万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金

2015 年度报告摘要

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

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	万家瑞丰灵活配置	
基金主代码	001488	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年6月19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	2,507,423,076.22份	
下属分级基金的基金简称：	万家瑞丰A	万家瑞丰C
下属分级基金的交易代码：	001488	001489
报告期末下属分级基金的份额总额	1,000,902,720.47份	1,506,520,355.75份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	基金管理人在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上，采取积极主动的投资管理策略，通过定性与定量分析，对利率变化趋势、债券收益率曲线移动方向、信用利差等影响固定收益投资品价格的因素进行评估，对不同投资品种运用不同的投资策略，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收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*50%＋中证全债指数收益率*50%
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但低于股票型基金，属于中高风险、中高预期收益的证券投资基金。

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

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

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

§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6月19日(基金合同生效日)-2015年12月31日	
	万家瑞丰A	万家瑞丰C
本期已实现收益	4,134,575.76	4,698,342.08
本期利润	10,529,139.36	9,649,601.20
加权平均基金份额本期利润	0.0105	0.0231
本期基金份额净值增长率	1.05%	0.92%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0041	0.0028
期末基金资产净值	1,011,431,833.31	1,520,326,924.01
期末基金份额净值	1.0105	1.0092

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2015年6月19日，截至2015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

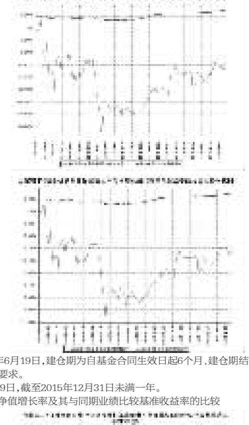
万家瑞丰A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	1.65%	0.06%	9.64%	0.83%	-7.99%	-0.77%
过去六个月	1.06%	0.08%	-5.16%	1.33%	6.22%	-1.25%
自基金合同生效起至今	1.05%	0.08%	-9.38%	1.42%	10.43%	-1.34%

万家瑞丰C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	1.57%	0.05%	9.64%	0.83%	-8.07%	-0.78%
过去六个月	0.93%	0.08%	-5.16%	1.33%	6.09%	-1.25%
自基金合同生效起至今	0.92%	0.08%	-9.38%	1.42%	10.30%	-1.34%

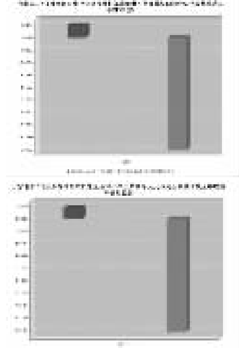
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：（1）本基金合同生效日期为2015年6月19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。

（2）本基金合同生效日为2015年6月19日，截至2015年12月31日未满一年。

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：1、本基金合同生效日为2015年6月19日，截至2015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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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、增强收益债券型证券投资基金和万家现金宝货币型证券投资基金基金经理。	2015年6月18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。

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

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。资本市场方面，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。权益市场在上半年杠杆牛资金牛改革牛预期下走出一波牛市，但年中叠加去杠杆及基本面背离等情况出现快速杀跌，全年波动巨大。

本基金在兼顾流动性的同时，根据大类资产配置灵活调整各类资产比例，抓住了纯债和权益的投资机会，并积极参与新股申购，获得了较好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，万家瑞丰A份额净值为1.0105 元，本报告期份额净值增长率为1.05%，业绩比较基准收益率-9.38%；万家瑞丰C份额净值为1.0092元，本报告期份额净值增长率为 0.92%，业绩比较基准收益率-9.38%。

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。加之外汇占款流出，基本面筑底，通缩压力加大等因素，央行必然会继续实施宽松的货币政策，很可能会继续降准降息为经济保驾护航，但这会是一个反复的过程。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较效应，资金在各类资产之间不断切换寻找相对估值便宜的资产。权益市场在快速下跌调整到位后可能会迎来一定的投资机会，债券市场由于较低的绝对收益率水平制约了收益率的进一步下行全年应该会表现的较为平稳。

基于以上判断，本基金会更灵活的操作在债券类资产和权益类资产间做切换，仓位控制会更趋灵活，并在新股政策不变的前提下积极参与打新，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

根据基金合同规定：“本基金收益每年最多分配12次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的50%；若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；”

结合法律法规及基金合同的规定，本基金2015年未进行利润分配。

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

本基金本报告期内未发生连续20个工作日基金资产净值低于5000万的情况。

§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，本托管人的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，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，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

本基金 2014 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（2015）审字第 60778298_B13 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：万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2015年12月31日
资 产：	
银行存款	633,243,388.26
结算备付金	282,767.39
存出保证金	93,905.36
交易性金融资产	1,086,167,528.97
其中：股票投资	32,869,197.67
基金投资	-
债券投资	1,053,298,331.30
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	799,912,629.87
应收证券清算款	2,613,613.31
应收利息	21,988,021.77
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	2,544,301,854.93
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日
负 债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	10,090,100.90
应付管理人报酬	1,333,270.09
应付托管费	333,317.52
应付销售服务费	409,839.03
应付交易费用	106,570.07
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	270,000.00
负债合计	12,543,097.61
所有者权益：	
实收基金	2,507,423,076.22
未分配利润	24,335,681.10
所有者权益合计	2,531,758,757.32
负债和所有者权益总计	2,544,301,854.93

注：1、报告截止日2015年12月31日，基金份额净1.0097元，基金份额总额2,507,423,076.22份，其中万家瑞丰A份额参考净值1.0105元，份额总额1,000,902,720.47份；万家瑞丰C份额参考净值1.0092元，份额总额1,506,520,355.75份。

2、本财务报表的实际编制期间为2015年6月19日（基金合同生效日）至2015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：万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金
本报告期：2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期 2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一、收入	27,971,417.52
1.利息收入	18,793,469.04
其中：存款利息收入	7,944,202.59
债券利息收入	7,262,051.48
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	3,587,214.97
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-2,171,900.39
其中：股票投资收益	-2,562,919.89
基金投资收益	-
债券投资收益	192,641.58
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	198,377.92
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	11,345,822.72
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	4,026.15
减：二、费用	7,792,676.96
1. 管理人报酬	4,491,432.15
2. 托管费	1,122,858.09
3. 销售服务费	642,923.43
4. 交易费用	224,176.84
5. 利息支出	1,003,680.83
其中：卖出回购金融资产支出	1,003,680.83
6. 其他费用	307,605.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	20,178,740.56
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	20,178,740.56

注：1、本财务报表的实际编制期间为2015年6月19日（基金合同生效日）至2015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：万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金
本报告期：2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月19日(基金合同生效日)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）	1,000,989,542.19	-	1,000,989,542.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	20,178,740.56	20,178,740.56
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）	1,506,433,534.03	4,156,940.54	1,510,590,474.57
其中：1.基金申购款	1,642,385,384.67	4,986,271.91	1,647,371,656.58
2.基金赎回款	-135,951,850.64	-829,331.37	-136,781,182.01
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）	2,507,423,076.22	24,335,681.10	2,531,758,757.32

注：1、本财务报表的实际编制期间为2015年6月19日（基金合同生效日）至2015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 - 至 - 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

万家瑞丰灵活配置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[2015]1138号文《关于核准万家瑞丰灵活配置混合型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2015年6月12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(2015)验字第60778298_B18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2015年6月19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1,000,944,500.96元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币45,041.23元，以上实收基金（本息）合计为人民币1,000,989,542.19元，折合1,000,989,542.19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，基金托管人为上海银行股份有限公司。

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（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债、证券公司短期公司债券）、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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（但须符合中国证监会相关规定）。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×50%＋中证全债指数收益率×50%。

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2015年12月31日的财务状况以及2015年度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2015年6月19日（基金合同生效日）至2015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0.60%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0.15%的年费率逐日计提；

(3)基金的A类基金份额不收取销售服务费；本基金的C类基金份额销售服务费按前一日基金资产净值的0.30%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。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

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，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的90%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

(2)?本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人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；若投资人不选择，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；同一投资人持有的基金份额只能选择一种分红方式，如投资人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人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[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[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
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
中泰证券股份有限公司（“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	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	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。

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中泰证券	157,224,319.80	100.00%

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。

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年6月19日(基金合同生效日)至2015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	46,372,901.63	100.00%

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。

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年6月19日(基金合同生效日)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
中泰证券	640,000,000.00	100.00%

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。

7.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中泰证券	136,449.99	100.00%	73,157.94	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

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。

7.4.8.2 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6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,491,432.15
其中：支付销售机构的客户维护费	1,384.14

注：1、基金管理费按前一日的基金资产净值的0.60%的年费率计提。计算方法如下：
H=E×0.60%/当年天数
H为每日应支付的基金管理费
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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，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基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,122,858.09

注：1、基金托管费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率计提。计算方法如下：
H=E×0.15%/当年天数
H为每日应支付的基金托管费
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。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，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基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

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。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家瑞丰A	万家瑞丰C	合计
万家基金管理有限公司	-	642,106.54	642,106.54
合计	-	-	-

注：1、销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及C类基金份额持有人服务等各项费用。本基金份额分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A 类不收取销售服务费，C 类销售服务费年费率为0.30%。C 类基金份额的销售服务费计算方法如下：
H=E×0.30%/当年天数
H为C类基金份额每日应计提的销售服务费
E为C类基金份额前一日的基金资产净值

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托管费划付指令，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基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

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。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期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

注：本基金的基金管理人本报告期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

注：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。

7.4.8.5 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6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
上海银行股份有限公司	6,243,388.26	894,496.88

注：1、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6,440.2元，2015年末结算备付金余额为人民币282,767.39元。

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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期未在承销期内直接购入关联方承销证券。

7.4.9 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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
002778	高科石化	2015年12月28日	2016年1月6日	新股流通受限	8.50	8.50	5,600	47,600.00	47,600.00	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
123001	蓝标转债	2015年12月23日	2016年1月8日	新债未上市	100.00	100.00	6,520	652,000.00	652,000.00	-

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002103	广博股份	2015年9月7日	重大事项停牌	31.13	2016年2月16日	19.27	200,000	4,405,623.10	6,226,000.00	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购。有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.9.4 公允价值

7.4.9.4.1 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。

7.4.9.4.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.9.4.2.1 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一层次的余额为人民币26,595,597.67元，属于第二层次的余额为人民币1,059,571,931.30元，无属于第三层次的余额。

7.4.9.4.2.2 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。

7.4.9.4.2.3 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。

7.4.9.5 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。

§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	32,869,197.67	1.29
	其中：股票	32,869,197.67	1.29
2	固定收益投资	1,053,298,331.30	41.40
	其中：债券	1,053,298,331.30	41.40
	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	2,613,613.31	31.44
	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	633,526,155.65	24.90
7	其他各项资产	24,695,540.44	0.97
8	合计	2,544,301,854.93	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
C	制造业	23,480,989.70	0.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	356,000.00	0.01
E	建筑业	764,359.95	0.03
F	批发和零售业	222,304.44	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	1,120,600.00	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,588,208.18	0.10
J	金融业	2,778,800.00	0.11
K	房地产业	575,211.00	0.02
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	982,724.40	0.04
S	综合	-	-
	合计	32,869,197.67	1.30

8.3 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金额

金额单位：人民币元

代码	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	002103	广博股份	200,000	6,226,000.00	0.25
2	000910	大亚科技	171,000	2,828,340.00	0.11
3	300032	金龙机电	51,800	1,574,720.00	0.06
4	002241	歌尔声学	40,000	1,384,000.00	0.05
5	600893	中航动力	30,000	1,350,900.00	0.05
6	600372	中航电子	50,000	1,231,500.00	0.05
7	600388	龙净环保	70,000	1,209,600.00	0.05
8	600172	黄河旋风	47,600	1,204,756.00	0.05
9	002179	中航光电	30,000	1,138,800.00	0.04
10	603508	思维列控	14,605	1,136,853.20	0.04

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	601288	农业银行	6,444,405.00	0.25
2	600016	民生银行	6,030,778.70	0.24
3	000728	国元证券	4,974,083.00	0.20
4	600270	外运发展	4,856,200.00	0.19
5	002241	歌尔声学	4,664,171.27	0.18
6	002103	广博股份	4,405,623.10	0.17
7	600089	特变电工	3,878,551.00	0.15
8	002142	宁波银行	3,689,264.59	0.15
9	000910	大亚科技	3,519,173.00	0.14
10	000001	平安银行	3,375,342.06	0.13
11	600372	中航电子	2,965,153.95	0.12
12	000598	兴蓉环境	2,867,422.33	0.11
13	601998	中信银行	2,717,519.60	0.11
14	002179	中航光电	2,605,994.00	0.10
15	601688	华泰证券	2,529,368.00	0.10
16	002170	芭田股份	2,226,268.00	0.09
17	300032	金龙机电	2,201,345.63	0.09
18	600388	龙净环保	1,877,681.70	0.07
19	000686	东北证券	1,705,220.75	0.07
20	601006	大秦铁路	1,611,900.00	0.06

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	600016	民生银行	6,810,801.00	0.27
2	600270	外运发展	5,843,277.36	0.23
3	601288	农业银行	5,707,000.00	0.23
4	600089	特变电工	3,305,014.00	0.13
5	002142	宁波银行	3,205,417.09	0.13
6	000001	平安银行	3,086,480.00	0.12
7	000728	国元证券	3,063,389.08	0.12
8	002241	歌尔声学	2,818,069.58	0.11
9	000598	兴蓉环境	2,173,985.85	0.09
10	000002	万 科A	1,877,900.00	0.07
11	601998	中信银行	1,872,956.00	0.07
12	002170	芭田股份	1,743,379.00	0.07
13	601688	华泰证券	1,697,846.29	0.07
14	600372	中航电子	1,455,391.00	0.06
15	002179	中航光电	1,433,265.51	0.06
16	000513	丽珠集团	1,331,246.00	0.05
17	603800	道森股份	1,110,167.00	0.04
18	000889	茂业通信	1,091,737.73	0.04
19	000686	东北证券	1,065,714.00	0.04
20	000783	长江证券	1,020,000.00	0.04

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	95,596,895.71
卖出股票收入（成交）总额	64,819,374.48

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	5,421,500.00	0.21
2	央行票据	-	-
3	金融债券	135,298,500.00	5.34
	其中：政策性金融债	135,298,500.00	5.34
4	企业债券	43,424,331.30	1.72
5	企业短期融资券	568,089,000.00	22.44
6	中期票据	300,413,000.00	11.87
7	可转债	652,000.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,053,298,331.30	41.60

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	101356006	13马城投MTN001	900,000	97,236,000.00	3.84
2	041553009	15横店CP001	900,000	91,008,000.00	3.59
3	1182047	11振华MTN1	800,000	81,112,000.00	3.20
4	011599723	15广汇汽车SCP003	800,000	80,192,000.00	3.17
5	041557004	15葛洲坝CP001	500,000	50,255,000.00	1.98

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

根据基金合同，本基金暂不投资于国债期货。

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	93,905.36
2	应收证券清算款	2,613,613.31
3	应收股利	-
4	应收利息	21,988,021.77
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,695,540.44

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	123001	蓝标转债	652,000.00	0.03

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002103	广博股份	6,226,000.00	0.25	重大事项停牌

§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

份额级别	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		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
万家瑞丰A	121	8,271,923.31	1,000,044,000.00	99.91%	858,720.47	0.09%
万家瑞丰C	136	11,077,355.56	1,505,929,427.10	99.96%	590,928.65	0.04%
合计	257	9,756,510.02	2,505,973,427.10	99.94%	1,449,649.12	0.06%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	万家瑞丰A	5,855.44	0.0006%
	万家瑞丰C	7,600.25	0.0005%
	合计	13,455.69	0.0005%

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	份额级别	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	万家瑞丰A	0
	万家瑞丰C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	万家瑞丰A	0
	万家瑞丰C	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家瑞丰A	万家瑞丰C
基金合同生效日（2015年6月19日）基金份额总额	1,000,538,100.90	451,441.29
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	1,310,977.49	1,641,074,407.18
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	946,357.92	135,005,492.72
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	1,000,902,720.47	1,506,520,355.75

§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，王蕤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

报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况未发生改变。

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	
中泰证券	2	157,224,319.80	100.00%	136,449.99	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，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：

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的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中泰证券	46,372,901.63	100.00%	640,000,000.00	100.00%	-	-

万家基金管理有限公司
2016年3月25日