万家现金宝货币市场证券投资基金

2015 年度报告摘要

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:上海银行股份有限公司
送出日期:2016年3月25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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月24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。

本年度报告摘要自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

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2015年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	万家现金宝
基金主代码	000773
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月23日
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	上海银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	298,163,500.22份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在合理控制风险和保持资产流动性的前提下,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	本基金在投资组合的管理中,将通过市场利率预期策略、久期管理策略、类属资产配置策略、个券选择策略、同业存款投资策略、回购策略、套利策略和现金流管理策略构建投资组合,谋求在满足流动性要求、控制风险的前提下,实现基金收益的最大化。
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,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		万家基金管理有限公司	上海银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	叶忆红
	联系电话	021-38909626	021-68475888
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	yeyh@bankofshanghai.com
客户服务电话		95538转6、4008880800	95594
传真		021-38909627	021-68476936

2.4 信息披露方式

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

§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	2015年	2014年9月23日(基金合同生效日)-2014年12月31日
本期已实现收益	4,000,093.37	1,679,042.04
本期利润	4,000,093.37	1,679,042.04
本期净值收益率	2.5713%	0.9530%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末
期末基金资产净值	298,163,500.22	65,922,977.89
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

1、本基金收益分配按日结转份额。

2、本基金无持有人申购、赎回的交易费用。

3、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,由于货币市场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。

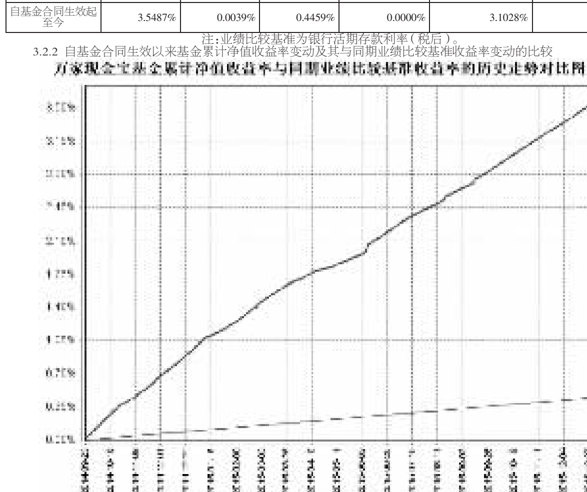
3.2 基金净值表现

3.2.1 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

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.6745%	0.0005%	0.0882%	0.0000%	0.5863%	0.0005%
过去六个月	1.2962%	0.0028%	0.1764%	0.0000%	1.1198%	0.0028%
过去一年	2.5713%	0.0040%	0.3500%	0.0000%	2.2213%	0.0040%
自基金合同生效起至今	3.5487%	0.0039%	0.4459%	0.0000%	3.1028%	0.0039%

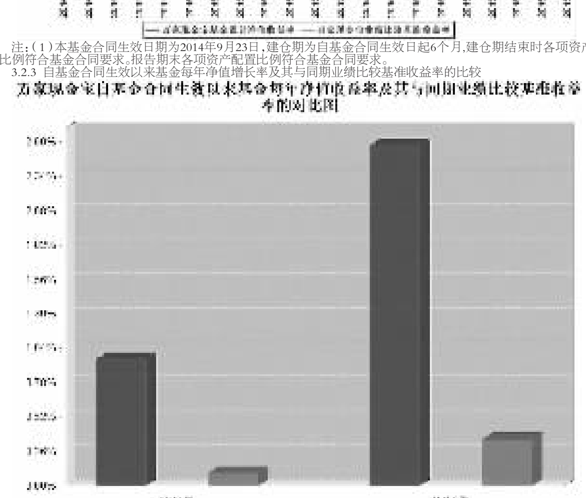
注:业绩比较基准为银行活期存款利率(税后)。

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)本基金合同生效日期为2014年9月23日,建仓期为自基金合同生效日起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。

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



注:本基金合同于2014年9月23日生效,合同生效当年按实际存续期计算,按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2015	4,000,093.37	-	-	4,000,093.37	
2014	1,679,042.04	-	-	1,679,042.04	
合计	5,679,135.41	-	-	5,679,135.41	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44号文批准设立。公司现股东为中泰证券有限公司、新疆国际实业股份有限公司和山东省国有资产投资控股有限公司,住所:中国(上海)自由贸易试验区浦电路360号8层(名义楼层9层);办公地址:中国(上海)自由贸易试验区浦电路360号8层(名义楼层9层),注册资本1亿元人民币。目前管理二十三只开放式基金,分别为万家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、万家瑞益灵活配置型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
高翰昆	本基金基金经理、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、万家双利债券型证券投资基金、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基金经理	2015年10月17日	-	7年	英国诺丁汉大学硕士。2009年7月加入万家基金管理有限公司,历任研究部助理、交易员、交易部总监助理、交易部副总监。
孙驰	本基金基金经理、万家货币市场基金基金经理、万家增强收益债券基金基金经理、万家日日薪货币市场基金基金经理、万家强化收益定期开放债券型基金基金经理、万家双利债券型证券投资基金基金经理、固定收益部总监	2014年5月24日	2015年10月17日	6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、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 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要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

2015年全年,各项宏观数据依然疲弱,ppi继续下跌cpi低位徘徊通缩压力逐步加大,央行全年不断降准降息实施宽松的货币政策。811汇改后,外汇市场出现明显波动并直接影响到国内的股票及债券市场,面对持续的资本流出压力及不稳定的金融市场,12月央行并没有再次降准降息,表明央行的宽松货币政策是比较审慎的。债券市场方面,全年动荡加剧,债券市场由于对基本面的担忧叠加宽松的货币政策,总体呈现一个较强的牛市格局,收益率曲线平坦化发展。短端债券收益率收到资金面宽松稳定的预期全年波动较小。

本基金考虑到资金淤积资本市场,未来经济下行压力依然较大,货币政策依然宽松流动性稳定的情况,较积极主动采取债券波段操作取得较好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值收益率为2.5713%,业绩比较基准收益率为0.3500%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望来年,决策层提出了供给侧改革的新思路,短期可能会造成全社会的阶段性阵痛。但考虑到基本面下行压力、通缩压力依然较大等因素,央行必然会在稳定汇率预期后继续维持或者实施宽松的货币政策,很可能会在反复中不断引导市场利率下行为经济保驾护航。资金可能会继续大量淤积在资本市场,全年资本市场可能会出现一个比价效应,资金在各类资产之间不断切换寻找相对估值便宜的资产。在资金切换的期间会有较多资金淤积货币市场,同时经济下行压力的持续发酵很可能会迫使央行打开回购利率的地板。

基于以上判断,本基金会采取更灵活的操作,加大对长券的配置力度,仓位控制上会更趋灵活,努力为持有人获得良好回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了估值委员会,定期评价现行估值政策和程序,在发生了影响估值政策和程序有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。估值委员会由督察长、基金运营部负责人、合规稽核部负责人、权益投资部负责人、固定收益部负责人等人员组成。估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关从业资格,精通各自领域的理论知识,熟悉政策法规,并具有丰富的实践经验。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不介入基金日常估值业务。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金每日计算分配收益,按日结转支付。本报告期内本基金应分配利润4,000,093.37元,本报告期内本基金已分配利润4,000,093.37元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内自1月13日至5月7日,连续60个工作日以上出现基金资产净值低于五千万元的情况;针对基金规模较低的情形,我公司主要领导高度重视,及时向中国证券监督管理委员会报告,并采取一系列措施,力争基金净值尽快回升并稳定在5000万以上:

1、公司已经启动万家现金宝中泰项目,万家现金宝作为中泰证券线上现金管理工具为中泰证券理财账户和保证金提供货币基金管理服务,同时为用户提供余额理财服务提升用户体验度。中泰会在线上线下同步项目进度,项目上线会大量整合理财账户资源。后期现金宝规模已显著提升。

2、万家现金宝基金对接众多互联网平台和第三方销售渠道,预计都会为基金规模和收益稳定带来支持。

本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情况。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、《万家现金宝货币市场证券投资基金基金合同》和《万家现金宝货币市场证券投资基金托管协议》的有关约定,诚实、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,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金实施利润分配的金额为4,000,093.37元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核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,认为复核内容真实、准确、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

本基金2015 年年度财务会计报告已经安永华明会计师事务所审计,注册会计师签字出具了安永华明(2016)审字第60778298_B19号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:万家现金宝货币市场证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	70,942,890.30	551,052.45
结算备付金		28,096.60	479,000.00
存出保证金		604.90	-
交易性金融资产	7.4.7.2	132,988,286.80	-
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		132,988,286.80	-
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	108,001,322.00	65,000,457.50
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	1,827,254.99	20,429.06
应收股利		-	-
应收申购款		1,665,075.58	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		315,453,531.17	66,050,939.01
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		17,019,791.49	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		56,030.98	12,526.36
应付托管费		10,376.08	2,319.67
应付销售服务费		41,504.45	9,278.79
应付交易费用	7.4.7.7	12,049.96	3,836.30
应交税费		-	-
应付利息		1,077.99	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	149,200.00	100,000.00
负债合计		17,290,030.95	127,961.12
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	298,163,500.22	65,922,977.89
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		298,163,500.22	65,922,977.89
负债和所有者权益总计		315,453,531.17	66,050,939.01

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.00元,基金份额总额298,163,500.22份。

7.2 利润表

会计主体:万家现金宝货币市场证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年9月23日(基金合同生效日)至2014年12月31日
一、收入		5,075,549.95	2,021,109.86
1.利息收入		4,968,551.68	1,999,671.69
其中:存款利息收入	7.4.7.11	1,124,503.51	1,861,273.20
债券利息收入		1,660,042.09	-11,112.96
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,184,006.08	149,511.45
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		106,998.27	21,438.17
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	106,998.27	21,438.17
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	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	-	-
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	-	-
减:二、费用		1,075,456.58	342,067.82
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	412,507.75	124,381.49
2.托管费	7.4.10.2.2	76,390.39	23,033.61
3.销售服务费	7.4.10.2.3	305,561.19	92,134.42
4.交易费用	7.4.7.19	-	-
5.利息支出		85,850.45	-
其中:卖出回购金融资产支出		85,850.45	-
6.其他费用	7.4.7.20	195,146.80	102,518.30
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		4,000,093.37	1,679,042.04
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		4,000,093.37	1,679,042.04

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:万家现金宝货币市场证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日 实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	65,922,977.89	-	65,922,977.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,000,093.37	4,000,093.37
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)	232,240,522.33	-	232,240,522.33
其中:1.基金申购款	601,479,719.17	-	601,479,719.17
2.基金赎回款	-369,239,196.84	-	-369,239,196.84
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)	-	-4,000,093.37	-4,000,093.37
五、期末所有者权益(基金净值)	298,163,500.22	-	298,163,500.22
项目	上年度可比期间 2014年9月23日(基金合同生效日)至2014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)	322,826,130.02	-	322,826,130.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,679,042.04	1,679,042.04
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)	-256,903,152.13	-	-256,903,152.13
其中:1.基金申购款	174,545,322.51	-	174,545,322.51
2.基金赎回款	-431,448,474.64	-	-431,448,474.64
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-1,679,042.04	-1,679,042.04
五、期末所有者权益(基金净值)	65,922,977.89	-	65,922,977.89

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:

方一天 方一天 陈广益

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

万家现金宝货币市场证券投资基金(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[2014]779号文《关于核准万家现金宝货币市场证券投资基金募集的批复》的批准,由万家基金管理有限公司作为基金管理人于2014年9月11日至2014年9月18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)验资并出具安永华明(2014)验字第60778298_B10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2014年9月23日生效。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)为人民币322,803,741.85元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币22,388.17元,以上实收基金(本息)合计为人民币322,826,130.02元,折合322,826,130.02份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为万家基金管理有限公司,基金托管人为上海银行股份有限公司。

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金,通知存款,短期融资券(包括超短期融资券),1年以内(含1年)的银行定期存款、大额存单,期限在1年以内(含1年)的债券回购,期限在1年以内(含1年)的中央银行票据,剩余期限在397天以内(含397天)的债券、资产支持证券、中期票据,以及中国证监会认可的其他具有良好流动性的金融工具。如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他金融工具,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金在合理控制风险和保持资产流动性的前提下,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。本基金业绩比较基准为银行活期存款利率(税后)。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称“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编报规则》第5号《货币市场基金信息披露特别规定》、《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2015年12月31日的财务状况以及2015年1月1日至2015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

本基金本财务报表编制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。

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

本基金的金融资产分类为交易类金融资产及贷款和应收款项,在初始确认时以公允价值计量。本基金对所持有的债券投资以摊余成本法进行后续计量。本会计期间内,本基金持有的债券投资的摊余成本接近其公允价值。

本基金的金融负债于初始确认时归类为其他金融负债,以公允价值计量,并以摊余成本进行后续计量。

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

(1) 债券投资

买入银行间同业市场交易的债券,于成交日确认为债券投资;

债券投资按实际支付的全部价款入账,其中所包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,作为应收利息单独核算,不构成债券投资成本,对于贴息债券,应作为债券投资成本;

卖出银行间同业市场交易的债券,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;

(2) 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;

(3) 资产支持证券投资

买入资产支持证券于成交日确认为资产支持证券投资;

卖出资产支持证券于成交日确认资产支持证券投资收益,卖出资产支持证券的成本按移动加权平均法结转。

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。

本基金估值采用摊余成本法,其相当于公允价值。估值对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内摊销,每日计提收益或损失。

本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值;

本基金金融工具的估值方法具体如下:

1) 银行存款

基金持有的银行存款以本金列示,按银行实际协议利率逐日计提利息;

2) 债券投资

基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本,每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入;

3) 回购协议

(1) 基金持有的回购协议(封闭式回购),以成本列示,按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息;

(2) 基金持有的买断式回购以协议成本列示,所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时,若双方都能履约,则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约,则继续持有现金资产;若融券业务到期无法履约,则继续持有债券资产,实际持有的相关资产按其性质进行估值;

4) 资产支持证券投资

(1) 在交易所交易的资产支持证券,以成本列示,按票面利率在实际持有期间内逐日计提利息;

(2) 在全国银行间债券市场交易的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值;

5) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值;

(2) 为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离,从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果,基金管理人于每一估值日,采用其他可参考公允价值指标,对基金持有的估值对象进行重新评估,即“影子定价”。当“影子定价”确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度的绝对值达到或超过0.25%时,基金管理人应根据风险控制的需要调整组合。其中,对于偏离度的绝对值达到或超过0.50%的情形,基金管理人应编制并披露临时报告;

(3) 如有新增事项,按国家最新规定估值。

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净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。每份基金份额面值为1.00元。由于申购、赎回引起的实收基金的变动分别于基金申购确认日、赎回确认日认列。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 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实际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帐面已确认的利息收入的差额确认利息收入损失,列入利息收入减项,存款利息收入以净额列示。另外,根据中国证监会基金部通知(2006)22号文《关于货币市场基金提前支取定期存款有关问题的通知》的规定,因提前支取导致的利息损失由基金管理公司承担;

(2) 债券利息收入按实际持有期内逐日计提。附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本,每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入;

(3) 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;

(4) 债券投资收益/(损失)于卖出债券成交日确认,并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账;

(5) 资产支持证券投资收益于卖出资产支持证券成交日确认,并按卖出资产支持证券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账;

(6) 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。

7.4.4.9 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0.27%的年费率逐日计提;

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率逐日计提;

(3) 基金销售服务费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率逐日计提;

(4) 卖出回购金融资产支出,按卖出回购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) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响每万份基金净收益小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

1、本基金的每份基金份额享有同等分配权;

2、本基金收益分配方式为红利再投资,免收再投资的费用;

3、“每日分配、按日支付”。本基金根据每日基金收益情况,以每万份基金已实现收益为基准,为投资人每日计算当日收益并分配,且每日进行支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后2位,小数点后第3位按去尾原则处理(因去尾形成的余额进行再次分配,直到分完为止);

4、本基金根据每日收益情况,将当日收益全部分配,若当日已实现收益大于零时,为投资人记正收益;若当日已实现收益小于零时,为投资人记负收益;若当日已实现收益等于零时,当日投资人不记收益;

5、本基金每日进行收益计算并分配时,收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式,投资人可通过赎回基金份额获得现金收益;若投资人在当日收益支付时,若当日已实现收益大于零,则增加基金份额持有人基金份额;若当日已实现收益等于零时,则保持基金份额持有人基金份额不变;基金管理人将采取必要措施尽量避免基金已实现收益小于零,若当日基金已实现收益小于零时,缩减投资人基金份额;

6、当日申购的基金份额自下一个工作日起,享有基金的收益分配权益;当日赎回的基金份额自下一个工作日起,不享有基金的收益分配权益;

7、在不违反法律法规、基金合同的约定以及对份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式,不需召开基金份额持有人大会;

8、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.11 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

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》的规定,自2015年3月23日起,交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

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[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入、储蓄存款利息收入,由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税;

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 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、基金的注册登记机构
上海银行股份有限公司(“上海银行”)	基金托管人、基金代销机构
中泰证券有限公司(“中泰证券”	
原“齐鲁证券有限公司”)	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(“万家共赢”)	基金管理人的子公司
上海承方股权投资管理有限公司	
(原“上海承方投资管理有限公司”)	基金管理人控制的公司
天津万家财富资产管理有限公司(“万家财富”)	基金管理人的子公司

注1:报告期内,天津万家财富资产管理有限公司于2015年9月11日由万家基金管理有限公司和自然人李修辞共同出资组建,为基金管理人的子公司。

注2:报告期内,深圳前海万家股权投资管理有限公司于2015年11月27日由天津万家财富资产管理有限公司全资设立,受基金管理人间接控制。

注3:报告期内,上海万家朴智投资管理有限公司于2015年11月20日由天津万家财富资产管理有限公司与上海灏济投资管理中心(有限合伙)共同出资组建,受基金管理人间接控制。

注4:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日 成交金额	占当期债券成交总额的比例	上年度可比期间 2014年9月23日(基金合同生效日)至2014年12月31日 成交金额	占当期债券成交总额的比例
中泰证券	8,015,170.00	100.00%	0.00	0.00%

注:本基金上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日 回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	上年度可比期间 2014年9月23日(基金合同生效日)至2014年12月31日 回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中泰证券	212,900,000.00	100.00%	189,200,000.00	100.00%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均未产生应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年9月23日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	412,507.75	124,381.49
其中:支付销售机构的客户维护费	2,989.43	38,573.42

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.27%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.27%÷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

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年9月23日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	76,390.39	23,033.61

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.05%÷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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

7.4.8.2.3 销售服务费

金额单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费
万家基金管理有限公司	300,161.92
上海银行股份有限公司	1,245.94
合计	301,407.86
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014年9月23日(基金合同生效日)至2014年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费
万家基金管理有限公司	22,195.87
上海银行股份有限公司	13,443.56
合计	35,639.43

注:本基金的年销售服务费率为0.20%,销售服务费计提的计算公式具体如下:

H=E×年销售服务费率÷当年天数

H为每日基金份额应计提的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构,由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延至最近可支付日支付。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期与上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日
基金合同生效日(2014年9月23日)持有的基金份额	-
期初持有的基金份额	-
期间申购/买入总份额	80,000,000.00
期间因拆分变动份额	465,497.91
减:期间赎回/卖出总份额	47,000,000.00
期末持有的基金份额	33,465,497.91
期末持有的基金份额占基金总份额比例	11.2200%

注:本基金的基金管理人上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2015年12月31日 持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
万家共赢	10,027,053.69	3.3600%
万家财富	15,037,380.36	5.0400%

注:本基金除基金管理人之外的其他关联方上年度末未投资本基金。

7.4.8.5 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 2015年1月1日至2015年12月31日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2014年9月23日(基金合同生效日)至2014年12月31日 期末余额	当期利息收入
上海银行	442,890.30	31,655.94	551,052.45	25,963.16

注:除上表列示的金额外,本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司,2015年度获得的利息收入为人民币1,780.85元(2014年度:人民币1,101.70元),2015年末结算备付金余额为人民币28,096.60元(2014年末:人民币479,000.00元)。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

7.4.9 利润分配情况

7.4.9.1 利润分配情况——货币市场基金

金额单位:人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
4,000,093.37	-	-	4,000,093.37	-

7.4.10 (2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末2015年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额人民币17,019,791.49元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
041573005	15丹东港CP001	2016年1月4日	99.97	80,000	7,997,262.08
011599245	15温公用SCP001	2016年1月4日	100.00	100,000	9,999,523.64
合计				180,000	17,996,785.72

7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.10.4 公允价值

7.4.10.4.1 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、应收利息、卖出回购金融资产款以及其他金融负债,其因剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

7.4.10.4.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.10.4.2.1 各层次金融工具公允价值

于2015年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第二层次的余额为人民币132,988,286.80元,无属于第一层次和第三层次的余额。(于2014年12月31日,第一层级的余额为人民币0.00元,属于第二层级的余额为人民币0.00元,属于第三层级余额为人民币0.00元)。

7.4.10.4.2.2 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。

根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》的规定,自2015年3月23日起,交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值,相关固定收益品种的公允价值所属层级从第一层级转入第二层级。

7.4.10.4.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金本期末未持有以公允价值计量的金融工具。

7.4.10.5 承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的重大承诺事项。

7.4.10.6 其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.10.7 财务报表的批准

本财务报表已于2016年3月20日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	132,988,286.80	42.16
	其中:债券	132,988,286.80	42.16
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	108,001,322.00	34.24
	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	70,970,986.90	22.50
4	其他各项资产	3,492,935.47	1.11
5	合计	315,453,531.17	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额		1.39
	其中:买断式回购融资		-
2	报告期末债券回购融资余额	17,019,791.49	5.71
	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:“本基金在全国银行间债券市场债券正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。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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????????	82
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	107
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	1

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限(天数)	原因	调整期

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都不得超过120天”。本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

8.3.2 期末投资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	46.44	5.71
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	11.74	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	12.74	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	21.97	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	11.74	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	104.63	5.71

8.4 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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	8,008,645.35	2.69
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,000,655.41	3.35
	其中:政策性金融债	10,000,655.41	3.35
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	114,978,986.04	38.56
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	132,988,286.80	44.60
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

8.5 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	011599759	15协鑫SCP004	200,000	19,999,617.01	6.71
2	011599651	15龙岩工贸SCP002	200,000	19,994,024.85	6.71
3	011518005	15铁物资SCP005	150,000	15,000,198.53	5.03
4	150416	15农发16	100,000	10,000,655.41	3.35
5	011599245	15温公用SCP001	100,000	9,999,523.64	3.35
6	011599258	15中材泥SCP001	100,000	9,998,843.72	3.35
7	011599723	15广汇汽车SCP003	100,000	9,998,390.44	3.35
8	011599653	15梅花SCP004	100,000	9,997,919.09	3.35
9	041573005	15丹东港CP001	100,000	9,996,577.60	3.35
10	041558117	15渤海租赁CP003	100,000	9,993,891.16	3.35

8.6 “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.1847%
报告期内偏离度的最低值	-0.0133%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0594%

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 投资组合报告附注

8.8.1

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。

8.8.2

本基金本报告期内未持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券。

序号	发生日期	该类浮动债占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期

8.8.3 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也不存在受到公开谴责、处罚的情形。

8.8.4 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	604.90
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,827,254.99
4	应收申购款	1,665,075.58
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	3,492,935.47

§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(户)	户均持有的基金份额	持有人结构 机构投资者 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
2,654	112,344.95	278,761,652.74	93.49%	19,401,847.48	6.51%

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	309.68	0.0001%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2014年9月23日)基金份额总额	322,866,848.76
本报告期期初基金份额总额	65,922,977.89
本报告期基金总申购份额	601,479,719.17
减:本报告期基金总赎回份额	369,239,196.84
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	298,163,500.22

注:总申购份额含红利再投、转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

§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:

董事长变更:2015年7月25日,本公司发布公告,聘任方一天为万家基金管理有限公司董事长,毕玉国先生工作原因不再担任本公司董事长职务。

总经理变更:2015年2月17日,本公司发布公告,聘任方一天为万家基金管理有限公司总经理。

督察长变更:2015年4月11日,本公司发布公告,聘任兰剑为万家基金管理有限公司督察长。

副总经理变更:2015年2月3日,本公司发布公告,聘任李修辞为万家基金管理有限公司副总经理。2015年3月11日,本公司发布公告,詹志令因个人原因离职,不再担任公司副总经理。2015年10月9日,本公司发布公告,李修辞因个人原因离职,不再担任公司副总经理。

基金经理变更:2015年10月17日本公司发布公告,聘任高翰昆为本基金基金经理,原基金经理孙驰因个人原因离职,不再担任本基金基金经理。

基金托管人:2015年9月,张梅女士不再担任上海银行股份有限公司资产托管部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2015年12月,王龚女士担任上海银行股份有限公司资产托管部副总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告

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2014年9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,本报告期末改聘会计师事务所。

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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
中泰证券	2	-	-	-	-	-

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,我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、个股分析的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:

本基金本报告期内成立,上述席位均为新增席位。

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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
中泰证券	-	-	-	-	-	-

万家基金管理有限公司
2016年3月25日