。

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0.9996元,本报告期份额净值增长率为28.09%,业绩比较基准收益率为13.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经历了四季度大幅上涨后,近期的获利盘和前期套牢盘使市场面临回调的压力,特别是估值较高的中小创标的,这些标的面临年报的业绩压力,加之这些标的减持压力,我们预计一季度会走出先抑后扬的走势,可重点关注因供给侧改革带来产能收缩大盘蓝筹的阶段性机会。重点关注人民币汇率贬值的不确定性和注册制的风险。我们会在2016年一季度前期保持相对谨慎的操作思路,等市场回调到一定阶段后再加大配置的力度。

本基金在坚持个股精选的同时,努力把握行业轮动的机会,从而实现为投资者带来较好收益的最终目标。

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	276,696,652.00	70.45
	其中:股票	276,696,652.00	70.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	115,376,638.07	29.38
8	其他资产	671,568.32	0.17
9	合计	392,744,858.39	100.00

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	110,403,378.90	28.28
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	16,075,000.00	4.12
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	37,868,056.77	9.70
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	20,185,688.58	5.17
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	12,396,076.00	3.18
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	79,768,451.75	20.44
S	综合	-	-
	合计	276,696,652.00	70.89

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	002174	游族网络	364,999	34,028,856.77	8.72
2	002624	完美环球	920,000	24,085,600.00	6.17
3	000513	丽珠集团	291,237	16,725,740.91	4.29
4	600647	同达创业	500,000	16,075,000.00	4.12
5	002572	索菲亚	340,000	14,654,000.00	3.75
6	000910	大亚科技	860,000	14,224,400.00	3.64
7	002159	三特索道	402,470	12,396,076.00	3.18
8	600138	中青旅	509,918	11,886,188.58	3.05
9	002071	长城影视	599,851	10,647,355.25	2.73
10	600373	中文传媒	445,000	10,453,050.00	2.68

5.4 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债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

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

本报告期末本基金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

本报告期末本基金未持有贵金属。

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

本报告期末本基金未持有权证。

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,本基金暂不可投资于国债期货。

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。

5.10.2

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

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	537,508.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	52,273.66
5	应收申购款	81,786.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	671,568.32

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金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	002174	游族网络	34,028,856.77	8.72	重大事项停牌
2	002624	完美环球	24,085,600.00	6.17	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	418,195,606.81
报告期期间基金总申购份额	18,676,692.92
减:报告期期间基金总赎回份额	46,383,435.02
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	390,488,864.71

§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购及买卖本基金的情况。

§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、《万家行业优选混合型证券投资基金(LOF)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及其他临时公告。

5、万家行业优选混合型证券投资基金(LOF)2015年第四季度报告原文。

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办公场所,并登载于基金管理人网站:http://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
2016年1月22日

万家和谐增长混合型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人:万家基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月22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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月20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,投资者在做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10月1日起至2015年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家和谐增长混合
基金主代码	519181
交易代码	519181
前端交易代码	519181
后端交易代码	519182
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月30日
报告期末基金份额总额	1,174,107,153.11份
投资目标	本基金通过有效配置股票、债券投资比例、平衡长期买入持有和事件驱动投资的优化选择策略,控制投资风险,谋取基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金最大特点是突出和谐增长,主要包含二层含义:一、资产配置的和谐,通过有效配置股票、债券资产比例,谋求基金资产在股票、债券投资中风险、收益的和谐平衡;二、长期买入持有和事件驱动投资的和谐,通过对不同行业、不同股票内在价值与市场价格的偏离程度和其市场价格向内在价值的回归速度的分析,谋求基金资产在不同行业和不同股票投资中长期投资和事件驱动投资的和谐平衡。
业绩比较基准	沪深300指数×65%+中证全债指数×30%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金是混合型基金,其预期收益及风险水平介于股票型基金与债券型基金之间,属于中等风险收益水平基金。
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

§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10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	156,215,886.20
2.本期利润	264,404,016.86
3.加权平均基金份额本期利润	0.2240
4.期末基金资产净值	1,190,682,464.22
5.期末基金份额净值	1.0141

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。

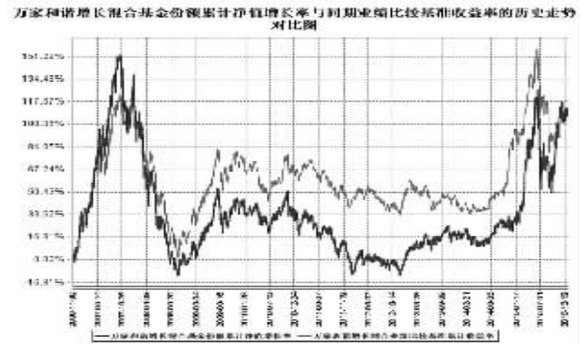
3.2 基金净值表现

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	27.75%	2.11%	11.56%	1.09%	16.19%	1.02%

注:业绩比较基准=沪深300指数×65%+中证全债指数×30%+同业存款利率×5%

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:本基金成立于2006年11月30日,建仓期为半年,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。

§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	投资研究部总监,本基金基金经理,万家精选股票型证券投资基金、万家品质生活股票型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家行业优选股票型证券投资基金和万家新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2015年5月6日	-	5	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。

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