

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  
送出日期:2015年8月26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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字确认，并由董事长签发。

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8月25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和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金托管人承诺以诚实信用、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。

基金管理人和基金托管人对基金净值的计算、利润分配等财务指标、基金资产净值和投资组合报告的内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人和基金托管人对各自应当承担的责任，根据相关法律法规、基金合同和本报告的各项声明予以说明。

§ 2 基金简介

# 万家上证380交易型开放式指数证券投资基金

## 2015 年度报告摘要

6.1 资产负债表

会计主体:万家上证380交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日: 2015年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日	
		金额	占基金总资产比例(%)
资产:			
银行存款	206,888.25	399,372.20	
结算备付金	4,489,936	5,509,46	
库存现金	1,135,50	7,067	
交易性金融资产	3,751,516.48	9,217,242.84	
其中:股票投资	3,751,516.48	9,217,242.84	
基金投资	-	-	
债券投资	-	-	
资产支持证券投资	-	-	
贵金属投资	-	-	
衍生金融资产	-	-	
买入返售金融资产	-	-	
应收证券清算款	5,987,57	-	
应收利息	38.39	101.14	
应收股利	-	-	
应收申购款	-	-	
应付证券清算款	-	-	
应付利息	-	-	
应付申购款	-	-	
应付赎回款	-	-	
应付交易费用	-	-	
应付手续费	-	-	
应付交易保证金	-	-	
应付税费	-	-	
应付利润	-	-	
负债和所有者权益			
本报告期末 2015年6月30日		9,628,922.96	
2014年12月31日		-	

2.1 基金基本情况

基金名称:万家上证380ETF

基金类别:股票型基金

基金代码:510988

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

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

报告期末基金份额总额:1,724,652,00

报告期末基金份额净值:1.00

基金资产净值:1,724,652,00

报告期末资产总额:1,724,652,00

报告期末负债总额:0.00

报告期末所有者权益总额:1,724,652,00

2.2 基金产品说明

投资目标:紧密跟踪上证380指数,力求将基金净值表现与上证380指数表现相挂钩。

投资策略:本基金将全部资产投资于上证380指数所包含的股票,并根据标的指数的成份股构成及其权重,结合对成份股基本面的研究,通过股票被动投资,在严格控制风险的前提下,追求基金净值的长期稳定增长。

业绩比较基准:上证380指数

风险收益特征:本基金属于股票型基金,风险与收益较高。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目 基金管理人 基金托管人

名称 万家基金管理有限公司 华夏银行股份有限公司

姓名 三剑 徐晓彬

信息披露负责人 联系电话 021-38909626

电子邮箱 lanwu@jiayufund.com

客户服务电话 95534转4,4008990000

传真 021-38909627

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址: http://www.jiayufund.com

基金半年度报告备置地点:上海市浦东新区浦电路360号陆家嘴投资大厦9楼基金管理人办公场所

报告期半年度报告摘要: 53

3.1 主要财务指标和基金净值表现

金额单位:人民币元

3.1.1 利润和利润分配

报告期(2015年1月1日-2015年6月30日) 4,208,652.33

本期已实现收益 4,208,652.33

本期利润 4,208,652.33

加权平均基金份额本期利润 1.0002

本期基金份额净值增长率为 50.77%

3.1.2 利润和利润分配

报告期(2015年1月1日至2015年6月30日) 1.1768

期初基金份额净值 3.754,276.20

报告期末基金份额净值 3.754,276.20

注:1.本期已实现收益指基金本期利润收入、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,计价费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.期末可供分配利润采用期末资产减去期末资产总值后未分配利润。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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 份额净值增长 率 (%) 份额净值增 长率标准差 (%) 业绩比较基 准收益率 (%) 业绩比较基 准收益率标准差 (%) ①-③ ②-④

过去一个月 -9.18% 3.91% -0.15% 3.93% -0.03% -0.12%

过去三个月 23.10% 2.92% 24.63% 3.00% -153% -0.08%

过去六个月 68.77% 2.33% 63.79% 2.30% -502% -0.06%

过去一年 126.13% 1.84% 136.89% 1.87% -1165% -0.03%

自基金合同生效至报告期 117.68% 1.69% 137.96% 1.64% -20.28% -0.04%

注:1.基金已实现收益指基金本期利润收入、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,计价费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.期末可供分配利润采用期末资产减去期末资产总值后未分配利润。

3.2.2 基金净值表现

3.2.2.1 基金份额净值

报告期(2015年1月1日至2015年6月30日) 1.1768

报告期初基金份额净值 3.754,276.20

报告期末基金份额净值 3.754,276.20

注:1.本期已实现收益指基金本期利润收入、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,计价费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.期末可供分配利润采用期末资产减去期末资产总值后未分配利润。

3.2.2.2 基金净值表现

3.2.2.2.1 基金份额净值

报告期(2015年1月1日至2015年6月30日) 1.1768

报告期初基金份额净值 3.754,276.20

报告期末基金份额净值 3.754,276.20

注:1.基金已实现收益指基金本期利润收入、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,计价费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.期末可供分配利润采用期末资产减去期末资产总值后未分配利润。

3.2.2.2.2 基金净值表现

3.2.2.2.2.1 基金份额净值

报告期(2015年1月1日至2015年6月30日) 1.1768

报告期初基金份额净值 3.754,276.20

报告期末基金份额净值 3.754,276.20

注:1.基金已实现收益指基金本期利润收入、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,计价费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.期末可供分配利润采用期末资产减去期末资产总值后未分配利润。

3.2.2.2.2.2 基金净值表现

3.2.2.2.2.2.1 基金份额净值

报告期(2015年1月1日至2015年6月30日) 1.1768

报告期初基金份额净值 3.754,276.20

报告期末基金份额净值 3.754,276.20

注:1.基金已实现收益指基金本期利润收入、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,计价费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.期末可供分配利润采用期末资产减去期末资产总值后未分配利润。

3.2.2.2.2.2.2 基金净值表现

3.2.2.2.2.2.2.1 基金份额净值

报告期(2015年1月1日至2015年6月30日) 1.1768

报告期初基金份额净值 3.754,276.20

报告期末基金份额净值 3.754,276.20

注:1.基金已实现收益指基金本期利润收入、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,计价费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.期末可供分配利润采用期末资产减去期末资产总值后未分配利润。

3.2.2.2.2.2.2.2 基金净值表现

3.2.2.2.2.2.2.2.1 基金份额净值

报告期(2015年1月1日至2015年6月30日) 1.1768

报告期初基金份额净值 3.754,276.20

报告期末基金份额净值 3.754,276.20