

万家上证50交易型开放式指数证券投资基金

[2015] 第四季度报告

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:2016年1月22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2016年1月20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。

报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	万家上证50ETF
场内简称	万家50
基金代码	510490
交易代码	510490
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012年10月31日
报告期末基金份额总额	3,724,652,000份
投资目标	紧密跟踪标的指数，即上证50指数，实现对标的指数的紧密跟踪，帮助投资者有效回避单只股票的系统性风险，从而获得与标的指数相当的收益。
投资策略	本基金主要通过被动投资的方法实现对标的指数的跟踪，即通过构建与标的指数成分股构成比例一致的股票组合，以期获得与标的指数相当的回报。本基金在严格控制跟踪误差的前提下，对股票组合进行定期调整，以使股票组合的构成与标的指数的构成相一致。本基金将定期评估和调整股票组合的构成，以期获得与标的指数相当的回报。
业绩比较基准	本基金选择上证50指数作为业绩比较基准，该指数由上海证券交易所编制，选取在上海证券交易所上市的50只规模大、流动性强的股票组成，能够较好地反映沪市大盘股票的整体走势。
风险收益特征	本基金为交易型开放式基金，风险收益特征与标的指数相似，即高风险、高收益。
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

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期三四利润	90,326,116
2.本期利润	1,722,162,30
3.加权平均基金份额本期利润	0.3836
4.期末基金份额净值	6,372,269,073
5.期末基金份额总值	1,7108

注:1.本期利润为本报告期内已实现收益占上期平均份额净值变动的比例。
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.基金净值增长率为净值增长/净值年初数。

4.期末基金份额净值

5.期末基金份额总值

6.报告期每万份基金净收益

7.报告期基金份额净值增长率

8.报告期基金份额净值增长率标准差

9.报告期基金份额净值增长率差

10.报告期基金份额净值增长率标准差

11.报告期基金份额净值增长率差

12.报告期基金份额净值增长率差

13.报告期基金份额净值增长率差

14.报告期基金份额净值增长率差

15.报告期基金份额净值增长率差

16.报告期基金份额净值增长率差

17.报告期基金份额净值增长率差

18.报告期基金份额净值增长率差

19.报告期基金份额净值增长率差

20.报告期基金份额净值增长率差

21.报告期基金份额净值增长率差

22.报告期基金份额净值增长率差

23.报告期基金份额净值增长率差

24.报告期基金份额净值增长率差

25.报告期基金份额净值增长率差

26.报告期基金份额净值增长率差

27.报告期基金份额净值增长率差

28.报告期基金份额净值增长率差

29.报告期基金份额净值增长率差

30.报告期基金份额净值增长率差

31.报告期基金份额净值增长率差

32.报告期基金份额净值增长率差

33.报告期基金份额净值增长率差

34.报告期基金份额净值增长率差

35.报告期基金份额净值增长率差

36.报告期基金份额净值增长率差

37.报告期基金份额净值增长率差

38.报告期基金份额净值增长率差

39.报告期基金份额净值增长率差

40.报告期基金份额净值增长率差

41.报告期基金份额净值增长率差

42.报告期基金份额净值增长率差

43.报告期基金份额净值增长率差

44.报告期基金份额净值增长率差

45.报告期基金份额净值增长率差

46.报告期基金份额净值增长率差

47.报告期基金份额净值增长率差

48.报告期基金份额净值增长率差

49.报告期基金份额净值增长率差

50.报告期基金份额净值增长率差

51.报告期基金份额净值增长率差

52.报告期基金份额净值增长率差

53.报告期基金份额净值增长率差

54.报告期基金份额净值增长率差

55.报告期基金份额净值增长率差

56.报告期基金份额净值增长率差

57.报告期基金份额净值增长率差

58.报告期基金份额净值增长率差

59.报告期基金份额净值增长率差

60.报告期基金份额净值增长率差

61.报告期基金份额净值增长率差

62.报告期基金份额净值增长率差

63.报告期基金份额净值增长率差

64.报告期基金份额净值增长率差

65.报告期基金份额净值增长率差

66.报告期基金份额净值增长率差

67.报告期基金份额净值增长率差

68.报告期基金份额净值增长率差

69.报告期基金份额净值增长率差

70.报告期基金份额净值增长率差

71.报告期基金份额净值增长率差

72.报告期基金份额净值增长率差

73.报告期基金份额净值增长率差

74.报告期基金份额净值增长率差

75.报告期基金份额净值增长率差

76.报告期基金份额净值增长率差

77.报告期基金份额净值增长率差

78.报告期基金份额净值增长率差

79.报告期基金份额净值增长率差

80.报告期基金份额净值增长率差

81.报告期基金份额净值增长率差

82.报告期基金份额净值增长率差

83.报告期基金份额净值增长率差

84.报告期基金份额净值增长率差

85.报告期基金份额净值增长率差

86.报告期基金份额净值增长率差

87.报告期基金份额净值增长率差

88.报告期基金份额净值增长率差

89.报告期基金份额净值增长率差

90.报告期基金份额净值增长率差

91.报告期基金份额净值增长率差

92.报告期基金份额净值增长率差

93.报告期基金份额净值增长率差

94.报告期基金份额净值增长率差

95.报告期基金份额净值增长率差

96.报告期基金份额净值增长率差

97.报告期基金份额净值增长率差

98.报告期基金份额净值增长率差

99.报告期基金份额净值增长率差

100.报告期基金份额净值增长率差

101.报告期基金份额净值增长率差

102.报告期基金份额净值增长率差

103.报告期基金份额净值增长率差

104.报告期基金份额净值增长率差

105.报告期基金份额净值增长率差

106.报告期基金份额净值增长率差

107.报告期基金份额净值增长率差

108.报告期基金份额净值增长率差

109.报告期基金份额净值增长率差

110.报告期基金份额净值增长率差

111.报告期基金份额净值增长率差

112.报告期基金份额净值增长率差

113.报告期基金份额净值增长率差

114.报告期基金份额净值增长率差

115.报告期基金份额净值增长率差

116.报告期基金份额净值增长率差

117.报告期基金份额净值增长率差

118.报告期基金份额净值增长率差

119.报告期基金份额净值增长率差

120.报告期基金份额净值增长率差

121.报告期基金份额净值增长率差

122.报告期基金份额净值增长率差

123.报告期基金份额净值增长率差

124.报告期基金份额净值增长率差

125.报告期基金份额净值增长率差

126.报告期基金份额净值增长率差

127.报告期基金份额净值增长率差

128.报告期基金份额净值增长率差

129.报告期基金份额净值增长率差

130.报告期基金份额净值增长率差

131.报告期基金份额净值增长率差

132.报告期基金份额净值增长率差

133.报告期基金份额净值增长率差

134.报告期基金份额净值增长率差

135.报告期基金份额净值增长率差