万家上证380交易型开放式指数证券投资基金2015年半年度报告

2015年6月30日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

送出日期：2015年8月26日

§1 重要提示及目录

1.1 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。本半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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 25 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
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 10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 11
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 11
§5 托管人报告 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
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 12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 12
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 12
6.1 资产负债表 12
6.2 利润表 13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 14
6.4 报表附注 16
§7 投资组合报告 31
7.1 期末基金资产组合情况 31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 32
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 44
7.6 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 44
7.7 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 44
7.8 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 44
7.9 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 44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 44

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 45
7.12 投资组合报告附注 45
§8 基金份额持有人信息 46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 46
8.2 期末上市基金前十名持有人 46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 46
8.4 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 46
§9 开放式基金份额变动 47
§10 重大事件揭示 47
10.1 基金份额持有人大会决议 47
10.2 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 47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 47
10.4 基金投资策略的改变 47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 48
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 48
§11 影响投资者决策的其他重要信息 49
§12 备查文件目录 49
12.1 备查文件目录 49
12.2 存放地点 49
12.3 查阅方式 49

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家上证 380 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	万家上证 380ETF
场内简称	万家 380
基金主代码	510680
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 10 月 31 日
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	华夏银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,724,652.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013-12-02

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用完全复制法跟踪标的指数，同时引入非成分股、股指期货、权证等金融工具以更好地追踪目标指数。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。未来，根据市场情况，基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为标的指数。若基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更，基金管理人可根据投资情况和市场惯例调整基金业绩比较基准的组成和权重，无需召开基金份额持有人大会，但基金管理人应取得基金托管人同意后，报中国证监会备案。
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金，属于较高风险、较高收益的产品。

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	华夏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	徐昊光
	联系电话	021-38909626	010-85238982

	电子邮箱	lanj@wjasset.com	bjxhg@hxb.com.cn
客户服务电话		95538 转 6、4008880800	95577
传真		021-38909627	010-85238680
注册地址		上海市浦东新区浦电路 360 号陆家嘴投资大厦 9 楼	北京市东城区建国门内大街 22 号
办公地址		上海市浦东新区浦电路 360 号陆家嘴投资大厦 9 楼	北京市东城区建国门内大街 22 号
邮政编码		200122	100005
法定代表人		毕玉国	吴建

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.wjasset.com
基金半年度报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	4,208,652.33
本期利润	4,234,070.15
加权平均基金份额本期利润	1.0032
本期加权平均净值利润率	57.12%
本期基金份额净值增长率	58.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	2,029,623.20
期末可供分配基金份额利润	1.1768
期末基金资产净值	3,754,275.20
期末基金份额净值	2.1768
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	117.68%

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、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。

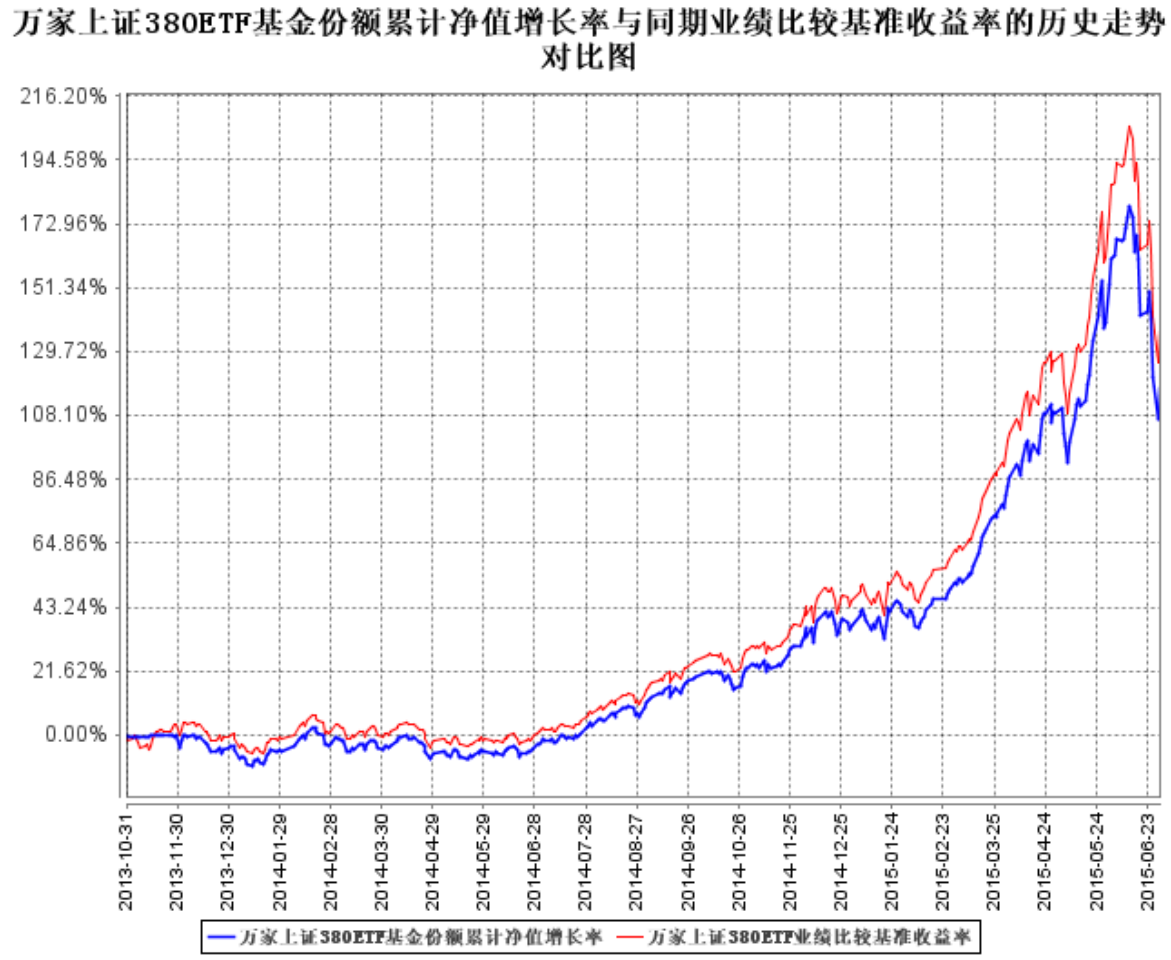
3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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
过去一个月	-9.18%	3.81%	-9.15%	3.93%	-0.03%	-0.12%
过去三个月	23.10%	2.92%	24.63%	3.00%	-1.53%	-0.08%
过去六个月	58.77%	2.33%	63.79%	2.39%	-5.02%	-0.06%
过去一年	125.13%	1.84%	136.68%	1.87%	-11.55%	-0.03%
自基金合同生效起至今	117.68%	1.60%	137.96%	1.64%	-20.28%	-0.04%

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：本基金成立于 2013 年 10 月 31 日，建仓期为 6 个月，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。公司现股东为齐鲁证券有限公司、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上海市浦东新区浦电路 360 号 9 楼，注册资本 1 亿元人民币。目前管理二十一只开放式基金，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 380 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和万家品质生活股票型证券投资基金。

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		
姚霞天	本基金经理、万家 180 指数基金基金经理、万家中证红利指数基金（LOF）基金经理、万家中证创业成长指数分级基金基金经理	2015 年 5 月 22 日	-	7	复旦大学金融学硕士。2007 年 7 月至 2008 年 6 月任泰信基金管理有限公司量化分析师；2008 年 9 月至 2009 年 5 月任上海金程国际金融学院 FRM 讲师；2009 年 9 月加入万家基金管理有限公司，历任风险分析师、量化分析师、基金经理助理、投资经理等职。
吴涛	本基金经理、量化投资部总监、万家 180 指数基金基金经理、万家中证红利指数基金基金经理、万家中证创业成长指数分级基金经理	2014 年 11 月 14 日	2015 年 5 月 22 日	21 年	硕士学位，曾任天同证券有限责任公司上海营业部副总经理、天同证券有限责任公司深圳营业部总经理、南方总部副总经理、万家基金管理有限公司监察稽核部总监等职。

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 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公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 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

回顾 2015 年上半年,市场在年初稍事休整一个多月后,又迅速迎来一波强劲上涨的火热行情,大盘蓝筹股累创新高,成交量急剧放大,中小板、创业板的表现相对于大盘股更加如火如荼。但进入 6 月中旬之后,本轮由流动性推动的牛市开始出现了大幅下调,而政府也迅速出手开始稳定市场,包括降息、定向降准以及成立平准基金等,预期股市快速下挫行情况有望得到改善。报告期本基金投资标的指数——上证 380 指数收益率为 63.79%。

本基金作为被动投资的 ETF 基金,其投资目标是通过跟踪、复制上证 380 指数,为投资者获取股票市场长期的平均收益。报告期内我们严格按照基金合同规定,采取了完全复制方法进行投资管理,努力拟合标的指数,减小跟踪误差。

报告期内,本基金采用有效的量化跟踪技术,将基金跟踪误差控制在较低范围内。跟踪误差

主要是由于基金申购赎回、标的指数成分股定期调整、各类费用等因素所造成。

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 2.1768 元，报告期内基金份额净值增长率为 58.77%，同期业绩比较基准收益率为 63.79%。本基金日均跟踪偏离度为 0.0743%，年化跟踪误差 0.81%，符合基金合同中日平均跟踪偏离度低于 0.2%和年跟踪误差低于 2%的规定。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015 年下半年，随着国企改革步伐的加快，企稳投资力度不断价码等积极政策的实施，以及人民币汇率贬值有利于降低出口的压力，利于经济的复苏等因素。我们预计下半年经济有望企稳回升。

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

截至本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施分配的利润。

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

自 1 月 5 日至 6 月 30 日，基金资产净值连续 60 个工作日以上低于五千万元。经与基金托管人华夏银行股份有限公司协商一致，基金管理人于 7 月 8 日向中国证券监督管理委员会提交了将

万家上证380交易型开放式指数证券投资基金变更注册为万家上证50交易型开放式指数证券投资基金的申请。

§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

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，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份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金 2015 年半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：万家上证 380 交易型开放式指数证券投资基金
报告截止日： 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	206,885.25	399,372.29
结算备付金		4,480.96	5,509.45
存出保证金		1,183.50	709.67
交易性金融资产	6.4.7.2	3,751,516.48	9,217,242.84
其中：股票投资		3,751,516.48	9,217,242.84
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-

应收证券清算款		-	5,987.57
应收利息	6.4.7.5	38.39	101.14
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,964,104.58	9,628,922.96
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2015 年 6 月 30 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,463.35	4,412.53
应付托管费		492.67	882.51
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,144.63	3,856.36
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	203,728.73	400,000.00
负债合计		209,829.38	409,151.40
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,724,652.00	6,724,652.00
未分配利润	6.4.7.10	2,029,623.20	2,495,119.56
所有者权益合计		3,754,275.20	9,219,771.56
负债和所有者权益总计		3,964,104.58	9,628,922.96

6.2 利润表

会计主体：万家上证 380 交易型开放式指数证券投资基金
本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		4,515,876.46	3,964,232.28
1.利息收入		1,103.73	5,384.50
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,103.73	5,384.50

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）		4,464,173.83	182,070.97
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,444,200.89	-340,071.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	19,972.94	522,142.54
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	25,417.82	3,777,362.51
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	25,181.08	-585.70
减：二、费用		281,806.31	540,949.40
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	18,133.08	179,757.13
2．托管费	6.4.10.2.2	3,626.66	35,951.44
3．销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4．交易费用	6.4.7.19	6,317.84	37,903.68
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．其他费用	6.4.7.20	253,728.73	287,337.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,234,070.15	3,423,282.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,234,070.15	3,423,282.88

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家上证 380 交易型开放式指数证券投资基金
本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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	6,724,652.00	2,495,119.56	9,219,771.56

金净值）			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,234,070.15	4,234,070.15
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）	-5,000,000.00	-4,699,566.51	-9,699,566.51
其中：1.基金申购款	12,000,000.00	8,176,182.07	20,176,182.07
2.基金赎回款	-17,000,000.00	-12,875,748.58	-29,875,748.58
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）	1,724,652.00	2,029,623.20	3,754,275.20
项目	**上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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）	148,724,652.00	-5,991,465.78	142,733,186.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,423,282.88	3,423,282.88
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）	-97,000,000.00	854,851.97	-96,145,148.03
其中：1.基金申购款	3,000,000.00	-73,438.76	2,926,561.24
2.基金赎回款	-100,000,000.00	928,290.73	-99,071,709.27
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）	51,724,652.00	-1,713,330.93	50,011,321.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

毕玉国	李杰	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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

万家上证 380 交易型开放式指数证券投资基金（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[2013]1047 号文《关于核准万家上证 380 交易型开放式指数证券投资基金的批复》的核准，由万家基金管理有限公司作为管理人于 2013 年 10 月 14 日至 2013 年 10 月 25 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（2013）验字第 B60778298_B22 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 2013 年 10 月 31 日生效。本基金为交易型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 464,189,000.00 元（不含股票部分），在募集期间产生的活期存款利息为人民币 3,200.00 元，有效认购股票按按认购期最后一日的均价计算的净额为人民币 36,532,452.00 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 500,724,652.00 元，折合 500,724,652.00 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，基金托管人为华夏银行股份有限公司。

本基金的标的指数为上证 380 指数。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地追踪目标指数，基金还可投资于非成份股、债券、股指期货、权证、新股、存款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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 90%。本基金的业绩比较基准为标的指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、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>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 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 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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

本半年度报告所采用的会计政策、会计估计与上年度报告相一致。

6.4.5 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。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	206,885.25
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	206,885.25

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2015 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		3,396,090.56	3,751,516.48	355,425.92
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,396,090.56	3,751,516.48	355,425.92

注：于 2015 年 6 月 30 日，股票投资的公允价值和公允价值变动包含的可退替代款估值增值为零。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	35.89
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2.00
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.50
合计	38.39

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	3,144.63
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,144.63

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提信息披露费	99,180.76
预提审计费	24,795.19
预提上市年费	29,752.78
应付指数使用费	50,000.00
合计	203,728.73

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,724,652.00	6,724,652.00
本期申购	12,000,000.00	12,000,000.00
本期赎回(以"-"号填列)	-17,000,000.00	-17,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以"-"号填列)	-	-
本期末	1,724,652.00	1,724,652.00

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,276,523.33	-781,403.77	2,495,119.56
本期利润	4,208,652.33	25,417.82	4,234,070.15
本期基金份额交易产生的变动数	-4,357,047.96	-342,518.55	-4,699,566.51
其中：基金申购款	7,558,226.58	617,955.49	8,176,182.07
基金赎回款	-11,915,274.54	-960,474.04	-12,875,748.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,128,127.70	-1,098,504.50	2,029,623.20

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,016.61
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	78.08
其他	9.04
合计	1,103.73

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	585,492.52
股票投资收益——赎回差价收入	3,858,708.37
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	4,444,200.89

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,210,720.07
减：卖出股票成本总额	1,625,227.55
买卖股票差价收入	585,492.52

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	29,875,748.58
减：现金支付赎回款总额	814,045.58
减：赎回股票成本总额	25,202,994.63
赎回差价收入	3,858,708.37

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	19,972.94
基金投资产生的股利收益	-
合计	19,972.94

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	25,417.82
——股票投资	25,417.82
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	25,417.82

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
ETF 替代损益	25,181.08
合计	25,181.08

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	6,317.84
银行间市场交易费用	-
合计	6,317.84

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	99,180.76
上市年费	29,752.78
指数使用费	100,000.00
合计	253,728.73

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03%的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度 50,000 元，计提期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
华夏银行股份有限公司	基金托管人，基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	18,133.08	179,757.13
其中：支付销售机构的客户维护费	10.99	1,879.50

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.50%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延至最近可支付日。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付	3,626.66	35,951.44

的托管费		

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.10%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延至最近可支付日。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期内未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

本基金的其他关联方本报告期内未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5 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 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
华夏银行股份有限公司	206,885.25	1,016.61	575,742.27	1,084.54

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 1 月 1 日至 6 月 30 日获得的利息为人民币 9.04 元（2014 年 1 月 1 日至 6 月 30 日为人民币 1,336.83 元），2015 年 6 月 30 日结算备付金余额为人民币 4,480.96 元（2014 年 6 月 30 日余额为 2,957.91 元）。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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
601718	际华集团	2015 年 6 月 17 日	重大事项	15.12	2015 年 7 月 2 日	13.61	2,800	23,986.19	42,336.00	-
600410	华胜天成	2015 年 5 月 28 日	重大事项	47.84	2015 年 7 月 22 日	43.06	800	25,522.03	38,272.00	-
600978	宜华木业	2015 年 6 月 18 日	重大事项	22.44	-	-	1,400	17,494.86	31,416.00	-
600587	新华医疗	2015 年 5 月 22 日	重大事项	58.63	2015 年 7 月 3 日	52.77	522	21,143.95	30,604.86	-
600872	中炬高新	2015 年 5 月 4 日	重大事项	21.62	-	-	1,400	18,157.61	30,268.00	-
600482	风帆股份	2015 年 5 月 28 日	重大事项	42.38	-	-	660	14,349.80	27,970.80	-
600654	中安消	2015 年 6 月 29 日	重大事项	30.91	-	-	800	14,758.05	24,728.00	-
601877	正泰电器	2015 年 5 月 18 日	重大事项	30.62	-	-	762	21,321.77	23,332.44	-
600366	宁波韵升	2015 年 5 月 22 日	重大事项	35.09	2015 年 8 月 12 日	31.58	600	12,168.66	21,054.00	-
600277	亿利能源	2015 年 6 月 1 日	重大事项	14.62	-	-	1,333	15,179.50	19,488.46	-
600312	平高电气	2015 年 6 月 23 日	重大事项	22.58	-	-	783	16,398.71	17,680.14	-
600790	轻纺城	2015 年 5 月 25 日	重大事项	13.38	2015 年 8 月 18 日	12.04	1,272	10,903.69	17,019.36	-
600416	湘电股份	2015 年 5 月 22 日	重大事项	22.64	2015 年 7 月 20 日	20.35	700	11,111.46	15,848.00	-
600676	交运股份	2015 年 5 月 27 日	重大事项	19.76	2015 年 7 月 7 日	17.78	799	10,644.05	15,788.24	-
600175	美都能源	2015 年 6 月 29 日	重大事项	10.64	2015 年 7 月 20 日	9.58	1,400	10,017.41	14,896.00	-
600575	皖江物流	2014 年 9 月 9 日	重大事项	4.11	-	-	3,504	12,986.98	14,401.44	-
601311	骆驼股份	2015 年 6	重大	28.20	2015 年 7 月	25.38	510	10,796.94	14,382.00	-

		月 18 日	事项		15 日					
600967	北方创业	2015 年 4 月 13 日	重大事项	17.12	-	-	840	12,483.10	14,380.80	-
601021	春秋航空	2015 年 6 月 26 日	重大事项	126.09	2015 年 7 月 21 日	113.48	100	11,900.00	12,609.00	-
600395	盘江股份	2015 年 6 月 9 日	重大事项	15.71	2015 年 8 月 19 日	14.00	759	9,557.39	11,923.89	-
600869	智慧能源	2015 年 5 月 11 日	重大事项	29.14	2015 年 7 月 31 日	26.23	371	5,333.21	10,810.94	-
600078	澄星股份	2015 年 6 月 9 日	重大事项	15.23	2015 年 7 月 1 日	13.71	600	5,846.15	9,138.00	-
600778	友好集团	2015 年 6 月 2 日	重大事项	16.10	-	-	552	6,107.40	8,887.20	-
600335	国机汽车	2015 年 6 月 15 日	重大事项	37.93	2015 年 7 月 21 日	34.14	200	5,094.17	7,586.00	-
601789	宁波建工	2015 年 6 月 15 日	重大事项	18.80	2015 年 8 月 13 日	16.81	400	6,178.38	7,520.00	-
600641	万业企业	2015 年 6 月 12 日	重大事项	11.23	-	-	600	4,940.37	6,738.00	-
600333	长春燃气	2015 年 5 月 29 日	重大事项	11.97	2015 年 7 月 9 日	10.77	463	5,780.91	5,542.11	-
600167	联美控股	2015 年 5 月 27 日	重大事项	25.76	-	-	200	4,581.33	5,152.00	-
600561	江西长运	2015 年 5 月 4 日	重大事项	19.48	-	-	258	4,032.99	5,025.84	-
600568	中珠控股	2015 年 4 月 27 日	重大事项	24.10	-	-	200	3,398.03	4,820.00	-
600882	华联矿业	2015 年 5 月 19 日	重大事项	13.42	-	-	230	2,270.09	3,086.60	-
600258	首旅酒店	2015 年 3 月 17 日	重大事项	18.55	-	-	123	1,990.95	2,281.65	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理融入各业务层面，建立了三道防线：以各岗位目标责任制为基础，形成第一道防线；通过相关部门、相关岗位之间相互监督制衡，形成第二道防线；由监察稽核部门、督察长对各岗位、各部门、各机构、各项业务实施监督反馈，形成第三道防线。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持证券均在证券交易所上市；因此，除在附注 6.4.12 列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本报告期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性要求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	206,885.25	-	-	-	-	-	206,885.25
结算备付金	4,480.96	-	-	-	-	-	4,480.96
存出保证金	1,183.50	-	-	-	-	-	1,183.50
交易性金融资产	-	-	-	-	-	3,751,516.48	3,751,516.48
应收利息	-	-	-	-	-	38.39	38.39
资产总计	212,549.71	-	-	-	-	3,751,554.87	3,964,104.58
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,463.35	2,463.35
应付托管费	-	-	-	-	-	492.67	492.67
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,144.63	3,144.63
其他负债	-	-	-	-	-	203,728.73	203,728.73
负债总计	-	-	-	-	-	209,829.38	209,829.38
利率敏感度缺口	212,549.71	-	-	-	-	3,541,725.49	3,754,275.20
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	399,372.29	-	-	-	-	-	399,372.29
结算备付金	5,509.45	-	-	-	-	-	5,509.45
存出保证金	709.67	-	-	-	-	-	709.67
交易性金融资产	-	-	-	-	-	9,217,242.84	9,217,242.84
应收证券清算款	-	-	-	-	-	5,985.77	5,985.77
应收利息	-	-	-	-	-	101.14	101.14
其他资产	-	-	-	-	-	1.80	1.80
资产总计	405,591.41	-	-	-	-	9,223,331.55	9,628,922.96
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,412.53	4,412.53
应付托管费	-	-	-	-	-	882.51	882.51
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,856.36	3,856.36
其他负债	-	-	-	-	-	400,000.00	400,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	409,151.40	409,151.40
利率敏感度缺口	405,591.41	-	-	-	-	8,814,180.15	9,219,771.56

注：上表统计了本基金资产及负债的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公

允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2014 年 6 月 30 日：同)，银行存款、结算备付金及存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2014 年 6 月 30 日： 同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	3,751,516.48	99.93	9,217,242.84	99.97
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,751,516.48	99.93	9,217,242.84	99.97

注：本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 90%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上表。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金所投资证券的贝塔系数紧密相关；		
	对于上市时间不足一年的股票，使用上证 380 指数替代股票价格计算其贝塔系数；		
	以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2015 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2014 年 12 月 31 日 ）
	上证 380 指数上涨 1%	39,953.72	89,742.29
	上证 380 指数下跌 1%	-39,953.72	-89,742.29

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 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	3,751,516.48	94.64
	其中：股票	3,751,516.48	94.64
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	211,366.21	5.33
7	其他各项资产	1,221.89	0.03
8	合计	3,964,104.58	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	18,739.50	0.50
B	采矿业	157,881.36	4.21
C	制造业	2,014,338.15	53.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	247,870.53	6.60
E	建筑业	142,093.28	3.78
F	批发和零售业	384,010.15	10.23
G	交通运输、仓储和邮政业	355,634.89	9.47
H	住宿和餐饮业	8,940.00	0.24
I	信息传输、软件和信息技术服务业	144,355.04	3.85
J	金融业	-	-
K	房地产业	107,359.45	2.86
L	租赁和商务服务业	40,637.01	1.08
M	科学研究和技术服务业	8,671.00	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	8,331.00	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,453.00	0.09
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	42,732.00	1.14
S	综合	66,470.12	1.77
	合计	3,751,516.48	99.93

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601718	际华集团	2,800	42,336.00	1.13
2	600410	华胜天成	800	38,272.00	1.02
3	601333	广深铁路	3,955	32,510.10	0.87

4	600009	上海机场	1,000	31,700.00	0.84
5	600978	宜华木业	1,400	31,416.00	0.84
6	600587	新华医疗	522	30,604.86	0.82
7	600872	中炬高新	1,400	30,268.00	0.81
8	600482	风帆股份	660	27,970.80	0.75
9	600881	亚泰集团	2,200	27,962.00	0.74
10	600863	内蒙华电	3,335	27,280.30	0.73
11	600398	海澜之家	1,500	27,195.00	0.72
12	600688	上海石化	2,515	26,985.95	0.72
13	600642	申能股份	2,683	26,856.83	0.72
14	600307	酒钢宏兴	3,700	25,012.00	0.67
15	600654	飞乐股份	800	24,728.00	0.66
16	600446	金证股份	200	24,692.00	0.66
17	601179	中国西电	2,400	24,600.00	0.66
18	600820	隧道股份	1,800	24,192.00	0.64
19	601168	西部矿业	2,200	24,024.00	0.64
20	601877	正泰电器	762	23,332.44	0.62
21	600601	方正科技	2,500	22,750.00	0.61
22	600635	大众公用	2,300	22,494.00	0.60
23	600594	益佰制药	384	22,321.92	0.59
24	600200	江苏吴中	600	22,050.00	0.59
25	600143	金发科技	1,800	21,456.00	0.57
26	600201	金宇集团	299	21,264.88	0.57
27	600571	信雅达	200	21,170.00	0.56
28	600021	上海电力	1,000	21,100.00	0.56
29	600366	宁波韵升	600	21,054.00	0.56
30	600500	中化国际	1,200	20,976.00	0.56
31	600525	长园集团	1,000	20,570.00	0.55
32	600026	中海发展	1,600	20,544.00	0.55
33	601258	庞大集团	3,690	20,147.40	0.54
34	600170	上海建工	2,100	19,698.00	0.52
35	600277	亿利能源	1,333	19,488.46	0.52
36	600694	大商股份	341	18,850.48	0.50
37	600521	华海药业	600	18,750.00	0.50
38	600600	青岛啤酒	400	18,636.00	0.50
39	600811	东方集团	1,510	18,618.30	0.50
40	601918	国投新集	1,200	18,468.00	0.49
41	600655	豫园商城	1,141	18,313.05	0.49
42	600122	宏图高科	1,108	18,193.36	0.48

43	600169	太原重工	2,000	17,800.00	0.47
44	600584	长电科技	930	17,772.30	0.47
45	600388	龙净环保	932	17,698.68	0.47
46	600312	平高电气	783	17,680.14	0.47
47	600166	福田汽车	2,000	17,660.00	0.47
48	600511	国药股份	348	17,535.72	0.47
49	601012	隆基股份	1,100	17,314.00	0.46
50	600682	南京新百	460	17,263.80	0.46
51	600790	轻纺城	1,272	17,019.36	0.45
52	600797	浙大网新	900	17,001.00	0.45
53	600704	物产中大	700	16,716.00	0.45
54	600651	飞乐音响	807	16,599.99	0.44
55	600664	哈药股份	1,368	16,470.72	0.44
56	600058	五矿发展	500	16,335.00	0.44
57	600125	铁龙物流	1,055	16,278.65	0.43
58	600567	山鹰纸业	2,700	16,038.00	0.43
59	600522	中天科技	700	15,911.00	0.42
60	600498	烽火通信	600	15,876.00	0.42
61	600416	湘电股份	700	15,848.00	0.42
62	600676	交运股份	799	15,788.24	0.42
63	600428	中远航运	950	15,380.50	0.41
64	600578	京能电力	1,700	15,181.00	0.40
65	600008	首创股份	1,050	15,067.50	0.40
66	601000	唐山港	1,100	15,059.00	0.40
67	600175	美都能源	1,400	14,896.00	0.40
68	601608	中信重工	906	14,767.80	0.39
69	600171	上海贝岭	600	14,670.00	0.39
70	600755	厦门国贸	1,300	14,612.00	0.39
71	600056	中国医药	600	14,604.00	0.39
72	600017	日照港	1,800	14,598.00	0.39
73	600575	皖江物流	3,504	14,401.44	0.38
74	601311	骆驼股份	510	14,382.00	0.38
75	600967	北方创业	840	14,380.80	0.38
76	600348	阳泉煤业	1,400	14,350.00	0.38
77	600255	鑫科材料	1,600	14,288.00	0.38
78	600673	东阳光科	1,422	14,063.58	0.37
79	600880	博瑞传播	900	13,977.00	0.37
80	600562	国睿科技	237	13,736.52	0.37
81	600343	航天动力	400	13,592.00	0.36

82	600176	中国巨石	500	13,530.00	0.36
83	600528	中铁二局	800	13,416.00	0.36
84	600478	科力远	788	13,411.76	0.36
85	600436	片仔癀	200	13,334.00	0.36
86	600611	大众交通	800	13,320.00	0.35
87	600270	外运发展	455	13,267.80	0.35
88	600835	上海机电	400	13,176.00	0.35
89	600391	成发科技	224	13,112.96	0.35
90	600426	华鲁恒升	700	12,992.00	0.35
91	600038	中直股份	207	12,823.65	0.34
92	600138	中青旅	600	12,672.00	0.34
93	600098	广州发展	900	12,627.00	0.34
94	601021	春秋航空	100	12,609.00	0.34
95	600517	置信电气	800	12,520.00	0.33
96	600711	盛屯矿业	1,100	12,441.00	0.33
97	600409	三友化工	1,100	12,430.00	0.33
98	600502	安徽水利	621	12,413.79	0.33
99	600626	申达股份	600	12,204.00	0.33
100	600582	天地科技	714	12,202.26	0.33
101	600063	皖维高新	1,300	12,142.00	0.32
102	600160	巨化股份	1,100	12,122.00	0.32
103	600614	鼎立股份	403	12,041.64	0.32
104	601717	郑煤机	1,100	12,001.00	0.32
105	600395	盘江股份	759	11,923.89	0.32
106	603766	隆鑫通用	475	11,922.50	0.32
107	600210	紫江企业	1,401	11,726.37	0.31
108	600236	桂冠电力	1,049	11,706.84	0.31
109	600064	南京高科	600	11,700.00	0.31
110	600667	太极实业	2,000	11,600.00	0.31
111	600826	兰生股份	300	11,589.00	0.31
112	600039	四川路桥	1,766	11,531.98	0.31
113	600536	中国软件	323	11,460.04	0.31
114	600120	浙江东方	337	11,420.93	0.30
115	600267	海正药业	600	11,274.00	0.30
116	600783	鲁信创投	300	11,244.00	0.30
117	600805	悦达投资	719	11,237.97	0.30
118	600662	强生控股	769	11,196.64	0.30
119	600495	晋西车轴	545	11,172.50	0.30
120	600557	康缘药业	400	11,132.00	0.30

121	600183	生益科技	1,092	11,127.48	0.30
122	600387	海越股份	434	11,075.68	0.30
123	600487	亨通光电	300	11,040.00	0.29
124	600527	江南高纤	1,010	10,847.40	0.29
125	600869	智慧能源	371	10,810.94	0.29
126	600580	卧龙电气	600	10,698.00	0.28
127	600399	抚顺特钢	900	10,656.00	0.28
128	600216	浙江医药	800	10,624.00	0.28
129	600380	健康元	700	10,612.00	0.28
130	600648	外高桥	300	10,524.00	0.28
131	600298	安琪酵母	300	10,434.00	0.28
132	600062	华润双鹤	400	10,416.00	0.28
133	600172	黄河旋风	500	10,415.00	0.28
134	600458	时代新材	410	10,291.00	0.27
135	600161	天坛生物	270	10,168.20	0.27
136	601058	赛轮金宇	900	10,035.00	0.27
137	601666	平煤股份	1,325	10,030.25	0.27
138	600963	岳阳林纸	1,000	10,010.00	0.27
139	600106	重庆路桥	858	9,969.96	0.27
140	600289	亿阳信通	500	9,965.00	0.27
141	600825	新华传媒	600	9,954.00	0.27
142	600284	浦东建设	600	9,786.00	0.26
143	600565	迪马股份	800	9,704.00	0.26
144	600206	有研新材	600	9,702.00	0.26
145	600990	四创电子	100	9,632.00	0.26
146	600422	昆药集团	260	9,601.80	0.26
147	600481	双良节能	400	9,580.00	0.26
148	600269	赣粤高速	1,400	9,520.00	0.25
149	600112	天成控股	500	9,500.00	0.25
150	601002	晋亿实业	600	9,492.00	0.25
151	600756	浪潮软件	300	9,468.00	0.25
152	600859	王府井	300	9,450.00	0.25
153	600123	兰花科创	800	9,408.00	0.25
154	600033	福建高速	1,599	9,370.14	0.25
155	601369	陕鼓动力	800	9,368.00	0.25
156	600546	山煤国际	1,100	9,361.00	0.25
157	600059	古越龙山	600	9,192.00	0.24
158	601238	广汽集团	600	9,180.00	0.24
159	601126	四方股份	300	9,150.00	0.24

160	600078	澄星股份	600	9,138.00	0.24
161	600300	维维股份	900	9,135.00	0.24
162	600736	苏州高新	800	9,112.00	0.24
163	600572	康恩贝	398	9,034.60	0.24
164	600545	新疆城建	600	9,006.00	0.24
165	603077	和邦股份	431	8,964.80	0.24
166	600754	锦江股份	300	8,940.00	0.24
167	600824	益民集团	900	8,937.00	0.24
168	600778	友好集团	552	8,887.20	0.24
169	600004	白云机场	522	8,821.80	0.23
170	600970	中材国际	600	8,772.00	0.23
171	600420	现代制药	200	8,700.00	0.23
172	600552	方兴科技	300	8,679.00	0.23
173	600640	号百控股	300	8,664.00	0.23
174	603019	中科曙光	100	8,659.00	0.23
175	601016	节能风电	300	8,658.00	0.23
176	600684	珠江实业	600	8,628.00	0.23
177	600577	精达股份	1,100	8,602.00	0.23
178	600180	瑞茂通	300	8,598.00	0.23
179	600884	杉杉股份	300	8,580.00	0.23
180	600239	云南城投	900	8,550.00	0.23
181	600761	安徽合力	511	8,549.03	0.23
182	601880	大连港	1,182	8,510.40	0.23
183	600666	西南药业	200	8,510.00	0.23
184	601139	深圳燃气	810	8,505.00	0.23
185	600363	联创光电	489	8,503.71	0.23
186	600794	保税科技	860	8,496.80	0.23
187	600460	士兰微	920	8,491.60	0.23
188	601908	京运通	404	8,475.92	0.23
189	600509	天富能源	600	8,442.00	0.22
190	600195	中牧股份	300	8,430.00	0.22
191	600621	华鑫股份	500	8,420.00	0.22
192	600321	国栋建设	1,100	8,415.00	0.22
193	600261	阳光照明	1,033	8,398.29	0.22
194	600596	新安股份	600	8,364.00	0.22
195	600559	老白干酒	100	8,352.00	0.22
196	600526	菲达环保	400	8,340.00	0.22
197	601001	大同煤业	900	8,316.00	0.22
198	600251	冠农股份	600	8,298.00	0.22

199	600775	南京熊猫	400	8,272.00	0.22
200	600260	凯乐科技	500	8,225.00	0.22
201	600496	精工钢构	1,117	8,165.27	0.22
202	600486	扬农化工	225	8,095.50	0.22
203	600020	中原高速	1,090	8,087.80	0.22
204	600784	鲁银投资	503	8,073.15	0.22
205	601218	吉鑫科技	800	8,064.00	0.21
206	600375	华菱星马	604	8,063.40	0.21
207	600351	亚宝药业	591	8,002.14	0.21
208	601233	桐昆股份	400	7,984.00	0.21
209	600405	动力源	500	7,915.00	0.21
210	600687	刚泰控股	200	7,850.00	0.21
211	600257	大湖股份	463	7,824.70	0.21
212	601886	江河创建	523	7,782.24	0.21
213	600729	重庆百货	238	7,658.84	0.20
214	600335	国机汽车	200	7,586.00	0.20
215	600586	金晶科技	1,100	7,568.00	0.20
216	600329	中新药业	300	7,557.00	0.20
217	601789	宁波建工	400	7,520.00	0.20
218	600396	金山股份	585	7,447.05	0.20
219	600846	同济科技	600	7,434.00	0.20
220	600720	祁连山	700	7,413.00	0.20
221	600750	江中药业	230	7,403.70	0.20
222	600818	中路股份	100	7,278.00	0.19
223	600323	瀚蓝环境	420	7,257.60	0.19
224	600616	金枫酒业	453	7,107.57	0.19
225	600491	龙元建设	600	7,080.00	0.19
226	600382	广东明珠	400	7,020.00	0.19
227	601678	滨化股份	778	6,978.66	0.19
228	600439	瑞贝卡	800	6,976.00	0.19
229	600073	上海梅林	539	6,974.66	0.19
230	600776	东方通信	420	6,925.80	0.18
231	601158	重庆水务	644	6,916.56	0.18
232	600141	兴发集团	400	6,892.00	0.18
233	601101	昊华能源	600	6,840.00	0.18
234	600273	嘉化能源	400	6,840.00	0.18
235	600831	广电网络	400	6,788.00	0.18
236	600993	马应龙	211	6,770.99	0.18
237	600641	万业企业	600	6,738.00	0.18

238	600668	尖峰集团	400	6,700.00	0.18
239	600628	新世界	400	6,700.00	0.18
240	603167	渤海轮渡	400	6,652.00	0.18
241	600318	巢东股份	270	6,617.70	0.18
242	600965	福成五丰	400	6,600.00	0.18
243	601777	力帆股份	413	6,521.27	0.17
244	600551	时代出版	300	6,513.00	0.17
245	600864	哈投股份	400	6,480.00	0.17
246	600088	中视传媒	200	6,454.00	0.17
247	600708	海博股份	497	6,446.09	0.17
248	600280	中央商场	460	6,380.20	0.17
249	600438	通威股份	400	6,292.00	0.17
250	600657	信达地产	763	6,287.12	0.17
251	600285	羚锐制药	500	6,280.00	0.17
252	600468	百利电气	269	6,270.39	0.17
253	600830	香溢融通	400	6,180.00	0.16
254	600523	贵航股份	200	6,166.00	0.16
255	600292	中电远达	200	6,108.00	0.16
256	600742	一汽富维	200	6,096.00	0.16
257	600636	三爱富	300	6,084.00	0.16
258	600650	锦江投资	292	6,070.68	0.16
259	600305	恒顺醋业	200	6,038.00	0.16
260	600997	开滦股份	700	6,034.00	0.16
261	600501	航天晨光	200	6,032.00	0.16
262	600350	山东高速	704	6,026.24	0.16
263	600510	黑牡丹	385	5,975.20	0.16
264	600971	恒源煤电	646	5,910.90	0.16
265	600566	济川药业	200	5,896.00	0.16
266	600995	文山电力	423	5,875.47	0.16
267	603308	应流股份	200	5,848.00	0.16
268	601801	皖新传媒	200	5,834.00	0.16
269	600268	国电南自	391	5,735.97	0.15
270	603188	亚邦股份	200	5,732.00	0.15
271	601567	三星电气	400	5,692.00	0.15
272	600624	复旦复华	300	5,640.00	0.15
273	600377	宁沪高速	581	5,624.08	0.15
274	601010	文峰股份	575	5,617.75	0.15
275	601313	江南嘉捷	300	5,613.00	0.15
276	600780	通宝能源	578	5,612.38	0.15

277	600480	凌云股份	236	5,560.16	0.15
278	600425	青松建化	566	5,558.12	0.15
279	600333	长春燃气	463	5,542.11	0.15
280	600850	华东电脑	100	5,539.00	0.15
281	600188	兖州煤业	400	5,500.00	0.15
282	600617	国新能源	300	5,481.00	0.15
283	601969	海南矿业	300	5,469.00	0.15
284	600987	航民股份	400	5,424.00	0.14
285	600507	方大特钢	600	5,424.00	0.14
286	600730	中国高科	200	5,396.00	0.14
287	600114	东睦股份	300	5,388.00	0.14
288	600290	华仪电气	400	5,376.00	0.14
289	600537	亿晶光电	300	5,370.00	0.14
290	601700	风范股份	500	5,370.00	0.14
291	600612	老凤祥	100	5,354.00	0.14
292	601107	四川成渝	776	5,346.64	0.14
293	600012	皖通高速	402	5,217.96	0.14
294	600167	联美控股	200	5,152.00	0.14
295	600874	创业环保	400	5,100.00	0.14
296	600724	宁波富达	518	5,029.78	0.13
297	600561	江西长运	258	5,025.84	0.13
298	603699	纽威股份	200	4,998.00	0.13
299	603993	洛阳钼业	400	4,944.00	0.13
300	600386	北巴传媒	300	4,878.00	0.13
301	600190	锦州港	609	4,847.64	0.13
302	600568	中珠控股	200	4,820.00	0.13
303	600743	华远地产	596	4,785.88	0.13
304	600814	杭州解百	300	4,782.00	0.13
305	600988	赤峰黄金	300	4,737.00	0.13
306	600162	香江控股	400	4,692.00	0.12
307	600119	长江投资	200	4,674.00	0.12
308	600197	伊力特	300	4,665.00	0.12
309	600459	贵研铂业	200	4,658.00	0.12
310	603128	华贸物流	400	4,656.00	0.12
311	600173	卧龙地产	500	4,610.00	0.12
312	600973	宝胜股份	300	4,569.00	0.12
313	600532	宏达矿业	254	4,505.96	0.12
314	600132	重庆啤酒	200	4,504.00	0.12
315	600007	中国国贸	289	4,401.47	0.12

316	600378	天科股份	212	4,379.92	0.12
317	600888	新疆众和	363	4,374.15	0.12
318	600467	好当家	460	4,314.80	0.11
319	601965	中国汽研	328	4,267.28	0.11
320	600479	千金药业	200	4,238.00	0.11
321	603555	贵人鸟	100	4,178.00	0.11
322	600168	武汉控股	300	4,143.00	0.11
323	600858	银座股份	300	4,116.00	0.11
324	601208	东材科技	360	4,111.20	0.11
325	600248	延长化建	300	4,068.00	0.11
326	600403	大有能源	454	4,058.76	0.11
327	600278	东方创业	200	4,048.00	0.11
328	601515	东风股份	200	4,040.00	0.11
329	600135	乐凯胶片	200	4,000.00	0.11
330	603698	航天工程	100	3,942.00	0.11
331	601339	百隆东方	400	3,880.00	0.10
332	600397	安源煤业	400	3,868.00	0.10
333	600327	大东方	300	3,726.00	0.10
334	603169	兰石重装	200	3,698.00	0.10
335	600295	鄂尔多斯	300	3,600.00	0.10
336	601199	江南水务	100	3,526.00	0.09
337	601222	林洋电子	100	3,509.00	0.09
338	600661	新南洋	100	3,453.00	0.09
339	600976	健民集团	100	3,404.00	0.09
340	601231	环旭电子	200	3,402.00	0.09
341	600716	凤凰股份	300	3,330.00	0.09
342	600697	欧亚集团	107	3,314.86	0.09
343	601798	蓝科高新	200	3,292.00	0.09
344	600513	联环药业	116	3,278.16	0.09
345	600802	福建水泥	300	3,264.00	0.09
346	601636	旗滨集团	300	3,219.00	0.09
347	601226	华电重工	200	3,182.00	0.08
348	600983	惠而浦	200	3,178.00	0.08
349	600801	华新水泥	300	3,171.00	0.08
350	600828	成商集团	300	3,132.00	0.08
351	600389	江山股份	100	3,124.00	0.08
352	601038	一拖股份	212	3,099.44	0.08
353	600563	法拉电子	100	3,095.00	0.08
354	600882	华联矿业	230	3,086.60	0.08

355	603328	依顿电子	100	3,066.00	0.08
356	600897	厦门空港	100	3,061.00	0.08
357	600785	新华百货	131	2,867.59	0.08
358	600623	双钱股份	100	2,769.00	0.07
359	600080	金花股份	200	2,666.00	0.07
360	600101	明星电力	200	2,658.00	0.07
361	601996	丰林集团	200	2,622.00	0.07
362	603399	新华龙	140	2,588.60	0.07
363	600449	宁夏建材	200	2,582.00	0.07
364	600548	深高速	299	2,556.45	0.07
365	600917	重庆燃气	200	2,528.00	0.07
366	600833	第一医药	100	2,300.00	0.06
367	600258	首旅酒店	123	2,281.65	0.06
368	600054	黄山旅游	100	2,223.00	0.06
369	600081	东风科技	100	2,121.00	0.06
370	603609	禾丰牧业	100	1,924.00	0.05
371	600116	三峡水利	100	1,775.00	0.05
372	601015	陕西黑猫	100	1,739.00	0.05
373	603126	中材节能	100	1,547.00	0.04

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600009	上海机场	100,999.00	1.10
2	601106	中国一重	68,019.00	0.74
3	600601	方正科技	50,640.00	0.55
4	600436	片仔癀	50,613.00	0.55
5	603168	莎普爱思	42,397.00	0.46
6	600219	南山铝业	36,840.00	0.40
7	600399	抚顺特钢	33,008.00	0.36
8	600522	中天科技	32,923.00	0.36
9	600026	中海发展	31,450.00	0.34

10	600600	青岛啤酒	31,068.00	0.34
11	600880	博瑞传播	30,758.00	0.33
12	600398	海澜之家	29,936.00	0.32
13	600063	皖维高新	27,972.00	0.30
14	600348	阳泉煤业	27,676.00	0.30
15	601021	春秋航空	23,800.00	0.26
16	600990	四创电子	23,169.00	0.25
17	600267	海正药业	23,073.00	0.25
18	603019	中科曙光	22,754.00	0.25
19	600648	外高桥	22,682.00	0.25
20	601588	北辰实业	21,006.00	0.23

注：买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	600415	小商品城	95,032.48	1.03
2	600029	南方航空	88,840.81	0.96
3	601106	中国一重	85,786.88	0.93
4	601727	上海电气	80,451.30	0.87
5	600068	葛洲坝	55,151.70	0.60
6	600153	建发股份	53,873.75	0.58
7	600219	南山铝业	53,192.00	0.58
8	600005	武钢股份	53,057.92	0.58
9	600777	新潮实业	51,386.40	0.56
10	601991	大唐发电	49,838.07	0.54
11	601111	中国国航	42,336.00	0.46
12	600873	梅花生物	42,306.32	0.46
13	600660	福耀玻璃	41,540.80	0.45
14	600867	通化东宝	41,494.06	0.45
15	600238	海南椰岛	40,804.21	0.44
16	601898	中煤能源	39,984.08	0.43
17	600009	上海机场	34,490.00	0.37
18	600677	航天通信	32,644.00	0.35
19	600110	中科英华	28,490.00	0.31

20	600584	长电科技	27,488.00	0.30

注：卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	2,084,760.00
卖出股票收入（成交）总额	2,210,720.07

注：买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，根据风险管理的原则，以套期保值为目的投资，从而降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，由于更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

7.11 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，本基金暂不可投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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情况，在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

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。

7.12.3 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	1,183.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	38.39
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,221.89

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资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	601718	际华集团	42,336.00	1.13	重大事项
2	600410	华胜天成	38,272.00	1.02	重大事项
3	600978	宜华木业	31,416.00	0.84	重大事项
4	600587	新华医疗	30,604.86	0.82	重大事项

5	600872	中炬高新	30,268.00	0.81	重大事项
6	600482	风帆股份	27,970.80	0.75	重大事项

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

§8 基金份额持有人信息

8.1 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
185	9,322.44	6,918.00	0.40%	1,717,734.00	99.60%

8.2 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	赵兴春	231,000.00	13.39%
2	黄铭月	129,300.00	7.50%
3	李秉其	100,000.00	5.80%
4	万强	100,000.00	5.80%
5	吴志明	96,000.00	5.57%
6	王伯英	91,050.00	5.28%
7	赵建军	71,000.00	4.12%
8	张鸿霏	50,800.00	2.95%
9	李晓明	50,000.00	2.90%
10	廖卓鹏	47,750.00	2.77%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 10 月 31 日）基金份额总额	500,724,652.00
本报告期期初基金份额总额	6,724,652.00
本报告期基金总申购份额	12,000,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	17,000,000.00
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	1,724,652.00

注：本基金合同生效日为 2013 年 10 月 31 日。

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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：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。

2015 年 5 月 23 日本公司发布公告，聘任姚霞天为本基金基金经理，原基金经理吴涛因个人原因离职，不再担任本基金基金经理。

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。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 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。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
国泰君安	2	4,295,480.07	100.00%	3,651.04	100.00%	-

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、报告期内基金租用证券公司交易单元的变更情况：

无。

10.7.2 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	成交金额	占当期债券回购	成交金额	占当期权证成交总额的

		例		成交总额的比例		比例
国泰君安	-	-	-	-	-	-

§11 影响投资者决策的其他重要信息

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处理进行估值。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%。

§12 备查文件目录

12.1 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、《万家上证 380 交易型开放式指数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、万家上证 380 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年半年度报告原文。

6、万家基金管理有限公司董事会决议。

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所，并登载于基金管理人网站：www.wjasset.com。

12.3 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
2015 年 8 月 26 日