

万家上证 380 交易型开放式指数证券投资 基金 2014 年年度报告

2014 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：华夏银行股份有限公司

送出日期：2015 年 3 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、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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2015 年 3 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。

本报告财务资料已经审计,安永华明会计师事务所为基金财务出具了标准无保留意见的审计报告,基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明,请投资者注意阅读。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表	15
7.2 利润表	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
7.4 报表附注	19
§8 投资组合报告	40
8.1 期末基金资产组合情况	40
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	40
8.3 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	41
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53
8.7 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	53

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	53
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	53
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	54
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
8.12 投资组合报告附注	54
§9 基金份额持有人信息	55
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
9.2 期末上市基金前十名持有人	55
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	55
§10 开放式基金份额变动	56
§11 重大事件揭示	56
11.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
11.4 基金投资策略的改变	57
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	57
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
§12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 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	6,724,652.00 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 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
会计师事务所	安永华明会计师事务所	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层
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、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	2014 年	2013 年 10 月 31 日(基金合同生效日)-2013 年 12 月 31 日
本期已实现收益	5,410,903.47	-8,327,297.04
本期利润	10,722,531.05	-13,308,916.52
加权平均基金份额本期利润	0.2366	-0.0372
本期加权平均净值利润率	24.18%	-3.75%
本期基金份额净值增长率	42.86%	-4.03%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	2,495,119.56	-5,991,465.78
期末可供分配基金份额利润	0.3710	-0.0403
期末基金资产净值	9,219,771.56	142,733,186.22

期末基金份额净值	1.3710	0.9597
3.1.3 累计期末指标	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	37.10%	-4.03%

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。

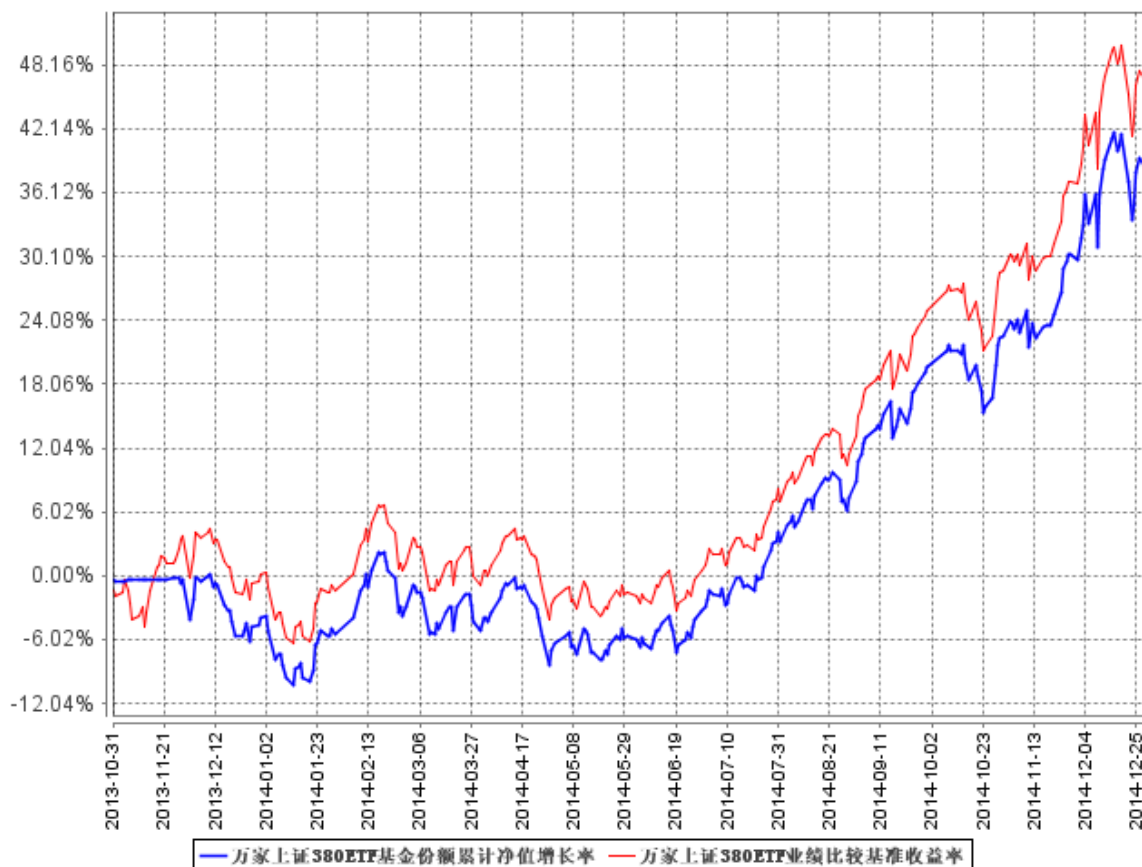
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	14.57%	1.45%	16.15%	1.46%	-1.58%	-0.01%
过去六个月	41.79%	1.20%	44.50%	1.20%	-2.71%	0.00%
过去一年	42.86%	1.19%	45.17%	1.19%	-2.31%	0.00%
自基金合同 生效起至今	37.10%	1.16%	45.28%	1.20%	-8.18%	-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

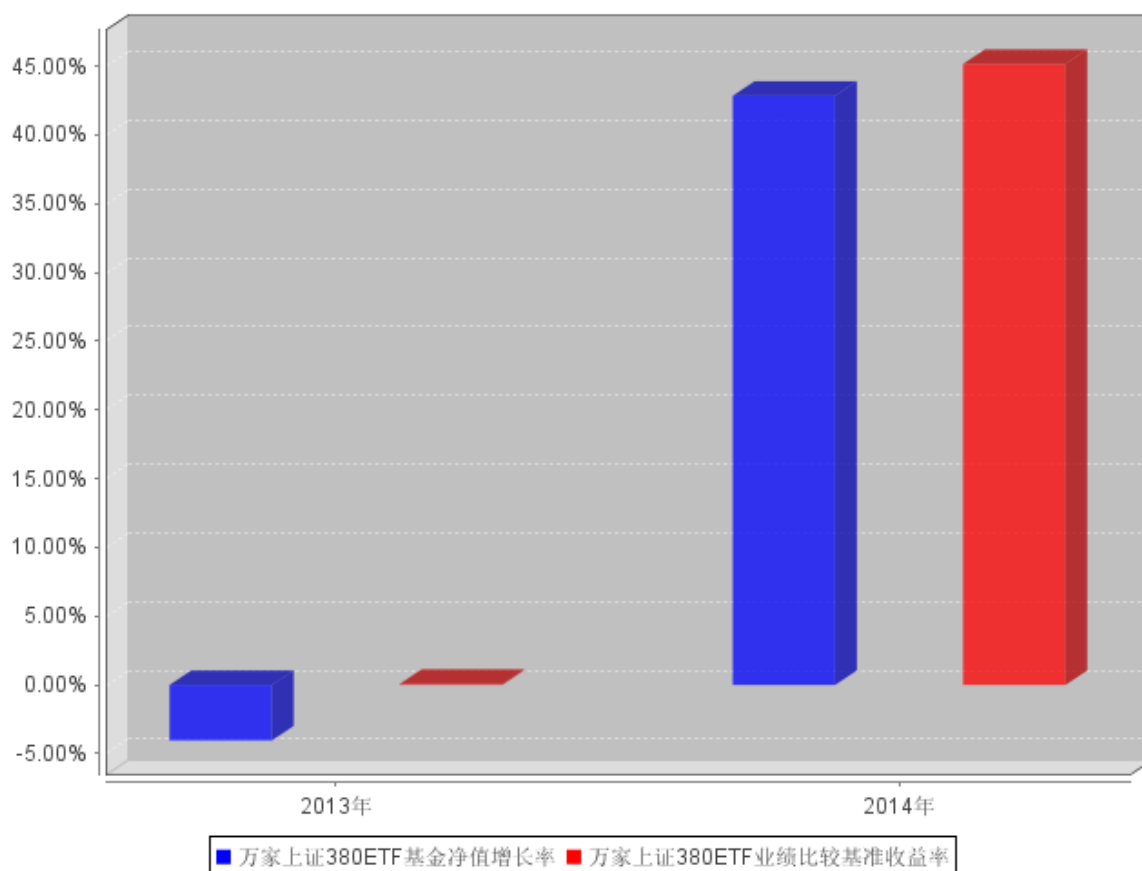
万家上证380ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：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。

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

万家上证380ETF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：本基金于 2013 年 10 月 31 日成立，合同生效当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

本基金成立至今尚未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44 号文批准设立。公司现股东为齐鲁证券有限公司、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、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、万家添利分级债券型证券投资基金、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、万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金和万家现金宝货币市场证券投资基金。

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		
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	-	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。
张鹏	本基金经理、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	2014 年 11 月 14 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合规守信情况的说明

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，公司执行交易系统内的公平交易程序；（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未发现违反公平交易的行为。

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 年第四季度，受到央行降息、国企改革、沪港通、券商利润预期大幅提升等利好信息刺激，银行和券商板块迎来一波强劲的上扬，带领大盘蓝筹股一路上扬，成交量急剧放大。受此风格切换影响，中小板、创业板表现不佳，宽幅震荡。报告期本基金投资标的指数——上证 380 指数收益率为 16.15%。

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 1.3710 元，报告期内基金份额净值增长率为 42.86%，同期业绩比较基准收益率为 45.17%。基金日均跟踪偏离度为 0.0270%，年化跟踪误差 0.4223%，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

我们认为国内经济增长 2015 年将保持平稳的下行态势，进入经济增速回落和增长质量提高的新常态，积极的财政政策和稳健偏松的货币政策将对冲房地产投资的下滑，有力保证经济增长的稳定性。随着经济结构调整的不断深化和诸多改革措施的落实，深刻的结构变化和动力机制变化将继续推进，特别是一些领域的改革攻坚将会为经济中长期发展注入持久的活力和动力，上市公司盈利状况将会稳步提高，证券市场的长期投资基础将会有效改善。因此，我们看好中国经济和国内股票市场中长期发展前景，看好符合产业发展趋势、具备成长性的上市公司在经济转型过程中的发展前景和市场表现。本基金所跟踪的上证 380 指数作为表征沪市有一定市值规模的高成长上市公司成份指数，财务指标优异，具备较高的长期投资价值。

本基金将继续贯彻被动投资理念，恪守基金合同规定的投资目标和投资策略，一如既往地规范、勤勉运作，将本基金打造为稳定有效的指数投资工具，为基金份额持有人谋求长期、稳定回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内,基金管理人为防范和化解经营风险,确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整,主要做了以下工作:

(一)加强风控文化建设

不断梳理和优化制度流程、防范操作风险、加强对员工的合规培训和加深员工对合规风控工作的理解,确保公司各项业务合法合规。

(二)制度流程建设

为加强内控管理,保证公司各项制度流程的有效性、及时性、完备性,本年度对投资、销售相关的制度流程及后台部门相关制度进行了修订;本年度还制订了多项 ETF 相关管理制度和流程。

(三)定期和临时稽核工作

报告期内,监察稽核部门按计划完成了各项定期稽核和专项稽核,检查内容覆盖公司各业务部门和业务环节,检查完成后出具监察稽核报告和建议书,并对整改情况进行跟踪。

(四)绩效评估和风险管理工作

报告期内,优化并形成了较为完善的每日风险监控;改进基金业绩评价工作,辅助基金经理投资决策;针对专户量化投资产品、股指期货产品等新业务进行合规、风险分析和系统测试,提供风险评估意见等;针对由于市场流动性紧张的情况,加大了对货币基金的风险管理,防范资金交收风险。

(五)员工行为管理与防控内幕交易

报告期内,公司进一步完善防控内幕交易制度和从业人员投资申报等制度,强化员工行为管理工作,防范内幕交易和利益输送。

4.7 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》。

4.8 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的利润。

4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内自 7 月 9 日至 12 月 31 日，基金资产净值连续 60 个工作日以上低于五千万元。

§ 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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2015）审字第 60778298_B17 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	万家上证 380 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的万家上证 380 交易型开放式指数证券投资基金财务报表，包括 2014 年 12 月 31 日的资产负债表、2014 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人万家基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了万家上证 380 交易型开放式指数证券投资基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	汤骏	浦未娜
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2015 年 3 月 20 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	399,372.29	129,387.77
结算备付金		5,509.45	4,593,144.92
存出保证金		709.67	351,397.87
交易性金融资产	7.4.7.2	9,217,242.84	137,970,710.48
其中：股票投资		9,217,242.84	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		5,987.57	473,781.79
应收利息	7.4.7.5	101.14	2,497.77
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		9,628,922.96	143,520,920.60
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
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		4,412.53	89,959.91
应付托管费		882.51	17,992.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	3,856.36	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	7.4.7.8	400,000.00	163,695.65
负债合计		409,151.40	787,734.38
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	6,724,652.00	148,724,652.00

未分配利润	7.4.7.10	2,495,119.56	-5,991,465.78
所有者权益合计		9,219,771.56	142,733,186.22
负债和所有者权益总计		9,628,922.96	143,520,920.60

注：报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3710 元，基金份额总额 6,724,652.00 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 10 月 31 日(基 金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日
一、收入		11,640,053.40	-12,083,833.03
1.利息收入		6,948.98	1,278,409.84
其中：存款利息收入	7.4.7.11	6,948.98	1,278,409.84
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）		6,302,492.32	-8,474,901.13
其中：股票投资收益	7.4.7.12	5,584,386.86	-8,481,953.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	718,105.46	7,052.46
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	5,311,627.58	-4,981,619.48
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	18,984.52	94,277.74
减：二、费用		917,522.35	1,225,083.49
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	227,751.09	294,996.78
2. 托管费	7.4.10.2.2	45,550.22	58,999.39
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	50,199.38	671,991.67
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	594,021.66	199,095.65

三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		10,722,531.05	-13,308,916.52
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		10,722,531.05	-13,308,916.52

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	10,722,531.05	10,722,531.05
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）	-142,000,000.00	-2,235,945.71	-144,235,945.71
其中：1.基金申购款	33,000,000.00	7,653,387.43	40,653,387.43
2.基金赎回款	-175,000,000.00	-9,889,333.14	-184,889,333.14
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）	6,724,652.00	2,495,119.56	9,219,771.56
项目	上年度可比期间 2013 年 10 月 31 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	500,724,652.00	-	500,724,652.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-13,308,916.52	-13,308,916.52
三、本期基金份额交易	-352,000,000.00	7,317,450.74	-344,682,549.26

产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中: 1.基金申购款	7,000,000.00	-263,773.47	6,736,226.53
2.基金赎回款	-359,000,000.00	7,581,224.21	-351,418,775.79
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)	148,724,652.00	-5,991,465.78	142,733,186.22

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:

_____ 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

7.4 报表附注

7.4.1 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向社会公开发行募集,基金合同于 2013 年 10 月 31 日生效,首次设立募集规模为 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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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并发布的《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。

采用若干修订后/新会计准则

2014 年 1 至 3 月，财政部制定了《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》和《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》；修订了《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》和《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》；上述 7 项会计准则均自 2014 年 7 月 1 日起施行。2014 年 6 月，财政部修订了《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，在 2014 年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本基金的财务报表无重大影响。

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 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度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。

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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

(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。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，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，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。估值日无交易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，调整最近交易市价以确定公允价值。

(2) 不存在活跃市场的金融工具

当金融工具不存在活跃市场，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

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

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。

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 0.50%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 0.10%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) 每份基金份额享有同等分配权；

(2) 基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过同期标的指数累计报酬率达到 1%以上时，可进行收益分配；

(3) 基金收益分配采用现金方式；

(4) 在符合基金收益分配条件的情况下，本基金收益每年最多分配 4 次，每次基金收益分配

数额的确定原则为使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

(5) 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

(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

会计政策变更的说明可参见 7.4.2 会计报表的编制基础。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

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、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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
活期存款	399,372.29	129,387.77
定期存款	—	—
其中：存款期限 1-3 个月	—	—
其他存款	—	—
合计：	399,372.29	129,387.77

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2014 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		8,887,234.74	9,217,242.84	330,008.10
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		8,887,234.74	9,217,242.84	330,008.10
项目		上年度末 2013 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		142,952,329.96	137,970,710.48	-4,981,619.48
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		142,952,329.96	137,970,710.48	-4,981,619.48

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告末及上年度末均无买入返售金融资产余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
----	-------------------------	--------------------------

应收活期存款利息	98.06	49.91
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	2.75	2,273.95
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	0.33	173.91
合计	101.14	2,497.77

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	3,856.36	516,086.81
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	3,856.36	516,086.81

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提信息披露费	300,000.00	80,000.00
预提审计费	50,000.00	50,000.00
应付指数使用费	50,000.00	33,695.65
合计	400,000.00	163,695.65

7.4.7.9 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 12 月 31 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	33,000,000.00	33,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-175,000,000.00	-175,000,000.00
— 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	6,724,652.00	6,724,652.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	5,410,903.47	5,311,627.58	10,722,531.05
本期基金份额交易产生的变动数	1,639,862.84	-3,875,808.55	-2,235,945.71
其中：基金申购款	7,249,927.62	403,459.81	7,653,387.43
基金赎回款	-5,610,064.78	-4,279,268.36	-9,889,333.14
本期已分配利润	—	—	—
本期末	3,276,523.33	-781,403.77	2,495,119.56

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2013年10月31日(基金合同生效日)至2013年12月31日
活期存款利息收入	2,489.84	99,604.75
定期存款利息收入	—	1,172,351.83
其他存款利息收入	—	—
结算备付金利息收入	1,482.52	5,994.72
其他	2,976.62	458.54
合计	6,948.98	1,278,409.84

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 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12月31日	上年度可比期间 2013年10月31日(基金合同生效日)至2013年12月31日
----	-----------------------------	---

股票投资收益——买卖股票差价收入	288,393.71	-2,406,353.25
股票投资收益——赎回差价收入	5,295,993.15	-6,075,600.34
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	5,584,386.86	-8,481,953.59

7.4.7.12.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 10 月 31 日(基金合 同生效日)至 2013 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	14,993,250.31	77,736,331.90
减：卖出股票成本总额	14,704,856.60	80,142,685.15
买卖股票差价收入	288,393.71	-2,406,353.25

7.4.7.12.3 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 10 月 31 日(基金 合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	184,889,333.14	351,418,775.79
减：现金支付赎回款总额	1,585,481.14	8,216,837.79
减：赎回股票成本总额	178,007,858.85	349,277,538.34
赎回差价收入	5,295,993.15	-6,075,600.34

7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

7.4.7.14 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。

7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具投资收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 10 月 31 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	718,105.46	7,052.46
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	718,105.46	7,052.46

7.4.7.18 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 10 月 31 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	5,311,627.58	-4,981,619.48
——股票投资	5,311,627.58	-4,981,619.48
——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	5,311,627.58	-4,981,619.48

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 10 月 31 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
ETF 替代损益	18,984.52	2,173.40
其他	-	92,104.34
合计	18,984.52	94,277.74

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。

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 10 月 31 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	50,199.38	671,991.67
银行间市场交易费用	-	-
合计	50,199.38	671,991.67

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 10 月 31 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	300,000.00	80,000.00
上市年费	60,000.00	35,000.00
指数使用费	184,004.16	33,695.65
银行汇划费用	17.50	-
开户费	-	400.00
合计	594,021.66	199,095.65

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。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 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、基金的销售机构
华夏银行股份有限公司（“华夏银行”）	基金托管人、基金的代销机构
齐鲁证券有限公司（“齐鲁证券”）	基金管理人的股东、基金的代销机构
新疆国际实业股份有限公司	基金管理人的股东
山东省国有资产投资控股有限公司	基金管理人的股东

万家共赢资产管理有限公司	基金管理人的子公司
上海承方投资管理有限公司	基金管理人控制的公司

注：报告期内，上海承方投资管理有限公司于 2014 年 12 月由万家共赢资产管理有限公司全资设立，受基金管理人间接控制。

7.4.9.1 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。

7.4.9.2 关联方报酬

7.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 10 月 31 日 (基金合同生效日) 至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	227,751.09	294,996.78
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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。

7.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 10 月 31 日 (基金合同生效日) 至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	45,550.22	58,999.39

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。

7.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年可比期间均未通过银行间同业市场与关联方进行银行间债券(含回购)交易。

7.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.9.4.1 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。

7.4.9.4.2 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。

7.4.9.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2013 年 10 月 31 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
华夏银行股份有限公司	399,372.29	2,489.84	129,387.77	99,604.75

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 年度获得的利息收入为人民币 1,482.52 元（2013 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日止期间获得的利息收入为人民币 5,994.72 元），2014 年末结算备付金余额为人民币 5,509.45 元（2013 年末结算备付金余额为人民币 4,593,144.92 元）。

7.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.11 期末（2014 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.11.1 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。

7.4.11.2 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
600584	长电科技	2014 年 11 月 3 日	重大事项	11.13	2015 年 1 月 14 日	12.24	4,930	45,117.55	54,870.90	-
600777	新潮实业	2014 年 11 月 25 日	重大事项	11.92	-	-	4,040	42,170.48	48,156.80	-
600458	时代新材	2014 年 10 月 27 日	重大事项	12.18	2015 年 1 月 5 日	13.40	3,110	35,730.78	37,879.80	-
600664	哈药股份	2014 年 12 月 31 日	重大事项	8.68	2015 年 2 月 17 日	9.45	4,323	36,240.01	37,523.64	-
600238	海南椰岛	2014 年 11 月 28 日	重大事项	11.19	-	-	2,853	25,155.61	31,925.07	-
600761	安徽合力	2014 年 12 月 26 日	重大事项	15.65	2015 年 1 月 6 日	16.60	2,011	26,647.53	31,472.15	-
600580	卧龙电气	2014 年 12 月 8 日	重大事项	10.48	2015 年 1 月 14 日	11.12	2,900	26,259.79	30,392.00	-
600704	物产中大	2014 年 10 月 13 日	重大事项	10.38	2015 年 2 月 13 日	11.42	2,580	26,738.00	26,780.40	-
600428	中远航运	2014 年 12 月 22 日	重大事项	8.00	2015 年 1 月 8 日	8.30	3,250	17,574.69	26,000.00	-
600754	锦江股份	2014 年 11 月 10 日	重大事项	25.11	2015 年 1 月 19 日	27.00	1,017	19,440.29	25,536.87	-
600487	亨通光电	2014 年 10 月 30 日	重大事项	18.95	2015 年 1 月 19 日	20.60	1,276	20,285.22	24,180.20	-
600677	航天通信	2014 年 12 月 17 日	重大事项	18.02	-	-	1,300	22,316.96	23,426.00	-
600236	桂冠电力	2014 年 12 月 4 日	重大事项	4.70	2015 年 1 月 30 日	5.17	4,882	19,085.32	22,945.40	-
600552	方兴科技	2014 年 9 月 29 日	重大事项	19.01	-	-	1,017	14,809.38	19,333.17	-
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	-
600845	宝信软件	2014 年 12 月 29 日	重大事项	33.50	2015 年 1 月 12 日	36.00	300	10,592.46	10,050.00	-
600318	巢东股份	2014 年 9 月 29 日	重大事项	11.20	2015 年 2 月 6 日	12.32	700	7,222.61	7,840.00	-
600623	双钱股份	2014 年 12 月 1 日	重大事项	14.52	-	-	500	6,791.77	7,260.00	-

7.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.11.3.1 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。

7.4.11.3.2 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。

7.4.12 金融工具风险及管理

7.4.12.1 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。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 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 7.4.12 列示的本基金于年末持有的流通受限证券外，本年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。

7.4.12.4 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。

7.4.12.4.1 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。

7.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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
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。

7.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2014 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2013 年 12 月 31 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(2013 年 12 月 31 日：同)。

7.4.12.4.2 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。

7.4.12.4.3 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。

7.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 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	9,217,242.84	99.97	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	9,217,242.84	99.97	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。

7.4.12.4.3.2 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（2014 年 12 月 31 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
	上证 380 指数上涨 1%	89,742.29	1,369,226.98
	上证 380 指数下跌 1%	-89,742.29	-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。

7.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收款项以及其他金融负债，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2014 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 8,737,269.00 元，属于第二层次的余额为人民币 479,973.84 元，无属于第三层次的余额。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

2014 年度，对于以公允价值计量的金融工具，由第一层次转入第二层次的投资的金额为人民

币 5,383,212.23 元, 无由第二层次转入第一层次的投资的金额。

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

7.4.14.1.2. 3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具本期末和上期末均不以第三层次公允价值计量。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日, 本基金无需要说明的重大承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日, 本基金的资产净值为人民币 9,219,771.56 元, 已连续超过 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5,000 万元。本基金资产管理人已就上述情况按照中国证监会颁布的《证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定, 向中国证监会说明原因和报送解决方案。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	9,217,242.84	95.72
	其中: 股票	9,217,242.84	95.72
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	404,881.74	4.20
7	其他各项资产	6,798.38	0.07
8	合计	9,628,922.96	100.00

注: 上述股票投资包括可退替代款估值增值, 而 8.2 的合计项中不含可退替代款估值增值。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值
----	------	------	---------

			比例（%）
A	农、林、牧、渔业	35,689.53	0.39
B	采矿业	408,063.99	4.43
C	制造业	4,817,085.56	52.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	712,524.66	7.73
E	建筑业	455,082.37	4.94
F	批发和零售业	963,383.63	10.45
G	交通运输、仓储和邮政业	804,765.73	8.73
H	住宿和餐饮业	25,536.87	0.28
I	信息传输、软件和信息技术服务业	250,967.92	2.72
J	金融业	—	—
K	房地产业	301,451.12	3.27
L	租赁和商务服务业	145,075.37	1.57
M	科学研究和技术服务业	4,329.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	28,495.75	0.31
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	69,819.87	0.76
S	综合	194,971.47	2.11
	合计	9,217,242.84	99.97

8.2.2 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。

8.3 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

8.3.1 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	600068	葛洲坝	10,533	98,272.89	1.07
2	601991	大唐发电	13,701	94,262.88	1.02

3	600029	南方航空	16,255	83,875.80	0.91
4	601168	西部矿业	8,800	81,312.00	0.88
5	600415	小商品城	6,212	78,830.28	0.86
6	600660	福耀玻璃	6,404	77,744.56	0.84
7	600153	建发股份	7,575	77,113.50	0.84
8	601727	上海电气	9,001	74,258.25	0.81
9	601179	中国西电	9,512	73,908.24	0.80
10	601333	广深铁路	15,758	71,226.16	0.77
11	600169	太原重工	7,700	67,144.00	0.73
12	601106	中国一重	12,024	67,093.92	0.73
13	600642	申能股份	10,383	67,074.18	0.73
14	600005	武钢股份	18,534	66,351.72	0.72
15	600881	亚泰集团	8,716	65,108.52	0.71
16	600694	大商股份	1,341	64,274.13	0.70
17	600307	酒钢宏兴	14,600	61,320.00	0.67
18	600863	内蒙华电	13,435	61,263.60	0.66
19	601111	中国国航	7,800	61,152.00	0.66
20	600755	厦门国贸	5,364	60,613.20	0.66
21	600410	华胜天成	2,927	59,622.99	0.65
22	600811	东方集团	6,210	58,995.00	0.64
23	600820	隧道股份	7,100	58,646.00	0.64
24	600008	首创股份	4,900	57,820.00	0.63
25	601898	中煤能源	8,332	57,657.44	0.63
26	600584	长电科技	4,930	54,870.90	0.60
27	600655	豫园商城	4,641	54,856.62	0.59
28	600388	龙净环保	1,563	54,705.00	0.59
29	600170	上海建工	6,249	52,554.09	0.57
30	600867	通化东宝	3,334	52,010.40	0.56
31	600635	大众公用	6,097	52,007.41	0.56
32	600495	晋西车轴	2,145	51,265.50	0.56
33	600873	梅花生物	7,126	51,022.16	0.55
34	600528	中铁二局	3,349	50,402.45	0.55
35	600143	金发科技	7,000	48,230.00	0.52
36	600166	福田汽车	7,700	48,202.00	0.52
37	600777	新潮实业	4,040	48,156.80	0.52
38	600219	南山铝业	5,306	47,064.22	0.51
39	600201	金宇集团	1,339	46,972.12	0.51
40	600312	平高电气	3,083	45,751.72	0.50
41	600525	长园集团	3,977	45,695.73	0.50

42	601718	际华集团	7,000	44,450.00	0.48
43	600688	上海石化	10,115	43,797.95	0.48
44	600967	北方创业	2,940	43,394.40	0.47
45	600594	益佰制药	1,284	42,847.08	0.46
46	600398	海澜之家	4,216	42,581.60	0.46
47	601002	晋亿实业	2,173	42,177.93	0.46
48	601877	正泰电器	1,386	42,065.10	0.46
49	600511	国药股份	1,348	41,774.52	0.45
50	600587	新华医疗	1,322	41,418.26	0.45
51	600578	京能电力	6,539	41,326.48	0.45
52	600611	大众交通	3,400	40,698.00	0.44
53	600500	中化国际	3,779	39,414.97	0.43
54	601158	重庆水务	4,344	38,661.60	0.42
55	600125	铁龙物流	4,338	38,434.68	0.42
56	600138	中青旅	2,316	38,121.36	0.41
57	600458	时代新材	3,110	37,879.80	0.41
58	600872	中炬高新	3,635	37,731.30	0.41
59	600664	哈药股份	4,323	37,523.64	0.41
60	600188	兖州煤业	2,800	36,904.00	0.40
61	600557	康缘药业	1,593	36,766.44	0.40
62	600654	飞乐股份	3,515	36,661.45	0.40
63	600517	置信电气	3,436	36,559.04	0.40
64	600175	美都能源	7,018	36,142.70	0.39
65	600498	烽火通信	2,300	35,466.00	0.38
66	601588	北辰实业	7,400	35,446.00	0.38
67	601258	庞大集团	5,945	35,372.75	0.38
68	600200	江苏吴中	2,927	35,094.73	0.38
69	600058	五矿发展	2,000	34,920.00	0.38
70	600805	悦达投资	3,019	34,114.70	0.37
71	600446	金证股份	718	33,659.84	0.37
72	600536	中国软件	1,023	33,656.70	0.37
73	601666	平煤股份	5,525	33,315.75	0.36
74	600277	亿利能源	3,733	33,298.36	0.36
75	600978	宜华木业	5,531	33,296.62	0.36
76	601000	唐山港	3,600	33,156.00	0.36
77	601238	广汽集团	3,813	33,096.84	0.36
78	600110	中科英华	5,235	33,032.85	0.36
79	601001	大同煤业	3,800	32,946.00	0.36
80	600426	华鲁恒升	3,000	32,820.00	0.36

81	600216	浙江医药	2,992	32,493.12	0.35
82	600017	日照港	6,977	32,443.05	0.35
83	600098	广州发展	3,700	32,412.00	0.35
84	600478	科力远	1,660	32,054.60	0.35
85	600521	华海药业	2,200	31,988.00	0.35
86	600238	海南椰岛	2,853	31,925.07	0.35
87	600720	祁连山	2,910	31,922.70	0.35
88	600062	华润双鹤	1,565	31,706.90	0.34
89	600761	安徽合力	2,011	31,472.15	0.34
90	600343	航天动力	1,700	31,280.00	0.34
91	600422	昆明制药	1,260	31,273.20	0.34
92	600183	生益科技	3,892	31,058.16	0.34
93	600122	宏图高科	4,308	30,888.36	0.34
94	601012	隆基股份	1,476	30,759.84	0.33
95	600580	卧龙电气	2,900	30,392.00	0.33
96	600038	哈飞股份	807	30,359.34	0.33
97	600161	天坛生物	1,170	30,197.70	0.33
98	600064	南京高科	1,649	29,665.51	0.32
99	600056	中国医药	1,788	29,341.08	0.32
100	600185	格力地产	1,333	29,326.00	0.32
101	600284	浦东建设	2,470	28,701.40	0.31
102	601717	郑煤机	3,700	28,231.00	0.31
103	600255	鑫科材料	5,700	28,044.00	0.30
104	600160	巨化股份	4,258	27,762.16	0.30
105	600651	飞乐音响	3,387	27,705.66	0.30
106	601918	国投新集	4,842	27,696.24	0.30
107	600835	上海机电	1,475	27,671.00	0.30
108	601369	陕鼓动力	3,173	27,605.10	0.30
109	600545	新疆城建	2,400	27,336.00	0.30
110	600269	赣粤高速	5,400	27,270.00	0.30
111	600572	康恩贝	1,798	27,131.82	0.29
112	600270	外运发展	1,655	27,059.25	0.29
113	600582	天地科技	2,214	26,988.66	0.29
114	600797	浙大网新	3,700	26,936.00	0.29
115	600395	盘江股份	2,259	26,927.28	0.29
116	600120	浙江东方	1,437	26,900.64	0.29
117	600409	三友化工	4,348	26,827.16	0.29
118	600970	中材国际	2,000	26,820.00	0.29
119	600704	物产中大	2,580	26,780.40	0.29

120	600562	国睿科技	537	26,774.82	0.29
121	600210	紫江企业	5,301	26,770.05	0.29
122	600502	安徽水利	2,291	26,667.24	0.29
123	600366	宁波韵升	1,643	26,534.45	0.29
124	600391	成发科技	924	26,435.64	0.29
125	600436	片仔癀	300	26,304.00	0.29
126	600377	宁沪高速	3,581	26,141.30	0.28
127	601608	中信重工	3,706	26,053.18	0.28
128	600323	瀚蓝环境	1,800	26,046.00	0.28
129	600428	中远航运	3,250	26,000.00	0.28
130	600662	强生控股	3,067	25,946.82	0.28
131	600754	锦江股份	1,017	25,536.87	0.28
132	600546	山煤国际	4,500	25,515.00	0.28
133	600171	上海贝岭	2,400	25,368.00	0.28
134	600096	云天化	2,088	25,243.92	0.27
135	603766	隆鑫通用	1,875	25,200.00	0.27
136	600783	鲁信创投	900	25,191.00	0.27
137	601311	骆驼股份	1,910	24,982.80	0.27
138	600596	新安股份	2,400	24,912.00	0.27
139	600673	东阳光科	1,670	24,782.80	0.27
140	600825	新华传媒	2,300	24,610.00	0.27
141	600176	中国玻纤	1,585	24,519.95	0.27
142	600033	福建高速	6,429	24,494.49	0.27
143	600021	上海电力	3,117	24,343.77	0.26
144	601058	赛轮金宇	1,528	24,325.76	0.26
145	603168	莎普爱思	300	24,291.00	0.26
146	600004	白云机场	2,222	24,286.46	0.26
147	600487	亨通光电	1,276	24,180.20	0.26
148	600509	天富能源	2,402	23,707.74	0.26
149	600711	盛屯矿业	3,500	23,660.00	0.26
150	600677	航天通信	1,300	23,426.00	0.25
151	600657	信达地产	2,863	23,362.08	0.25
152	600039	四川路桥	4,266	23,292.36	0.25
153	600526	菲达环保	1,537	23,008.89	0.25
154	600236	桂冠电力	4,882	22,945.40	0.25
155	600742	一汽富维	817	22,916.85	0.25
156	600416	湘电股份	1,900	22,876.00	0.25
157	600141	兴发集团	1,500	22,860.00	0.25
158	600261	阳光照明	2,689	22,802.72	0.25

159	601678	滨化股份	2,185	22,702.15	0.25
160	600227	赤天化	3,651	22,198.08	0.24
161	600351	亚宝药业	2,541	22,182.93	0.24
162	600864	哈投股份	1,492	22,156.20	0.24
163	600884	杉杉股份	1,326	21,998.34	0.24
164	600874	创业环保	1,980	21,879.00	0.24
165	600486	扬农化工	725	21,822.50	0.24
166	600350	山东高速	4,304	21,692.16	0.24
167	601880	大连港	4,682	21,584.02	0.23
168	600289	亿阳信通	2,164	21,423.60	0.23
169	600971	恒源煤电	2,452	21,405.96	0.23
170	600997	开滦股份	2,952	21,224.88	0.23
171	600668	尖峰集团	1,572	21,206.28	0.23
172	600790	轻纺城	2,578	21,165.38	0.23
173	600380	健康元	2,923	21,016.37	0.23
174	600112	天成控股	1,860	20,869.20	0.23
175	600375	华菱星马	1,704	20,737.68	0.22
176	600059	古越龙山	2,318	20,722.92	0.22
177	600567	山鹰纸业	7,100	20,519.00	0.22
178	600482	风帆股份	1,586	20,158.06	0.22
179	600460	士兰微	3,520	20,099.20	0.22
180	600073	上海梅林	2,139	20,063.82	0.22
181	600824	益民集团	2,938	20,037.16	0.22
182	600667	太极实业	3,800	20,026.00	0.22
183	600859	王府井	900	19,962.00	0.22
184	600628	新世界	1,900	19,874.00	0.22
185	600846	同济科技	2,282	19,739.30	0.21
186	600292	中电远达	882	19,650.96	0.21
187	600106	重庆路桥	3,358	19,610.72	0.21
188	601101	昊华能源	2,275	19,565.00	0.21
189	600784	鲁银投资	2,103	19,431.72	0.21
190	600300	维维股份	3,800	19,380.00	0.21
191	600552	方兴科技	1,017	19,333.17	0.21
192	600626	申达股份	2,387	19,024.39	0.21
193	600756	浪潮软件	932	19,003.48	0.21
194	600826	兰生股份	960	18,806.40	0.20
195	600559	老白干酒	380	18,749.20	0.20
196	600586	金晶科技	4,600	18,722.00	0.20
197	600481	双良节能	1,850	18,666.50	0.20

198	600993	马应龙	911	18,475.08	0.20
199	601886	江河创建	2,223	18,450.90	0.20
200	600729	重庆百货	738	18,442.62	0.20
201	600387	海越股份	1,434	18,340.86	0.20
202	600251	冠农股份	1,000	18,260.00	0.20
203	600382	广东明珠	1,210	17,968.50	0.19
204	600963	岳阳林纸	3,390	17,865.30	0.19
205	600420	现代制药	853	17,836.23	0.19
206	600750	江中药业	880	17,820.00	0.19
207	600239	云南城投	2,600	17,810.00	0.19
208	600684	珠江实业	2,400	17,520.00	0.19
209	600496	精工钢构	1,844	17,499.56	0.19
210	600571	信雅达	646	17,396.78	0.19
211	600990	四创电子	300	17,394.00	0.19
212	600686	金龙汽车	1,458	17,379.36	0.19
213	600612	老凤祥	537	17,361.21	0.19
214	601107	四川成渝	3,200	17,344.00	0.19
215	600736	苏州高新	3,000	17,310.00	0.19
216	600438	通威股份	1,842	17,130.60	0.19
217	600794	保税科技	1,200	17,124.00	0.19
218	600335	国机汽车	950	17,033.50	0.18
219	600020	中原高速	4,190	17,011.40	0.18
220	600425	青松建化	2,466	16,990.74	0.18
221	600363	联创光电	1,770	16,885.80	0.18
222	600577	精达股份	2,370	16,803.30	0.18
223	600298	安琪酵母	905	16,706.30	0.18
224	600624	复旦复华	1,300	16,627.00	0.18
225	600858	银座股份	1,651	16,609.06	0.18
226	600775	南京熊猫	1,600	16,592.00	0.18
227	600676	交运股份	1,999	16,571.71	0.18
228	600563	法拉电子	572	16,485.04	0.18
229	600551	时代出版	1,016	16,469.36	0.18
230	600132	重庆啤酒	1,016	16,438.88	0.18
231	601218	吉鑫科技	2,400	16,368.00	0.18
232	600260	凯乐科技	1,893	16,355.52	0.18
233	600285	羚锐制药	1,950	16,302.00	0.18
234	600636	三爱富	1,200	16,272.00	0.18
235	600527	江南高纤	3,510	16,216.20	0.18
236	600449	宁夏建材	1,301	16,158.42	0.18

237	600491	龙元建设	2,400	16,056.00	0.17
238	600405	动力源	1,639	16,029.42	0.17
239	600831	广电网络	1,713	15,639.69	0.17
240	600830	香溢融通	1,518	15,498.78	0.17
241	600621	华鑫股份	1,900	15,485.00	0.17
242	600682	南京新百	980	15,484.00	0.17
243	600007	中国国贸	1,009	15,427.61	0.17
244	600488	天药股份	2,611	15,404.90	0.17
245	600976	健民集团	561	15,354.57	0.17
246	600708	海博股份	1,750	15,120.00	0.16
247	601567	三星电气	802	15,029.48	0.16
248	600329	中新药业	982	14,985.32	0.16
249	600088	中视传媒	843	14,912.67	0.16
250	600566	洪城股份	752	14,814.40	0.16
251	600180	瑞茂通	1,200	14,784.00	0.16
252	600780	通宝能源	2,178	14,679.72	0.16
253	600168	武汉控股	1,080	14,601.60	0.16
254	600650	锦江投资	892	14,495.00	0.16
255	600575	皖江物流	3,504	14,401.44	0.16
256	601222	林洋电子	634	14,353.76	0.16
257	600321	国栋建设	3,700	14,171.00	0.15
258	601139	深圳燃气	1,710	14,107.50	0.15
259	600501	航天晨光	1,000	14,050.00	0.15
260	600973	宝胜股份	1,300	13,988.00	0.15
261	603077	和邦股份	1,431	13,880.70	0.15
262	600439	瑞贝卡	2,900	13,862.00	0.15
263	601801	皖新传媒	832	13,827.84	0.15
264	601233	桐昆股份	1,300	13,780.00	0.15
265	600459	贵研铂业	756	13,774.32	0.15
266	600479	千金药业	977	13,736.62	0.15
267	600537	亿晶光电	1,000	13,710.00	0.15
268	600616	金枫酒业	1,453	13,629.14	0.15
269	603699	纽威股份	700	13,608.00	0.15
270	600403	大有能源	2,254	13,591.62	0.15
271	600850	华东电脑	381	13,578.84	0.15
272	600480	凌云股份	1,036	13,499.08	0.15
273	601126	四方股份	778	13,459.40	0.15
274	601231	环旭电子	448	13,453.44	0.15
275	600116	三峡水利	923	13,346.58	0.14

276	600614	鼎立股份	1,003	13,339.90	0.14
277	600987	航民股份	1,560	13,338.00	0.14
278	600396	金山股份	1,985	13,319.35	0.14
279	600888	新疆众和	1,663	13,270.74	0.14
280	601100	恒立油缸	988	13,179.92	0.14
281	600776	东方通信	1,620	13,170.60	0.14
282	600467	好当家	2,060	13,101.60	0.14
283	600697	欧亚集团	507	13,055.25	0.14
284	600119	长江投资	907	13,024.52	0.14
285	600305	恒顺醋业	700	12,712.00	0.14
286	603005	晶方科技	300	12,630.00	0.14
287	600470	六国化工	1,900	12,597.00	0.14
288	600979	广安爱众	2,000	12,580.00	0.14
289	601777	力帆股份	1,413	12,519.18	0.14
290	601208	东材科技	1,460	12,483.00	0.14
291	600995	文山电力	1,623	12,480.87	0.14
292	600568	中珠控股	900	12,447.00	0.14
293	600190	锦州港	2,409	12,430.44	0.13
294	600195	中牧股份	784	12,426.40	0.13
295	601908	京运通	1,104	12,420.00	0.13
296	600172	黄河旋风	1,600	12,400.00	0.13
297	600114	东睦股份	929	12,383.57	0.13
298	600078	澄星股份	1,800	12,294.00	0.13
299	600507	方大特钢	2,300	12,190.00	0.13
300	601700	风范股份	883	12,097.10	0.13
301	600724	宁波富达	2,018	12,047.46	0.13
302	600897	厦门空港	500	11,995.00	0.13
303	603366	日出东方	737	11,961.51	0.13
304	600280	中央商场	830	11,952.00	0.13
305	601038	一拖股份	912	11,874.24	0.13
306	600257	大湖股份	1,663	11,823.93	0.13
307	600310	桂东电力	665	11,737.25	0.13
308	601965	中国汽研	952	11,652.48	0.13
309	600468	百利电气	869	11,540.32	0.13
310	600565	迪马股份	2,222	11,465.52	0.12
311	600510	黑牡丹	1,485	11,449.35	0.12
312	600983	惠而浦	925	11,377.50	0.12
313	600666	西南药业	927	11,179.62	0.12
314	600641	万业企业	1,800	11,160.00	0.12

315	603369	今世缘	400	11,148.00	0.12
316	600386	北巴传媒	1,060	11,119.40	0.12
317	600743	华远地产	2,396	11,069.52	0.12
318	600197	伊力特	900	11,052.00	0.12
319	600523	贵航股份	700	11,004.00	0.12
320	600162	香江控股	1,700	10,982.00	0.12
321	600268	国电南自	1,491	10,958.85	0.12
322	600802	福建水泥	1,200	10,908.00	0.12
323	600135	乐凯胶片	1,000	10,880.00	0.12
324	600561	江西长运	858	10,879.44	0.12
325	600548	深高速	1,299	10,768.71	0.12
326	600965	福成五丰	1,200	10,764.00	0.12
327	603167	渤海轮渡	965	10,730.80	0.12
328	600687	刚泰控股	539	10,656.03	0.12
329	600327	大东方	1,496	10,591.68	0.11
330	600801	华新水泥	999	10,579.41	0.11
331	601566	九牧王	817	10,539.30	0.11
332	600012	皖通高速	1,702	10,518.36	0.11
333	600278	东方创业	776	10,336.32	0.11
334	600778	友好集团	1,124	10,273.36	0.11
335	600389	江山股份	386	10,259.88	0.11
336	600378	天科股份	712	10,174.48	0.11
337	600845	宝信软件	300	10,050.00	0.11
338	601313	江南嘉捷	1,062	10,035.90	0.11
339	600295	鄂尔多斯	1,056	9,884.16	0.11
340	601515	东风股份	862	9,637.16	0.10
341	601339	百隆东方	900	9,540.00	0.10
342	600785	新华百货	631	9,452.38	0.10
343	603006	联明股份	300	9,450.00	0.10
344	600080	金花股份	1,000	9,440.00	0.10
345	601636	旗滨集团	1,100	9,372.00	0.10
346	601010	文峰股份	930	9,346.50	0.10
347	603328	依顿电子	400	9,316.00	0.10
348	601789	宁波建工	1,000	9,290.00	0.10
349	600218	全柴动力	833	9,221.31	0.10
350	600397	安源煤业	1,700	9,180.00	0.10
351	600869	智慧能源	1,033	9,111.06	0.10
352	603308	应流股份	500	8,960.00	0.10
353	600333	长春燃气	1,163	8,943.47	0.10

354	600054	黄山旅游	571	8,844.79	0.10
355	600101	明星电力	933	8,779.53	0.10
356	603993	洛阳钼业	1,000	8,750.00	0.09
357	600618	氯碱化工	860	8,557.00	0.09
358	603555	贵人鸟	500	8,380.00	0.09
359	600882	华联矿业	1,030	8,178.20	0.09
360	600248	延长化建	931	8,174.18	0.09
361	601996	丰林集团	977	7,874.62	0.09
362	600318	巢东股份	700	7,840.00	0.09
363	600833	第一医药	600	7,734.00	0.08
364	600230	沧州大化	650	7,371.00	0.08
365	601798	蓝科高新	600	7,302.00	0.08
366	603128	华贸物流	500	7,280.00	0.08
367	600623	双钱股份	500	7,260.00	0.08
368	600532	宏达矿业	754	6,974.50	0.08
369	600258	首旅酒店	423	6,958.35	0.08
370	603399	新华龙	640	6,848.00	0.07
371	600081	东风科技	500	6,790.00	0.07
372	603009	北特科技	300	6,417.00	0.07
373	600353	旭光股份	757	6,328.52	0.07
374	600828	成商集团	900	6,255.00	0.07
375	601199	江南水务	300	5,742.00	0.06
376	601799	星宇股份	300	5,571.00	0.06
377	600167	联美控股	400	5,244.00	0.06
378	600985	雷鸣科化	300	5,088.00	0.06
379	600513	联环药业	316	4,793.72	0.05
380	603126	中材节能	300	4,329.00	0.05

8.3.2 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。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600436	片仔癀	604,636.59	0.42

2	600317	营口港	376,671.00	0.26
3	600820	隧道股份	364,274.63	0.26
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	600845	宝信软件	262,811.00	0.18
8	600990	四创电子	243,219.00	0.17
9	600572	康恩贝	241,274.00	0.17
10	600216	浙江医药	235,295.00	0.16
11	600366	宁波韵升	223,549.00	0.16
12	601111	中国国航	220,728.00	0.15
13	600797	浙大网新	215,785.00	0.15
14	600777	新潮实业	207,868.00	0.15
15	600160	巨化股份	167,171.71	0.12
16	600058	五矿发展	164,794.00	0.12
17	600873	梅花生物	164,094.00	0.11
18	600594	益佰制药	163,303.00	0.11
19	600389	江山股份	160,857.00	0.11
20	600064	南京高科	158,427.00	0.11

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	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	410,428.00	0.29
5	600499	科达洁能	354,900.00	0.25
6	600827	百联股份	352,019.83	0.25
7	600570	恒生电子	342,453.86	0.24
8	600639	浦东金桥	309,854.60	0.22
9	601933	永辉超市	302,611.98	0.21
10	601098	中南传媒	276,982.00	0.19
11	600787	中储股份	257,980.81	0.18

12	600820	隧道股份	252,963.92	0.18
13	600373	中文传媒	252,541.00	0.18
14	600648	外高桥	246,232.00	0.17
15	600521	华海药业	214,981.00	0.15
16	600596	新安股份	180,200.00	0.13
17	601231	环旭电子	173,329.64	0.12
18	600388	龙净环保	172,350.18	0.12
19	601872	招商轮船	172,326.81	0.12
20	600435	北方导航	159,455.04	0.11

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。

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	21,064,802.53
卖出股票收入（成交）总额	14,993,250.31

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	709.67
2	应收证券清算款	5,987.57
3	应收股利	—
4	应收利息	101.14
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	6,798.38

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
203	33,126.36	365,818.00	5.44%	6,358,834.00	94.56%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	何镜堂	1,009,000.00	15.00%
2	招颖钊	983,000.00	14.62%
3	张进文	500,000.00	7.44%
4	赵兴春	231,000.00	3.44%
5	山东时风高唐汽车涂料有限公司	200,100.00	2.98%
6	秦健	200,000.00	2.97%
7	齐鲁证券有限公司客户信用交易担 保证券账户	160,300.00	2.38%
8	林瑶	150,100.00	2.23%
9	黄铭月	150,000.00	2.23%
10	陈月飞	149,800.00	2.23%

9.3 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。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（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	33,000,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	175,000,000.00
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	6,724,652.00

注：本基金合同生效日为 2013 年 10 月 31 日。

§ 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：

2014 年 10 月 25 日本公司发布公告，原总经理吕宜振因个人原因离职，不再担任本公司总经理。由副总经理李杰代为履行总经理职务。

2014 年 10 月 25 日本公司发布公告，原督察长李振伟因个人原因离职，不再担任本公司督察长。由副总经理詹志令代为履行督察长职务。

2014 年 11 月 15 日，本公司发布公告，聘任吴涛为本基金基金经理。原基金经理张鹏因个人原因离职，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。

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

自 2013 年 10 月起，本基金聘请安永华明会计师事务所为本基金提供审计服务。

本基金 2014 年度需向安永华明会计师事务所支付审计费 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

无。

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	
国泰君安	2	36,058,052.84	100.00%	30,650.08	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；能根据基金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。

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
国泰君安	-	-	-	-	-	-

§ 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 2014 年年度报告原文。
- 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 3 月 27 日