万家中证创业成长指数分级证券投资基金

【2015】第二季度报告

基金管理人:万家基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2015年7月20日

§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。

基金托管人中国工商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财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月01日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家中创		
基金主代码	161910		
交易代码	161910		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年8月2日		
报告期末基金份额总额	177,458,844.14份		
投资目标	本基金采用被动式指数化投资方法,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪偏离度不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。		
投资策略	本基金为指数型基金,采用完全复制的方法进行投资运作,按照成份股在中证创业成长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。当成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的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,以便实现对跟踪误差的有效控制。		
业绩比较基准	95%×中证创业成长指数收益率+5%×银行同业存款利率。		
风险收益特征	本基金为指数分级基金,不同的基金份额具有不同的风险收益特征。万家创业成长份额为常规指数基金份额,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。		
基金管理人	万家基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
下属分级基金简称	万家创A	万家创B	万家中创
下属分级基金交易代码	150090	150091	161910
下属分级基金报告期末基金份额总额	80,400,026.00份	80,400,027.00份	16,658,791.14份
下属分级基金的风险收益特征	万家创业成长A份额,具有较低风险、收益相对稳定的特征。	万家创业成长B份额具有高风险、高预期收益的特征。	万家创业成长份额为常规指数基金份额,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	9,268,925.63
2.本期利润	-22,980,472.26
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2910
4.期末基金资产净值	144,181,835.33
5.期末基金份额净值	0.8125

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。

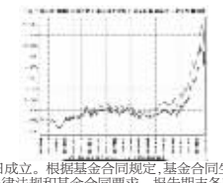
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	11.14%	3.05%	13.22%	2.98%	-2.08%	0.07%

注:业绩比较基准为95%×中证创业成长指数收益率+5%×银行同业存款利率

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



注:本基金于2012年8月2日成立。根据基金合同规定,基金合同生效后六个月内为建仓期,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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
姚霞天	本基金基金经理、万家180指数基金、万家中证红利指数分级基金和万家上证380ETF基金经理。	2015年5月22日	-	7年	基金经理。复旦大学金融学硕士。2007年7月至2008年6月任泰信基金管理有限公司量化分析师;2008年9月至2009年5月任上海金程国际金融学院FRM讲师;2009年9月加入万家基金管理有限公司,历任风险分析师、量化分析师、基金经理助理、投资经理等职。现任万家180指数基金、万家中证红利指数基金(LOF)、万家中证创业成长指数分级基金和万家上证380ETF基金经理。
吴涛	本基金基金经理、万家180基金基金经理、万家中证红利指数(LOF)基金基金经理、万家上证380ETF基金基金经理、量化投资部总监	2012年8月2日	2015年5月22日	18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。

注:1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

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遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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《公平交易管理办法》和《异常交易监控及报告管理办法》等规章制度,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,确保公平对待不同投资组合,防范导致不公平交易以及利益输送的异常交易发生。

公司制订了明确的投资授权制度,并建立了统一的投资管理平台,确保不同投资组合获得公平的投资决策机会。实行集中交易制度,对于交易所公开竞价交易,执行交易系统中的公平交易程序;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,按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;对于银行间交易,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。为保证公平交易原则的实现,通过制度规范、流程审批、系统风控参数设置等进行事前控制,通过对投资交易系统的实时监控进行事中控制,通过对异常交易的监控和分析实现事后控制。

4.3.2 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。

本报告期内无下列情况: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%。

4.4 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

报告期内,经过6月份的下跌,市场对经济增长低于预期的情绪得到充分释放,在各类经济数据的支撑下,股指稳步反弹,市场成交活跃,主题类投资大行其道。市场风格小盘、成长风格市场表现优于大盘蓝筹股。本基金标的指数中证创业成长指数作为代表市场高成长中小市值公司的指数也取得了较好的收益。作为被动操作的指数基金,本基金严格执行基金合同规定的投资策略,按照规定的投资策略和方法进行投资操作,努力拟合标的指数,减小跟踪误差。由于个别交易日巨额申购赎回以及成分股剧烈波动,导致报告期内本基金跟踪误差有所增加,本基金报告期内日跟踪误差为0.6850%,年化跟踪误差为11.98%。

本基金标的指数所代表的是高成长中小市值公司的集合,在经济结构调整及转型的背景下,完全基于扎实的上市公司基本面成长性选股的编制方法,在今后有望取得更好的市场表现。本基金管理人将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,为基金份额持有人谋求长期、稳定回报。

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0.8125 元,本报告期基金份额净值增长率为11.14%,业绩比较基准收益率13.22%

4.5 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4月22日至5月28日,基金资产净值连续26个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情况。本基金没有出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情况。

§5 投资组合报告

5.1 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	132,211,874.56	90.83
	其中:股票	132,211,874.56	90.83
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	13,261,320.84	9.11
7	其他资产	94,320.72	0.06
8	合计	145,567,516.12	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	280.50	0.00
B	采矿业	3,264.64	0.00
C	制造业	73,080,564.99	50.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,716,781.13	1.19
E	建筑业	2,948,255.36	2.04
F	批发和零售业	1,370,627.93	0.95
G	交通运输、仓储和邮政业	2,265.71	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,235,880.17	16.81
J	金融业	7,297,354.00	5.06
K	房地产业	6,194,939.73	4.30
L	租赁和商务服务业	4,213,327.77	2.92
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,159,685.06	2.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	521,403.00	0.36
Q	卫生和社会工作	2,783,994.06	1.93
R	文化、体育和娱乐业	4,681,324.24	3.25
S	综合	1,926.27	0.00
	合计	132,211,874.56	91.70

5.2.2 报告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。

5.3 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

5.3.1 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	300059	东方财富	138,103	8,712,918.27	6.04
2	002415	海康威视	144,274	6,463,475.20	4.48
3	300104	乐视网	107,900	5,584,904.00	3.87
4	002450	康得新	168,936	5,169,441.60	3.59
5	300027	华谊兄弟	102,838	3,922,241.32	2.72
6	002673	西部证券	130,400	3,699,448.00	2.57
7	002736	国信证券	143,400	3,597,906.00	2.50
8	002202	金风科技	179,100	3,487,077.00	2.42
9	002241	歌尔声学	90,125	3,235,487.50	2.24
10	300124	汇川技术	55,452	2,661,696.00	1.85

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 报告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

5.5 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。

5.6 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投资。

5.7 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同,本基金暂不可投资于股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同,本基金暂不可投资国债期货。

5.10 资组合报告附注

5.10.1

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,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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	61,142.57
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,626.93
5	应收申购款	30,551.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	94,320.72

5.10.4 报告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转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 报告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。

5.10.5.2 报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	万家创A	万家创B	万家中创
报告期期初基金份额总额	3,040,784.00	3,040,785.00	4,684,751.86
报告期期间基金总申购份额	-	-	229,743,554.20
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	78,202,934.01
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	77,359,242.00	77,359,242.00	-139,566,580.91
报告期期末基金份额总额	80,400,026.00	80,400,027.00	16,658,791.14

注:本报告期基金拆分变动份额包含基金份额配对转换及基金份额折算所带来的变动数。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本季度未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 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、《万家中证创业成长指数分级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、万家中证创业成长指数分级证券投资基金2015年第二季度报告原文。

6、万家基金管理有限公司董事会决议。

8.2 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>

8.3 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7月20日

万家增强收益债券型证券投资基金

【2015】第二季度报告

基金管理人:万家基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2015年7月20日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至2015年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家增强收益债券
基金主代码	161902
交易代码	161902
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年9月28日
报告期末基金份额总额	396,301,107.88份
投资目标	在满足基金资产良好流动性的前提下,谋求基金资产的稳健增值。
投资策略	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,追求基金资产的长期稳定增值。并通过新股申购和投资于相对价值被低估的成长型股票谋取增强收益。
业绩比较基准	中证全债指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型和混合型基金,高于货币市场基金。
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	17,203,191.24
2.本期利润	11,043,447.55
3.加权平均基金份额本期利润	0.0297
4.期末基金资产净值	507,323,742.94
5.期末基金份额净值	1.2801

注:1、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。

2、上表中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。

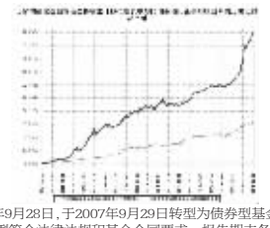
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	2.22%	0.36%	2.21%	0.09%	0.01%	0.27%

注:基金业绩比较基准中证全债指数

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注:本基金成立于2004年9月28日,于2007年9月29日转型为债券型基金,转型后建仓期为半年,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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙驰	本基金基金经理、万家货币基金基金经理、万家日日薪货币基金基金经理、万家双利债券型基金基金经理、万家强化收益定期开放债券型基金基金经理、万家现金宝货币市场基金基金经理、固定收益部总监	2011年3月19日	-	8年	硕士学位,曾任中海信托股份有限公司投资经理。2010年4月加入万家基金管理有限公司,曾担任固定收益研究员、基金经理助理。

注:1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

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遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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《公平交易管理办法》和《异常交易监控及报告管理办法》等规章制度,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,确保公平对待不同投资组合,防范导致不公平交易以及利益输送的异常交易发生。

公司制订了明确的投资授权制度,并建立了统一的投资管理平台,确保不同投资组合获得公平的投资决策机会。实行集中交易制度,对于交易所公开竞价交易,执行交易系统中的公平交易程序;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,按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;对于银行间交易,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。为保证公平交易原则的实现,通过制度规范、流程审批、系统风控参数设置等进行事前控制,通过对投资交易系统的实时监控进行事中控制,通过对异常交易的监控和分析实现事后控制。

4.3.2 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。

本报告期内无下列情况: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%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度,经济环境变化不大,基本面依旧比较低迷,央行也在此环境下继续进行了降准降息等货币政策放松的操作。但债券市场收益率却先下后上,原因在于收益率下到了低位后,市场对货币政策的放松已经有点审美疲劳,地方债务置换源源不断出炉引发了供给增加的担心,同时ipo的加速带来了资金面的扰动,引发了债券的收益率上行。

本基金在兼顾流动性的同时,根据大类资产配置灵活调整各类资产比例,抓住了纯债和权益的投资机会,获得了可观的绝对收益。

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1.2801元,本报告期份额净值增长率为2.22%,同期业绩比较基准增长率为2.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

货币政策继续放松的背景下,债券市场依然面临着有利的环境。但同时基本面企稳的可能以及地方债务置换形成的供给压力,都会对债券市场形成压制。好消息是IPO暂停,打新基金缩水后对债券需求会增加。股市暴跌后,可能会面临一段时间的盘整期,期间有价值的品种会面临结构性机会。

本基金还是基于大类资产配置的原则,在管理好流动性的同时,灵活操作,努力为持有人获得良好回报。

4.6 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,本基金没有出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情况。

§5 投资组合报告

5.1 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	37,759,234.56	7.01
	其中:股票	37,759,234.56	7.01
2	固定收益投资	479,794,035.76	89.11
	其中:债券	479,794,035.76	89.11
	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	7,164,642.30	1.33
7	其他资产	13,710,248.56	2.55
8	合计	538,428,161.18	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,500,000.00	0.49
B	采矿业	-	-
C	制造业	15,197,700.00	3.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,640,615.00	0.32
G	交通运输、仓储和邮政业	3,931,200.00	0.77
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	14,489,719.56	2.86
K	房地产业	-	-
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	37,759,234.56	7.44

5.3 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

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	002241	歌尔声学	220,000	7,898,000.00	1.56
2	601006	大秦铁路	280,000	3,931,200.00	0.77
3	600016	民生银行	386,674	3,843,539.56	0.76
4	601318	中国平安	40,000	3,277,600.00	0.65
5	601336	新华保险	50,000	3,053,000.00	0.60
6	002447	壹桥海参	200,000	2,500,000.00	0.49
7	600587	新华医疗	40,000	2,345,200.00	0.46
8	600036	招商银行	110,000	2,059,200.00	0.41
9	000513	丽珠集团	30,000	2,034,900.00	0.40
10	000750	国海证券	120,000	2,016,000.00	0.40

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	14,030,192.00	2.77
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,058,000.00	1.98
	其中:政策性金融债	10,058,000.00	1.98
4	企业债券	214,606,670.66	42.30
5	企业短期融资券	140,908,000.00	27.77
6	中期票据	81,370,000.00	16.04
7	可转债	8,453,673.10	1.67
8	其他	10,367,500.00	2.04
9	合计	479,794,035.76	94.57

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	126019	09长虹债	550,960	54,996,827.20	10.84
1	041260019	09长虹债	550,960	54,996,827.20	10.84
2	112119	12恒邦债	339,869	34,591,866.82	6.82
3	101452009	14浙农资MTN001	300,000	30,660,000.00	6.04
4	041553013	15广新CP001	300,000	30,243,000.00	5.96
5	011599058	15锦产业SCP001	300,000	30,213,000.00	5.96

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据基金合同,本基金暂不可投资于国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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,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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	368,628.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,480,482.06
5	应收申购款	3,861,138.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,710,248.56

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128009	歌尔转债	6,351,200.00	1.25

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600587	新华医疗	2,345,200.00	0.46	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	324,535,394.76
报告期期间基金总申购份额	199,076,718.82
减:报告期期间基金总赎回份额	127,311,005.70
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	396,301,107.88

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 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、《万家增强收益债券型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及其他临时公告

5、万家增强收益债券型证券投资基金2015年第二季度报告原文

6、万家基金管理有限公司董事会决议

8.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所,并登载于基金管理人网站:<http://www.wjasset.com>

8.3 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7月20日

万家行业优选股票型证券投资基金(LOF)

【2015】第二季度报告

基金管理人:万家基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2015年7月20日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家行业优选股票型
基金主代码	161903
交易代码	161903
基金运作方式	契约型上市开放式基金(LOF)
基金合同生效日	2005年7月15日
报告期末基金份额总额	360,803,951.89份
投资目标	本基金主要投资景气行业或预期景气度向好的行业股票,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采取优选行业和精选个股相结合的主动投资管理方式,并适度动态配置大类资产。
业绩比较基准	80%×沪深300指数收益率+20%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金是股票型基金,风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金,属于较高风险、较高预期收益的证券投资基金。
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	136,563,758.23
2.本期利润	65,362,883.05
3.加权平均基金份额本期利润	0.1687
4.期末基金资产净值	330,513,918.05
5.期末基金份额净值	0.9160

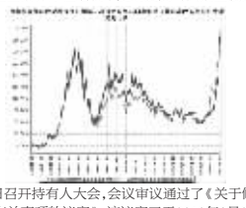
注:(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;(2)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	24.59%	2.75%	8.86%	2.09%	15.73%	0.66%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注:本基金于2013年7月11日召开持有人大会,会议审议通过了《关于修改万家公用事业行业股票型证券投资基金(LOF)基金合同有关事项的议案》,该议案已于2013年8月28日通过并完成向中国证监会的备案。根据基金份额持有人大会决议,原"万家公用事业行业股票型证券投资基金(LOF)"更名为"万家行业优选股票型证券投资基金(LOF)"。更名后基金的建仓期为持有人大会决议生效日起6个月。建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同要求。

管理人报告

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
莫海波	本基金基金经理、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家精选股票型证券投资基金基金经理、投资研究部总监	2015年5月6日	-	5	-投资研究部总监,MBA,2010年进入财富证券责任有限公司,任分析师、投资经理助理;2011年进入中银国际证券有限责任公司基金,任分析师、环保行业研究员、策略分析师、投资经理。2015年3月加入本公司,现任投资研究部总监、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家精选股票型证券投资基金基金经理和万家行业优选股票型证券投资基金基金经理。
章恒	本基金基金经理、万家精选股票型基金基金经理	2015年2月12日	-	7	基金经理。清华大学硕士,2007年5月进入东方基金任研究员,2009年9月进入天弘基金任