

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10月26日

1 重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员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、完整性和及时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10月22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。

本报告期截至2015年1月1日起至9月30日止。

2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称:万家上证380交易型开放式指数证券投资基金

基金场内简称:万家上证380ETF

基金场内代码: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:5,724,652,000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。

本基金采用完全复制法跟踪标的指数，同时引入部分现金、股票期货、权证等金融工具对组合进行调整，以降低组合的跟踪误差。

本基金力争在风险调整后收益不低过2%，未来根据市场情况，本基金将根据实际情况进行调整。

本基金的业绩基准为标的指数，若标的指数发生变更，基金管理人将根据实际情况对业绩基准进行调整。

业绩比较基准:标的指数×2.2%+现金比例

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

2.2 主要财务指标

单位:人民币元

报告期(2015年1月1日 - 2015年9月30日)

1.本期已实现收益 103,206.67

2.本期利润 -1,796,379.00

3.期初现金及现金等价物余额 -3,015.65

4.期末现金及现金等价物余额 8,206,060.55

5.期末基金份额净值 1.4326

注:1.本期已实现收益指本基金本期利息收入、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.上证基金指数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将低于所列数据。

2.3 基金净值表现

3.2.1 本基金本期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(%) 业绩比较基准净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%)

① ② ③ ④ ⑤

过去三个月 -34.15% -31.7% 4.46% -2.78% 0.11%

3.2.2 本基金同期以来(以基金份额累计净值计算)净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金同期以来(以基金份额累计净值计算)净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

2.4 管理人报告

本基金报告期内未出现可能影响公平交易和利益输送的异常情况。

本基金报告期内未出现所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

超过该证券成交金额的1%。

4.1 公司基本情况

4.1.1 公司概况

2015年1季度，在经济企稳向好的背景下，市场整体的流动性好和交易量都有了明显的提高，市场

政策预期逐步趋好而趋于平稳。进入4月份以来，市场整体的流动性好和交易量都有了明显的提高，

政策预期逐步趋好而趋于平稳。虽然实体经济总体上仍然偏弱，但由于市场风险已经得到了较大

程度的释放，估值也已基本合理，同时，预期宽松和微刺激的政策环境仍将延续，部分基本面良好及

估值合理的股票将会有较好的表现。对于银行股而言，由于其估值较低，业绩稳定，且银行股的市

盈率也相对较高，因此，银行股的估值较低，业绩稳定，且银行股的市盈率也相对较高，因此，银行

股的估值较低，业绩稳定，且银行股的市盈率也相对较高，因此，银行股的估值较低，业绩稳定，且银行

股的估值较低，业绩稳定，且银行股的市盈率也相对较高，因此，银行股的估值较低，业绩稳定，且银行