万家日日薪货币市场证券投资基金

【2016】第四季度报告

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:2017年1月20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2017年1月18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2016年10月1日起至2016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	519611		
交易代码	519611		
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	1,013,213,542.81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	248,580,776.25份	764,632,766.56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(2016年10月1日 - 2016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	582,440.69	1,534,129.41	-
2. 本期利润	582,440.69	1,534,129.41	-
3. 期末基金资产净值	248,580,776.25	764,632,766.56	-

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

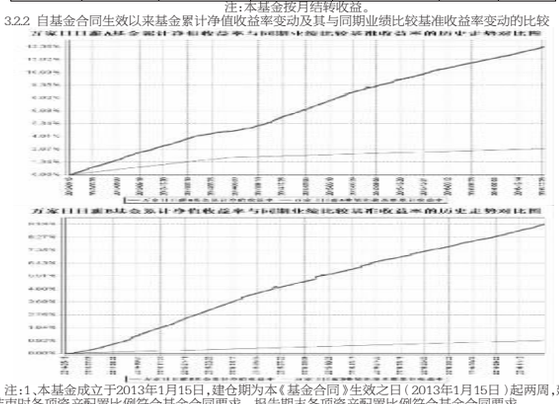
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7011%	0.0046%	0.0882%	0.0000%	0.6129%	0.0046%

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	0.7607%	0.0046%	0.0882%	0.0000%	0.6725%	0.0046%

注:本基金按月结转收益。

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、万家颐和保本混合型基金、万家恒瑞18个月定期开放债券型基金、万家年年恒祥定期开放债券型基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、万家鑫通纯债债券型证券投资基金、万家鑫稳纯债债券型证券投资基金、万家恒景18个月定期开放债券型证券投资基金和万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2013年8月8日	-	5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,现任固定收益部副总监。

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

四季度,经济基本面波澜不惊经济下行风险下降,ppi同比数据连续回升预示企业盈利环境得到改善。上海出台最严地产调控政策,显示地产防泡沫的决心较大。特朗普意外当选美国总统,美债收益率持续走强,人民币对美元汇率亦出现大幅贬值效本外流压力加大。在此背景下,股债两市都呈现出了冲高回落的走势。其中债券市场更是受到年末效应,央行收缩流动性,银行mpa考核压力,本身已处于高位以及市场爆发交易对于风险等多因素叠加在12月出现暴跌。而股市则在国庆长假后出现一轮上涨,PPP、一带一路、券商银行等大盘蓝筹股先后发力带领上证指数创出1月底以来的反弹新高,但到了12月受到流动性及汇率压力等多重因素制约下整体出现了回调,其中创业板整体表现更弱破位下跌。

本基金自三季度起就降低了债券持仓久期并主动去杠杆做好防御准备,本轮债市大调整中规避了大部分下跌。权益配置上控制仓位积极参与一带一路ppp等交易机会并战略性超配大金融,同时积极参与新股发行。整个四季度本基金在努力控制回撤的同时获取了较可观的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,万家日日薪A份额净值为0.7011%,本报告期份额净值增长率为0.7011%,业绩比较基准收益率0.0882%;万家日日薪B份额净值为0.7607%,本报告期份额净值增长率为0.7607%,业绩比较基准收益率为0.0882%;万家日日薪R类基金份额本报告期基金份额为0,因此无收益数据。

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	固定收益投资	139,935,526.54	10.44
	其中:债券	139,935,526.54	10.44
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	577,709,892.58	43.09
	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	193,646,773.60	14.82
4	其他资产	424,308,022.84	31.65
5	合计	1,340,600,215.56	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	2.66	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	30,399,754.40	3.00
	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:"本基金进入全国银行间同业市场进行债券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。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	56
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	101
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	56

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

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均不得超过120天",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告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	64.29	32.21
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	2.49	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	13.89	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	0.98	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	8.79	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		90.43	32.21

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

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均不得超过120天",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	11,627,887.33	1.15
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,998,318.91	0.99
	其中:政策性金融债	9,998,318.91	0.99
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	9,999,344.64	0.99
6	中期票据	-	-
7	同业存单	108,309,975.66	10.69
8	其他	-	-
9	合计	139,935,526.54	13.81
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111681045	16杭州银行CD192	200,000	19,325,867.37	1.91
2	011699725	16深圳特发SCP002	100,000	9,999,344.64	0.99
3	160211	16国开11	100,000	9,998,318.91	0.99
4	111697022	16郑州市市郊农联社CD009	100,000	9,947,173.84	0.98
5	111696997	16珠海农商行CD030	100,000	9,947,059.08	0.98
6	111697110	16辽阳银行CD042	100,000	9,946,649.69	0.98
7	111697209	16湖北银行CD050	100,000	9,946,385.25	0.98
8	111697189	16齐鲁银行CD031	100,000	9,946,022.87	0.98
9	111698906	16江苏紫金农村商业银行CD058	100,000	9,902,855.77	0.98
10	111693224	16郑州银行CD062	100,000	9,888,439.00	0.98

5.7 "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	0
报告期内偏离度的最高值	0.1197%
报告期内偏离度的最低值	-0.2207%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	-0.0381%

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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

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。

5.9.2

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不存在受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	648.36
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,073,151.02
4	应收申购款	423,234,223.46
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	424,308,022.84

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	万家日日薪A	万家日日薪B	万家日日薪R
报告期期初基金份额总额	42,955,403.00	188,514,607.39	-
报告期期间基金总申购份额	454,137,801.25	688,355,656.86	-
报告期期间基金总赎回份额	248,512,428.00	112,237,497.69	-
报告期期末基金份额总额	248,580,776.25	764,632,766.56	-

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	分红	2016年10月18日	23,018.73	23,018.73	0.00%
2	分红	2016年12月16日	21,950.12	21,950.12	0.00%
3	分红	2016年11月16日	23,627.11	23,627.11	0.00%
4	申购	2016年12月30日	14,000,000.00	14,000,000.00	0.00%
合计			-	-	

§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、《万家日日薪货币市场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及其他临时公告。

5、万家日日薪货币市场证券投资基金2016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
2017年1月20日

万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金

【2016】第四季度报告

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
报告送出日期:2017年1月20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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年01月18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2016年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家瑞丰灵活配置	
基金主代码	001488	
交易代码	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	
报告期末基金份额总额	507,017,105.82份	
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。	
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	
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	278,487,793.11份	228,529,312.71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(2016年10月1日 - 2016年12月31日)	
	万家瑞丰A	万家瑞丰C
1. 本期已实现收益	2,428,676.34	1,956,843.04
2. 本期利润	173,221.93	323,218.61
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0007	0.0014
4. 期末基金资产净值	300,239,697.90	240,021,155.04
5. 期末基金份额净值	1.0781	1.0503

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

万家瑞丰A

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	0.21%	0.10%	0.00%	0.39%	0.21%	-0.29%

万家瑞丰C

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	0.13%	0.10%	0.00%	0.39%	0.13%	-0.29%

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2015年6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		
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、万家现金宝货币型证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家颐达保本混合型证券投资基金、万家颐和保本混合型证券投资基金、万家瑞旭灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金和万家瑞隆灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2015年6月19日	-	7年	基金经理,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 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

四季度,经济基本面波澜不惊经济下行风险下降,ppi同比数据连续回升预示企业盈利环境得到改善。上海出台最严地产调控政策,显示地产防泡沫的决心较大。特朗普意外当选美国总统,美债收益率持续走强,人民币对美元汇率亦出现大幅贬值效本外流压力加大。在此背景下,股债两市都呈现出了冲高回落的走势。其中债券市场更是受到年末效应,央行收缩流动性,银行mpa考核压力,本身已处于高位以及市场爆发交易对于风险等多因素叠加在12月出现暴跌。而股市则在国庆长假后出现一轮上涨,PPP、一带一路、券商银行等大盘蓝筹股先后发力带领上证指数创出1月底以来的反弹新高,但到了12月受到流动性及汇率压力等多重因素制约下整体出现了回调,其中创业板整体表现更弱破位下跌。

本基金自三季度起就降低了债券持仓久期并主动去杠杆做好防御准备,本轮债市大调整中规避了大部分下跌。权益配置上控制仓位积极参与一带一路ppp等交易机会并战略性超配大金融,同时积极参与新股发行。整个四季度本基金在努力控制回撤的同时获取了较可观的收益。

4.5 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1.0781元,本报告期份额净值增长率为0.21%,业绩比较基准收益率0.00%;万家瑞丰C份额净值为1.0503元,本报告期份额净值增长率为0.13%,业绩比较基准收益率0.00%。

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	56,501,657.36	8.70
	其中:股票	56,501,657.36	8.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	526,475,771.80	81.09
	其中:债券	526,475,771.80	81.09
	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	59,400,209.10	9.15
	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	932,654.51	0.14
8	其他资产	5,962,120.69	0.92
9	合计	649,272,413.46	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	138,889.92	0.03
B	采矿业	4,912,101.16	0.91
C	制造业	24,636,441.11	4.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,370,942.00	0.44
E	建筑业	571,449.41	0.11
F	批发和零售业	394,283.98	0.07
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	2,760,294.95	0.51
J	金融业	20,030,844.61	3.71
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	79,716.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	218,619.35	0.04
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	388,074.87	0.07
S	综合	-	-
	合计	56,501,657.36	10.46

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票投资组合。

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	601318	中国平安	200,402	7,100,242.86	1.31
2	600036	招商银行	355,700	6,260,320.00	1.16
3	002155	湖南黄金	371,500	4,253,675.00	0.79
4	601727	上海电气	469,100	3,949,822.00	0.73
5	601766	中国中车	400,000	3,908,000.00	0.72
6	002103	广博股份	194,300	3,367,219.00	0.62
7	000166	申万宏源	513,600	3,210,000.00	0.59
8	000001	平安银行	294,100	2,676,310.00	0.50
9	000538	云南白药	32,500	2,474,875.00	0.46
10	600021	上海电力	195,300	2,370,942.00	0.44

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	5,262,500.00	0.97
2	央行票据	-	-
3	金融债券	54,990,000.00	10.18
	其中:政策性金融债	54,990,000.00	10.18
4	企业债券	8,343,766.80	1.54
5	企业短期融资券	328,852,000.00	60.87
6	中期票据	60,876,000.00	11.27
7	可转债(可交换债)	197,505.00	0.04
8	同业存单	67,954,000.00	12.58
9	其他	-	-
10	合计	526,475,771.80	97.45

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	011698058	16巨石SCP002	400,000	39,960,000.00	7.40
2	011698177	16桑德SCP005	400,000	39,940,000.00	7.39
3	011698175	16桂铁投SCP001	400,000	39,936,000.00	7.39
4	041658038	16津铁路CP001	400,000	39,836,000.00	7.37
5	041651032	16桂投资CP002	400,000	39,828,000.00	7.37

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,本基金暂不可投资于股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同,本基金暂不可投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据基金合同,本基金暂不可投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

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,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	46,714.42
2	应收证券清算款	199,733.34
3	应收股利	-
4	应收利息	5,712,778.89
5	应收申购款	2,894.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,962,120.69

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	601727	上海电气	3,949,822.00	0.73	重大事项停牌
2	000166	申万宏源	3,210,000.00	0.59	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	万家瑞丰A	万家瑞丰C
报告期期初基金份额总额	184,061,515.27	228,966,063.03
报告期期间基金总申购份额	96,150,458.49	589,214.17
减:报告期期间基金总赎回份额	1,724,180.65	1,025,964.49
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	278,487,793.11	228,529,312.71

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申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、《万家瑞丰灵活配置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、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金2016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。

7、《万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。

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
2017年1月20日

万家瑞和灵活配置混合型证券投资基金

【2016】第四季度报告

基金管理人:万家基金管理有限公司
基金托管人:宁波银行股份有限公司
报告送出日期:2017年1月20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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年1月18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2016年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家瑞和	
基金主代码	002664	
交易代码	002664	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年4月26日	