万家强化收益定期开放债券型证券投资基金

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:华夏银行股份有限公司
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。

基金托管人华夏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12月31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办理基金份额的申购、赎回业务。
基金合同生效日	2013年5月7日
报告期末基金份额总额	250,635,902.00份
投资目标	在合理控制风险的基础上,追求基金资产的长期稳定增值,力争获得超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上,通过对利率变化趋势、债券收益率曲线移动方向、信用利差等影响债券价格的因素进行评估,采取积极的债券投资管理策略,并充分利用市场的非有效性,把握各类套利的机会。在信用风险可控的前提下,寻求组合流动性与收益的最佳配比,力求持续取得达到或超过业绩比较基准的债券组合投资收益。
业绩比较基准	三年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,主要投资品种为发行主体信用评级在A(含)至AA(含)之间的信用债券,其预期的风险收益水平高于开放式纯债基金。
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

§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	4,429,727.87
2.本期利润	3,349,842.15
3.加权平均基金份额本期利润	0.0134
4.期末基金资产净值	265,466,121.52
5.期末基金份额净值	1.0592

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 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	1.26%	0.04%	0.71%	0.00%	0.55%	0.04%

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:本基金合同生效日期为2013年5月7日,建仓期为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		
苏谋东	本基金基金经理、万家日日薪货币基金基金经理、万家添利债券型基金(LOF)基金经理、万家信用恒利债券基金基金经理	2013年5月29日	-	7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。
孙驰	本基金基金经理、万家货币基金基金经理、万家增强收益基金基金经理、万家日日薪货币基金基金经理、万家双利债券型证券投资基金基金经理、万家现金宝货币市场基金基金经理、固定收益部总监	2013年5月7日	2015年10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。

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 管理人对投资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。

本报告期内发生1次同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

1.宏观经济分析

四季度国内宏观经济继续走弱,但是初步显现出弱势企稳的态势。传统产业仍然面临较大的去产能压力,固定资产投资增速继续探底。一二线城市商品房销售数据靓丽,但是三四线城市尚且处于库存去化的过程中,房地产开发投资增速仍然处于下行过程中。过去支撑国内经济高速增长的传统引擎仍然动力不足。在供给侧改革的宏观调控框架下,国内经济中长期内仍然以去产能、调结构为主,宏观层面难以看到明显的数据反弹。在人民币汇率开启贬值之路后,国内货币政策终于可以更加聚焦国内的稳增长问题,资金面在四季度保持较为宽松的状态。

2.市场回顾

四季度债券收益率继续下行,但是结构分化较为明显:利率债和中高等级信用债收益率大幅下行,纷纷突破本轮低点,中高等级信用债的信用利差也进一步压缩到历史低位;而中低评级信用债则表现较为一般,整体信用利差甚至有所扩大。我们认为四季度债券行情的主导因素是避险情绪的集中释放和部分机构提前配置所致。四季度债券市场信用风险事件频发,避免"踩雷"是信用债投资的重中之重。

3.运行分析

四季度本基金继续保持较为均衡的配置。四季度国内信用风险事件频发,本基金高度重视经济下行周期下对于信用风险的控制,继续精挑细选质优秀的发行人以及其发行的债券,为投资人获取超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0592元,本报告期份额净值增长率为1.26%,业绩比较基准收益率为0.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

一季度宏观经济大概率延续四季度走势,继续弱势企稳。供给侧的改革框架下,货币政策将继续保持较为宽松的状态,有利于债市延续强势走势。但是,经济下行周期下淘汰过剩产能等政策将使得国内信用环境仍然不容乐观,信用风险事件仍将高发。相比较于中低评级信用债,我们更看好避险需求下利率债和高等级信用债的交易性机会。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	267,048,358.76	79.68
	其中:债券	267,048,358.76	79.68
	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	873,414.19	0.26
8	其他资产	67,210,899.38	20.06
9	合计	335,132,672.33	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	公允价值(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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	230,719,883.76	86.91
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	30,666,000.00	11.55
7	可转债	5,662,475.00	2.13
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	267,048,358.76	100.60

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112172	13晋邦债	257,400	26,208,468.00	9.87
2	112119	12恒邦债	250,209	25,756,514.46	9.70
3	122216	12铜昆债	250,180	25,398,273.60	9.57
4	112174	13广田01	245,780	25,030,235.20	9.43
5	112170	12豫耐01	233,049	23,551,931.94	8.87

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,本基金暂不可投资股指期货。

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,本基金暂不可投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的情况,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。

5.11.2

基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	11,648.41
2	应收证券清算款	60,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	7,199,250.97
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	67,210,899.38

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113008	电气转债	826,020.00	0.31
2	110031	航信转债	129,840.00	0.05

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	250,635,902.00
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-
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	250,635,902.00

§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	10,000,800.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,800.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	3.99

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申赎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、《万家强化收益定期开放债券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、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金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

万家精选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:中国建设银行股份有限公司
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。

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

§2 基金产品概况

基金简称	万家精选混合
基金主代码	519185
交易代码	519185
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	60,571,775.94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,风险高于货币市场基金和债券型基金,属于较高风险,较高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10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	13,106,458.18
2.本期利润	26,671,602.67
3.加权平均基金份额本期利润	0.4309
4.期末基金资产净值	118,014,019.37
5.期末基金份额净值	1.9483

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	27.85%	1.65%	13.57%	1.34%	14.28%	0.31%

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、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家行业优选混合型证券投资基金、万家品质生活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和万家新利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	本基金基金经理和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

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。

4.5 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1.9483元,本报告期份额净值增长率为27.85%,同期业绩比较基准增长率为13.57%。

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	80,987,256.58	67.92
	其中:股票	80,987,256.58	67.92
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	38,070,820.01	31.93
8	其他资产	174,813.95	0.15
9	合计	119,232,890.54	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	34,423,374.98	29.17
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	4,501,000.00	3.81
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	10,940,910.00	9.27
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,774,390.68	4.89
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,037,880.00	3.42
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	21,309,700.92	18.06
S	综合	-	-
	合计	80,987,256.58	68.63

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	105,000	9,789,150.00	8.29
2	002572	索菲亚	110,000	4,741,000.00	4.02
3	000513	丽珠集团	80,000	4,594,400.00	3.89
4	600647	同达创业	140,000	4,501,000.00	3.81
5	000910	大亚科技	260,100	4,302,054.00	3.65
6	002624	完美环球	160,000	4,188,800.00	3.55
7	002159	三特索道	131,100	4,037,880.00	3.42
8	300043	互动娱乐	200,000	3,438,000.00	2.91
9	600373	中文传媒	141,908	3,333,418.92	2.82
10	002071	长城影视	185,000	3,283,750.00	2.78

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	112,835.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,591.09
5	应收申购款	53,387.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	174,813.95

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	002174	游族网络	9,789,150.00	8.29	重大事项停牌
2	002624	完美环球	4,188,800.00	3.55	重大事项停牌
3	300043	互动娱乐	3,438,000.00	2.91	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	64,531,098.86
报告期期间基金总申购份额	4,628,537.30
减:报告期期间基金总赎回份额	8,587,860.22
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	60,571,775.94

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期未发生基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金的情况。

§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、万家精选股票型证券投资基金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

基金管理人的办公场所,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

万家日日薪货币市场证券投资基金

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:中国农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。

基金托管人中国农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	181,773,688.48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	57,137,757.26份	124,635,931.22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10月1日-2015年12月31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	514,476.84	785,713.04	0.00
2.本期利润	514,476.84	785,713.04	0.00
3.期末基金资产净值	57,137,757.26	124,635,931.22	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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

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

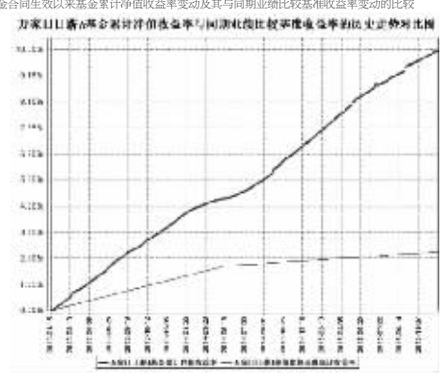
万家日日薪A

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	0.6988%	0.0087%	0.0882%	0.0000%	0.6106%	0.0087%

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	0.7597%	0.0087%	0.0882%	0.0000%	0.6715%	0.0087%

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		
苏谋东	本基金基金经理、万家强化收益定期开放债券基金、万家添利分级债券型证券投资基金、万家信用恒利债券基金基金。	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。
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	2015年10月17日	8年	硕士学位,