# 万家180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:中国银行股份有限公司
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180指数 |
| 基金主代码 | 519180 |
| 交易代码 | 519180 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2003年3月17日 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,806,955,406.33份 |
| 投资目标 | 本基金通过运用指数化投资方法,力求基金的股票组合收益率拟合上证180指数的增长率。伴随中国经济增长和资本市场的发展,实现利用指数化投资方法谋求基金资产长期增值的目标。 |
| 投资策略 | 本基金以跟踪目标指数为原则,实现与市场同步成长为基本理念。指数化投资是一种充分考虑投资者利益的投资方法,采取拟合目标指数收益率的投资策略,分散投资于目标指数所包含的股票中,力求股票组合的收益率拟合目标指数所代表的资本市场的平均收益率。 |
| 业绩比较基准 | 95%×上证180指数收益率+5%×银行同业存款利率 |
| 风险收益特征 | 本基金追踪上证180指数,是一种风险适中、长期资本收益稳健的投资产品,并具有长期稳定的投资风格。 |
| 基金管理人 | 万家基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |

§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 | 923,840,812.34 |
| 2.本期利润 | 420,734,641.63 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1224 |
| 4.期末基金资产净值 | 2,863,254,813.81 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0201 |

注:1、上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(例如,开放式基金的申购、赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

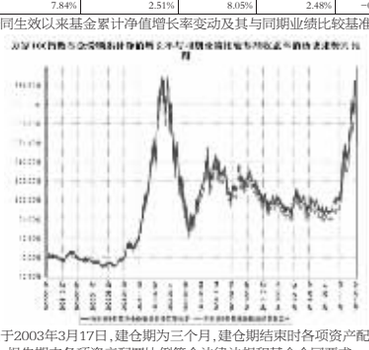
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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 | 7.84% | 2.51% | 8.05% | 2.48% | -0.21% | 0.03% |

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2003年3月17日,建仓期为三个月,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 | 本基金经理、万家上证380ETF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年 | 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 | 本基金基金经理、万家中证红利基金基金经理、万家中证创业成长指数分级基金基金经理、万家上证380ETF基金基金经理、量化投资部总监 | 2010年3月31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、闽方总部副总经理、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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2015年第二季度,市场在前期继续接棒3月份以来的一波强劲上涨并继续发酵,大盘蓝筹股再创新高,成交量急剧放大,中小板、创业板的表现相对于大盘股更加迅猛。但进入6月中旬之后,本轮由流动性推动的牛市开始出现了大幅下调,而政府也迅速出手开始稳定市场,包括降息、定向降准以及成立平准基金等,预期股市快速下挫行情况有望得到改善。

本基金作为被动投资型的指数基金,其投资目标是通过跟踪、复制上证180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。本基金报告期内日跟踪误差为0.1780%,符合基金合同规定的日拟合偏离度不超过0.5%的规定。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1.0201元,报告期基金份额净值增长率为7.84%,业绩比较基准收益率8.05%。

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,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 | 2,715,971,913.86 | 93.66 |
| | 其中:股票 | 2,715,971,913.86 | 93.66 |
| 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 | 166,180,879.44 | 5.73 |
| 7 | 其他资产 | 17,694,110.53 | 0.61 |
| 8 | 合计 | 2,899,846,903.83 | 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 | 9,202,120.96 | 0.32 |
| B | 采矿业 | 135,468,677.03 | 4.73 |
| C | 制造业 | 697,261,302.55 | 24.35 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 120,673,459.65 | 4.21 |
| E | 建筑业 | 142,108,016.42 | 4.96 |
| F | 批发和零售业 | 42,822,683.18 | 1.50 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 114,570,080.51 | 4.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 112,189,299.30 | 3.92 |
| J | 金融业 | 1,155,557,197.36 | 40.36 |
| K | 房地产业 | 125,739,335.29 | 4.39 |
| L | 租赁和商务服务业 | 13,846,476.24 | 0.48 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 9,957,646.04 | 0.35 |
| 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 | 18,084,869.68 | 0.63 |
| S | 综合 | 18,490,749.65 | 0.65 |
| | 合计 | 2,715,971,913.86 | 94.86 |

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 | 601318 | 中国平安 | 1,803,315 | 147,763,631.10 | 5.16 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 5,495,774 | 102,880,889.28 | 3.59 |
| 3 | 600016 | 民生银行 | 9,840,621 | 97,815,772.74 | 3.42 |
| 4 | 601398 | 工商银行 | 15,025,323 | 79,333,705.44 | 2.77 |
| 5 | 600030 | 中信证券 | 2,620,814 | 70,526,104.74 | 2.46 |
| 6 | 601166 | 兴业银行 | 3,805,754 | 65,649,256.50 | 2.29 |
| 7 | 600000 | 浦发银行 | 3,726,855 | 63,207,460.80 | 2.21 |
| 8 | 600837 | 海通证券 | 2,694,415 | 58,738,247.00 | 2.05 |
| 9 | 601766 | 中国南车 | 3,052,969 | 56,052,510.84 | 1.96 |
| 10 | 601328 | 交通银行 | 6,536,184 | 53,858,156.16 | 1.88 |

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

根据基金合同,本基金暂不可能投资于股指期货。

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,本基金暂不可投资于国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在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 | 3,706,362.14 |
| 2 | 应收证券清算款 | 12,077,978.66 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 35,233.72 |
| 5 | 应收申购款 | 1,874,536.01 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 17,694,110.53 |

5.11.4 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

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。

5.11.5.2 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

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 | 4,071,298,630.66 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 671,689,035.62 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 1,936,032,259.95 |
| 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 | 2,806,955,406.33 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内,基金管理人未发生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、中国证监会批准万家180指数证券投资基金发行及募集的文件

2、《万家180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180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

基金管理人和基金托管人的办公场所,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

# 万家和谐增长混合型证券投资基金

## 【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:兴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。

基金托管人兴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2015年6月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 万家和谐增长混合 |
| 基金主代码 | 519181 |
| 交易代码 | 519181 |
| 前端交易代码 | 519181 |
| 后端交易代码 | 519182 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2006年11月30日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,234,957,839.60份 |
| 投资目标 | 本基金通过有效配置股票、债券投资比例、平衡长期买入持有和事件驱动投资的优化选择策略,控制投资风险,谋取基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金最大特点是突出和谐增长,主要包含三层含义:一、资产配置的和谐,通过有效配置股票、债券资产比例,谋求基金资产在股票、债券投资中风险、收益的和谐平衡;二、长期买入持有和事件驱动投资约和谐,通过对不同行业、不同股票内在价值与市场价格的偏离程度和其市场价格向内在价值的回归速度的分析,谋求基金资产在不同行业和不同股票投资中长期投资和事件驱动投资的和谐平衡。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数×65%+中证全债指数×30%+同业存款利率×5% |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金,其预期收益及风险水平介于股票型基金与债券型基金之间,属于中等风险收益水平基金。 |
| 基金管理人 | 万家基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 兴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 | 486,563,449.19 |
| 2.本期利润 | 162,211,206.95 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1072 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,096,631,913.97 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.8880 |

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 | 7.98% | 2.72% | 7.88% | 1.70% | 0.10% | 1.02% |

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2006年11月30日,建仓期为半年,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 | | |
| 莫海波 | 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。 |
| 华光磊 | 本基金基金经理,万家双引擎灵活配置基金基金经理、权益投资部副总监 | 2013年1月4日 | 2015年5月5日 | 11年 | 学士学位,2004年8月进入光大证券研究所工作,于2008年获得新财富房地产行业最佳分析师第三名(团队);2008年12月加入光大证券资产管理总部;2009年9月加入天弘基金,分别担任研究员、基金经理助理等职务;2011年5月加入万家基金,先后担任研究总监助理、研究总监等职务。 |

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

2015年二季度股票市场整体出现较大的波动,6月中旬以前市场稳步上涨,其后出现了较深幅度的下跌,下跌主要是由于前期涨幅较大获利盘太多叠加去杠杆的因素。二季度沪深300指数上涨10.41%、创业板指数上涨22.42%。

二季度,本基金继续保持了一直以来秉持了稳健的思路,5月下旬开始慢慢减仓前期涨幅较大的创业板和题材股,加仓了前期涨幅相对落后的银行、地产和非银行业,换仓取得了较好的效果。

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0.8880元,本报告期份额净值增长率为7.98%,业绩比较基准收益率为7.88% 。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

指数经过前期大幅上涨后,积累了大量的浮盈,而杠杆资金在这波行情中也起到助涨助跌的作用。当杠杆太高、浮盈盘太多时,市场只要有风吹草动就会引发踩踏和恐慌。但是,当在某一时点高杠杆被清理完之后,市场就会达到一个相对平衡,并在这个平衡点震荡筑底。依据以下三个逻辑,一是居民大类资产向金融资产转移的趋势没有变。第二,中国无风险利率向下走的趋势没有变,这意味着居民的风险偏好会提高。第三,企业直接融资发IPO,就需要保持股市稳步向上的节奏,我们判断上证指数调整后已经到了中期的底部区域,再向下的空间不大,市场经过震荡去杠杆和消化前期的获利盘后重回上升通道,但创业板风险并未完全释放,还有下探空间。

换仓后在此次调整中略占主动,在坚持个股精选的同时,努力把握行业轮动的机会,从而实现为投资者带来绝对收益的最终目标。

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 | 1,016,751,684.45 | 88.11 |
| | 其中:股票 | 1,016,751,684.45 | 88.11 |
| 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 | 124,483,959.40 | 10.79 |
| 7 | 其他资产 | 12,747,104.67 | 1.10 |
| 8 | 合计 | 1,153,982,748.52 | 100.00 |

5.2 报告期末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 | - | - |
| C | 制造业 | 359,744,417.83 | 32.80 |
| 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 | 599,995.50 | 0.05 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 37,660,140.00 | 3.43 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 74,970,031.50 | 6.84 |
| J | 金融业 | 398,340,521.91 | 36.32 |
| K | 房地产业 | 145,436,577.71 | 13.26 |
| 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 | 1,016,751,684.45 | 92.72 |

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 | 000513 | 丽珠集团 | 1,419,811 | 96,305,780.13 | 8.78 |
| 2 | 002174 | 游族网络 | 724,046 | 67,162,506.96 | 6.12 |
| 3 | 600037 | 歌华有线 | 2,068,001 | 65,142,031.50 | 5.94 |
| 4 | 601688 | 华泰证券 | 2,622,807 | 60,665,525.91 | 5.53 |
| 5 | 600048 | 保利地产 | 5,038,900 | 57,544,238.00 | 5.25 |
| 6 | 600036 | 招商银行 | 2,959,400 | 55,399,968.00 | 5.05 |
| 7 | 601998 | 中信银行 | 5,400,000 | 41,634,000.00 | 3.80 |
| 8 | 600000 | 浦发银行 | 2,287,000 | 38,787,520.00 | 3.54 |
| 9 | 000800 | 一汽轿车 | 1,529,825 | 38,062,046.00 | 3.47 |
| 10 | 600270 | 外运发展 | 1,291,500 | 37,660,140.00 | 3.43 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末本基金未持有债券。

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

报告期末本基金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

报告期末本基金未持有贵金属。

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

报告期末本基金未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金未持有股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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

本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 | 2,556,329.78 |
| 2 | 应收证券清算款 | 9,881,076.92 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 63,412.32 |
| 5 | 应收申购款 | 246,285.65 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 12,747,104.67 |

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中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 | 1,655,628,892.94 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 279,795,007.25 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 700,466,060.59 |
| 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 | 1,234,957,839.60 |

§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、中国证监会批准万家和谐增长混合型证券投资基金发行及募集的文件。

2、《万家和谐增长混合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、万家和谐增长混合型证券投资基金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

# 信达澳银转型创新股票型证券投资基金

## 【2015】第二季度报告

基金管理人:信达澳银基金管理有限公司
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。

基金托管人中国建设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15日(基金合同生效日)起至6月30日止。

§2基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 信达澳银转型创新股票 |
| 基金主代码 | 001105 |
| 交易代码 | 001105 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年4月15日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,593,147,566.04份 |
| 投资目标 | 在有效控制风险的前提下,深度挖掘企业转型创新过程中产生的各类投资机遇,力争在中长期为投资者获取超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金采取自上而下和自下而上相结合的积极主动的投资策略,并对投资组合进行动态调整。由于本基金为股票型基金,核心投资策略为股票精选策略,同时辅以资产配置策略优化投资组合的风险收益,提升投资组合回报。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×85%+上证国债指数收益率×15% |
| 风险收益特征 | 基金风险等级:高风险。本基金是股票型基金,长期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金,属于风险及预期收益较高的证券投资基金产品。 |
| 基金管理人 | 信达澳银基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |

§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15日 - 2015年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 396,763,354.36 |
| 2.本期利润 | 126,846,922.22 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0539 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,501,576,791.94 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.943 |

注:1、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的认购、申购及赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

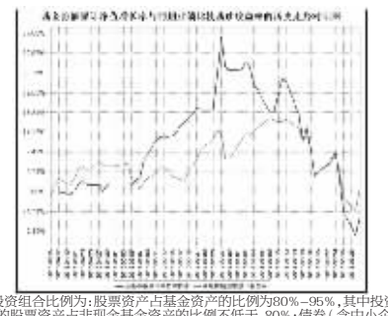
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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①② | 净值增长率标准差③ | 业绩比较基准收益率④ | 业绩比较基准收益率标准差⑤ | ①-④ | ②-③ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -5.70% | 3.20% | 1.06% | 2.36% | -6.76% | 0.84% |

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:1、本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为80%-95%,其中投资于本基金定义的转型创新主题相关的股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%;债券(含中小企业私募债、可转换债券等)资产、现金、货币市场工具、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为5%-20%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%;权证的投资比例不超过基金资产净值的3%;资产支持证券的投资比例不超过基金资产净值的20%。

2、本基金基金合同生效日2015年4月15日至报告期末未满1年。按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,本报告期处于建仓期内,建仓期结束时本基金的各项投资比例将符合基金合同的有关约定。

§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(助理)期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 杜鹏鹏 | 本基金的基金经理、精华配置混合基金基金经理、消费优选股票基金基金经理、红利回报股票基金基金经理 | 2015-4-15 | - | 7年 | 中国人民银行研究生部金融学硕士。2008年8月加入信达澳银基金公司,历任投资研究部研究员、信达澳银精华配置混合基金基金经理助理、信达澳银精华灵活配置混合基金基金经理(2012年4月6日起至今)、信达澳银消费优选股票基金基金经理(2013年12月19日起至今)、信达澳银红利回报股票基金基金经理(2015年2月14日起至今)、信达澳银转型创新股票基金基金经理(2015年4月15日起至今)。 |
| 尹哲 | 本基金的基金经理、消费优选股票基金基金经理 | 2015-4-15 | - | 6年 | 中南大学管理学博士。2009年5月起在金鹰基金公司任职,历任行业研究员、基金经理助理;2014年6月加入信达澳银基金公司,历任股票投资部高级研究员、信达澳银消费优选股票基金基金经理(2014年10月22日起至今)、信达澳银转型创新股票基金基金经理(2015年4月15日起至今)。 |

注:1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职(或离任)日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定等。

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《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、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,在严格控制投资风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,没有发生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

本基金管理人已经建立了投资决策及交易内控制度, 确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,维护投资者的利益。本基金管理人建立了严谨的公平交易机制,确保不同基金在买卖同一证券时,按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司对报告期内