万家行业优选混合型证券投资基金(LOF)

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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月23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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,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	万家行业优选混合型
基金主代码	161903
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2005年7月15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
报告期末基金份额总额	390,488,864.71份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2005-08-15

2.2 基金产品说明

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。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	汤嵩彦
	联系电话	021-38909626	95559
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		95538转6,4008880800	95559
传真		021-38909627	021-62701216

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

§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	2013年
本期已实现收益	162,018,579.02	-34,328,116.93	-24,681,476.39
本期利润	171,835,447.76	-32,875,128.59	-5,727,576.40
加权平均基金份额本期利润	0.3890	-0.0339	-0.0047
本期基金份额净值增长率	77.01%	2.69%	-1.06%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.1819	-0.2392	-0.2251
期末基金资产净值	390,327,606.20	296,260,134.75	867,066,142.63
期末基金份额净值	0.9996	0.5647	0.5499

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。

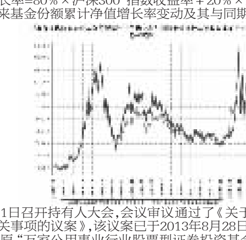
3.2 基金净值表现

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

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	28.09%	1.70%	13.57%	1.34%	14.52%	0.36%
过去六个月	9.13%	3.09%	-12.31%	2.14%	21.44%	0.95%
过去一年	77.01%	2.67%	6.98%	1.99%	70.03%	0.68%
过去三年	79.85%	1.79%	46.65%	1.40%	33.20%	0.39%
过去五年	24.75%	1.56%	18.04%	1.27%	6.71%	0.29%
自基金合同生效起至今	227.81%	1.66%	159.55%	1.51%	68.26%	0.15%

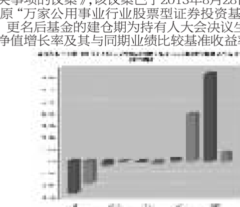
注:基金业绩比较基准增长率=80%×沪深300 指数收益率+20%×上证国债指数收益率

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: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。

3.2.3 过去五年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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过往三年无利润分配

§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、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金和万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金。

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		
朱颖	本基金基金经理、万家双引擎灵活配置基金基金经理	2011年11月11日	2015年2月12日	7年	硕士学位,2006年10月加入万家基金管理有限公司,曾担任行业分析师、基金经理助理。
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 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、投资建议和实施投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年国内市场可谓大起大落,跌宕起伏。年初在互联网+等各类新经济逻辑驱动下,社会资金不断涌入市场,短期内股指快速推高,牛市氛围在5-6月达到高潮。6月中,市场出现了拐点,8月,在人民币汇率贬值突袭下,市场再次出现深度下跌,上证和创业板指数也再次创出7个月的新低。随后四季度,市场逐步筑底回升,人民币汇率走稳和大幅下跌后风险的释放,市场出现一波急跌后的弱反弹。

从全年来看,我们的产品顺应时势,结合市场波动特点,从仓位和选股两个层面较为精准的把握了市场拐点:2015年1-5月,产品保持较高的仓位,并密切关注计算机、传媒、新能源汽车等转型概念。5-6月,我们及时洞察了中小创板块存在的估值泡沫,并对市场资金杠杆风险进行的全面的评估,因而我们提前将中小创持仓转移至低估值蓝筹股。在7月初国家队的第一次救市到8月的第二次大幅下跌之间,我们抓住反弹的机会继续减持中小创股票,至8月中下旬我们的仓位已较5月显著下降。市场两次下跌后我们认为市场风险偏好已急剧下降,资金离场的趋势非常明显。从经验和各种迹象推演,14-15年的大牛市终结后的市场不确定性将大幅提升。处于谨慎考虑,我们从9月开始既将产品仓位保持在较低水平,以最大限度的规避风险和保存牛市收益。

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0.9996元,本报告期份额净值增长率为77.01%,同期业绩比较基准增长率为6.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年国内股市开局表现不佳。但站在目前时点,我们认为不必过度恐慌,因为股市泡沫风险得到了充分的释放。同时我们长期看好的代表新经济转型的部分传媒、新能源等行业股票已经显示出了中长期的价值投资机会。从政策面上看,监管部门积极引导新资金入市,国内推出略宽松政策,这些都会市场起到了积极的作用。

除新经济产业外,在供给侧改革的强力推行下,很多传统行业的供给收缩出现了难得的历史机遇。我们预计随着这些行业的供给收缩,这些行业基本面改善将会超预期,一旦这些映射到资本市场,便可给这些行业带来边际上的利好。

今年市场宽幅震荡的特征非常明显,我们力图抓住市场宽幅震荡的机会,加大波段操作的力度,重点关注受益于供给侧改革和一带一路的大盘蓝筹行业,例如:地产、化工、建筑等行业。除此,我们还会对新能源和传媒行业进行自下而上的标的选择,对基本面较好、估值合理的标的进行长期配置。

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:"基金收益分配后基金份额净值不能低于基金面值;基金当期收益应先弥补前期亏损后,才可进行当期收益分配;在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益每年至少分配一次,最多6次,基金每次收益分配比例最低不低于已实现收益的60%"。

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 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

2015年度,基金托管人在万家行业优选股票型证券投资基金(LOF)的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2015年度,万家基金管理有限公司在万家行业优选股票型证券投资基金(LOF)投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配,符合基金合同的规定。

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

2015年度,由万家基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关万家行业优选股票型证券投资基金(LOF)的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§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_B04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:万家行业优选混合型证券投资基金(LOF)

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	上年度末 2014年12月31日
资 产:		
银行存款	3,129,738.54	5,226,723.58
结算备付金	112,246,899.53	42,244,227.24
存出保证金	537,508.25	315,256.30
交易性金融资产	276,696,652.00	242,167,319.21
其中:股票投资	276,696,652.00	242,167,319.21
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	-	-
应收证券清算款	-	23,628,786.06
应收利息	52,273.66	12,024.20
应收股利	-	-
应收申购款	81,786.41	134,197.52
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	392,744,858.39	313,728,534.11
负债和所有者权益	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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	13,987,146.42
应付赎回款	606,971.70	1,079,860.08
应付管理人报酬	428,153.20	331,756.01
应付托管费	65,869.74	51,039.43
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	651,602.15	1,354,276.93
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	664,655.40	664,320.49
负债合计	2,417,252.19	17,468,399.36
所有者权益:		
实收基金	220,115,500.66	295,734,396.38
未分配利润	170,212,105.54	525,738.37
所有者权益合计	390,327,606.20	296,260,134.75
负债和所有者权益总计	392,744,858.39	313,728,534.11

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值0.9996元,基金份额总额390,488,864.71份。

7.2 利润表

会计主体:万家行业优选混合型证券投资基金(LOF)

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	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	182,996,068.26	-19,088,867.00
1.利息收入	1,190,168.34	3,028,020.06
其中:存款利息收入	1,176,858.54	1,564,971.05
债券利息收入	-	1,418,970.20
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	13,309.80	44,078.81
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	171,603,649.98	-24,196,273.61
其中:股票投资收益	169,810,585.69	-28,980,179.91
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	2,405,780.00
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	1,793,064.29	2,378,126.30
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	9,816,868.74	1,452,988.34
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	385,381.20	626,398.21
减:二、费用	11,160,620.50	13,786,261.59
1. 管理人报酬	4,694,062.05	6,616,918.99
2. 托管费	722,163.38	1,017,987.58
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	5,278,388.07	5,696,318.92
5. 利息支出	-	4,418.97
其中:卖出回购金融资产支出	-	4,418.97
6. 其他费用	466,007.00	450,617.13
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	171,835,447.76	-32,875,128.59
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	171,835,447.76	-32,875,128.59

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:万家行业优选混合型证券投资基金(LOF)

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)	295,734,396.38	525,738.37	296,260,134.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	171,835,447.76	171,835,447.76
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)	-75,618,895.72	-2,149,080.59	-77,767,976.31
其中:1.基金申购款	263,130,277.06	180,904,057.76	444,034,334.82
2.基金赎回款	-338,749,172.78	-183,053,138.35	-521,802,311.13
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)	220,115,500.66	170,212,105.54	390,327,606.20
项目	上年度可比期间 2014年1月1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)	888,740,610.09	-21,674,467.46	867,066,142.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-32,875,128.59	-32,875,128.59
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)	-593,006,213.71	55,075,334.42	-537,930,879.29
其中:1.基金申购款	135,540,603.30	-7,539,265.46	128,001,337.84
2.基金赎回款	-728,546,817.01	62,614,599.88	-665,932,217.13
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)	295,734,396.38	525,738.37	296,260,134.75

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

万家行业优选混合型证券投资基金(LOF)(以下简称"本基金"),原天同公用事业行业股票型证券投资基金,系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字[2005]83号文《关于同意天同公用事业行业股票型证券投资基金募集的批复》的核准,由天同基金管理有限公司(系万家基金管理有限公司的前身)作为发起人向社会公开发行募集,基金合同于2005年7月15日正式生效,首次设立的募集规模为309,958,613.24份基金份额。经中国证监会证监基金字[2006]13号文《关于同意天同基金管理有限公司变更名称及修改公司章程的批复》的核准,天同基金管理有限公司于2006年2月更名为万家基金管理有限公司;另经基金管理人董事会审议通过,基金托管人同意,中国证监会基金部核准,本基金于2006年2月更名为万家公用事业行业股票型证券投资基金(LOF)。本基金为契约型上市开放式(LOF),存续期限不定。本基金经深圳证券交易所(以下简称"深交所")深证上[2005]66号文审核同意,于2005年8月15日在深交所挂牌交易。万家公用事业行业股票型证券投资基金(LOF)自2013年6月7日至2013年7月10日以通讯方式召开了基金份额持有人大会,大会讨论通过了关于修改基金名称及投资细节的议案。在基金管理人向中国证监会履行相应备案手续,并经中国证监会书面确认后,基金份额持有人大会决议生效。2013年8月28日,中国证监会基金部函[2013]753号文《关于万家公用事业行业股票型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会决议备案的回函》书面确认后,原《万家公用事业行业股票型证券投资基金 (LOF) 基金合同》 失效,《万家行业优选股票型证券投资基金(LOF)基金合同》生效,"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)",同时基金投资目标、投资范围等投资细节相应调整。根据中国证券监督管理委员会于2014年8月8日实行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及相关基金合同的有关规定,经与基金托管人协商一致,自2015年7月31日起将本基金变更为万家行业优选混合型证券投资基金,并相应修改本基金的《基金合同》。本基金的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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

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。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。本基金的业绩比较基准为:80%×沪深300 指数收益率+20%×上证国债指数收益率。

2008年3月3日(拆分日),本基金管理人万家基金管理有限公司对本基金进行了基金份额拆分。拆分前,本基金的基金份额净值为人民币1.7741元,根据基金份额拆分公式,计算精确到小数点后第9位(第9位以后舍去)为人民币1.774103626元。本基金管理人于拆分日,按照1:1.774103626的拆分比例对本基金进行拆分。拆分后,基金份额净值为人民币1.0000元,基金份额面值为人民币0.5637元。

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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 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

1 、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。

2 、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。

3、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
交通银行股份有限公司("交通银行")	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
山东省国有资产投资控股有限公司	基金管理人的股东
新疆国际实业股份有限公司	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。

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.7.1.1 股票交易

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		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中泰证券	279,514,066.33	8.12%	307,888,146.09	8.52%

注:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.7.1.2 债券交易

注: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债券交易。

7.4.7.1.3 债券回购交易

注: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债券回购交易。

7.4.7.1.4 权证交易

注: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。

7.4.7.1.5 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1月1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	259,530.27	8.29%	225,509.85	34.61%
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
中泰证券	280,300.38	8.51%	207,974.16	15.36%

注:上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 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1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,694,062.05	6,616,918.99
其中:支付销售机构的客户维护费	630,998.78	628,681.16

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.30%的年费率计提 。计算方法如下:

H=E×1.30%÷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

基金管理费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送管理费划付指令,基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支付,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

7.4.7.2.2 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1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	722,163.38	1,017,987.58

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.20%÷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

基金托管费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月前两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、休息日等,支付日期顺延。

7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本报告期及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。

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本基金基金管理人本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.7.4.2 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于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.7.5 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		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	3,129,738.54	146,913.49	5,226,723.58	198,603.65

注: 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1,018,791.88元 (2014年度:人民币1,357,196.24元),2015年末结算备付金余额为人民币112,246,899.53元(2014年末:人民币42,244,227.24元)。

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方所承销的证券。

7.4.8 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

7.4.8.2 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
002174	游族网络	2015年7月23日	重大事项停牌	93.23	2016年2月15日	80.58	364,999	32,170,792.80	34,028,856.77	-
002624	完美环球	2015年7月7日	重大事项停牌	26.18	2016年1月20日	23.13	920,000	22,887,357.24	24,085,600.00	-
300043	互动娱乐	2015年12月17日	重大事项停牌	17.19	-	-	549,955	9,265,611.41	9,453,726.45	-

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末,本基金无因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。

7.4.8.3.2 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。

1.1.1 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1公允价值

7.4.14.1.1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、存出保证金应收款项以及其他金融负债,其因剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1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资产中属于第一层次的余额为人民币209,128,468.78元,属于第二层次的余额为人民币67,568,183.22元,无属于第三层次的余额。(于2014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资产中属于第一层次的余额为人民币234,827,319.21元,属于第二层次的余额为人民币7,340,000.00元,无属于第三层次的余额。)

7.4.14.1.2.2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,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,确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.1.2.3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和上期末均不以第三层次公允价值计量。

7.4.14.2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。

7.4.14.3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。

7.4.14.4财务报表的批准

本财务报表已于2016年3月15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	权益投资	276,696,652.00	70.45
	其中:股票	276,696,652.00	70.45
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	115,376,638.07	29.38
7	其他各项资产	671,568.32	0.17
8	合计	392,744,858.39	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	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

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

金额单位:人民币元

序号	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	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

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本基金管理人网站的年度报告正文。

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初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例(%)
1	600373	中文传媒	71,711,716.08	24.21
2	000568	泸州老窖	66,057,322.16	22.30
3	300463	迈克生物	60,134,142.93	20.30
4	600138	中青旅	57,542,635.74	19.42
5	601098	中南传媒	55,788,686.37	18.83
6	300291	华录百纳	55,419,671.72	18.71
7	600315	上海家化	46,190,637.96	15.59
8	300210	森远股份	45,749,598.15	15.44
9	002653	海思科	45,157,655.28	15.24
10	601928	凤凰传媒	42,721,945.41	14.42
11	000513	丽珠集团	42,299,656.08	14.28
12	002174	游族网络	39,827,656.18	13.44
13	002327	富安娜	36,346,370.45	12.27
14	600597	光明乳业	35,746,579.11	12.07
15	000800	一汽轿车	33,157,744.54	11.19
16	600270	外运发展	31,043,284.70	10.48
17	002035	华帝股份	29,020,795.34	9.80
18	000002	万 科A	28,854,807.31	9.74
19	002555	顺荣三七	28,701,963.85	9.69
20	000078	海王生物	23,482,389.85	7.93
21	002104	恒宝股份	23,461,140.84	7.92
22	002675	东诚药业	23,299,635.64	7.86
23	002624	完美环球	22,887,357.24	7.73
24	002354	天神娱乐	22,151,067.55	7.48
25	300026	红日药业	21,589,055.77	7.29
26	600647	同达创业	21,335,581.16	7.20
27	601566	九牧王	21,081,768.38	7.12
28	000530	大冷股份	19,247,571.35	6.50
29	002071	长城影视	19,091,406.80	6.44
30	002159	三特索道	17,482,299.51	5.90
31	002143	印纪传媒	16,545,845.42	5.58
32	601398	工商银行	15,711,000.00	5.30
33	000793	华闻传媒	15,219,235.42	5.14
34	300303	聚飞光电	15,113,077.99	5.10
35	000718	苏宁环球	14,756,288.74	4.98
36	000910	大亚科技	14,410,752.12	4.86
37	300439	美康生物	14,069,543.20	4.75
38	600325	华发股份	13,756,000.00	4.64
39	300113	顺网科技	13,517,816.83	4.56
40	002572	索菲亚	13,460,546.00	4.54
41	600351	亚宝药业	12,795,265.00	4.32
42	600837	海通证券	12,221,839.00	4.13
43	002701	奥瑞金	11,912,717.68	4.02
44	601688	华泰证券	11,341,027.30	3.83
45	002400	省广股份	11,112,195.76	3.75
46	600715	*ST松辽	10,605,274.08	3.58
47	600496	精工钢构	10,019,115.35	3.38
48	600976	健民集团	9,946,061.50	3.36
49	600633	浙报传媒	9,834,050.96	3.32
50	600080	金花股份	9,423,837.81	3.18
51	600551	时代出版	9,405,167.20	3.17
52	300043	互动娱乐	9,265,611.41	3.13
53	600048	保利地产	9,252,947.93	3.12
54	600559	老白干酒	8,930,589.18	3.01
55	600637	东方明珠	8,833,291.37	2.98
56	600469	风神股份	8,659,248.77	2.92
57	300326	凯利泰	8,532,432.75	2.88
58	600298	安琪酵母	8,315,395.34	2.81
59	600887	伊利股份	8,220,776.43	2.77
60	000423	东阿阿胶	8,139,370.00	2.75
61	000858	五 粮 液	8,004,248.68	2.70
62	300039	上海凯宝	7,988,393.00	2.70
63	000024	招商地产	7,499,289.59	2.53
64	601988	中国银行	7,220,000.00	2.44
65	603898	好莱客	7,118,701.00	2.40
66	002666	德联集团	6,670,168.04	2.25
67	002557	洽洽食品	6,650,220.65	2.24
68	000596	古井贡酒	6,554,633.10	2.21
69	601166	兴业银行	6,499,865.00	2.19
70	000932	华菱钢铁	6,437,223.75	2.17
71	600016	民生银行	6,418,789.00	2.17
72	601668	中国建筑	6,349,724.00	2.14
73	000001	平安银行	6,262,351.52	2.11

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例(%)
1	300291	华录百纳	79,626,777.53	26.88
2	600373	中文传媒	67,682,407.28	22.85
3	000568	泸州老窖	65,891,904.05	22.24
4	300463	迈克生物	52,178,169.51	17.61
5	601928	凤凰传媒	48,740,974.15	16.45
6	601098	中南传媒	44,487,663.28	15.02
7	600138	中青旅	44,379,260.96	14.98
8	002653	海思科	43,948,868.18	14.83
9	300210	森远股份	43,825,466.39	14.79
10	002327	富安娜	42,371,375.34	14.30
11	002555	顺荣三七	41,844,841.58	14.12
12	600315	上海家化	38,076,271.51	12.85
13	000513	丽珠集团	37,079,167.32	12.52
14	600270	外运发展	34,793,289.06	11.74
15	000078	海王生物	29,565,754.85	9.98
16	000800	一汽轿车	28,974,776.22	9.78
17	601566	九牧王	28,135,314.07	9.50
18	000002	万 科A	28,036,820.69	9.46
19	000718	苏宁环球	27,710,525.57	9.35
20	002035	华帝股份	26,204,028.88	8.84
21	600597	光明乳业	24,569,882.80	8.29
22	002354	天神娱乐	22,161,320.80	7.48
23	300026	红日药业	21,725,433.39	7.33
24	002572	索菲亚	21,201,363.71	7.16
25	300303	聚飞光电	19,317,639.41	6.52
26	300113	顺网科技	18,340,445.79	6.19
27	600715	*ST松辽	18,060,909.28	6.10
28	000596	古井贡酒	17,816,678.55	6.01
29	002143	印纪传媒	17,758,620.29	5.99
30	002104	恒宝股份	17,724,140.18	5.98
31	600325	华发股份	17,080,373.27	5.77
32	300439	美康生物	16,907,762.70	5.71
33	002589	瑞康医药	16,801,672.44	5.67
34	601668	中国建筑	16,701,285.41	5.64
35	601398	工商银行	15,938,978.70	5.38
36	000530	大冷股份	15,622,916.71	5.27
37	002675	东诚药业	15,261,573.13	5.15
38	600647	同达创业	15,099,681.66	5.10
39	600521	华海药业	14,322,602.10	4.83
40	002071	长城影视	13,817,504.05	4.66
41	601299	中国北车	13,182,566.97	4.45
42	603128	华贸物流	12,792,537.00	4.32
43	600496	精工钢构	12,459,048.60	4.21
44	600351	亚宝药业	12,353,674.35	4.17
45	600837	海通证券	11,886,387.34	4.01
46	600551	时代出版	11,734,775.98	3.96
47	600559	老白干酒	11,711,616.99	3.95
48	002174	游族网络	11,241,562.90	3.79
49	601390	中国中铁	10,991,063.54	3.71
50	601688	华泰证券	10,621,805.31	3.59
51	603898	好莱客	10,226,445.00	3.45
52	600287	江苏舜天	10,117,587.08	3.42
53	600637	东方明珠	9,987,868.00	3.37
54	300326	凯利泰	9,712,744.90	3.28
55	002584	西陇科学	9,687,176.90	3.27
56	600048	保利地产	9,612,146.59	3.24
57	600990	四创电子	9,581,559.08	3.23
58	600855	航天长峰	9,407,379.63	3.18
59	601989	中国重工	9,319,661.34	3.15
60	002701	奥瑞金	9,294,981.00	3.14
61	600976	健民集团	9,212,315.00	3.11
62	002666	德联集团	9,193,241.80	3.10
63	600118	中国卫星	8,951,484.70	3.02
64	600469	风神股份	8,940,068.56	3.02
65	300039	上海凯宝	8,805,829.91	2.97
66	000826	启迪桑德	8,775,762.10	2.96
67	600486	扬农化工	8,637,466.07	2.92
68	002159	三特索道	8,564,769.10	2.89
69	002054	德美化工	8,501,957.20	2.87
70	002678	珠江钢琴	8,477,604.69	2.86
71	600887	伊利股份	8,292,604.00	2.80
72	600111	北方稀土	8,260,269.39	2.79
73	600259	广晟有色	8,256,370.15	2.79
74	000528	柳 工	8,192,871.58	2.77
75	000793	华闻传媒	7,674,255.61	2.59
76	000680	山推股份	7,560,004.00	2.55
77	000858	五 粮 液	7,539,124.00	2.54
78	000423	东阿阿胶	7,470,550.00	2.52
79	601988	中国银行	7,467,000.00	2.52
80	002690	美亚光电	7,312,913.16	2.47
81	002557	洽洽食品	7,276,933.74	2.46
82	300070	碧水源	7,132,097.72	2.41
83	000024	招商地产	7,019,281.80	2.37
84	600079	人福医药	6,877,096.10	2.32
85	600016	民生银行	6,418,271.51	2.17
86	000001	平安银行	6,309,228.53	2.13
87	601166	兴业银行	6,248,533.00	2.11

注:本项卖出金额均按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。1.1.1 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	1,648,576,738.98
卖出股票收入(成交)总额	1,793,674,860.62

注:本项买入金额均按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用

本项卖出金额均按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用

1.2 期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本报告期末本基金未持有债券。

1.3 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

注:本报告期末本基金未持有债券。

1.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注:本报告期末本基金未持有资产支持证券。

1.5 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

注:本报告期末本基金未持有权证。

1.6 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.6.1 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同,本基金暂不可投资于股指期货。

1.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1.7.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同,本基金暂不可投资于国债期货。

1.8 投资组合报告附注

1.8.1

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。

1.8.2

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。

1.8.3 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	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

1.8.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

1.8.5 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	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

§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		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
14,780	26,420.09	209,685,113.27	53.70%	180,803,751.44	46.30%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	王明瑞	1,504,299.00	10.69%
2	陈明杰	300,210.00	2.13%
3	张晓岩	235,778.00	1.68%
4	胡培安	200,000.00	1.42%
5	胡薇	177,410.00	1.26%
6	钱霞琴	168,495.00	1.20%
7	杨易	160,000.00	1.14%
8	戴华	157,600.00	1.12%
9	唐进宇	151,402.00	1.08%
10	许晓海	132,000.00	0.94%

9.3 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	17,904.11	0.00%

9.4 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(2005年7月15日)基金份额总额	309,958,613.24
本报告期期初基金份额总额	524,630,809.54
本报告期基金总申购份额	466,800,666.69
减:本报告期基金总赎回份额	600,942,611.52
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	390,488,864.71

§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2月12日本公司发布公告,聘任章恒为本基金基金经理。原基金经理朱颖因个人原因离职,不再担任本基金基金经理。2015年5月6日本公司发布公告,聘任莫海波为本基金基金经理,与原基金经理章恒共同管理本基金。

基金托管人:

本报告期内,交通银行股份有限公司(以下简称"本行")因工作需要,刘树军先生不再担任本行资产托管业务中心总裁,任命袁庆伟女士为本行资产托管业务中心总裁。

袁庆伟女士的基金行业高级管理人员任职资格已在中国证券投资基金业协会备案。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本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事项。

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

自2009年4月起,本基金聘请安永华明会计师事务所为本基金提供审计服务。

本基金2015年度需向安永华明会计师事务所支付审计费70,000.00元。

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	
银河证券	2	1,047,537,241.19	30.43%	925,710.88	29.57%	-
广发证券	1	824,486,155.90	23.95%	756,945.01	24.18%	-
海通证券	1	668,428,960.19	19.42%	621,906.67	19.87%	-
申银万国	1	622,285,175.99	18.08%	566,529.53	18.10%	-
中泰证券	1	279,514,066.33	8.12%	259,530.27	8.29%	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
江南证券	1	-	-	-	-	-

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

无。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

1.2015年3月31日,万家基金管理有限公司发布关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告,经与相关托管银行、会计事务所协商一致,自2015年3月30日起,本公司对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)的估值方法进行调整,采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。于2015年3月30日,相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过0.50%。

2.2015年7月31日,万家基金管理有限公司发布关于万家行业优选股票型证券投资基金(LOF)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,现将万家行业优选股票型证券投资基金(LOF)更名为万家行业优选混合型证券投资基金(LOF),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。

万家基金管理有限公司

2016年3月25日