

万家中证红利指数证券投资基金(LOF)

2014 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：中国建设银行股份有限公司
送出日期：2015年3月27日

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法律责任。本年度报告已经经过以上一独立签署审计会计师事务所的审计，会计师事务所不存在虚假记载、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法律责任。本年度报告已经经过以上一独立签署审计会计师事务所的审计，会计师事务所不存在虚假记载、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法律责任。

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3月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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预示其未来表现。投资者有风险，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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。
本年度报告全文已经审计，安永华明会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期内2014年1月1日起至2014年12月31日止。

§ 2 基金简介	
基金名称	万家中证红利指数基金(LOF)
场内简称	万家红利
基金代码	161907
基金运作方式	上市型开放式基金(LOF)
基金合同生效日	2011年3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
报告期末基金份额总额	103,281,107.71份
基金合同存续期	不定期
基金上市证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011-06-15

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，通过严格的投资纪律和投资风险控制，跟踪中证红利指数的表现，力争实现基金净值增长率长期稳定地超越中证红利指数1.0%以上。
投资策略	本基金为被动指数基金，跟踪中证红利指数的表现，力争实现基金净值增长率长期稳定地超越中证红利指数1.0%以上。
业绩比较基准	95%×中证红利指数收益率+5%×银行间同业存款利率
风险收益特征	本基金为被动指数基金，跟踪中证红利指数的表现，力争实现基金净值增长率长期稳定地超越中证红利指数1.0%以上。

2.3 基金管理人及基金托管人	
项目	基金管理人 基金托管人
名称	万家基金管理有限公司 中国建设银行股份有限公司
法定代表人	王卫 王洪章
信息披露负责人	董志勇 021-38990626 010-67595096
电子邮箱	law@wjfund.com tianqiang_dh@ccb.com
客户服务电话	95538转4、400888800 010-67595096
传真	021-38990627 010-60275853

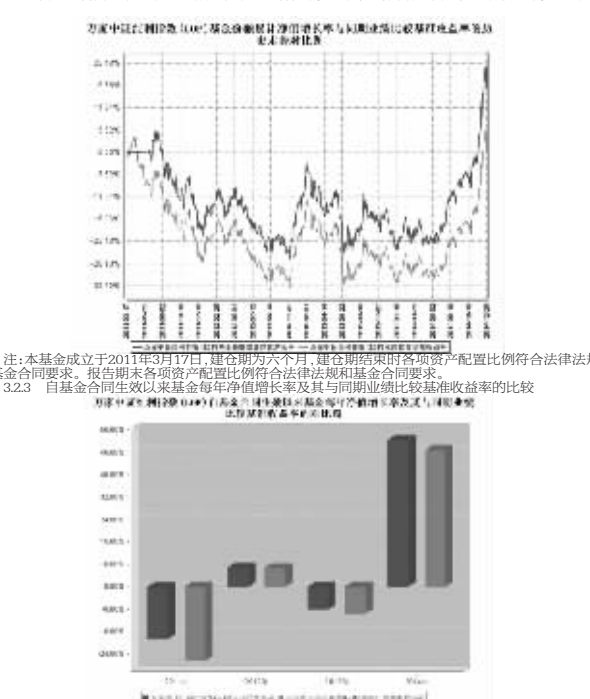
2.4 信息披露方式	
基金年度报告置备地点	上海市浦东新区世纪大道360号东方财富大厦9楼万家基金管理人办公室
基金年度报告备置地点	http://www.wjfund.com

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 2012年
本期已实现收益	12,778,810.09 -10,540,533.04 -75,470,256.57
本期净利润	64,074,824.82 -93,726,185.16 -56,489,625.17
本期平均基金份额本期利润	0.2245 -0.0866 0.0660
本期基金份额净值增长率	52.36% -7.98% 6.93%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末 2013年末 2012年末
期末可供分配基金份额总额	0.0073 -0.0181 0.0126
期末可供分配基金份额净值	126.132,283.52 554,668,782.75 943,791,720.93
期末基金份额净值	1.2213 0.8019 0.8714

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(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的金额。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。

3.2 基金净值表现	
3.2.1 基金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② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-③
过去三个月	29.72% 1.37% 29.46% 1.36% 0.26% 0.01%
过去六个月	53.16% 1.12% 51.28% 1.11% 1.88% 0.01%
过去一年	52.36% 1.09% 48.72% 3.38% 0.08% 0.01%
过去三年	49.87% 1.22% 43.74% 1.22% 6.13% 0.09%
自基金合同生效起至今	22.13% 1.18% 6.14% 1.12% 15.99% -0.03%

注：本基金业绩比较基准=65%×中证红利指数收益率+35%×银行间同业存款利率。
3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注：本基金成立于2011年3月17日，建仓期为六个月，建仓期结束后各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。本报告期末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净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.3 基金管理人及基金托管人	
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

4.1 基金管理人及基金托管人	
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

4.2 基金管理人及基金托管人	
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

4.3 基金管理人及基金托管人	
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

4.4 基金管理人及基金托管人	
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

4.5 基金管理人及基金托管人	
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

4.6 基金管理人及基金托管人	
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

4.7 基金管理人及基金托管人	
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

4.8 基金管理人及基金托管人	
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

4.9 基金管理人及基金托管人	
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

4.10 基金管理人及基金托管人	
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

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分配基准日可供分配的20%(收益分配基准日可供分配利润是指基金基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润已实现收益的孰低者)。本基金本报告期末未实施基金收益分配。”
4.9 报告期内本基金未发生收益分配。本基金本报告期末未实施基金收益分配。
4.10 报告期内本基金未发生收益分配。本基金本报告期末未实施基金收益分配。

5.1 报告期内本基金管理人遵守情况	
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

5.2 基金管理人及基金托管人	
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

5.3 基金管理人及基金托管人	
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

5.4 基金管理人及基金托管人	
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

5.5 基金管理人及基金托管人	
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

5.6 基金管理人及基金托管人	
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

5.7 基金管理人及基金托管人	
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

5.8 基金管理人及基金托管人	
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

5.9 基金管理人及基金托管人	
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

5.10 基金管理人及基金托管人	
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

5.11 基金管理人及基金托管人	
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

5.12 基金管理人及基金托管人	
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

5.13 基金管理人及基金托管人	
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

5.14 基金管理人及基金托管人	
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

5.15 基金管理人及基金托管人	
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

5.16 基金管理人及基金托管人	
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

5.17 基金管理人及基金托管人	
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

5.18 基金管理人及基金托管人	
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

5.19 基金管理人及基金托管人	
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

5.20 基金管理人及基金托管人	
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

5.21 基金管理人及基金托管人	
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

5.22 基金管理人及基金托管人	
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

5.23 基金管理人及基金托管人	
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

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]129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，对基金取得的股票股息、红利收入、债券利息、股息红利收入、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《关于股息红利的个人所得税问题的通知》的规定，股息红利个人所得税由基金管理人负责代扣代缴，并向税务机关申报纳税。
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、国家税务总局财税字[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。
7.4.1 关联方关系

关联方名称	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	
中国建设银行股份有限公司(“建设银行”)	基金托管人、基金代销机构	
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人股东、基金代销机构	
招商证券股份有限公司	基金管理人股东	
山东国信证券资产管理有限公司	基金管理人股东	
万家基金管理有限公司	基金管理人子公司	
上海东方证券资产管理有限公司	基金管理人关联方	

关联方名称	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
华泰证券股份有限公司	277,109,611.41	389,999
招商证券股份有限公司	277,109,611.41	389,999
山东国信证券资产管理有限公司	277,109,611.41	389,999
万家基金管理有限公司	277,109,611.41	389,999
上海东方证券资产管理有限公司	277,109,611.41	389,999

关联方名称	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
华泰证券股份有限公司	277,109,611.41	389,999
招商证券股份有限公司	277,109,611.41	389,999
山东国信证券资产管理有限公司	277,109,611.41	389,999
万家基金管理有限公司	277,109,611.41	389,999
上海东方证券资产管理有限公司	277,109,611.41	389,999

关联方名称	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
华泰证券股份有限公司	277,109,611.41	389,999
招商证券股份有限公司	277,109,611.41	389,999
山东国信证券资产管理有限公司	277,109,611.41	389,999
万家基金管理有限公司	277,109,611.41	389,999
上海东方证券资产管理有限公司	277,109,611.41	389,999

关联方名称	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
华泰证券股份有限公司	277,109,611.41	389,999
招商证券股份有限公司	277,109,611.41	389,999
山东国信证券资产管理有限公司	277,109,611.41	389,999
万家基金管理有限公司	277,109,611.41	389,999
上海东方证券资产管理有限公司	277,109,611.41	389,999

关联方名称	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
华泰证券股份有限公司	277,109,611.41	389,999
招商证券股份有限公司	277,109,611.41	389,999
山东国信证券资产管理有限公司	277,109,611.41	389,999
万家基金管理有限公司	277,109,611.41	389,999
上海东方证券资产管理有限公司	277,109,611.41	389,999

关联方名称	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
华泰证券股份有限公司	277,109,611.41	389,999
招商证券股份有限公司	277,109,611.41	389,999
山东国信证券资产管理有限公司	277,109,611.41	389,999
万家基金管理有限公司	277,109,611.41	389,999
上海东方证券资产管理有限公司	277,109,611.41	389,999

关联方名称	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
华泰证券股份有限公司	277,109,611.41	389,999
招商证券股份有限公司	277,109,611.41	389,999
山东国信证券资产管理有限公司	277,109,611.41	389,999
万家基金管理有限公司	277,109,611.41	389,999
上海东方证券资产管理有限公司	277,109,611.41	389,999

关联方名称	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
华泰证券股份有限公司	277,109,611.41	389,999
招商证券股份有限公司	277,109,611.41	389,999
山东国信证券资产管理有限公司	277,109,611.41	389,999
万家基金管理有限公司	277,109,611.41	389,999
上海东方证券资产管理有限公司	277,109,611.41	389,999

关联方名称	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
华泰证券股份有限公司	277,109,611.41	389,999
招商证券股份有限公司	277,109,611.41	389,999
山东国信证券资产管理有限公司	277,109,611.41	389,999
万家基金管理有限公司	277,109,611.41	389,999
上海东方证券资产管理有限公司	277,109,611.41	389,999

关联方名称	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
华泰证券股份有限公司	277,109,611.41	389,999
招商证券股份有限公司	277,109,611.41	389,999
山东国信证券资产管理有限公司	277,109,611.41	389,999
万家基金管理有限公司	277,109,611.41	389,999
上海东方证券资产管理有限公司	277,109,611.41	389,999

关联方名称	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
华泰证券股份有限公司	277,109,611.41	389,999
招商证券股份有限公司	277,109,611.41	389,999
山东国信证券资产管理有限公司	277,109,611.41	389,999
万家基金管理有限公司	277,109,611.41	389,999
上海东方证券资产管理有限公司	277,109,611.41	389,999

关联方名称	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
华泰证券股份有限公司	277,109,611.41	389,999
招商证券股份有限公司	277,109,611.41	389,999
山东国信证券资产管理有限公司	277,109,611.41	389,999
万家基金管理有限公司	277,109,611.41	389,999
上海东方证券资产管理有限公司	277,109,611.41	389,999

关联方名称	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
华泰证券股份有限公司	277,109,611.41	389,999
招商证券股份有限公司	277,109,611.41	389,999
山东国信证券资产管理有限公司	277,109,611.41	389,999
万家基金管理有限公司	277,109,611.41	389,999
上海东方证券资产管理有限公司	277,109,611.41	389,999

关联方名称	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
华泰证券股份有限公司	277,109,611.41	389,999
招商证券股份有限公司	277,109,611.41	389,999
山东国信证券资产管理有限公司	277,109,611.41	389,999
万家基金管理有限公司	277,109,611.41	389,999
上海东方证券资产管理有限公司	277,109,611.41	389,999