万家上证380交易型开放式指数证券投资基金

【2014】半年度报告摘要

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

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	zhjtgb@hxb.com.cn
客户服务电话		95538转6,4008880800	95577
传真		021-38619888	010-85238680

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.wjasset.com
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区浦电路360号陆家嘴投资大厦9楼基金管理人办公场所

§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

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。

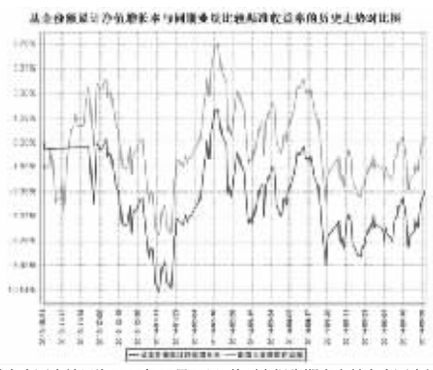
2、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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