

万家中证红利指数证券投资基金(LOF)

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
送出日期:2018年8月28日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保留在报告所披露的资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对本报告书的真实性、完整性、完整性和完整性承担个别及连带的法律责任。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。

本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2018年8月27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基金资产，但不保证基金一定盈利。

本基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者在作出投资决策前应仔细阅读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，应阅读半年度报告全文。

本报告财务数据未经审计。

本报告期自2018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

基金名称 万家中证红利指数(LOF)
基金代码 161908
基金运作方式 上市开放式
基金合同生效日 2011年6月17日
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
基金类别 指数型基金
基金经理 不定期更新
基金的基金份额上市交易场所 上海证券交易所
上市日期 2011年6月17日

2.2 基金产品说明

投资目标 本基金采用被动式指数化投资方法，通过严格的资产纪律和科学合理的资产配置，力争实现对中证红利指数成份股的有效跟踪，为投资人创造稳定的投资收益。

投资策略 本基金将主要投资于中证红利指数成份股，同时辅以少量现金、国债、政策性金融债、短期国债、央行票据、货币市场基金、债券基金以及权证等低风险品种，以降低基金的波动率。

业绩比较基准 96%×中证红利指数收益+4%×银行同业存款利息。

风险收益特征 本基金是一只指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

基金管理人和基金托管人

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

基金名称 万家中证红利指数(LOF)
基金代码 161908
基金运作方式 上市开放式
基金合同生效日 2011年6月17日
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
基金类别 指数型基金
基金经理 不定期更新
基金的基金份额上市交易场所 上海证券交易所
上市日期 2011年6月17日

2.3 基金管理人和基金托管人

基金管理人负责基金的日常运营，基金托管人负责基金的资产保管。

4.1 管理人报告 基金管理人对报告期内基金运作情况的说明

1、参与估值流程各方及人员的专业胜任能力、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了估值委员会，定期评价现值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序有效性和适用性的情况时及时修订估值方法。估值委员会由督察长、基金经理运营部负责人、合规风控部负责人、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，熟悉相关政策，并具有丰富的实践经验。

2、基金经理定期报告的编制情况

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、参与估值流程各方面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、已订约的与所用不同的平均价格评价方法的性质和程度

本基金管理人与中信证券金融估值中心有限公司签署了《中债估值定价数据服务协议》，基金估值管理人与中债指数与评估有限公司签署了《中债国债估值数据服务协议》。

5、其他可能影响估值的说明

根据基金合同规定：“基金收益每年最多分配6次，每次基金收益分配比例不低于收益/基金总份额/6000份的20%”（收益分配基准日可为基金收益分配日或收益分配基准日之后的任意一日），本基金将根据上述规定进行收益分配。

6、涉及上市基金的事项

基金托管人严格遵守《证券投资基金托管办法》和《基金法》的有关规定，严格按照托管协议履行自己的义务，没有损害基金持有人利益的行为。

7、报告期末持有的股票

报告期末，本基金不存在持有的股票。

8、报告期末持有的债券

报告期末，本基金不存在持有的债券。

9、报告期末持有的贵金属

报告期末，本基金不存在持有的贵金属。

10、报告期末持有的权证

报告期末，本基金不存在持有的权证。

11、报告期末持有的股指期货

报告期末，本基金不存在持有的股指期货。

12、报告期末持有的国债期货

报告期末，本基金不存在持有的国债期货。

13、报告期末持有的互换

报告期末，本基金不存在持有的互换。

14、报告期末持有的权证

报告期末，本基金不存在持有的权证。

15、报告期末持有的股票期权

报告期末，本基金不存在持有的股票期权。

16、报告期末持有的信用衍生品

报告期末，本基金不存在持有的信用衍生品。

17、报告期末持有的其他金融工具

报告期末，本基金不存在持有的其他金融工具。

18、报告期末持有的其他金融资产

报告期末，本基金不存在持有的其他金融资产。

19、报告期末持有的其他负债

报告期末，本基金不存在持有的其他负债。

20、报告期末持有的其他资产

报告期末，本基金不存在持有的其他资产。

21、报告期末持有的其他金融负债

报告期末，本基金不存在持有的其他金融负债。

22、报告期末持有的其他金融资产

报告期末，本基金不存在持有的其他金融资产。

23、报告期末持有的其他金融负债

报告期末，本基金不存在持有的其他金融负债。

24、报告期末持有的其他资产

报告期末，本基金不存在持有的其他资产。

25、报告期末持有的其他负债

报告期末，本基金不存在持有的其他负债。

26、报告期末持有的其他金融资产

报告期末，本基金不存在持有的其他金融资产。

27、报告期末持有的其他金融负债

报告期末，本基金不存在持有的其他金融负债。

28、报告期末持有的其他资产

报告期末，本基金不存在持有的其他资产。

29、报告期末持有的其他负债

报告期末，本基金不存在持有的其他负债。

30、报告期末持有的其他金融资产

报告期末，本基金不存在持有的其他金融资产。

31、报告期末持有的其他金融负债

报告期末，本基金不存在持有的其他金融负债。

32、报告期末持有的其他资产

报告期末，本基金不存在持有的其他资产。

33、报告期末持有的其他负债

报告期末，本基金不存在持有的其他负债。

34、报告期末持有的其他金融资产

报告期末，本基金不存在持有的其他金融资产。

35、报告期末持有的其他金融负债

报告期末，本基金不存在持有的其他金融负债。

36、报告期末持有的其他资产

报告期末，本基金不存在持有的其他资产。

37、报告期末持有的其他负债

报告期末，本基金不存在持有的其他负债。

38、报告期末持有的其他金融资产

报告期末，本基金不存在持有的其他金融资产。

39、报告期末持有的其他金融负债

报告期末，本基金不存在持有的其他金融负债。

40、报告期末持有的其他资产

报告期末，本基金不存在持有的其他资产。

41、报告期末持有的其他负债

报告期末，本基金不存在持有的其他负债。

42、报告期末持有的其他金融资产

报告期末，本基金不存在持有的其他金融资产。

43、报告期末持有的其他金融负债

报告期末，本基金不存在持有的其他金融负债。

44、报告期末持有的其他资产

报告期末，本基金不存在持有的其他资产。

45、报告期末持有的其他负债

报告期末，本基金不存在持有的其他负债。

46、报告期末持有的其他金融资产

报告期末，本基金不存在持有的其他金融资产。

47、报告期末持有的其他金融负债

报告期末，本基金不存在持有的其他金融负债。

48、报告期末持有的其他资产

报告期末，本基金不存在持有的其他资产。

49、报告期末持有的其他负债

报告期末，本基金不存在持有的其他负债。

50、报告期末持有的其他金融资产

报告期末，本基金不存在持有的其他金融资产。

51、报告期末持有的其他金融负债

报告期末，本基金不存在持有的其他金融负债。

52、报告期末持有的其他资产

报告期末，本基金不存在持有的其他资产。

53、报告期末持有的其他负债

报告期末，本基金不存在持有的其他负债。

54、报告期末持有的其他金融资产

报告期末，本基金不存在持有的其他金融资产。

55、报告期末持有的其他金融负债

报告期末，本基金不存在持有的其他金融负债。

56、报告期末持有的其他资产

报告期末，本基金不存在持有的其他资产。

57、报告期末持有的其他负债

报告期末，本基金不存在持有的其他负债。

58、报告期末持有的其他金融资产

报告期末，本基金不存在持有的其他金融资产。

59、报告期末持有的其他金融负债

报告期末，本基金不存在持有的其他金融负债。

60、报告期末持有的其他资产

报告期末，本基金不存在持有的其他资产。

61、报告期末持有的其他负债

报告期末，本基金不存在持有的其他负债。

62、报告期末持有的其他金融资产

报告期末，本基金不存在持有的其他金融资产。

63、报告期末持有的其他金融负债

报告期末，本基金不存在持有的其他金融负债。

64、报告期末持有的其他资产

报告期末，本基金不存在持有的其他资产。

65、报告期末持有的其他负债

报告期末，本基金不存在持有的其他负债。

66、报告期末持有的其他金融资产

报告期末，本基金不存在持有的其他金融资产。

67、报告期末持有的其他金融负债

报告期末，本基金不存在持有的其他金融负债。

68、报告期末持有的其他资产