

# 万家上证 380 交易型开放式指数证券投资 基金 2014 年半年度报告

2014 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：2014 年 8 月 27 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 2014 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 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
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合规守信情况的说明.....	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.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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真实、准确和完整发表意见.....	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
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.....	15
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>30</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	30
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.....	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43

7.12 投资组合报告附注.....	44
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
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.....	45
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>45</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>47</b>
11.1 备查文件目录.....	47
11.2 存放地点.....	48
11.3 查阅方式.....	48

## § 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
交易代码	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	51,724,652.00 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 年 12 月 2 日

### 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	郑鹏

	联系电话	021-38619810	010-85238667
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	zhjtg@hxb.com.cn
客户服务电话		95538 转 6、4008880800	95577
传真		021-38619888	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	<a href="http://www.wjasset.com">http://www.wjasset.com</a>
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(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-354,079.63
本期利润	3,423,282.88
加权平均基金份额本期利润	0.0461
本期加权平均净值利润率	4.84%
本期基金份额净值增长率	0.75%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-1,713,330.93
期末可供分配基金份额利润	-0.0331
期末基金资产净值	50,011,321.07
期末基金份额净值	0.9669
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)

基金份额累计净值增长率	-3.31%
-------------	--------

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。

4、本基金合同生效日为 2013 年 10 月 31 日，截至 2014 年 6 月 30 日不满一年。

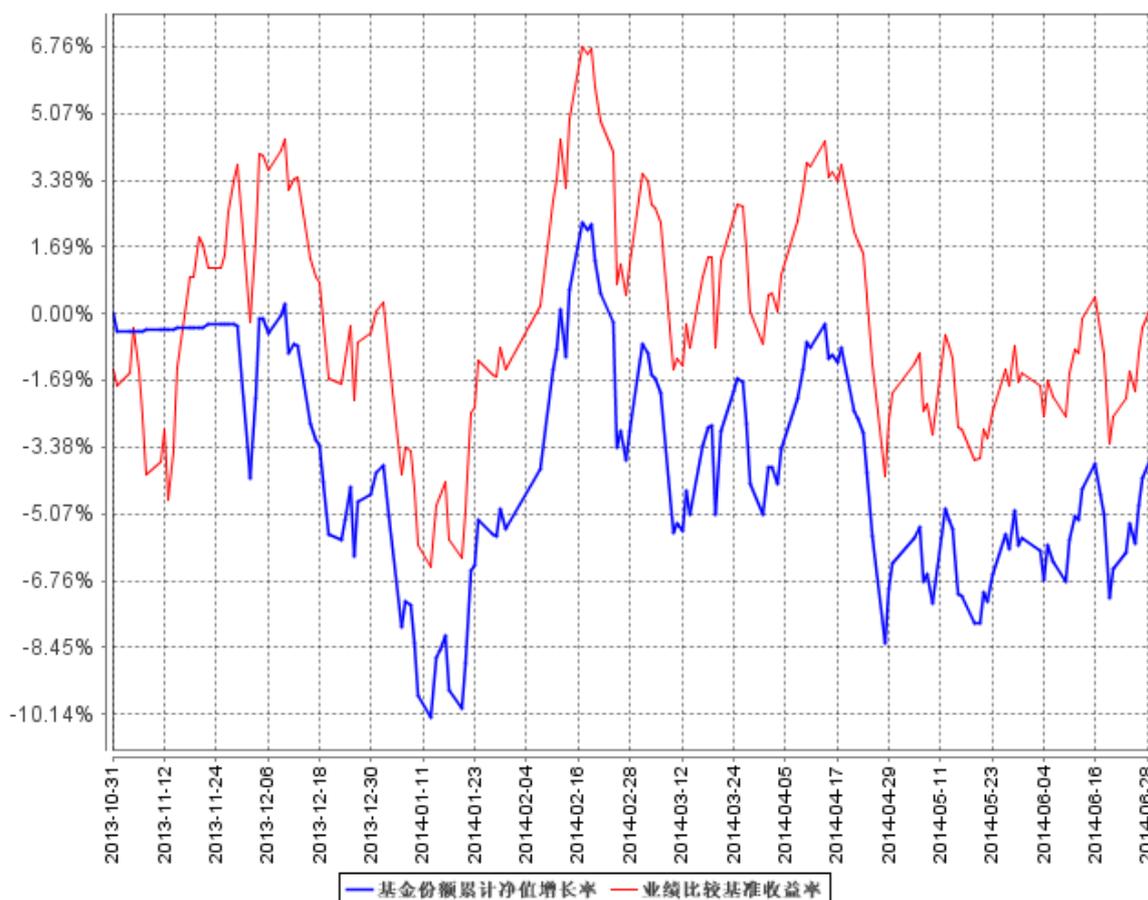
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	2.52%	0.88%	2.09%	0.88%	0.43%	0.00%
过去三个月	1.89%	0.98%	1.34%	0.99%	0.55%	-0.01%
过去六个月	0.75%	1.16%	0.46%	1.17%	0.29%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-3.31%	1.11%	0.54%	1.19%	-3.85%	-0.08%

### 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

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 2013 年 10 月 31 日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年；  
2、本基金的建仓期为自基金合同生效日起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合基金合同要求。

## § 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 号陆家嘴投资大厦 9 楼，注册资本 1 亿元人民币。目前管理十八只基金，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、万家行业优选股票型证券投资基金（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、万家精选股票型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数型证券投资基金（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、万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金、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、万家市政纯债定期开放债券型证券投资基金和万家城市建设主题纯债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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张鹏	本基金基金经理、万家中证红利指数证券投资基金（LOF）基金经理、量化投资部副总监	2013 年 10 月 31 日	-	5 年	复旦大学经济学硕士，FRM，长期从事金融工程研究和量化投资工作，曾任上海银行风险管理部 副 主 管、信诚基金量化投资部副 总 监 等 职，2012 年 5 月 14 日加入万家基金管理有限公司任量化投资部副 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,执行交易系统内的公平交易程序;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%的交易次数为 1 次,为指数型基金因被动跟踪标的指数与其他组合发生同日反向交易,不存在不公平交易和利益输送行为。

### 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

2014 年上半年,中央出台了多项定向的、结构性的“微刺激”政策,宏观经济稍有好转,工业增加值同比略有反弹,PMI 指数改善,PPI 环比跌幅收窄,但是地产投资下滑态势没有得到遏制,经济趋势下行的压力依然存在。货币政策保持宽松态势,定向降准,社会融资规模有所回升。从市场表现来看,A 股市场仍然处于存量资金博弈阶段,大盘类指数窄幅震荡,创业板指数在一季度创出新高后回落,二季度虽然有所反弹,但见顶迹象明显。报告期本基金投资标的指数——上证 380 指数收益率为 0.46%。

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 0.9669 元，报告期内基金份额净值增长率为 0.75%，同期业绩比较基准收益率为 0.46%。本基金日均跟踪偏离度为 0.0233%，年化跟踪误差 0.3609%，符合基金合同中日均跟踪偏离度低于 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

展望 2014 年下半年，若后续政策持续，我们预计宏观经济将出现短周期反弹，工业企业盈利将出现改善，货币政策进一步宽松概率较大。从资金面来看，下半年 A 股市场有望改变存量资金博弈的局面，沪港直通将加速海外资金流入 A 股的趋势。因此，我们认为下半年 A 股市场有望出现一波估值修复行情，从行业配置角度，我们认为应该把握政策主线，前期配置价值类行业，后期再轮换成成长类行业。

被动型指数基金的产品设计运作思路下，管理人日常运作中尽量避免用自己的观点判断干扰基金的运作。

#### 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。

### § 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 2014 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：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	575,742.27	129,387.77
结算备付金		2,957.91	4,593,144.92
存出保证金		9,699.64	351,397.87
交易性金融资产	6.4.7.2	49,714,280.99	137,970,710.48
其中：股票投资		49,714,280.99	137,970,710.48
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		-	473,781.79
应收利息	6.4.7.5	114.80	2,497.77
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		50,302,795.61	143,520,920.60
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014年6月30日</b>	<b>上年度末 2013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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		667.97	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		20,549.95	89,959.91
应付托管费		4,109.99	17,992.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	12,831.14	516,086.81
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	253,315.49	163,695.65
负债合计		291,474.54	787,734.38
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	51,724,652.00	148,724,652.00
未分配利润	6.4.7.10	-1,713,330.93	-5,991,465.78
所有者权益合计		50,011,321.07	142,733,186.22
负债和所有者权益总计		50,302,795.61	143,520,920.60

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9669 元，基金份额总额 51,724,652.00 份。

## 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
-----	-----	---------------------------------------

一、收入		3,964,232.28
1.利息收入		5,384.50
其中：存款利息收入	6.4.7.11	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）		182,070.97
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-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		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	522,142.54
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	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）	6.4.7.17	-585.70
<b>减：二、费用</b>		540,949.40
1. 管理人报酬		179,757.13
2. 托管费		35,951.44
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	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	6.4.7.19	287,337.15
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		3,423,282.88
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		3,423,282.88

注：本基金合同生效日为2013年10月31日，无上年度可比期间数据。

### 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：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	本期
	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

基金管理人负责人

李杰

主管会计工作负责人

陈广益

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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 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 2014 年 6 月 30 日
活期存款	575,742.27
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	575,742.27

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	50,918,537.96	49,714,280.99	-1,204,256.97
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	50,918,537.96	49,714,280.99	-1,204,256.97

注：于 2014 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

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

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**

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 2014年6月30日
应收活期存款利息	108.96
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	1.44
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	4.40
合计	114.80

**6.4.7.6 其他资产**

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 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	12,831.14
银行间市场应付交易费用	-
合计	12,831.14

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2014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	148,767.52
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	253,315.49
----	------------

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	148,724,652.00	148,724,652.00
本期申购	3,000,000.00	3,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-100,000,000.00	-100,000,000.00
本期末	51,724,652.00	51,724,652.00

#### 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	-3,774,242.98	-2,217,222.80	-5,991,465.78
本期利润	-354,079.63	3,777,362.51	3,423,282.88
本期基金份额交易产生的变动数	2,982,593.35	-2,127,741.38	854,851.97
其中：基金申购款	-58,997.87	-14,440.89	-73,438.76
基金赎回款	3,041,591.22	-2,113,300.49	928,290.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,145,729.26	-567,601.67	-1,713,330.93

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
	活期存款利息收入
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	1,336.83
其他	2,963.13
合计	5,384.50

### 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-137,619.07
股票投资收益——赎回差价收入	-202,452.50
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-340,071.57

#### 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	11,060,788.07
减：卖出股票成本总额	11,198,407.14
买卖股票差价收入	-137,619.07

#### 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	99,071,709.27
减：现金支付赎回款总额	-1,008,596.73
减：赎回股票成本总额	100,282,758.50
赎回差价收入	-202,452.50

### 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 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具投资收益。

### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	522,142.54

基金投资产生的股利收益	-
合计	522,142.54

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	3,777,362.51
——股票投资	3,777,362.51
——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	3,777,362.51

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-585.70
合计	-585.70

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。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	37,903.68
银行间市场交易费用	-
合计	37,903.68

### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	148,767.52
上市年费	29,752.78
指数使用费	84,004.16
银行汇划费用	17.50
合计	287,337.15

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
	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	179,757.13
其中：支付销售机构的客户维护费	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：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	35,951.44

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：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

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自有资金投资本基金。

**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 2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
华夏银行股份有限公司	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，2014年1月1日至6月30日获得的利息为人民币1,336.83元，2014年6月30日结算备付金余额为人民币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****6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

本基金本报告期未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2014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
601012	隆基股份	2014年6月19日	重大事项	15.50	2014年7月1日	15.60	11,400	153,650.38	176,700.00	-
600582	天地科技	2014年6月26日	重大事项	7.97	未知	未知	17,190	126,666.03	137,004.30	-
600685	广船国际	2014年4月8日	重大事项	17.13	未知	未知	7,500	123,675.78	128,475.00	-
600210	紫江企业	2014年6月26日	重大事项	2.96	2014年7月3日	3.18	40,601	131,491.82	120,178.96	-
600864	哈投股份	2014年4月11日	重大事项	8.68	2014年7月15日	8.30	11,970	120,455.17	103,899.60	-

600260	凯乐科技	2014 年 6 月 9 日	重大事项	6.59	未知	未知	14,993	116,638.56	98,803.87	-
600378	天科股份	2014 年 6 月 18 日	重大事项	12.84	2014 年 7 月 23 日	13.50	6,600	73,957.09	84,744.00	-
600682	南京新百	2014 年 3 月 3 日	重大事项	11.64	2014 年 7 月 4 日	11.20	6,902	81,541.02	80,339.28	-
600227	赤天化	2014 年 6 月 6 日	重大事项	2.84	未知	未知	27,651	81,214.99	78,528.84	-
600135	乐凯胶片	2014 年 6 月 30 日	重大事项	8.87	2014 年 7 月 14 日	9.76	8,500	72,226.82	75,395.00	-
601777	力帆股份	2014 年 6 月 24 日	重大事项	6.39	2014 年 7 月 8 日	6.70	10,900	72,276.12	69,651.00	-
600850	华东电脑	2014 年 4 月 4 日	重大事项	19.56	2014 年 7 月 11 日	21.52	3,281	66,455.03	64,176.36	-
600295	鄂尔多斯	2014 年 5 月 6 日	重大事项	7.38	未知	未知	8,124	60,889.13	59,955.12	-
600666	西南药业	2014 年 4 月 25 日	重大事项	7.31	2014 年 8 月 12 日	8.04	7,500	52,284.28	54,825.00	-

### 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 2014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	575,742.27	-	-	-	-	-	575,742.27
结算备付金	2,957.91	-	-	-	-	-	2,957.91

存出保证金	9,699.64	-	-	-	-	-	9,699.64
交易性金融资产	-	-	-	-	-	49,714,280.99	49,714,280.99
应收利息	-	-	-	-	-	114.80	114.80
资产总计	588,399.82	-	-	-	-	49,714,395.79	50,302,795.61
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	667.97	667.97
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	20,549.95	20,549.95
应付托管费	-	-	-	-	-	4,109.99	4,109.99
应付交易费用	-	-	-	-	-	12,831.14	12,831.14
其他负债	-	-	-	-	-	253,315.49	253,315.49
负债总计	-	-	-	-	-	291,474.54	291,474.54
利率敏感度缺口	588,399.82	-	-	-	-	49,422,921.25	50,011,321.07
上年度末 2013 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	129,387.77	-	-	-	-	-	129,387.77
结算备付金	4,593,144.92	-	-	-	-	-	4,593,144.92
存出保证金	351,397.87	-	-	-	-	-	351,397.87
交易性金融资产	-	-	-	-	-	137,970,710.48	137,970,710.48
应收证券清算款	-	-	-	-	-	473,781.79	473,781.79
应收利息	-	-	-	-	-	2,497.77	2,497.77
资产总计	5,073,930.56	-	-	-	-	138,446,990.04	143,520,920.60
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	89,959.91	89,959.91
应付托管费	-	-	-	-	-	17,992.01	17,992.01
应付交易费用	-	-	-	-	-	516,086.81	516,086.81
其他负债	-	-	-	-	-	163,695.65	163,695.65
负债总计	-	-	-	-	-	787,734.38	787,734.38
利率敏感度缺口	5,073,930.56	-	-	-	-	137,659,255.66	142,733,186.22

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

本基金本报告期末计息资产仅包括银行存款、结算备付金及存出保证金，且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其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本报告期末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

#### 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 2014年6月30日		上年度末 2013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	49,714,280.99	99.41	137,970,710.48	96.66
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	49,714,280.99	99.41	137,970,710.48	96.66

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	1、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；		
	2、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；		
	3、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（2014年6月30日）	上年度末（2013年12月31日）

	上证 380 指数上涨 1%	482,439.40	1,369,226.98
	上证 380 指数下跌 1%	-482,439.40	-1,369,226.98

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	49,714,280.99	98.83
	其中：股票	49,714,280.99	98.83
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	578,700.18	1.15
7	其他各项资产	9,814.44	0.02
8	合计	50,302,795.61	100.00

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项中不含可退替代款估值增值。

### 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	248,041.07	0.50
B	采矿业	1,836,298.51	3.67
C	制造业	26,694,082.07	53.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,352,363.97	6.70
E	建筑业	2,037,345.22	4.07

F	批发和零售业	5,103,178.36	10.20
G	交通运输、仓储和邮政业	4,420,456.33	8.84
H	住宿和餐饮业	108,043.44	0.22
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,544,692.11	5.09
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,202,886.58	2.41
L	租赁和商务服务业	466,929.82	0.93
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	195,521.25	0.39
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	445,373.01	0.89
S	综合	1,059,069.25	2.12
	合计	49,714,280.99	99.41

## 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	600570	恒生电子	17,803	523,408.20	1.05
2	600660	福耀玻璃	50,304	422,553.60	0.84
3	600594	益佰制药	9,984	410,641.92	0.82
4	601991	大唐发电	107,601	383,059.56	0.77
5	600587	新华医疗	5,011	373,570.05	0.75
6	601929	吉视传媒	31,624	361,778.56	0.72
7	600557	康缘药业	12,576	360,931.20	0.72
8	600642	申能股份	81,683	352,870.56	0.71
9	600879	航天电子	29,855	351,691.90	0.70
10	600312	平高电气	24,483	341,293.02	0.68
11	600867	通化东宝	25,734	335,314.02	0.67
12	600153	建发股份	60,975	332,313.75	0.66
13	600201	金宇集团	10,239	318,637.68	0.64
14	601018	宁波港	137,819	312,849.13	0.63

15	601333	广深铁路	121,858	309,519.32	0.62
16	600068	葛洲坝	82,633	306,568.43	0.61
17	600433	冠豪高新	30,000	306,300.00	0.61
18	600872	中炬高新	28,457	303,636.19	0.61
19	601618	中国中冶	175,082	299,390.22	0.60
20	600388	龙净环保	12,322	297,576.30	0.60
21	600398	海澜之家	32,300	297,160.00	0.59
22	600967	北方创业	23,640	296,682.00	0.59
23	600005	武钢股份	145,134	294,622.02	0.59
24	600029	南方航空	126,100	291,291.00	0.58
25	600873	梅花生物	55,826	286,387.38	0.57
26	600517	置信电气	26,935	273,659.60	0.55
27	600525	长园集团	24,777	273,538.08	0.55
28	601727	上海电气	70,766	271,741.44	0.54
29	600584	长电科技	30,630	270,462.90	0.54
30	600694	大商股份	10,579	270,081.87	0.54
31	600655	豫园商城	36,141	265,997.76	0.53
32	600522	中天科技	20,301	265,740.09	0.53
33	601898	中煤能源	65,832	265,302.96	0.53
34	600138	中青旅	12,167	264,997.26	0.53
35	601179	中国西电	73,700	263,109.00	0.53
36	600863	内蒙华电	69,633	262,516.41	0.52
37	600027	华电国际	85,300	261,871.00	0.52
38	600688	上海石化	78,739	259,051.31	0.52
39	600307	酒钢宏兴	112,600	252,224.00	0.50
40	600881	亚泰集团	68,149	250,788.32	0.50
41	600811	东方集团	47,931	248,761.89	0.50
42	600175	美都控股	43,195	248,371.25	0.50
43	600654	飞乐股份	27,197	246,132.85	0.49
44	600820	隧道股份	50,100	242,985.00	0.49
45	600037	歌华有线	22,917	241,086.84	0.48
46	600717	天津港	30,063	239,902.74	0.48
47	601877	正泰电器	10,895	238,709.45	0.48
48	600638	新黄浦	16,170	237,699.00	0.48
49	600511	国药股份	10,348	234,899.60	0.47
50	600200	江苏吴中	22,466	233,421.74	0.47
51	601238	广汽集团	30,313	228,256.89	0.46
52	600635	大众公用	47,299	226,562.21	0.45
53	601231	环旭电子	7,288	224,761.92	0.45

54	600805	悦达投资	24,419	224,410.61	0.45
55	600436	片仔癀	2,827	219,177.31	0.44
56	600410	华胜天成	18,367	218,383.63	0.44
57	600110	中科英华	41,435	217,533.75	0.43
58	600664	哈药股份	34,423	214,111.06	0.43
59	600216	浙江医药	23,100	211,365.00	0.42
60	600432	吉恩镍业	14,608	210,939.52	0.42
61	600062	华润双鹤	12,155	208,944.45	0.42
62	600978	宜华木业	42,731	208,527.28	0.42
63	600261	阳光照明	20,889	206,383.32	0.41
64	600422	昆明制药	9,799	205,876.99	0.41
65	600219	南山铝业	41,002	205,830.04	0.41
66	600797	浙大网新	29,800	204,130.00	0.41
67	600478	科力远	8,973	203,328.18	0.41
68	601111	中国国航	61,300	201,677.00	0.40
69	600572	康恩贝	14,400	199,728.00	0.40
70	600651	飞乐音响	26,621	196,995.40	0.39
71	600139	西部资源	14,200	195,960.00	0.39
72	600777	新潮实业	22,500	195,525.00	0.39
73	600756	浪潮软件	7,832	195,173.44	0.39
74	600500	中化国际	29,979	193,064.76	0.39
75	600366	宁波韵升	12,900	191,436.00	0.38
76	600284	浦东建设	19,970	187,917.70	0.38
77	600183	生益科技	30,492	187,830.72	0.38
78	600323	瀚蓝环境	14,600	187,610.00	0.38
79	600112	天成控股	14,560	186,659.20	0.37
80	600776	东方通信	13,620	181,827.00	0.36
81	601106	中国一重	94,000	180,480.00	0.36
82	600351	亚宝药业	19,541	179,777.20	0.36
83	600835	上海机电	11,420	177,923.60	0.36
84	601012	隆基股份	11,400	176,700.00	0.35
85	600446	金证股份	5,721	175,863.54	0.35
86	600884	杉杉股份	10,226	175,784.94	0.35
87	600038	哈飞股份	6,270	174,494.10	0.35
88	600426	华鲁恒升	24,100	173,520.00	0.35
89	600611	大众交通	26,200	172,134.00	0.34
90	600161	天坛生物	9,270	170,382.60	0.34
91	601158	重庆水务	34,444	170,153.36	0.34
92	601666	平煤股份	41,725	168,569.00	0.34

93	600387	海越股份	10,926	164,764.08	0.33
94	600317	营口港	70,700	164,731.00	0.33
95	600704	物产中大	19,880	164,606.40	0.33
96	600673	东阳光科	13,370	163,782.50	0.33
97	600755	厦门国贸	33,600	162,960.00	0.33
98	600058	五矿发展	15,400	162,470.00	0.32
99	600343	航天动力	13,400	162,006.00	0.32
100	601001	大同煤业	29,500	161,365.00	0.32
101	600578	京能电力	48,839	161,168.70	0.32
102	600122	宏图高科	32,296	160,834.08	0.32
103	600545	新疆城建	19,500	159,900.00	0.32
104	600171	上海贝岭	19,400	158,304.00	0.32
105	600270	外运发展	13,062	157,788.96	0.32
106	600125	铁龙物流	32,700	157,614.00	0.32
107	600790	轻纺城	17,400	156,252.00	0.31
108	600160	巨化股份	31,967	154,720.28	0.31
109	600580	卧龙电气	20,100	154,167.00	0.31
110	600509	天富热电	19,102	154,153.14	0.31
111	600998	九州通	11,395	152,579.05	0.31
112	600662	强生控股	22,900	152,514.00	0.30
113	600056	中国医药	14,288	151,881.44	0.30
114	600377	宁沪高速	27,333	151,424.82	0.30
115	600536	中国软件	7,025	151,037.50	0.30
116	600761	安徽合力	15,311	150,660.24	0.30
117	600677	航天通信	10,400	150,176.00	0.30
118	600458	时代新材	16,559	146,050.38	0.29
119	600825	新华传媒	18,600	145,266.00	0.29
120	600289	亿阳信通	16,169	144,712.55	0.29
121	600409	三友化工	33,100	144,647.00	0.29
122	600188	兖州煤业	20,900	144,628.00	0.29
123	600017	日照港	55,477	143,685.43	0.29
124	600846	同济科技	18,200	142,870.00	0.29
125	600481	双良节能	14,550	142,153.50	0.28
126	601717	郑煤机	29,100	141,426.00	0.28
127	600285	羚锐制药	10,300	141,110.00	0.28
128	600098	广州发展	29,600	140,600.00	0.28
129	600667	太极实业	30,200	139,826.00	0.28
130	600059	古越龙山	17,537	139,769.89	0.28
131	600720	祁连山	22,291	139,764.57	0.28

132	600292	中电远达	7,275	138,516.00	0.28
133	601588	北辰实业	56,300	137,935.00	0.28
134	601718	际华集团	55,700	137,022.00	0.27
135	600582	天地科技	17,190	137,004.30	0.27
136	600626	申达股份	17,608	136,638.08	0.27
137	600064	南京高科	12,700	136,525.00	0.27
138	600460	士兰微	22,600	133,792.00	0.27
139	600527	江南高纤	28,410	132,674.70	0.27
140	600563	法拉电子	3,972	132,069.00	0.26
141	600363	联创光电	15,890	131,410.30	0.26
142	600859	王府井	8,300	131,140.00	0.26
143	601369	陕鼓动力	23,373	131,122.53	0.26
144	600502	安徽水利	18,200	131,040.00	0.26
145	600575	芜湖港	35,200	130,944.00	0.26
146	600566	洪城股份	5,609	129,567.90	0.26
147	601311	骆驼股份	12,073	129,422.56	0.26
148	600685	广船国际	7,500	128,475.00	0.26
149	600073	上海梅林	17,481	127,086.87	0.25
150	600132	重庆啤酒	8,516	127,058.72	0.25
151	601000	唐山港	29,000	127,020.00	0.25
152	600668	尖峰集团	12,194	126,329.84	0.25
153	600783	鲁信创投	7,800	125,268.00	0.25
154	600482	风帆股份	11,600	124,120.00	0.25
155	600742	一汽富维	5,995	123,916.65	0.25
156	600824	益民集团	22,036	123,621.96	0.25
157	600551	时代出版	7,403	123,408.01	0.25
158	600874	创业环保	15,480	123,066.00	0.25
159	601258	庞大集团	27,828	122,164.92	0.24
160	600120	浙江东方	10,810	122,153.00	0.24
161	600636	三爱富	9,600	121,248.00	0.24
162	600141	兴发集团	12,300	120,663.00	0.24
163	600528	中铁二局	26,049	120,606.87	0.24
164	600210	紫江企业	40,601	120,178.96	0.24
165	600329	中新药业	7,701	119,288.49	0.24
166	600300	维维股份	29,500	119,180.00	0.24
167	600628	新世界	15,200	117,952.00	0.24
168	600420	现代制药	6,325	117,328.75	0.23
169	601002	晋亿实业	13,900	116,760.00	0.23
170	600251	冠农股份	7,800	116,610.00	0.23

171	600729	重庆百货	5,941	116,087.14	0.23
172	600004	白云机场	16,487	116,068.48	0.23
173	600486	扬农化工	5,657	115,459.37	0.23
174	600612	老凤祥	4,537	114,831.47	0.23
175	600269	赣粤高速	41,600	114,400.00	0.23
176	600624	复旦复华	10,000	114,300.00	0.23
177	600993	马应龙	7,268	114,180.28	0.23
178	600826	兰生股份	7,691	113,980.62	0.23
179	601222	林洋电子	5,034	113,718.06	0.23
180	600389	江山股份	3,486	113,678.46	0.23
181	600096	云天化	15,968	112,255.04	0.22
182	600438	通威股份	11,800	111,982.00	0.22
183	600380	健康元	22,200	111,888.00	0.22
184	600395	盘江股份	17,500	111,475.00	0.22
185	600831	广电网络	14,113	109,093.49	0.22
186	600033	福建高速	49,529	108,468.51	0.22
187	600754	锦江股份	6,584	108,043.44	0.22
188	600567	山鹰纸业	53,700	107,937.00	0.22
189	600487	亨通光电	7,457	107,231.66	0.21
190	600970	中材国际	15,400	105,028.00	0.21
191	600495	晋西车轴	7,683	105,026.61	0.21
192	600586	金晶科技	35,800	104,536.00	0.21
193	601918	国投新集	37,400	104,346.00	0.21
194	600864	哈投股份	11,970	103,899.60	0.21
195	600238	海南椰岛	16,465	103,894.15	0.21
196	601886	江河创建	16,600	103,750.00	0.21
197	600350	山东高速	34,904	103,664.88	0.21
198	600298	安琪酵母	7,024	102,409.92	0.20
199	603766	隆鑫通用	11,487	101,545.08	0.20
200	600983	合肥三洋	7,810	101,373.80	0.20
201	600686	金龙汽车	11,300	101,135.00	0.20
202	600750	江中药业	6,383	100,021.61	0.20
203	600571	信雅达	5,100	99,399.00	0.20
204	600176	中国玻纤	12,800	99,328.00	0.20
205	600021	上海电力	22,722	99,295.14	0.20
206	600260	凯乐科技	14,993	98,803.87	0.20
207	600971	恒源煤电	18,300	97,722.00	0.20
208	600277	亿利能源	15,033	97,714.50	0.20
209	601880	大连港	37,100	97,573.00	0.20

210	601101	昊华能源	17,248	97,106.24	0.19
211	600391	成发科技	7,034	96,998.86	0.19
212	600496	精工钢构	14,800	96,644.00	0.19
213	600335	国机汽车	6,100	95,831.00	0.19
214	600405	动力源	7,900	95,511.00	0.19
215	600997	开滦股份	21,836	95,204.96	0.19
216	601139	深圳燃气	14,210	94,922.80	0.19
217	601058	赛轮股份	8,028	94,248.72	0.19
218	601608	中信重工	29,706	92,979.78	0.19
219	600708	海博股份	12,900	92,622.00	0.19
220	601515	东风股份	7,762	92,212.56	0.18
221	600039	四川路桥	16,500	92,070.00	0.18
222	600425	青松建化	19,466	91,684.86	0.18
223	600439	瑞贝卡	23,500	91,180.00	0.18
224	600403	大有能源	17,171	90,834.59	0.18
225	600830	香溢融通	11,700	90,090.00	0.18
226	600106	重庆路桥	25,658	90,059.58	0.18
227	600858	银座股份	12,834	89,966.34	0.18
228	601801	皖新传媒	6,700	89,579.00	0.18
229	600676	交运股份	15,799	89,422.34	0.18
230	600185	格力地产	10,670	89,414.60	0.18
231	600622	嘉宝集团	14,872	89,232.00	0.18
232	600976	武汉健民	4,461	89,130.78	0.18
233	601678	滨化股份	11,900	89,012.00	0.18
234	600526	菲达环保	10,137	88,800.12	0.18
235	600236	桂冠电力	32,257	88,706.75	0.18
236	600459	贵研铂业	5,487	88,176.09	0.18
237	600552	方兴科技	6,400	87,488.00	0.17
238	600479	千金药业	7,585	87,455.05	0.17
239	600428	中远航运	29,750	87,167.50	0.17
240	600088	中视传媒	6,000	87,120.00	0.17
241	600257	大湖股份	12,500	86,500.00	0.17
242	600470	六国化工	15,100	86,070.00	0.17
243	600467	好当家	15,660	85,347.00	0.17
244	600616	金枫酒业	10,922	85,191.60	0.17
245	600080	金花股份	8,500	85,170.00	0.17
246	600378	天科股份	6,600	84,744.00	0.17
247	600172	黄河旋风	13,200	84,744.00	0.17
248	600382	广东明珠	9,910	84,433.20	0.17

249	601965	中国汽研	6,824	84,412.88	0.17
250	600508	上海能源	10,704	84,347.52	0.17
251	600577	精达股份	17,900	84,309.00	0.17
252	601700	风范股份	6,432	84,259.20	0.17
253	600501	航天晨光	8,200	83,640.00	0.17
254	600794	保税科技	10,200	83,436.00	0.17
255	600082	海泰发展	18,336	83,428.80	0.17
256	601126	四方股份	5,850	83,070.00	0.17
257	600784	鲁银投资	16,510	82,715.10	0.17
258	600973	宝胜股份	10,100	82,012.00	0.16
259	600697	欧亚集团	4,507	80,404.88	0.16
260	600682	南京新百	6,902	80,339.28	0.16
261	600195	中牧股份	6,150	80,011.50	0.16
262	600963	岳阳林纸	26,390	79,433.90	0.16
263	600337	美克股份	13,800	79,212.00	0.16
264	600078	澄星股份	14,100	78,678.00	0.16
265	603366	日出东方	5,816	78,574.16	0.16
266	600227	赤天化	27,651	78,528.84	0.16
267	600614	鼎立股份	7,800	78,312.00	0.16
268	600114	东睦股份	6,850	78,295.50	0.16
269	600589	广东榕泰	15,200	77,824.00	0.16
270	600449	宁夏建材	10,501	76,867.32	0.15
271	600119	长江投资	6,500	75,920.00	0.15
272	600488	天药股份	17,421	75,432.93	0.15
273	600135	乐凯胶片	8,500	75,395.00	0.15
274	600888	新疆众和	13,663	74,599.98	0.15
275	600190	锦州港	18,909	74,123.28	0.15
276	600723	首商股份	11,900	73,066.00	0.15
277	600523	贵航股份	5,400	73,062.00	0.15
278	600559	老白干酒	3,480	72,975.60	0.15
279	600469	风神股份	7,800	72,852.00	0.15
280	600480	凌云股份	8,936	72,649.68	0.15
281	600007	中国国贸	7,465	72,111.90	0.14
282	600020	中原高速	32,200	71,806.00	0.14
283	600780	通宝能源	16,500	71,115.00	0.14
284	600979	广安爱众	15,500	70,835.00	0.14
285	603077	和邦股份	5,446	70,798.00	0.14
286	600657	信达地产	22,270	70,595.90	0.14
287	600386	北巴传媒	7,500	69,900.00	0.14

288	600396	金山股份	15,326	69,886.56	0.14
289	601777	力帆股份	10,900	69,651.00	0.14
290	600197	伊力特	7,700	69,608.00	0.14
291	600565	迪马股份	20,800	69,472.00	0.14
292	600568	中珠控股	7,600	68,932.00	0.14
293	600801	华新水泥	10,299	68,694.33	0.14
294	600375	华菱星马	6,050	68,304.50	0.14
295	600246	万通地产	22,038	67,215.90	0.13
296	600491	龙元建设	20,300	66,787.00	0.13
297	601566	九牧王	6,300	66,402.00	0.13
298	600468	百利电气	6,658	66,313.68	0.13
299	603167	渤海轮渡	6,900	66,033.00	0.13
300	600327	大东方	11,401	65,669.76	0.13
301	600193	创兴资源	10,781	65,656.29	0.13
302	601908	京运通	9,204	65,624.52	0.13
303	603308	应流股份	4,200	65,604.00	0.13
304	600116	三峡水利	6,900	65,550.00	0.13
305	601636	旗滨集团	9,100	65,156.00	0.13
306	601233	桐昆股份	10,600	64,978.00	0.13
307	601100	恒立油缸	7,000	64,820.00	0.13
308	600333	长春燃气	9,363	64,698.33	0.13
309	600850	华东电脑	3,281	64,176.36	0.13
310	600995	文山电力	13,623	64,164.33	0.13
311	600990	四创电子	2,360	63,932.40	0.13
312	600475	华光股份	5,500	63,855.00	0.13
313	600724	宁波富达	16,200	63,828.00	0.13
314	601107	四川成渝	23,200	62,872.00	0.13
315	600280	中央商场	6,223	62,790.07	0.13
316	601388	怡球资源	5,807	62,657.53	0.13
317	600897	厦门空港	4,300	62,608.00	0.13
318	600650	锦江投资	6,900	62,169.00	0.12
319	600987	航民股份	11,242	61,831.00	0.12
320	600101	明星电力	7,833	61,489.05	0.12
321	600368	五洲交通	15,100	61,306.00	0.12
322	600081	东风科技	4,400	61,116.00	0.12
323	600321	国栋建设	29,800	60,196.00	0.12
324	601567	三星电气	5,800	60,030.00	0.12
325	600295	鄂尔多斯	8,124	59,955.12	0.12
326	601208	东材科技	8,860	59,805.00	0.12

327	603001	奥康国际	4,300	59,125.00	0.12
328	600510	黑牡丹	11,262	58,562.40	0.12
329	600778	友好集团	7,624	58,476.08	0.12
330	600507	方大特钢	18,500	58,460.00	0.12
331	600618	氯碱化工	7,860	58,399.80	0.12
332	600268	国电南自	11,675	57,908.00	0.12
333	600869	远东电缆	7,032	57,310.80	0.11
334	600054	黄山旅游	4,471	57,005.25	0.11
335	603993	洛阳钼业	8,500	56,950.00	0.11
336	600278	东方创业	5,900	56,876.00	0.11
337	601996	丰林集团	8,177	56,503.07	0.11
338	600845	宝信软件	1,900	56,449.00	0.11
339	600641	万业企业	14,200	56,374.00	0.11
340	600882	华联矿业	7,372	55,953.48	0.11
341	600168	武汉控股	7,500	55,875.00	0.11
342	600012	皖通高速	12,729	55,753.02	0.11
343	600666	西南药业	7,500	54,825.00	0.11
344	603555	贵人鸟	4,300	54,739.00	0.11
345	600218	全柴动力	6,000	54,660.00	0.11
346	600687	刚泰控股	5,139	54,524.79	0.11
347	601010	文峰股份	7,730	53,955.40	0.11
348	600743	华远地产	19,396	53,920.88	0.11
349	600561	江西长运	5,100	53,754.00	0.11
350	600230	沧州大化	5,350	53,179.00	0.11
351	601038	一拖股份	6,600	51,810.00	0.10
352	600785	新华百货	4,831	50,967.05	0.10
353	603399	新华龙	5,140	49,189.80	0.10
354	600248	延长化建	6,600	48,444.00	0.10
355	600397	安源煤业	14,100	47,799.00	0.10
356	600121	郑州煤电	11,634	47,466.72	0.09
357	600833	第一医药	4,800	46,848.00	0.09
358	600287	江苏舜天	7,500	46,125.00	0.09
359	600258	首旅酒店	3,116	45,680.56	0.09
360	600318	巢东股份	5,300	45,421.00	0.09
361	600353	旭光股份	6,300	44,856.00	0.09
362	600560	金自天正	4,799	44,102.81	0.09
363	600310	桂东电力	4,665	43,477.80	0.09
364	600829	三精制药	6,510	42,510.30	0.09
365	601313	江南嘉捷	5,669	41,780.53	0.08

366	603128	华贸物流	4,300	41,538.00	0.08
367	601799	星宇股份	2,400	41,088.00	0.08
368	600532	宏达矿业	5,599	40,816.71	0.08
369	600167	联美控股	3,700	39,516.00	0.08
370	600975	新五丰	6,373	39,448.87	0.08
371	601789	宁波建工	5,300	38,372.00	0.08
372	600513	联环药业	3,216	37,884.48	0.08
373	600828	成商集团	7,900	37,051.00	0.07
374	600097	开创国际	3,540	36,745.20	0.07
375	600548	深高速	9,999	36,596.34	0.07
376	600262	北方股份	2,222	28,730.46	0.06
377	600985	雷鸣科化	2,400	26,760.00	0.05
378	600623	双钱股份	2,160	24,408.00	0.05

### 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

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	600436	片仔癀	397,762.59	0.28
2	600317	营口港	376,671.00	0.26
3	600820	隧道股份	353,645.63	0.25
4	600398	海澜之家	308,614.00	0.22
5	600029	南方航空	299,279.00	0.21
6	600027	华电国际	286,575.00	0.20
7	600572	康恩贝	226,766.00	0.16
8	600216	浙江医药	211,692.00	0.15
9	600797	浙大网新	209,057.00	0.15
10	601111	中国国航	208,005.00	0.15
11	600777	新潮实业	207,868.00	0.15
12	600366	宁波韵升	187,035.00	0.13
13	600845	宝信软件	182,413.00	0.13
14	600160	巨化股份	167,171.71	0.12

15	600058	五矿发展	163,280.00	0.11
16	601012	隆基股份	156,346.00	0.11
17	600873	梅花生物	154,059.00	0.11
18	600307	酒钢宏兴	152,045.00	0.11
19	600594	益佰制药	151,802.00	0.11
20	600990	四创电子	148,731.00	0.10

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	600079	人福医药	450,034.73	0.32
2	600839	四川长虹	433,752.00	0.30
3	600718	东软集团	428,542.88	0.30
4	600317	营口港	355,128.00	0.25
5	600499	科达洁能	354,900.00	0.25
6	600827	友谊股份	352,019.83	0.25
7	600639	浦东金桥	309,854.60	0.22
8	601933	永辉超市	302,611.98	0.21
9	601098	中南传媒	276,982.00	0.19
10	600787	中储股份	257,980.81	0.18
11	600373	中文传媒	252,541.00	0.18
12	600648	外高桥	246,232.00	0.17
13	600820	隧道股份	237,820.00	0.17
14	600521	华海药业	214,981.00	0.15
15	600596	新安股份	180,200.00	0.13
16	601872	招商轮船	172,326.81	0.12
17	600435	北方导航	159,455.04	0.11
18	600388	龙净环保	126,576.72	0.09
19	600595	中孚实业	119,596.00	0.08
20	600978	宜华木业	113,885.06	0.08

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	16,510,912.64
卖出股票收入（成交）总额	11,060,788.07

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	9,699.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	114.80
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,814.44

### 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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 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

693	74,638.75	747,655.00	1.45%	50,976,997.00	98.55%
-----	-----------	------------	-------	---------------	--------

## 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	招颖钊	3,000,000.00	5.80%
2	张曦	2,000,000.00	3.87%
3	何镜堂	1,009,000.00	1.95%
4	刘洪潮	1,000,000.00	1.93%
5	柏惠	820,000.00	1.59%
6	罗秀惠	800,000.00	1.55%
7	郝志坚	680,000.00	1.31%
8	莫浩材	600,000.00	1.16%
9	王增友	600,000.00	1.16%
10	王群	520,000.00	1.01%

## 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	148,724,652.00
本报告期基金总申购份额	3,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	100,000,000.00
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	51,724,652.00

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：

报告期内无涉及基金管理人的重大人事变动。

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	1	27,413,228.53	100.00%	23,301.76	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
国泰君安	-	-	-	-	-	-

## § 11 备查文件目录

### 11.1 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 2014 年半年度报告原文。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。

## 11.2 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](http://www.wjasset.com)〉。

## 11.3 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  
2014 年 8 月 27 日