万家双利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04月01日起至06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家双利
基金主代码	519190
交易代码	519190
基金运作方式	契约型开放式。
基金合同生效日	2013年3月6日
报告期末基金份额总额	84,536,501.70份
投资目标	在合理控制风险和保持资产流动性的前提下,追求基金资产的长期稳定增值,力争获得超过业绩比较基准的收益。
投资策略	在严格控制风险并保持良好流动性的基础上,力争通过主动的组合管理实现超越业绩比较基准的收益。基金管理人在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上,采取积极主动地投资管理策略,通过定性与定量分析,对利率变化趋势、债券收益率曲线移动方向、信用利差等影响固定收益投资品价格的因素进行评估,对不同投资品种运用不同的投资策略,并充分利用市场的非有效性,把握各类套利的机会。在信用风险可控的前提下,寻求组合流动性与收益的最佳配比,力求持续取得达到或超过业绩比较基准的收益。
业绩比较基准	中债总全价指数(总值)
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金
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

注:基金份额持有人大会于2015 年6 月8 日表决通过了《关于修改万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同有关事项的议案》。《万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》修订为《万家双利债券型证券投资基金基金合同》,详情请参阅相关公告。

§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	2,744,391.76
2.本期利润	2,554,816.37
3.加权平均基金份额本期利润	0.0109
4.期末基金资产净值	89,043,878.89
5.期末基金份额净值	1.0533

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。

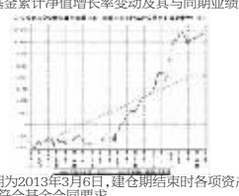
2、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	1.16%	0.03%	0.27%	0.04%	0.89%	-0.01%

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:(1)本基金合同生效日期为2013年3月6日,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合基金合同要求。

(2)基金份额持有人大会于2015 年6 月8 日表决通过了《关于修改万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同有关事项的议案》。《万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》修订为《万家双利债券型证券投资基金基金合同》。

§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、万家增强收益基金基金经理、万家日日薪货币基金基金经理、万家强化收益定期开放债券型发起式基金基金经理、固定收益部总监	2014年5月24日	-	6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1.0533元,本报告期份额净值增长率为1.16%,业绩比较基准收益率0.27%

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	3,407,850.00	3.15
	其中:股票	3,407,850.00	3.15
2	固定收益投资	17,203,873.08	15.91
	其中:债券	17,203,873.08	15.91
	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	10,000,000.00	9.25
	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	77,152,361.10	71.36
7	其他资产	348,982.20	0.32
8	合计	108,113,066.38	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,236,650.00	1.39
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	2,171,200.00	2.44
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	3,407,850.00	3.83

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	25,000	897,500.00	1.01
2	600016	民生银行	50,000	497,000.00	0.56
3	002142	宁波银行	20,000	423,000.00	0.48
4	000728	国元证券	10,000	379,800.00	0.43
5	601288	农业银行	100,000	371,000.00	0.42
6	000513	丽珠集团	5,000	339,150.00	0.38
7	600030	中信证券	10,000	269,100.00	0.30
8	601688	华泰证券	10,000	231,300.00	0.26

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	17,203,873.08	19.32
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	17,203,873.08	19.32

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	112172	13晋邦债	55,000	5,522,000.00	6.20
2	122126	11虎大02	40,000	4,206,000.00	4.72
3	112046	11华孚01	40,000	4,024,400.00	4.52
4	122216	12铜昆债	20,000	2,033,600.00	2.28
5	112180	12奥飞债	13,009	1,310,266.48	1.47

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国债期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

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。

5.9.2

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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	8,041.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	340,941.11
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	348,982.20

5.9.4 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处于转股期的可转换债券。

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	438,024,997.69
报告期期间基金总申购份额	24,793,507.24
减:报告期期间基金总赎回份额	378,282,003.23
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	84,536,501.70

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期,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、《万家双利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、更新招募说明书及其他临时公告。

5、万家双利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

万家上证380交易型开放式指数证券投资基金

【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:华夏银行股份有限公司
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。

基金托管人华夏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6月30日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	1,724,652.00份
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。
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

§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	3,808,068.60
2.本期利润	2,215,944.20
3.加权平均基金份额本期利润	0.6941
4.期末基金资产净值	3,754,275.20
5.期末基金份额净值	2.1768

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。

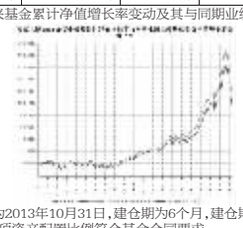
2、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	23.10%	2.92%	24.63%	3.00%	-1.53%	-0.08%

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:1、本基金合同生效日为2013年10月31日,建仓期为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。报告期末各项资产配置比例符合基金合同要求。

§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	本基金经理、万家180指数基金基金经理、万家中证红利指数基金(LOF)基金经理、万家中证创业成长指数分级基金基金经理	2015年5月22日	-	7	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。
吴涛	本基金经理、量化投资部总监、万家180指数基金基金经理、万家中证红利指数基金基金经理、万家中证创业成长指数分级基金经理	2014年11月14日	2015年5月22日	21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、任职日期以公告为准。

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

2015年第一季度,市场在去年底创新高后进入调整期,受到改革预期刺激后在3月份再次迎来一波强劲的上涨,大盘蓝筹股再创新高,成交量急剧放大。中小板、创业板则是在一季度一路上扬,涨幅更强于大盘股。报告期本基金投资标的指数——上证380指数收益率为24.63%。

本基金作为被动投资的ETF基金,其投资目标是通过跟踪、复制上证380指数,为投资者获取股票市场长期的平均收益。报告期内我们严格按照基金合同规定,采取了完全复制方法进行投资管理,努力拟合标的指数、减小跟踪误差。

报告期内,本基金采用有效的量化跟踪技术,将基金跟踪误差控制在较低范围内。跟踪误差主要是由于基金申购赎回、标的指数成分股定期调整、各类费用等因素所造成。

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2.1768元,报告期内基金份额净值增长率为23.10%,同期业绩比较基准收益率为24.63%。本基金日均跟踪偏离度为0.0981%,年化跟踪误差1.72%,符合基金合同中日平均跟踪偏离度低于0.2%和年跟踪误差低于2%的规定。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

自1月13日至6月30日,基金资产净值连续60个工作日以上低于五千万元。经与基金托管人华夏银行股份有限公司协商一致,基金管理人于7月8日向中国证券监督管理委员会提交了将万家上证380交易型开放式指数证券投资基金变更注册为万家上证50交易型开放式指数证券投资基金的申请。

§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	3,751,516.48	94.64
	其中:股票	3,751,516.48	94.64
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	211,366.21	5.33
7	其他资产	1,221.89	0.03
8	合计	3,964,104.58	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	18,739.50	0.50
B	采矿业	157,881.36	4.21
C	制造业	2,014,338.15	53.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	247,870.53	6.60
E	建筑业	142,093.28	3.78
F	批发和零售业	384,010.15	10.23
G	交通运输、仓储和邮政业	355,634.89	9.47
H	住宿和餐饮业	8,940.00	0.24
I	信息传输、软件和信息技术服务业	144,355.04	3.85
J	金融业	-	-
K	房地产业	107,359.45	2.86
L	租赁和商务服务业	40,637.01	1.08
M	科学研究和技术服务业	8,671.00	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	8,331.00	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,453.00	0.09
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	42,732.00	1.14
S	综合	66,470.12	1.77
	合计	3,751,516.48	99.93

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	601718	际华集团	2,800	42,336.00	1.13
2	600410	华胜天成	800	38,272.00	1.02
3	601333	广深铁路	3,955	32,510.10	0.87
4	600009	上海机场	1,000	31,700.00	0.84
5	600978	宜华木业	1,400	31,416.00	0.84
6	600587	新华医疗	522	30,604.86	0.82
7	600872	中炬高新	1,400	30,268.00	0.81
8	600482	风帆股份	660	27,970.80	0.75
9	600881	亚泰集团	2,200	27,962.00	0.74
10	600863	内蒙华电	3,335	27,280.30	0.73

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将选择流动性好、交易活跃的股指期货合约,根据风险管理的原则,以套期保值为目的投资,从而降低股票仓位调整的交易成本,提高投资效率,由于更好地跟踪标的指数,实现投资目标。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同,本基金暂不可投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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情况,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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,183.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	38.39
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,221.89

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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

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	601718	际华集团	42,336.00	1.13	重大事项
2	600410	华胜天成	38,272.00	1.02	重大事项
3	600978	宜华木业	31,416.00	0.84	重大事项
4	600587	新华医疗	30,604.86	0.82	重大事项
5	600872	中炬高新	30,268.00	0.81	重大事项
6	600482	风帆股份	27,970.80	0.75	重大事项

5.11.5.2 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

注: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

报告期期初基金份额总额	4,724,652.00
报告期期间基金总申购份额	5,000,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	8,000,000.00
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	1,724,652.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期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、《万家上证380交易型开放式指数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、万家上证380交易型开放式指数证券投资基金2015年第2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

万家日日薪货币市场证券投资基金

【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	万家日日薪		
基金主代码	519511		
交易代码	519511		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013年1月15日		
报告期末基金份额总额	122,720,883.15份		
投资目标	本基金在力保本金安全性和基金资产流动性的基础上,追求超过业绩比较基准的稳定收益。		
投资策略	本基金主要为投资者提供短期现金管理工具,因此本基金最主要的投资策略是在保持安全性和流动性的前提下尽可能提升组合的收益。基金管理人根据对宏观经济走势、国家货币政策、资金供求、利率期限结构变动趋势等的研究与判断,预测货币市场利率水平,确定投资组合的平均剩余期限。本基金控制整个投资组合的平均剩余期限不得超过120天。		
业绩比较基准	银行活期存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。		
基金管理人	万家基金管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	万家日日薪A	万家日日薪B	万家日日薪R
下属分级基金的交易代码	519511	519512	519513
报告期末下属分级基金的份额总额	46,997,296.79份	75,723,586.36份	0.00份

§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)		
	万家日日薪A	万家日日薪B	万家日日薪R
1. 本期已实现收益	606,220.06	470,722.46	0.00
2.本期利润	606,220.06	470,722.46	0.00
3.期末基金资产净值	46,997,296.79	75,723,586.36	0.00

注: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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家日日薪A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9558%	0.0113%	0.0873%	0.0000%	0.8685%	0.0113%

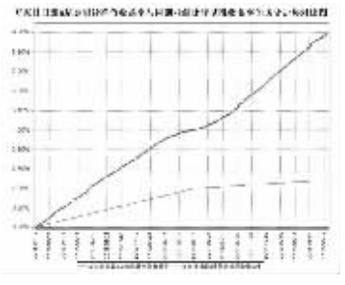
万家日日薪B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.0164%	0.0113%	0.0873%	0.0000%	0.9291%	0.0113%

万家日日薪R

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金成立于2013年1月15日,建仓期为本《基金合同》生效之日(2013年1月15日)起两周,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合基金合同要求。

2、2014年5月16日,本基金转型为货币市场基金,转型后本基金设三类基金份额:A 类基金份额、B类基金份额和R 类基金份额,其中B类基金份额的指标计算自分类实施日(2014年5月16日)算起,B类基金份额为0,因此无收益数据。

§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、万家货币市场基金、万家双利债券型证券投资基金、万家增强收益债券基金、万家