

# 万家中证红利指数型证券投资基金(LOF)更新招募说明书摘要

基金管理人: 万家基金管理有限公司  
 基金托管人: 中国建设银行股份有限公司  
 本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等有关法律、法规及基金合同的有关规定募集。并经中国证监会2010年10月11日证监许可[2010]1388号文核准。本基金的基金合同于2011年3月17日正式生效。

**【重要提示】**  
 投资有风险, 投资者申购基金时应认真阅读本基金招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。  
 本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写, 并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额, 即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人, 其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受, 并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务, 应详细查阅本基金的基金合同。

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产, 但不保证基金一定盈利, 也不保证最低收益。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2015年9月17日, 有关财务数据和净值表现截止日为2015年6月30日, 财务数据未经审计。

## 一、基金管理人

(一)基金管理人概况  
 名称: 万家基金管理有限公司  
 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  
 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

法定代表人: 方一天  
 总经理: 方一天  
 成立日期: 2002年8月23日  
 批准设立机关: 中国证券监督管理委员会  
 批准设立文号: 中国证监会证监基金字[2002]44号  
 组织形式: 有限责任公司  
 注册资本: 1亿元人民币  
 存续期间: 持续经营  
 经营范围: 基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

联系人: 兰剑  
 电话: 021-38909626  
 传真: 021-38909627  
 (二)主要人员情况  
 1、基金管理人董事会成员  
 董事长方一天先生, 大学本科, 学士学位, 先后在上海财政证券公司、中国证监会系统、上证所信息网络有限公司任职, 2014年10月加入万家基金管理有限公司, 2014年12月起任公司董事, 2015年2月起任公司总经理。

董事马永春先生, 政治经济学硕士学位, 曾任新疆自治区党委政策研究室科长, 新疆通宝投资有限公司总经理, 新疆对外经济贸易总公司, 新疆天山股份有限公司董事, 现任新疆国际实业股份有限公司副董事长兼总经理。  
 董事袁西存先生, 中共党员, 研究生, 工商管理学硕士, 曾任莱钢集团财务部部长, 副部长, 齐鲁证券有限责任公司计划财务部总经理, 现任中泰证券股份有限公司财务总监。

独立董事陈增敬先生, 中国民主建国会会员, 博士研究生, 教授, 曾任山东大学数学学院讲师兼副教授, 法国国家信息与自动化研究所博士后, 加拿大西安大略大学保险系访问学者、兼职教授, 山东大学金融研究院(现更名为山东大学齐鲁证券金融研究院)常务副院长兼教授, 现任山东大学齐鲁证券金融研究院院长兼数学学院院长、教授。  
 独立董事王瑞瑜先生, 中共党员, 研究生, 经济学博士, 副教授, 曾任上海财经大学金融学院银行系讲师, 上海财经大学证券期货学院副教授、副院长, 美国国际管理研究生院(雷鸟)访问研究员, 上海财经大学证券期货学院副院长兼副教授, 新疆财经大学金融系专任教师, 上海财经大学金融学院副院长、常务副院长, 上海财经大学金融学院副教授, 现任上海财经大学金融学院副院长。

独立董事黄磊先生, 中国民主建国会会员, 经济学博士, 教授, 曾任贵州财经学院财政金融系教师, 山东财经大学金融学院院长, 山东省政协常委, 现任山东财经大学资本市场研究中心主任, 山东金融产业优化与区域管理协同创新中心副主任, 山东省人大常委会、山东省人大财经委员会委员, 教育部高校金融类专业教学指导委员会委员。  
 2、基金管理人监事会成员  
 监事会主席李润起先生, 硕士学位, 经济师, 曾任宏源证券股份有限公司文艺路营业部客户主管、公司投行项目经理, 新疆国际实业股份有限公司客户服务代表, 现任新疆国际实业股份有限公司董事会秘书兼副总经理。  
 监事张浩先生, 中共党员, 现任山东省国有资产投资控股有限公司综合部(党委办公室)部长(主任)。

监事李丽女士, 中共党员, 硕士, 中级讲师, 先后任职于中国工商银行济南分行、济南卓越外语学校、山东中医药大学。2008年3月起加入本公司, 现任公司综合管理部总监。  
 监事蔡鹏鹏女士, 本科, 先后任职于北京幸福之光商贸有限公司, 北京之星数码技术(北京)有限公司, 路讯资讯香港有限公司, 2007年4月起加入本公司, 现任公司机构理财部总监。  
 监事陈广益先生, 硕士学位, 先后任职于苏州对外贸易公司, 兴业全球管理有限公司。2005年3月加入本公司, 现任公司基金运营部总监。

3、基金管理人高级管理人员  
 董事长: 方一天先生(简介请参见基金管理人董事会成员)  
 总经理: 方一天先生(简介请参见基金管理人董事会成员)  
 副总经理: 李杰先生, 硕士研究生。1994年至2003年任职于国泰君安证券, 从事行政管理、机构客户开发等工作; 2003年至2007年任职于兴安证券, 从事营销管理工作; 2007年至2011年任职于齐鲁证券, 任营业部高级经理、总经理等职。2011年加入本公司, 曾任综合管理部总监、董事会秘书、总经理助理, 2013年4月起任公司副总经理, 2014年10月至2015年2月任任公司总经理。

副总经理: 李修彦先生, 硕士研究生。先后在华夏证券、中国证监会系统任职, 2012年至2014年任职于国通通用基金管理有限公司, 先后任总经理助理、督察长、副总经理等职位, 2015年2月起任我公司副总经理。  
 督察长: 兰剑先生, 法学硕士, 律师, 注册会计师, 曾在江苏淮安知源律师事务所、上海和华利盛律师事务所从事律师工作, 2008年1月进入万家基金管理有限公司工作, 2015年4月起任公司督察长。

4、本基金基金经理简历  
 卜勇, 量化投资部总监, 基金经理, 硕士研究生。2008年进入上海双隆投资管理咨询有限公司, 任金融工程师; 2010年进入上海尚雅投资管理有限公司, 从事高级量化分析师工作; 2010年10月进入国泰基金管理有限公司, 历任产品开发、专户投资理财助理等职务; 2014年4月进入广发证券担任投资理财职务; 2014年11月进入中融基金管理有限公司担任产品开发部总监职务; 2015年4月加入本公司, 现任量化投资部总监, 万家180指数证券投资基金、万家中证红利指数型证券投资基金(LOF)、万家中证创业板成长指数分级证券投资基金和万家上证380交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

历任基金经理:  
 张鹏: 2012年7月5日至2014年11月14日  
 吴涛: 2014年11月14日至2015年5月23日  
 姚震天: 2015年5月23日至2015年8月18日  
 5、投资决策委员会成员  
 主任: 方一天  
 副主任: 黄海、陈工文  
 委员: 罗毅、张军、莫海波、白宇、卜勇  
 方一天先生, 万家基金管理有限公司董事长兼基金经理  
 黄海先生, 公司投资总监  
 陈工文先生, 公司总经理助理  
 罗毅先生, 公司总经理助理  
 张军先生, 公司总经理助理  
 莫海波先生, 投资研究部总监, 万家和谐增长混合型证券投资基金基金经理、万家精选股票型证券投资基金基金经理、万家行业优选股票型证券投资基金基金经理。

白宇先生, 公司交易部总监。  
 卜勇先生, 量化投资部总监, 万家180指数证券投资基金、万家中证红利指数型证券投资基金(LOF)、万家中证创业板成长指数分级证券投资基金和万家上证380交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人  
 (一)基金托管人情况  
 名称: 中国建设银行股份有限公司(简称: 中国建设银行)  
 住所: 北京市西城区金融大街25号  
 办公地址: 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼  
 法定代表人: 王洪章  
 成立时间: 2004年09月17日  
 组织形式: 股份有限公司

注册资本: 贰仟伍佰亿零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整  
 存续期间: 持续经营  
 基金托管资格批文及文号: 中国证监会证监基金字[1998]12号  
 联系人: 田青  
 联系电话: (010) 6759 5096  
 中国建设银行成立于1954年10月, 是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行, 总部设在北京。中国建设银行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939), 于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。于2014年末, 中国建设银行市值约为2.079亿美元, 居全球上市银行第四位。

于2014年末, 本集团资产总额167,441.30亿元, 较上年增长8.99%; 客户贷款和垫款总额94,745.23亿元, 增长10.30%; 客户存款总额128,986.75亿元, 增长5.53%。营业收入5,704.70亿元, 较上年增长12.16%; 其中, 利息净收入增长12.28%, 净利润收益率(NIM)2.80%; 手续费及佣金净收入占营业收入比重为19.02%; 成本收入比为28.85%。利润总额2,990.86亿元, 较上年增长6.89%; 净利润2,282.47亿元, 增长6.10%。资本充足率14.87%, 不良贷款率1.19%, 拨备覆盖率222.33%。

客户基础进一步夯实, 全年公司机构有效客户和单位人民币结算账户分别新增11万户和68万户, 个人有效客户新增1,188万户。网点“三综合”覆盖面进一步扩大, 综合性网点达到1.37万个, 综合柜员占比达到80%, 综合营销团队1.75万个, 网点功能逐步向客户营销平台、体验平台和产品展示平台转变。深化网点柜面业务前后台分离, 全行超过1.45万个营业网点30类柜面实时性业务产品实现总行集中处理, 处理效率提高60%。总分行之间、总分行与子公司之间、境内外以及各分行之间的业务联动和交叉营销取得重要进展, 集团综合性、多功能优势逐步显现。  
 债务融资工具累计承销3,989.83亿元, 承销额连续四年同业排名第一。以“养颐”为主品牌的养老金融产品体系进一步丰富, 养老委托资产规模、账户管理规模分别新增188.32亿元和62.34万户。投资托管业务规模增幅38.06%, 新增证券投资基金托管只数和首发份额市场领先, 跨境人民币客户数突破1万个, 结算量达1.46万亿元, 信用卡累计发卡量6,593万张, 消费交易额16,580.81亿元, 多项核心指标同业第一。私人银行业务持续推进, 客户数量增长14.18%, 金融资产增长18.21%。

2014年, 本集团各方面良好表现, 得到市场与业界广泛认可, 先后荣获国内外知名机构授予的100余项重要奖项。在英国《银行家》杂志2014年“世界银行1000强排名”中, 以一级资本总额位列全球第2; 在英国《金融时报》全球500强排名第29位, 新兴市场500强排名第3位; 在美国《福布斯》杂志2014年全球上市公司2000强排名中位列第2; 在美国《财富》杂志世界500强排名第38位。此外, 本集团还荣获国内外重要媒体评出的诸多重要奖项, 覆盖公司治理、社会责任、风险管理、客户信贷、零售业务、投资托管、债券承销、信用卡、住房金融和金融科技等多个领域。

中国建设银行总行设投资托管业务部, 下设综合处、基金市场处、证券保险资产部、理财信托股权市场处、OFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9个职能处室, 在上海设有投资托管服务上海备份中心, 共有员工220余人。自2007年起, 托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计, 并已经成为常态化的内控工作手段。

(二)主要人员情况  
 赵观彬, 投资托管业务部总经理, 曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作, 并在中国建设银行河北省分行营业部、总行人力银行部、总行审计部担任领导职务, 长期从事信贷业务、个人银行业务、总行内部审计等工作, 具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟, 投资托管业务部副总经理, 曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部, 长期从事大客户的客户管理及服务工作, 具有丰富的客户服务和业务管理经验。  
 张军民, 投资托管业务部副总经理, 曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室, 长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作, 具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮, 投资托管业务部副总经理, 曾就职于中国建设银行总行运营管理部, 信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部, 并在总行集团客户部和建设银行北京市分行担任领导职务, 长期从事信贷业务和集团客户业务等工作, 具有丰富的客户服务和业务管理经验。  
 黄秀莲, 投资托管业务部副总经理, 曾就职于中国建设银行总行会计部, 长期从事托管业务管理等工作, 具有丰富的客户服务和业务管理经验。

(三)基金托管业务经营情况  
 作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行, 中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念, 不断加强风险管理和内部控制, 严格履行托管人的各项职责, 切实维护资产持有人的合法权益, 为资产委托人提供高质量的服务。经过多年稳步发展, 中国建设银行托管资产规模不断扩大, 托管业务品种不断增加, 已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老金个人帐户、OFII、企业年金等产品在内的托管业务体系, 是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行为一。截至2015年6月末, 中国建设银行已托管514只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平, 赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

三、相关服务机构  
 (一)基金份额销售机构  
 1.直销机构  
 本基金直销机构为本公司以及本公司的网上交易平台。  
 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

法定代表人: 方一天  
 电话: (021)38909770  
 传真: (021)38619998  
 联系人: 李忆莎  
 客户服务热线: 95538 转 6 ; (021)68644599; 400-888-0800;  
 网址: http://www.wjasset.com  
 投资人可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、申购及赎回等业务, 具体交易细则请参阅本公司网站公告。网上交易网址: http://trade.wjasset.com/

2.代销机构  
 (1)中国建设银行股份有限公司  
 客户服务电话: 95533  
 公司网址: www.ccb.com  
 (2)中国银行股份有限公司  
 客户服务电话: 95566  
 网址: www.boc.cn  
 (3)中国工商银行股份有限公司  
 客户服务电话: 95588  
 网址: www.icbc.com.cn  
 (4)华夏银行股份有限公司  
 客服电话: 95577  
 网址: www.hxb.com

(5)上海浦东发展银行股份有限公司  
 客户服务热线: 95528  
 公司网址: www.spdb.com.cn  
 (6)中国农业银行股份有限公司  
 客户服务电话: 95599 (或拨打各城市营业网点咨询电话)  
 网址: www.abchina.com  
 (7)中国银河证券股份有限公司  
 客户服务电话: 400-888-8888  
 网址: www.chinastock.com.cn  
 (8)中泰证券股份有限公司  
 客服电话: 95538  
 网址: www.qtzq.com.cn  
 (9)招商证券股份有限公司  
 客户服务或投诉电话: 95565, 0755-26951111、4008888111  
 公司电子邮箱: sbxw@cmchina.com.cn  
 公司网址: http://www.newone.com.cn/  
 (10)江海证券有限公司  
 客户服务电话: 400-666-2288  
 网址: www.jhzq.com.cn  
 (11)广发证券股份有限公司  
 统一客户服务热线: 95575或致电各营业网点  
 网址: www.gf.com.cn  
 (12)中航证券有限公司  
 客服电话: 4008866567  
 公司网址: www.avicsec.com  
 (13)中信证券股份有限公司  
 统一客户服务热线: 95558  
 公司网站地址: http://www.citics.com  
 (14)海通证券股份有限公司  
 注册地址: 上海市淮海中路90号  
 客服电话: 400-8888-001、(021)95553 或拨打各城市营业网点咨询电话  
 网址: www.htsec.com

(15)天相投资顾问有限公司  
 客服电话: 010-66045678  
 传真: 010-66045600  
 天相投顾网-网址: www.txsec.com  
 天相基金网-网址: www.txjijin.com  
 (16)国泰君安证券股份有限公司  
 客户服务热线: 4008888666  
 网址: www.gtja.com  
 (17)上海证券有限责任公司  
 客户服务电话: (021) 962518  
 网址: www.962518.com.cn  
 (18)中信建投证券股份有限公司  
 客户服务电话: 400-888-8108  
 网址: www.csc108.com  
 (19)华泰证券股份有限公司  
 客服电话: 95597  
 网址: www.htsc.com.cn  
 (20)信达证券股份有限公司  
 客服电话: 400-800-8899  
 公司网址: www.cindasc.com  
 (21)申银万国证券股份有限公司  
 客户服务电话: (021) 962505  
 网址: www.sw2000.com.cn  
 (22)国信证券股份有限公司  
 联系电话: 0755-82130833  
 传真: 0755-82133952  
 客户服务热线: 95536  
 公司网址: www.guosen.com.cn  
 (23)山西证券股份有限公司  
 客服电话: 400-666-1618  
 网址: www.i618.com.cn  
 (24)民生证券股份有限公司  
 联系传真: 010-85129877  
 客服电话: 4006198889  
 公司网址: www.msyzq.com  
 (25)五矿证券股份有限公司  
 客服电话: 40018-40028  
 网址: www.wkzq.com.cn  
 (26)华龙证券有限责任公司  
 客服电话: 4006898888  
 网址: www.hlzqqs.com  
 (27)宏源证券股份有限公司  
 客服电话: 4008-000-562  
 公司网址: www.hyscq.com  
 (28)中国国际金融有限公司  
 电话: 010-65051166  
 网址: www.cicc.com.cn  
 (29)光大证券股份有限公司  
 客服电话: 4008888788  
 网址: www.ebscn.com  
 (30)中信万通证券股份有限公司  
 客服电话: 95577  
 网址: www.zxwt.com.cn  
 (31)东吴证券股份有限公司  
 客户服务电话: 0512-962888  
 网址: www.dwjz.com  
 (32)中信证券(浙江)有限责任公司(原中信金通证券)  
 客服电话: 0571-96589  
 网址: www.bigsun.com.cn  
 (33)日信证券有限责任公司  
 客服电话: 4006098393  
 网址: http://www.rxzq.com.cn  
 (34)中国银河国际证券有限责任公司  
 客服电话: 4006208888  
 网址: http://www.bocichina.com  
 (35)杭州数米基金销售有限公司  
 客服电话: 4000-766-123  
 网址: www.fund123.cn  
 (36)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司  
 客服电话: 400-821-5399  
 网址: www.noah-fund.com  
 (37)上海长量基金销售投资顾问有限公司  
 客服电话: 400-089-1289  
 网址: www.erichfund.com  
 (38)上海好买基金销售有限公司  
 客服电话: 400-700-9665  
 网址: www.ehowbuy.com  
 (39)深圳众禄基金销售有限公司  
 客服电话: 4006-788-887  
 网址: www.zlfund.cn及www.jmmw.com  
 (40)北京展恒基金销售有限公司  
 客服电话: 400-888-6661  
 公司网站: www.myfund.com  
 (41)上海天天基金销售有限公司  
 客服电话: 400-1818-188  
 网址: www.1234567.com  
 (42)华鑫证券有限责任公司  
 电话: 021-32109999; 029-68918888  
 网址: www.cfsc.com.cn  
 (43)和讯信息科技有限公司  
 客服电话: 400-920-0022  
 公司网站: hlicaike.hexun.com  
 (44)中国中投证券有限责任公司  
 客户服务电话: 95532  
 公司网站: http://www.china-invs.cn/  
 (45)金元证券股份有限公司  
 客户服务电话: 4008-888-228  
 公司网站: www.jyzq.cn  
 (46)万银财富基金销售有限公司  
 客服电话: 400-808-0069  
 网址: www.wy-fund.com  
 (47)东海证券股份有限公司  
 客服电话: 95531; 400-8888-588  
 网址: www.longone.com.cn  
 (48)北京钱景财富投资管理有限公司  
 客户服务电话: 400-893-6885  
 网址: fund.qianjing.com  
 场内代销机构是指具有基金销售资格的深圳证券交易所会员, 具体会员单位名单详见深圳证券交易所网站: http://www.szse.cn/main/marketdata/catalog\_hylb.aspx

基金管理人可根据有关法律法规的要求, 选择其他符合要求的机构代理销售本基金, 并及时公告。  
 (二)注册登记机构  
 名称: 中国证券登记结算有限责任公司  
 住所: 北京西城区金融大街27号投资广场23层  
 电话: 010-59378888  
 传真: 010-59378828  
 (三)律师事务所  
 名称: 北京市大成律师事务所上海分所  
 地址: 上海市世纪大道100号上海环球金融中心24层  
 电话: 021-38722416  
 联系人: 华涛  
 (四)审计基金财产的会计师事务所  
 名称: 安永华明会计师事务所  
 住所: 北京市东长安街1号东方广场东塔楼安永大楼16层(邮编: 100738)  
 办公地址: 上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心50楼(邮编: 200120)  
 联系电话: (021) 22288888  
 传真: (021) 22280000  
 联系人: 徐艳

四、基金名称  
 万家中证红利指数型证券投资基金(LOF)  
 五、基金的类型  
 基金类别: 股票型证券投资基金  
 基金运作方式: 上市契约型开放式

六、基金的投资目标  
 本基金采用被动式指数化投资策略, 通过严格的投资纪律约束和数量化风险控制手段, 在正常市场情况下, 力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.35%, 年跟踪误差不得超过4%, 实现对中证红利指数的有效跟踪。

七、基金的投资方向  
 本基金投资于具有良好流动性的金融工具, 包括中证红利指数的成份股及经中证指数公司公告将要被调入中证红利指数的股票、新股(一级市场初次发行或增发)、债券以及法律法规或中国证监会批准的允许本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本基金投资的其他金融产品出现后, 本基金在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。  
 本基金投资于中证红利指数成份股及经中证指数公司公告将要被调入中证红利指数的股票的组合比例不低于基金资产净值的90%, 现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。

八、基金的投资策略  
 本基金投资于中证红利指数成份股及经中证指数公司公告将要被调入中证红利指数的股票的组合比例不低于基金资产净值的90%, 现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。

本基金为指数型基金, 原则上采用完全复制法, 按照成份股在中证红利指数中的基准权重构建指数化投资组合, 并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时, 以及因基金份额申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时, 基金管理人会对实际投资组合进行适当调整, 以实现跟踪误差的有效控制。

1. 资产配置策略  
 本基金投资于中证红利指数成份股及经中证指数公司公告将要被调入中证红利指数的股票的组合比例不低于基金资产净值的90%, 现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%。本基金将根据市场的实际情况, 适当调整基金资产的配置比例, 以保证对标的指数的有效跟踪。

2. 股票投资策略  
 本基金原则上采用完全复制法来跟踪中证红利指数, 按照中证红利指数成份股的基准权重构建指数化投资组合, 为求基金实际投资组合尽量贴近标的指数的表现, 减小跟踪误差, 基金管理人将根据实际情况对基金投资组合进行适当调整:

- 1) 本基金股票组合根据所跟踪的中证红利指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整;
- 2) 根据指数编制规则, 中证红利指数成份股因增发、送配、分红或其他原因所造成的临时成份股调整, 本基金将根据中证红利指数成份股临时调整决定及其需调整的股权比例, 进行相应调整;
- 3) 根据指数编制规则及优化公告, 本基金在指数成份股调整生效前, 对投资组合进行调整, 以尽量减小指数成份股变动所造成的跟踪误差;
- 4) 其他影响指数复制的因素, 本基金可以根据实际情况, 结合以往经验, 对本基金资产进行适当调整, 力争在控制风险的前提下, 获得更贴近标的指数的收益率。

3. 债券投资策略  
 本基金基于流动性管理的需要, 以保证基金资产流动性为目的, 可以投资于国债、金融债等到期日在一年以内的债券。本基金在构建债券投资组合时, 合理评估收益性、流动性和信用风险, 有效利用基金资产, 提高基金资产投资收益。

4. 其他金融衍生产品投资策略  
 在法律法规许可时, 本基金可在充分考虑金融衍生产品风险和收益特征的前提下, 结合对金融衍生产品的研究, 运用金融衍生工具谨慎进行投资, 提高投资组合收益。如有新的产品推出市场, 本基金将在届时相应法律法规的框架内, 制订符合本基金投资目标的投资策略。

5. 根据中基协发[2015]4号文“关于发布《基金参与融资融券及转融通证券出借业务指引》的通知”规定, 本基金可以参与转融通证券出借业务。

九、基金的业绩比较基准  
 95% × 中证红利指数收益率 + 5% × 银行同业存款利率

十、基金的风险收益特征  
 本基金为股票型指数基金, 预期风险高于货币市场基金、债券型基金及混合型基金, 属于较高风险, 较高预期收益的证券投资基金品种。

十一、投资组合报告  
 万家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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2015年7月16日复核了本报告中的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及重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2015年6月30日, 本报告中所列财务数据未经审计。

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	78,978,433.95	92.65
	其中: 股票	78,978,433.95	92.65
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	4,963,987.23	5.82
7	其他资产	1,302,494.23	1.53
8	合计	85,244,905.41	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合  
 2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	--	--
B	采矿业	5,145,710.59	6.29
C	制造业	37,929,433.21	46.38
D	电力、热力、燃气及生产供应业	10,418,587.46	12.74
E	建筑业	1,929,882.90	2.36
F	批发和零售业	4,521,503.54	5.53
G	交通运输、仓储和邮政业	5,008,730.15	6.12
H	住宿和餐饮业	--	--
I	信息技术、软件和信息技术服务业	412,188.92	0.50
J	金融业	10,921,037.64	13.36
K	房地产业	2,691,282.54	3.29
L	租赁和商务服务业	--	--
M	科学研究和技术服务业	--	--
N	水利、环境和公共设施管理业	--	--
O	居民服务、修理和其他服务业	--	--
P	教育	--	--
Q	卫生和社会工作	--	--
R	文化、体育和娱乐业	--	--
S	综合	--	--
	合计	78,978,433.96	96.57

2.2 报告期末非指数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非指数投资股票。

3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细  
 3.1 报告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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600607	万大特钢	385,090	3,210,013.60	3.93
2	601988	中国国旅	389,474	1,956,383.96	2.39
3	000687	广州友声	63,647	1,841,307.71	2.25
4	002289	美邦服饰	137,236	1,548,687.60	1.89
5	601010	文峰股份	155,310	1,517,378.70	1.86
6	002489	浙江永顺	39,970	1,506,863.00	1.84
7	600863	内蒙华电	180,437	1,475,974.66	1.80
8	600795	国电电力	203,740	1,420,067.80	1.74
9	002003	伟星股份	102,800	1,406,276.00	1.72
10	600397	安源煤业	142,587	1,378,816.29	1.69

3.2 报告期末非指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细