

# 万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告摘要

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 31 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2017 年 3 月 30 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 2016 年 1 月 26 日(基金合同生效日)起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                 |
|------------|-----------------|
| 基金简称       | 万家新兴蓝筹          |
| 基金主代码      | 519196          |
| 基金运作方式     | 契约型开放式          |
| 基金合同生效日    | 2016 年 1 月 26 日 |
| 基金管理人      | 万家基金管理有限公司      |
| 基金托管人      | 中国建设银行股份有限公司    |
| 报告期末基金份额总额 | 48,970,661.00 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期             |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                             |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金投资于中国经济中具有代表性和竞争力的蓝筹公司。在有效控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳定增值，力争使基金份额持有人分享中国经济持续成长的成果                                                                                                     |
| 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，采取积极主动地的投资管理策略，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 | 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%。                                                                                                                                               |
| 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           | 中国建设银行股份有限公司         |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 兰剑                   | 田青                   |
|         | 联系电话 | 021-38909626         | 010-67595096         |
|         | 电子邮箱 | lanj@wjasset.com     | tianqingl.zh@ccb.com |
| 客户服务电话  |      | 95538 转 6、4008880800 | 010-67595096         |
| 传真      |      | 021-38909627         | 010-66275853         |

## 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          | 上海市浦东新区浦电路 360 号陆家嘴投资大厦 9 楼<br>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 | 2016 年 1 月 26 日<br>(基金合同生效<br>日)-2016 年 12 月<br>31 日 | 2015 年  | 2014 年  |
|---------------|------------------------------------------------------|---------|---------|
| 本期已实现收益       | 17,129,327.80                                        | -       | -       |
| 本期利润          | 19,340,916.58                                        | -       | -       |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.2073                                               | -       | -       |
| 本期基金份额净值增长率   | 12.66%                                               | -       | -       |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016 年末                                              | 2015 年末 | 2014 年末 |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1266                                               | -       | -       |
| 期末基金资产净值      | 55,172,388.19                                        | -       | -       |
| 期末基金份额净值      | 1.1266                                               | -       | -       |

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。

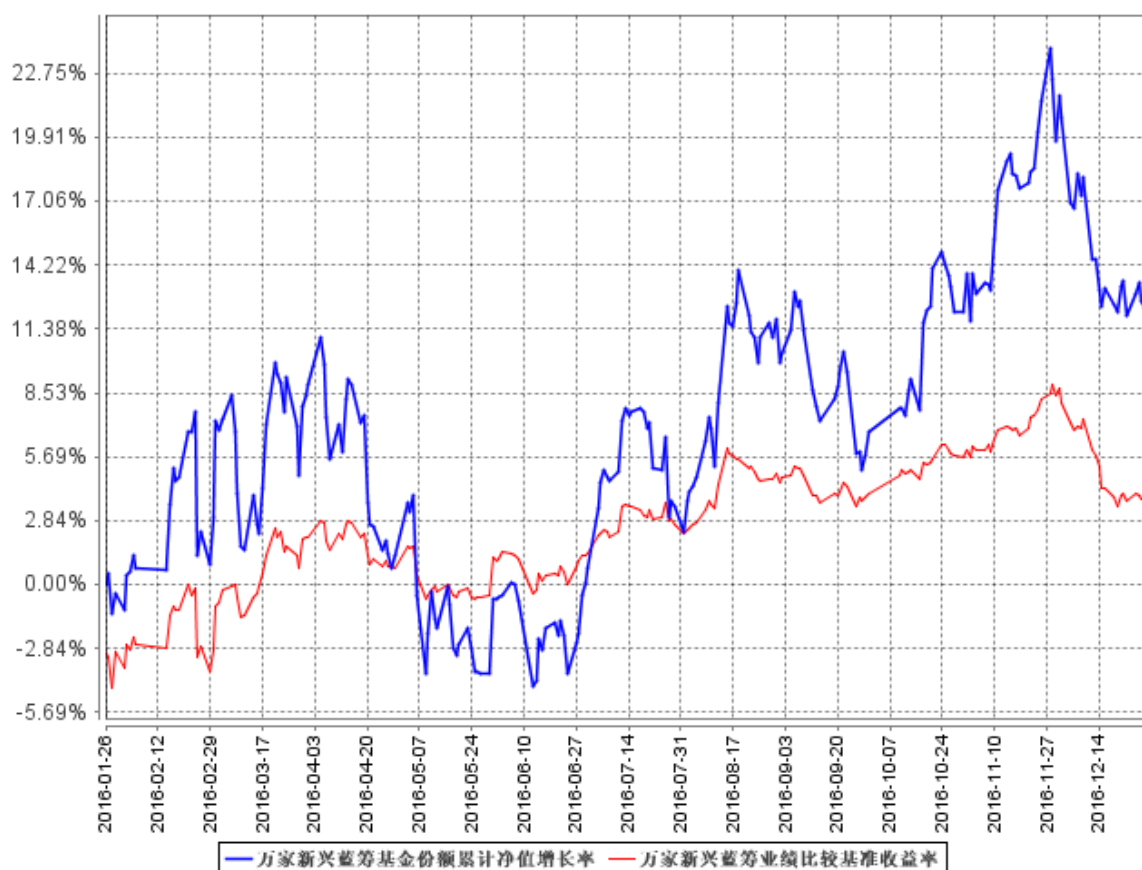
### 3.2 基金净值表现

#### 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<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③   | ②—④   |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|-------|-------|
| 过去三个月          | 5.48%        | 1.21%               | 0.00%              | 0.39%                 | 5.48% | 0.82% |
| 过去六个月          | 12.55%       | 1.24%               | 2.72%              | 0.40%                 | 9.83% | 0.84% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 12.66%       | 1.44%               | 4.08%              | 0.59%                 | 8.58% | 0.85% |

### 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

万家新兴蓝筹基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

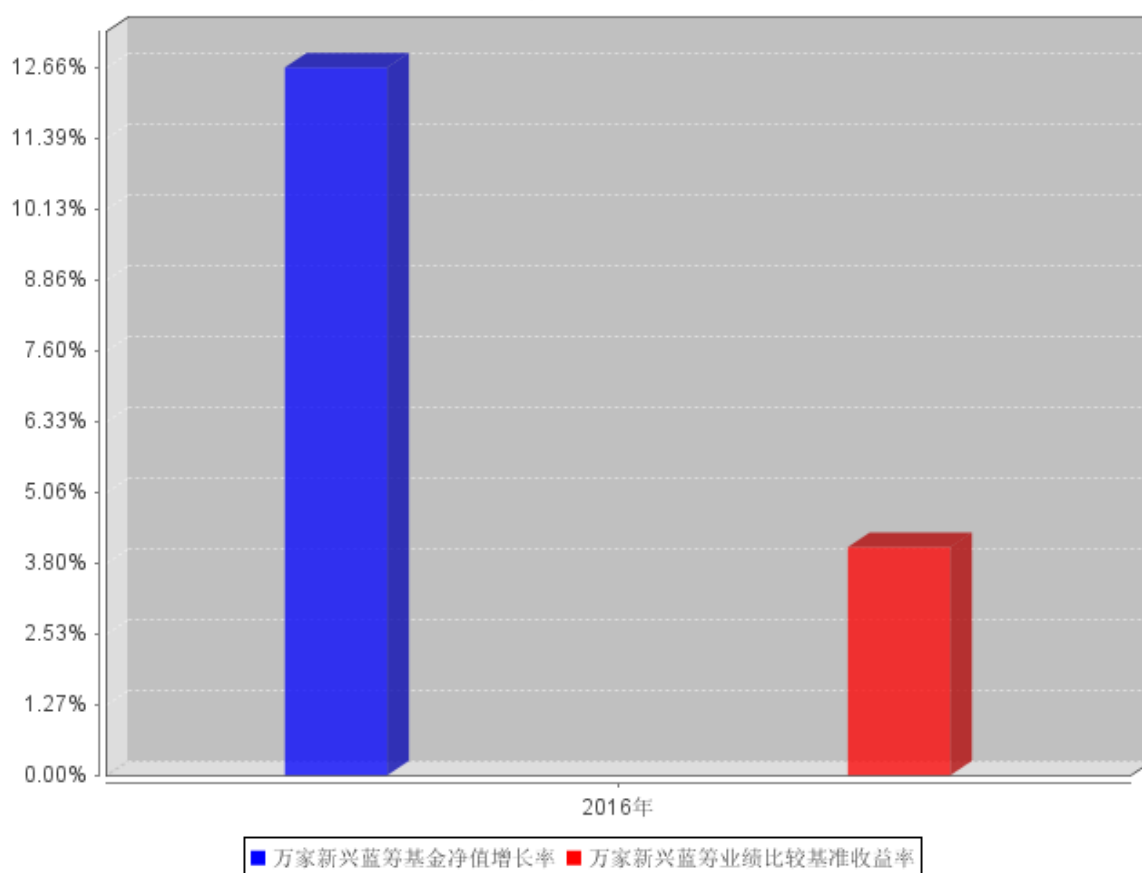


注：1、本基金合同生效日为 2016 年 1 月 26 日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年；

2、本基金于 2016 年 1 月 26 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。截至报告期末，本基金尚处于建仓期。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。

### 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

万家新兴蓝筹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对比图



注：本基金合同于 2016 年 1 月 26 日生效，截至 2016 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

本基金过去三年无利润分配情况。

## § 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，住所地及办公地点均为中国（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。

目前管理四十只开放式基金，分别万家 180 指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资

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、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金、万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞和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、万家恒瑞 18 个月定期开放债券型证券投资基金、万家年年恒祥定期开放债券型证券投资基金、万家鑫安纯债债券型证券投资基金、万家鑫璟纯债债券型证券投资基金、万家瑞旭灵活配置混合型证券投资基金、万家家享纯债债券型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金、万家年年恒荣定期开放债券型证券投资基金、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、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞隆灵活配置混合型证券投资基金、万家恒景 18 个月定期开放债券型证券投资基金。

#### 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期限     |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                   |
|-----|----------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|------|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                                                                                                    | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                                                                                      |
| 莫海波 | 本基金基金经理、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家精选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、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金和万家新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 | 2016 年 1 月 26 日 | —    | 5 年    | 投资研究部总监，MBA，2010 年进入财富证券责任有限公司，任分析师、投资经理助理；2011 年进入中银国际证券有限责任公司基金，任分析师、环保行业研究员、策略分析师、投资经理。2015 年 3 月加入本公司，现任投资研究部总监。 |

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

2016 年 A 股市场行情整体偏向低估值蓝筹,上证综指走势要强于中小板和创业板指数。家用电器、食品饮料和银行等防御性板块受到资金的青睐,有较为明显的绝对收益。从 16 年年底的中央经济工作会议来看,强调供给侧改革和风险,货币政策基调趋紧。纵观 16 年全年,28 个申万一级行业指数全年多数下跌,仅有 4 个行业(食品饮料、家电、采掘和银行)出现逆势上涨。在下跌行业中,传媒、计算机和社会服务处于领跌位置。截止四季度末,产品配置中持仓比例最大的是银行、房地产和 PPP 等行业。另外在操作方面同三季度相比,我们逐步减少了大建筑的仓位,增加了银行在产品中的配置。

自去年四季度以来的市场走好的逻辑是基于经济企稳下企业盈利出现修复改善,而这一趋势在 16 年四季度的数据中相继得到验证。目前不仅中国的宏观读数继续保持在企稳扩张状态,其他主要经济体的经济也处于扩张改善状态,说明国内经济整体没有大幅下滑的风险。证监会去年四季度以来多次在不同场合强调从严监管的工作总基调。市场稳定运行仍然是监管基础要求,通过监管沟通加强对于市场预期的引导。从 17 年以来对于保险资金入市规范以及再融资规则完善等措施来看,证监会一直致力于构建监管工作立法、执行与监督全程,深化依法全面从严监管,维护市场秩序,提升监管能力。这也与中央经济工作会议特别强调“稳中求进”、“防控资产泡沫”等提法相一致。另外股指期货松绑以及养老金投资运营有助于提升市场的风险偏好,整体对市场影响偏正面。

2017 年我们判断市场风格将大概率不会一面倒向价值蓝筹股,待成长股估值回到合理区间后将会出现投资机会,纵观全年采取价值蓝筹和成长股之间均衡配置的策略将会更佳。我们预测,上半年市场投资主线会围绕两会政策重点展开,从年前的政策密集期转入经济确认期,如国企混

改、一带一路、农业供给侧改革、区域发展等。此外 PPP 和基建领域等依然会是中央重点发力稳定经济的优先手段。下半年，长期看以成长股为代表的中小创会迎来比较好的配置机会，国内经济的企稳有利于改革创新以及消费升级。“十三五”期间中央重点扶持的“新一代信息技术、高端制造、生物、绿色低碳和数字创意”等五大战略性新兴产业将会逐步进入快速发展期，我们认为这些领域中待估值调整后将会出现投资机会。另外中央可能会寄希望于多种渠道，重启内需和消费，相关新消费领域，例如：教育、医疗及服务、泛娱乐、体育等值得重视。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.1266 元，本报告期份额净值增长率为 12.66%，业绩比较基准收益率 4.08%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年我们判断市场风格将大概率不会一面倒向价值蓝筹股，待成长股估值回到合理区间后将会出现投资机会，纵观全年采取价值蓝筹和成长股之间均衡配置的策略将会更佳。我们预测，上半年市场投资主线会围绕两会政策重点展开，从年前的政策密集期转入经济确认期，如国企改革、一带一路、农业供给侧改革、区域发展等。此外 PPP 和基建领域等依然会是中央重点发力稳定经济的优先手段。下半年，长期看以成长股为代表的中小创会迎来比较好的配置机会，国内经济的企稳有利于改革创新以及消费升级。“十三五”期间中央重点扶持的“新一代信息技术、高端制造、生物、绿色低碳和数字创意”等五大战略性新兴产业将会逐步进入快速发展期，我们认为这些领域中待估值调整后将会出现投资机会。另外中央可能会寄希望于多种渠道，重启内需和消费，相关新消费领域，例如：教育、医疗及服务、泛娱乐、体育等值得重视。

#### 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

本基金 2016 年末未进行利润分配。

### 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，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关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 2016 年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（2017）审字第 60778298\_B26 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：万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产             | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日         |
|-----------------|---------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |                                 |
| 银行存款            | 4,971,932.00                    |
| 结算备付金           | 98,990.81                       |
| 存出保证金           | 20,081.42                       |
| 交易性金融资产         | 50,399,488.58                   |
| 其中：股票投资         | 50,399,488.58                   |
| 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         | —                               |
| 应收利息            | 1,419.63                        |
| 应收股利            | —                               |
| 应收申购款           | 330,843.02                      |
| 递延所得税资产         | —                               |
| 其他资产            | —                               |
| 资产总计            | 55,822,755.46                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2016 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |                                 |
| 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         | 173,530.98    |
| 应付管理人报酬       | 70,564.33     |
| 应付托管费         | 11,760.70     |
| 应付销售服务费       | -             |
| 应付交易费用        | 44,319.39     |
| 应交税费          | -             |
| 应付利息          | -             |
| 应付利润          | -             |
| 递延所得税负债       | -             |
| 其他负债          | 350,191.87    |
| 负债合计          | 650,367.27    |
| <b>所有者权益：</b> |               |
| 实收基金          | 48,970,661.00 |
| 未分配利润         | 6,201,727.19  |
| 所有者权益合计       | 55,172,388.19 |
| 负债和所有者权益总计    | 55,822,755.46 |

注：1、报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1266 元，基金份额总额 48,970,661.00 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2016 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2016 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：万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目               | 本期<br>2016 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年<br>12 月 31 日 |
|-------------------|-----------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>       | 22,079,006.79                                       |
| 1. 利息收入           | 125,743.37                                          |
| 其中：存款利息收入         | 125,743.37                                          |
| 债券利息收入            | -                                                   |
| 资产支持证券利息收入        | -                                                   |
| 买入返售金融资产收入        | -                                                   |
| 其他利息收入            | -                                                   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | 18,723,457.43                                       |

|                            |                      |
|----------------------------|----------------------|
| 其中：股票投资收益                  | 17,766,786.59        |
| 基金投资收益                     | -                    |
| 债券投资收益                     | -                    |
| 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                       | 956,670.84           |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 2,211,588.78         |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         | -                    |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 1,018,217.21         |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>2,738,090.21</b>  |
| 1. 管理人报酬                   | 1,383,882.03         |
| 2. 托管费                     | 230,647.01           |
| 3. 销售服务费                   | -                    |
| 4. 交易费用                    | 757,987.31           |
| 5. 利息支出                    | -                    |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | -                    |
| 6. 其他费用                    | 365,573.86           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>19,340,916.58</b> |
| 减：所得税费用                    | -                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>19,340,916.58</b> |

注：1、本财务报表的实际编制期间为 2016 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2016 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：万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                       | 本期<br>2016 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日 |               |                 |
|--------------------------|--------------------------------------------------|---------------|-----------------|
|                          | 实收基金                                             | 未分配利润         | 所有者权益合计         |
| 一、基金合同生效日所有者权益（基金净值）     | 249,064,678.74-                                  | -             | 249,064,678.74- |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | -                                                | 19,340,916.58 | 19,340,916.58   |

|                                        |                 |                |                 |
|----------------------------------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号填列)  | -200,094,017.74 | -13,139,189.39 | -213,233,207.13 |
| 其中: 1. 基金申购款                           | 72,950,722.41   | 9,139,440.39   | 82,090,162.80   |
| 2. 基金赎回款                               | -273,044,740.15 | -22,278,629.78 | -295,323,369.93 |
| 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)                        | 48,970,661.00   | 6,201,727.19   | 55,172,388.19   |

注: 1、本财务报表的实际编制期间为 2016 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 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 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

|            |            |            |
|------------|------------|------------|
| <u>方一天</u> | <u>经晓云</u> | <u>陈广益</u> |
| 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

万家新兴蓝筹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]1930 号文《关于准予万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准, 由万家基金管理有限公司作为发起人于 2015 年 12 月 17 日至 2016 年 1 月 21 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)验证并出具安永华明(2016)验字第 60778298\_B01 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 2016 年 1 月 26 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 248,960,356.19 元, 在募集期间产生的活期存款利息为人民币 104,322.55 元, 以上实收基金(本息)合计为人民币 249,064,678.74 元, 折合 249,064,678.74 份基金份额。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, 基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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(包括主板、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、期权、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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 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 2016 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 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为股票投资；

#### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

### 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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值；估值日无市价，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，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，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，确定公允价值；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，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**

当本基金同时满足下列条件时，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：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；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。

#### **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 1.5%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 0.25%的年费率逐日计提;

(3) 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;

(4) 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) 每一基金份额享有同等分配权;

(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; 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净值不能低于基金面值，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；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(4) 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；

(5) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年最多 12 次，基金每次收益分配比例最低不低于已实现收益的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(6) 法律、法规或监管机关另有规定的，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

#### 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、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[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；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

## 3、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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。4、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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。

#### 4、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

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   |
| 中国建设银行股份有限公司（“建设银行”） | 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”）   | 基金管理人股东、基金代销机构 |
| 新疆国际实业股份有限公司         | 基金管理人股东        |
| 山东省国有资产投资控股有限公司      | 基金管理人股东        |
| 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       | 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     |

#### 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

##### 7.4.10.1.1 股票交易

| 关联方名称 | 本期<br>2016 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |                  |
|-------|--------------------------------------------------|------------------|
|       | 成交金额                                             | 占当期股票<br>成交总额的比例 |
| 中泰证券  | 13,095,390.66                                    | 2.58%            |

##### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

### 7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

| 关联方名称 | 本期 2016 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2016 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  | 12,195.78                                     | 2.58%      | 12,195.78 | 27.52%       |

### 7.4.8.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2016 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |
|-----------------|--------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,383,882.03                                     |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 660,666.61                                       |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2016 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |
|----------------|--------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 230,647.01                                       |

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下:

$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$

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。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据,自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

### 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

本基金本报告期内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

报告期内基金管理人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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于报告期末均未投资本基金。

### 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

| 关联方<br>名称 | 本期<br>2016 年 1 月 26 日(合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |            |
|-----------|------------------------------------------------|------------|
|           | 期末余额                                           | 当期利息收入     |
| 建设银行      | 4,971,932.00                                   | 120,559.74 |

注:(1)2016 年度,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,2016 年 1 月 26 日(合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间获得的利息收入为人民币 4,021.69 元,2016 年末结算备付金余额为人民币 98,990.81 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

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券情况。

### 7.4.9 期末(2016 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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 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<br>代码 | 股票名<br>称 | 停牌日<br>期 | 停牌<br>原因 | 期末<br>估值单价 | 复牌日<br>期 | 复牌<br>开盘单价 | 数量(股) | 期末<br>成本总额 | 期末估值<br>总额 | 备注 |
|----------|----------|----------|----------|------------|----------|------------|-------|------------|------------|----|
|----------|----------|----------|----------|------------|----------|------------|-------|------------|------------|----|

|        |          |                    |            |        |                    |        |     |          |           |   |
|--------|----------|--------------------|------------|--------|--------------------|--------|-----|----------|-----------|---|
| 603986 | 兆易创<br>新 | 2016 年 9<br>月 19 日 | 重大事<br>项停牌 | 177.97 | 2017 年 3<br>月 13 日 | 195.77 | 166 | 3,861.16 | 29,543.02 | - |
|--------|----------|--------------------|------------|--------|--------------------|--------|-----|----------|-----------|---|

### 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

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，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。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，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。

### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### 7.4.10.1 公允价值

##### 7.4.10.1.1 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、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。

##### 7.4.10.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.10.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2016 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 50,369,945.56 元，属于第二层次的余额为人民币 29,543.02 元，无第三层次余额。

##### 7.4.10.1.2.2 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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 7.4.10.1.2.3 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不以第三层次公允价

值计量。

#### 7.4.10.2 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<br>(%) |
|----|-------------------|---------------|------------------|
| 1  | 权益投资              | 50,399,488.58 | 90.28            |
|    | 其中：股票             | 50,399,488.58 | 90.28            |
| 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      | 5,070,922.81  | 9.08             |
| 7  | 其他各项资产            | 352,344.07    | 0.63             |
| 8  | 合计                | 55,822,755.46 | 100.00           |

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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         | 4,807,836.88  | 8.71         |
| B  | 采矿业              | 3,006,385.20  | 5.45         |
| C  | 制造业              | 7,153,520.37  | 12.97        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 534,160.00    | 0.97         |
| E  | 建筑业              | 16,044,243.12 | 29.08        |
| F  | 批发和零售业           | —             | —            |
| 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 | -             | -     |
| J | 金融业             | 5,935,365.79  | 10.76 |
| K | 房地产业            | 12,917,977.22 | 23.41 |
| 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       | -             | -     |
| S | 综合              | -             | -     |
|   | 合计              | 50,399,488.58 | 91.35 |

### 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  | 600068 | 葛洲坝  | 473,656 | 4,352,898.64 | 7.89         |
| 2  | 300197 | 铁汉生态 | 286,905 | 3,637,955.40 | 6.59         |
| 3  | 600338 | 西藏珠峰 | 103,740 | 3,006,385.20 | 5.45         |
| 4  | 001979 | 招商蛇口 | 177,761 | 2,913,502.79 | 5.28         |
| 5  | 600048 | 保利地产 | 302,991 | 2,766,307.83 | 5.01         |
| 6  | 002299 | 圣农发展 | 119,884 | 2,543,938.48 | 4.61         |
| 7  | 600528 | 中铁二局 | 177,583 | 2,443,542.08 | 4.43         |
| 8  | 000928 | 中钢国际 | 137,700 | 2,413,881.00 | 4.38         |
| 9  | 600820 | 隧道股份 | 219,200 | 2,413,392.00 | 4.37         |
| 10 | 600325 | 华发股份 | 182,308 | 2,333,542.40 | 4.23         |

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<br>比例（%） |
|----|--------|--------|---------------|--------------------|
| 1  | 600048 | 保利地产   | 12,764,503.13 | 23.14              |
| 2  | 601669 | 中国电建   | 12,651,074.02 | 22.93              |
| 3  | 601800 | 中国交建   | 12,235,551.11 | 22.18              |
| 4  | 600528 | 中铁二局   | 11,658,264.91 | 21.13              |
| 5  | 000402 | 金 融 街  | 10,263,409.54 | 18.60              |
| 6  | 601106 | 中国一重   | 9,876,991.58  | 17.90              |
| 7  | 600068 | 葛洲坝    | 9,133,912.32  | 16.56              |
| 8  | 601186 | 中国铁建   | 8,525,245.19  | 15.45              |
| 9  | 002019 | 亿帆医药   | 8,187,254.00  | 14.84              |
| 10 | 002146 | 荣盛发展   | 7,732,718.86  | 14.02              |
| 11 | 601766 | 中国中车   | 7,702,866.99  | 13.96              |
| 12 | 601390 | 中国中铁   | 7,560,962.78  | 13.70              |
| 13 | 002458 | 益生股份   | 7,429,836.70  | 13.47              |
| 14 | 600497 | 驰宏锌锗   | 7,316,211.00  | 13.26              |
| 15 | 600373 | 中文传媒   | 7,237,578.59  | 13.12              |
| 16 | 002299 | 圣农发展   | 7,216,432.00  | 13.08              |
| 17 | 001979 | 招商蛇口   | 7,211,830.69  | 13.07              |
| 18 | 002241 | 歌尔股份   | 7,196,206.40  | 13.04              |
| 19 | 002268 | 卫 士 通  | 6,936,656.87  | 12.57              |
| 20 | 002047 | 宝鹰股份   | 6,790,818.45  | 12.31              |
| 21 | 000800 | 一汽轿车   | 6,430,676.04  | 11.66              |
| 22 | 600150 | 中国船舶   | 5,897,734.41  | 10.69              |
| 23 | 300197 | 铁汉生态   | 5,007,615.00  | 9.08               |
| 24 | 600325 | 华发股份   | 4,986,170.00  | 9.04               |
| 25 | 000530 | 大冷股份   | 4,972,396.00  | 9.01               |
| 26 | 600987 | 航民股份   | 3,760,303.28  | 6.82               |
| 27 | 000831 | *ST 五稀 | 3,732,458.86  | 6.77               |
| 28 | 300011 | 鼎汉技术   | 3,181,052.68  | 5.77               |
| 29 | 601668 | 中国建筑   | 3,141,040.00  | 5.69               |
| 30 | 601618 | 中国中冶   | 3,127,794.34  | 5.67               |
| 31 | 600338 | 西藏珠峰   | 2,991,762.00  | 5.42               |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 32 | 002480 | 新筑股份 | 2,881,949.88 | 5.22 |
| 33 | 000042 | 中洲控股 | 2,677,698.07 | 4.85 |
| 34 | 000036 | 华联控股 | 2,539,938.00 | 4.60 |
| 35 | 300133 | 华策影视 | 2,495,370.00 | 4.52 |
| 36 | 002123 | 梦网荣信 | 2,486,237.33 | 4.51 |
| 37 | 000910 | 大亚圣象 | 2,484,509.18 | 4.50 |
| 38 | 600318 | 新力金融 | 2,481,188.40 | 4.50 |
| 39 | 600919 | 江苏银行 | 2,474,792.93 | 4.49 |
| 40 | 300367 | 东方网力 | 2,461,486.70 | 4.46 |
| 41 | 000928 | 中钢国际 | 2,390,278.00 | 4.33 |
| 42 | 002444 | 巨星科技 | 2,363,007.00 | 4.28 |
| 43 | 300351 | 永贵电器 | 2,306,236.01 | 4.18 |
| 44 | 600820 | 隧道股份 | 2,268,276.00 | 4.11 |
| 45 | 600029 | 南方航空 | 2,117,259.00 | 3.84 |
| 46 | 601997 | 贵阳银行 | 1,983,577.00 | 3.60 |
| 47 | 000925 | 众合科技 | 1,948,960.00 | 3.53 |
| 48 | 600015 | 华夏银行 | 1,540,030.55 | 2.79 |
| 49 | 600266 | 北京城建 | 1,124,674.00 | 2.04 |
| 50 | 601155 | 新城控股 | 1,118,870.00 | 2.03 |

#### 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  | 601800 | 中国交建 | 14,454,593.95 | 26.20          |
| 2  | 601669 | 中国电建 | 12,986,753.07 | 23.54          |
| 3  | 600048 | 保利地产 | 10,312,064.58 | 18.69          |
| 4  | 002019 | 亿帆医药 | 10,020,619.50 | 18.16          |
| 5  | 601186 | 中国铁建 | 9,512,193.42  | 17.24          |
| 6  | 000402 | 金融街  | 8,889,308.49  | 16.11          |
| 7  | 600528 | 中铁二局 | 8,498,419.62  | 15.40          |
| 8  | 600497 | 驰宏锌锗 | 8,300,103.73  | 15.04          |
| 9  | 002268 | 卫士通  | 7,914,503.38  | 14.35          |
| 10 | 002047 | 宝鹰股份 | 7,914,147.57  | 14.34          |
| 11 | 601766 | 中国中车 | 7,770,451.89  | 14.08          |
| 12 | 002299 | 圣农发展 | 7,416,812.52  | 13.44          |

|    |        |        |              |       |
|----|--------|--------|--------------|-------|
| 13 | 002458 | 益生股份   | 7,395,279.98 | 13.40 |
| 14 | 601390 | 中国中铁   | 7,355,655.04 | 13.33 |
| 15 | 002146 | 荣盛发展   | 7,211,412.46 | 13.07 |
| 16 | 601106 | 中国一重   | 7,085,980.00 | 12.84 |
| 17 | 000800 | 一汽轿车   | 6,736,357.26 | 12.21 |
| 18 | 002241 | 歌尔股份   | 6,706,613.01 | 12.16 |
| 19 | 600373 | 中文传媒   | 6,565,890.49 | 11.90 |
| 20 | 600150 | 中国船舶   | 6,166,997.02 | 11.18 |
| 21 | 000530 | 大冷股份   | 5,941,885.15 | 10.77 |
| 22 | 600068 | 葛洲坝    | 5,392,110.50 | 9.77  |
| 23 | 001979 | 招商蛇口   | 5,247,543.09 | 9.51  |
| 24 | 000831 | *ST 五稀 | 4,285,295.33 | 7.77  |
| 25 | 600987 | 航民股份   | 4,242,488.90 | 7.69  |
| 26 | 600325 | 华发股份   | 3,641,838.03 | 6.60  |
| 27 | 601668 | 中国建筑   | 3,227,930.00 | 5.85  |
| 28 | 000910 | 大亚圣象   | 3,010,339.27 | 5.46  |
| 29 | 300011 | 鼎汉技术   | 2,914,637.09 | 5.28  |
| 30 | 601618 | 中国中冶   | 2,888,053.43 | 5.23  |
| 31 | 300367 | 东方网力   | 2,865,490.80 | 5.19  |
| 32 | 600318 | 新力金融   | 2,853,933.75 | 5.17  |
| 33 | 000036 | 华联控股   | 2,683,343.62 | 4.86  |
| 34 | 300133 | 华策影视   | 2,653,700.00 | 4.81  |
| 35 | 002123 | 梦网荣信   | 2,629,058.28 | 4.77  |
| 36 | 300197 | 铁汉生态   | 2,559,322.21 | 4.64  |
| 37 | 000042 | 中洲控股   | 2,459,971.46 | 4.46  |
| 38 | 600029 | 南方航空   | 2,251,194.38 | 4.08  |
| 39 | 002444 | 巨星科技   | 2,036,679.42 | 3.69  |
| 40 | 000925 | 众合科技   | 2,024,401.13 | 3.67  |

### 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 | 269,684,971.41 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 239,263,858.20 |

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末无债券投资。

## 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

本基金本报告期末无债券投资。

## 8.7 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

本基金本报告期末无资产支持证券投资。

## 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

本基金本报告期末无贵金属投资。

## 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

本基金本报告期末无权证投资。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

在股指期货投资上，本基金以避险保值和有效管理为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中，将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约，通过研究现货和期货市场的发展趋势，运用定价模型对其进行合理估值，谨慎利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，及时调整投资组合仓位，以降低组合风险、提高组合的运作效率。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同，本基金不可投资国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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   | 20,081.42  |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 1,419.63   |
| 5  | 应收申购款   | 330,843.02 |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 352,344.07 |

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## § 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

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
| 2,281        | 21,468.94     | 0     | 0.00 %     | 48,970,661.00 | 100.00%    |

### 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 | 79,562.21 | 0.1625%  |

### 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 | 万家新兴蓝筹 | 0~10              |

|                    |        |      |
|--------------------|--------|------|
| 投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 合计     | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金    | 万家新兴蓝筹 | 0~10 |
|                    | 合计     | 0~10 |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                                    |                |
|------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（ 2016 年 1 月 26 日 ）基金份额总额   | 249,064,678.74 |
| 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              | 72,950,722.41  |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额            | 273,044,740.15 |
| 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                       | 48,970,661.00  |

## § 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：

总经理变更：2016 年 7 月 29 日，本公司发布公告，聘任经晓云为万家基金管理有限公司总经理，同时方一天不再兼任本公司总经理，继续担任本公司董事长。

基金托管人：

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 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

本基金自基金合同生效日起聘任安永华明会计师事务所为基金提供审计服务。本报告期应支付审计费 50,000.00 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

报告期内管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况

## 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 |    |
| 中信证券 | 2      | 169,058,321.97 | 33.24%       | 157,444.27 | 33.24%     | -  |
| 兴业证券 | 2      | 139,408,319.75 | 27.41%       | 129,830.73 | 27.41%     | -  |
| 国泰君安 | 1      | 102,046,546.52 | 20.07%       | 95,036.43  | 20.07%     | -  |
| 安信证券 | 1      | 41,752,374.23  | 8.21%        | 38,885.32  | 8.21%      | -  |
| 川财证券 | 1      | 25,392,905.41  | 4.99%        | 23,648.44  | 4.99%      | -  |
| 中泰证券 | 1      | 13,095,390.66  | 2.58%        | 12,195.78  | 2.58%      | -  |
| 方正证券 | 1      | 10,709,256.78  | 2.11%        | 9,973.58   | 2.11%      | -  |
| 国信证券 | 1      | 7,084,455.68   | 1.39%        | 6,597.71   | 1.39%      | -  |
| 宏源证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 齐鲁证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 民生证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 高华证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 上海证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 东兴证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 国金证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 中银国际 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |

### 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 |
| 中信证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 兴业证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 国泰君安 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 安信证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 川财证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中泰证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 方正证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 国信证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 宏源证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 齐鲁证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 民生证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 高华证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 上海证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东兴证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 国金证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中银国际 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |

注: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、报告期内基金租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金为本报告期内成立的基金,上述席位均为新增席位。

万家基金管理有限公司  
2017 年 3 月 31 日