万家14天理财债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

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

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等有关法律、法规及基金合同的有关规定募集。并经中国证监会证监许可[2012]1441号文核准。本基金的基金合同于2013年1月15日正式生效。

【重要提示】

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本基金招募说明书。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅本基金的基金合同。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。本基金在投资运作过程中可能面临各种风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等。本基金特有风险包括：1）每个运作期到期日前，基金份额持有人不能提出赎回申请，因此面临流动性风险。2）如果投资者运作期到期日当日未赎回，其持有的基金份额将自动转入下一个14天的投资周期，期间也将无法赎回其持有的份额。3）本基金名称为万家14天理财债券型证券投资基金，但是考虑到法定节假日等原因，每份基金份额的实际运作期期限或有不同，可能短于或长于14天的运作期期限或有变化风险。本基金是一只短期理财债券型证券投资基金，属于证券投资基金中较低与其风险较低预期收益品种，投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。在投资者作出投资决策后，基金投资运作与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

本基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2014年1月15日，有关财务数据和净值表现截止日为2013年12月31日，财务数据未经审计。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：万家基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区浦电路360号9层

办公地址：上海市浦东新区浦电路360号9层

法定代表人：毕玉国

成立日期：2002年8月23日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字【2002】44号

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理和中国证监会许可的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿元

存续期间：持续经营

联系人：兰剑

电话：021－38619810　　传真：021－38619888 （二）主要人员情况

（1）基金管理人董事会成员

董事长毕玉国先生，中共党员，硕士学历，高级会计师，注册企业风险管理师。历任莱钢股份公司炼铁厂财务科科长，莱钢股份公司财务处成本科科长，莱钢集团财务部副部长，莱钢驻日照钢铁有限公司财务总监，齐鲁证券计划财务部总经理，齐鲁证券副总经理兼财务负责人等职。现任齐鲁证券有限公司党委委员、总经理兼财务负责人。2011年3月起任本公司董事长，现兼任万家共赢资产管理有限公司董事长。

董事马永春先生，政治经济学硕士学位，曾任新疆自治区党委政策研究室科长，新疆通宝投资有限公司总经理，新疆对外经贸集团总经理，新疆天山股份有限公司董事，现任新疆国际实业股份有限公司副董事长兼总经理。

董事吕祥发先生，中共党员，大学本科，硕士学位，高级经济师，曾任莱芜钢铁集团有限公司财务处科长、鲁银投资集团股份有限公司办公室主任兼董事会秘书、天同证券风险处置工作小组托管组成员，现任齐鲁证券有限公司副总经理兼合规总监、董事会秘书、党委组织部部长、人力资源部总经理、鲁证期货有限公司董事。

董事吕宜振先生，中共党员，博士研究生。曾任易方达基金管理有限公司研究主管、信诚基金管理有限公司研究总监、天弘基金管理有限公司投资总监，2011年5月起加入本公司，历任公司副总经理，现任公司总经理。

独立董事刘兴云先生，中共党员，管理学博士，教授，曾任山东财政学院会计系副主任、党总支书记、教务长、副院长，中央人民政府驻香港特别行政区联络办公室行政财务部副部长、巡视员兼副部长，现任山东财经大学党委书记兼校长，并从事企业财务管理方向的理论研究。

独立董事陈增敬先生，中国民主建国会成员，博士研究生，教授，曾任山东大学数学院讲师兼副教授，法国国家信息与自动化研究所博士后，加拿大西安大略大学保险系访问学者、兼职教授，山东大学金融研究院（现更名为山东大学齐鲁证券金融研究院）常务副院长兼教授，现任山东大学齐鲁证券金融研究院院长兼数学院副院长、教授。

独立董事骆玉鼎先生，中共党员，研究生，经济学博士，副教授，曾任上海财经大学金融学院银行系讲师，上海财经大学证券期货学院副教授、副院长，美国国际管理研究生院（雷鸟）访问研究员，上海财经大学证券期货学院副院长兼副教授，新疆财经大学金融系支教教师，上海财经大学金融学院副院长、常务副院长，上海财经大学金融学院副教授，现任上海财经大学商学院副院长。

（2）基金管理人监事会成员

监事会主席李润起先生，硕士学位，经济师。曾任宏源证券股份有限公司文艺路营业部客户主管、公司投行部项目经理，新疆国际实业股份有限公司证券事务代表，现任新疆国际实业股份有限公司董事会秘书兼副总经理。

监事崔朋朋先生，中共党员，工商管理硕士，经济师，先后任职于山东智星计算机总公司、中创软件、山东山大华特科技股份有限公司，将军控股有限公司。现任山东省国有资产投资控股有限公司项目经理、副部长。

监事兰剑先生，法学硕士，律师、注册会计师，曾在江苏淮安知源律师事务所、上海和华利盛律师事务所从事律师工作，现为本公司信息披露负责人、合规稽核部总监。

监事李丽女士，中共党员，硕士，中级讲师，先后任职于中国工商银行济南分行、济南卓越外语学校、山东中医药大学。2008年3月起加入本公司，现任公司综合管理部副总监。

监事蔡鹏鹏女士，本科，先后任职于北京幸福之光商贸有限公司、北方之星数码技术（北京）有限公司、路通资讯香港有限公司，2007年4月起加入本公司，现任公司机构理财部副总监。

3、基金管理人高级管理人员

董事长：毕玉国先生（简介请参见基金管理人董事会成员）

总经理：吕宜振先生（简介请参见基金管理人董事会成员）

副总经理：偷志令先生，大学本科，学士学位。1997年至2004年任职于国泰君安证券从事证券营销管理工作；2004年至2005年任职于中银国际证券，任营业部副总经理；2005年至2009年任职于信诚基金管理有限公司，直销部副总监等职；2009年至2011年任职于天弘基金管理有限公司，任机构理财部总经理兼上海分公司总经理；2011年加入本公司，任机构理财部总监、总经理助理。2013年4月起任本公司副总经理。

副总经理：李杰先生，硕士研究生。1994年至2003年任职于国泰君安证券，从事行政管理、机构客户开发等工作；2003年至2007年任职于兴安证券从事营销管理工作；2007年至2011年任职于齐鲁证券，任营业部高级经理、总经理等职；2011年加入本公司，任综合管理部总监、董事会秘书、总经理助理。2013年4月起任本公司副总经理。

督察长：李振伟先生，中共党员，大学本科，学士学位，高级经济师。1998年6月起从事证券监管工作，先后任证监会济南证管办党委办公室、上市处主任科员，证监会济南证管办上市处、机构处副处长，证监会山东证监局机构处副处长、处长，本公司总经理、监事会主席等职。2012年4月起任本公司督察长。

4.本基金基金经理简历

孙驰，男，硕士学位，2007年7月至2010年4月在中海信托股份有限公司从事固定收益投资研究工作，担任投资经理职务。2010年4月加入万家基金管理有限公司，历任固定收益研究员、基金经理助理。现任固定收益部副总监、万家货币基金基金经理、万家14天理财债券基金基金经理、万家增强收益债券基金基金经理、万家强化收益定期开放债券基金基金经理。

历任基金经理：

邹昱：2011年6月至2013年4月

5.投资决策委员会成员

委员会主席：吕宜振

副主席：刘芳洁

委员：吴涛、华光磊、朱虹、吴印、孙驰、刘荆、高翰昆

吕宜振先生，万家基金管理有限公司总经理

刘芳洁先生，万家基金管理有限公司总经理助理、权益投资总监、权益投资部总监（兼）万家和谐基金基金经理

吴涛先生，量化投资部总监、万家180基金基金经理、万家中证红利基金基金经理、万家中证创业成长基金基金经理

华光磊先生，研究部总监、万家和谐基金基金经理、万家双引擎基金基金经理

朱虹女士，固定收益部总监、万家稳健增利债券基金基金经理、万家恒利债券基金基金经理、万家添利分级债券基金基金经理、万家岁得利定期开放债券基金基金经理、万家市政基金基金经理、万家城建债基金基金经理

吴印先生，权益投资部副总监，万家行业优选股票基金（LOF）基金经理、万家精选股票基金基金经理

孙驰先生，固定收益部副总监、万家货币基金基金经理、万家增强收益债券基金基金经理、万家强化收益定期开放债券基金基金经理、万家14天理财债券型证券投资基金基金经理

刘荆先生，研究部副总监

高翰昆先生，交易部副总监

6.上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座九层

法定代表人：蒋超良

注册资本：32,479,411.7万元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23号

联系人：李芳菲

联系电话：010－63201510

传真：010－63201816

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广、服务领域最广、服务对象最多、业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营，可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计，并获得无保留意见的SAS70审计报告，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在2010年首届“‘金牌理财’TOP10颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004年9月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

（二）主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工140余名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

（三）基金托管业务经营情况

截止2013年12月31日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共188只。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1.直销机构

本基金直销机构为万家基金管理有限公司以及本公司的网上交易平台。

住所、办公地址：上海市浦东新区浦电路360号9层

法定代表人：毕玉国

联系人：刘怡君

电话：(021)38619982

传真：(021)38619998

客户服务热线：400－888－0800；95538转6

投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购、申购及赎回等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。网上交易网址：

https://trade.wjasset.com/

2.代销机构

（1）、中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人：蒋超良

客户服务电话：95599（或拨打各城市营业网点咨询电话）

网址：www.abchina.com

（2）、交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人：胡怀邦

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

（3）、招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

客服电话：95555

网址：www.cmbchina.com

（4）、齐鲁证券有限公司

注册地址：山东省济南市市中区经七路86号

法定代表人：李玮

客服电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

（5）、光大证券股份有限公司

注册地址：上海市新闸路1508号

法定代表人：徐浩明

客服电话：400－888－8788，10108998，95525

网址：www.ebscn.com

（6）、海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路689号

办公地址：上海市广东路689号

法定代表人：王开国

电话：021－23219000

传真：021－ 23219100

联系人：李笑鸣

客服电话：95553或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网址：www.htsec.com

（7）、信达证券股份有限公司

注册地址、办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心

法定代表人：高冠江

客户服务电话：400－800－8899

网址：www.cindasc.com

（8）、中国银河证券股份有限公司

注册地址、办公地址：北京市西城区金融大街35号2－6层

法定代表人：陈有安

客户服务电话：400－888－8888

网址：www.chinastock.com.cn

（9）、国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法人代表人：何如

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

（10）、山西证券股份有限公司

注册地址：太原市府西街69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

客户服务电话：400－666－1618

网址：www.i618.com.cn

（11）、上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路336号

法定代表人：郁忠民

客户服务电话：400－891－8918，021－962518

网址：www.962518.com

（12）、东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区翠园路181 号商旅大厦18－21 层

法定代表人：吴永敏

客户服务电话：4008601555

网址：www.dwzq.com.cn

（13）、日信证券有限责任公司

注册地址：呼和浩特市新城区锡林南路18号

法定代表人：孔伐杰

客户服务电话：400－660－9839

网址：www.rxzq.com.cn

（14）、申银万国证券股份有限公司

客服电话：021－95523，4008－895523

网址：www.sywg.com

（15）、国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路618 号

法定代表人：万建华

客服电话：400－888－8666

网址：www.gtja.com

（16）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

法定代表人：王常青

客户服务电话：400－888－8108

网址：www.csc108.com

（17）、中国国际金融有限公司

电话：010－65051166

网址：www.cicc.com.cn

（18）、招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A 座38－45 层

法定代表人：宫少林

客户服务电话：400－8888－111，95565

网址：www.newone.com.cn

（19）、中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层

办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层

法定代表人：张智河

联系人：吴忠超

电话：0532－85022326

客服电话：0532－96577

网址：www.zxwt.com.cn

（20）、江海证券有限公司

住所：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

法定代表人：孙名扬

联系人：张宇宏

电话：0451－82336863

传真：0451－82287211

客户服务热线：400－666－2288

网址：www.jhzq.com.cn

（21）、上海好买基金销售有限公司

客服电话：400－700－9665

网址：www. ehowbuy.com

（22.杭州数米基金销售有限公司

客服电话：4000－766－123

网址：www.fund123.cn

（23）、长量基金销售投资顾问有限公司

客服电话：400－089－1289

网址：www.erichfund.com

（24）、上海天天基金销售有限公司

客服电话：400－1818－188

网址：www.1234567.com.cn

（25）、深圳众禄基金销售有限公司

客服电话：4006－788－887

网址：www.zlfund.com

（25）和讯信息技术有限公司

客服电话：400－920－0022

网址：licaike.hexun.com

（26）中国中投证券有限责任公司

客户服务电话：95532

公司网站：http://www.china－invs.cn/

(27) 金元证券股份有限公司

客户服务电话：4008－888－228??

公司网站：www.jyzq.cn

场内代销机构指由中国证监会核准的具有开放式基金代销资格，并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员(以下简称“有资格的上证所会员”)，名单详见上海证券交易所网站：

http://www.sse.com.cn/sseportal/ps/zhs/hyzq/zxzg_szjit.jsp

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）基金登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京西城区金融大街27号投资广场23层

电话：（010）58598888

传真：（010）58598824

（三）律师事务所

名称：北京市大成律师事务所上海分所

住所：上海市世纪大道100号上海环球金融中心24层

电话：（021）3872 2416

联系人：华涛

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所

住所：北京市东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层（100738）

办公地址：上海市浦东新区 世纪大道100号上海环球金融中心50楼（200120）

联系电话：（021）22288888

传真：（021）22280000

联系人：徐艳

经办注册会计师：徐艳，汤骏

四、基金的名称

万家14天理财债券型证券投资基金

五、基金的类型

基金类别：短期理财债券型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金存续期间：不定期

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资方向

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括现金、一年以内（含一年）的银行定期存款和大额存单、剩余期限在397天以内（含397天）的债券（不包括可转换债券）、资产支持证券、中期票据、期限在一年以内（含一年）的债券回购、剩余期限在一年以内（含一年）的中央银行票据，以及经中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

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134天。

1.资产配置策略

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、信用利差等影响债券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。

2.利率预期策略

利率变化是影响债券价格的最重要的因素，利率预期策略是本基金的基本投资策略。本基金通过对宏观经济、金融政策、市场供需、市场结构变化等因素的分析，采用定性分析与定量分析相结合的方法，形成对未来利率走势的判断，并在此基础上对债券组合的久期结构进行有效配置，以达到降低组合利率风险，获取较高投资收益的目的。

3.类属配置策略

不同类型的债券在收益率、流动性和信用风险上存在差异，债券资产有必要配置于不同类型的债券品种以及在不同市场上进行配置，以寻求收益性、流动性和信用风险补偿间的最佳平衡点。本基金将综合信用分析、流动性分析、税收及市场结构等因素分析的结果来决定投资组合的类别资产配置策略。

4.债券品种选择策略

在上述债券投资策略的基础上，本基金对个券进行定价，充分评估其到期收益率、流动性溢价、信用风险补偿、税收、含权等因素，选择那些定价合理或价值被低估的债券进行投资。

具有以下一项或多项特征的债券，将是本基金债券投资重点关注的对象：

(1)符合前述投资策略；

(2)短期内价值被低估的品种；

(3)具有套利空间的品种；

(4)符合风险管理指标；

(5)双边报价债券品种；

(6)市场流动性高的债券品种。

5.其他衍生工具的投资策略

对于未来推出的国债期货等新型金融工具或衍生金融工具，如法律法规或监管机构允许基金投资，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金对衍生金融工具的投资主要以套期保值或无风险套利为主要目的。将在届时相应法律法规的框架内，制订符合本基金投资目标的投资策略，同时结合对衍生工具的研究，在充分考虑衍生产品风险和收益特征的前提下，谨慎进行投资。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：7天通知存款税后利率

通知存款是一种不约定存期，支取时需提前通知银行，约定支取日期和金额方能支取的存款，具有存期灵活、存取方便的特征，同时可获得高于活期存款利息的收益。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩基准时，经与基金托管人协商一致，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为短期理财债券型基金，属于证券投资基金中较低风险、预期收益较为稳定的品种，其预期的风险水平低于股票型基金、混合型基金和普通债券型基金。

十一、投资组合报告

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2014年1月7日复核了本招募说明书中的投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2013年12月31日，本报告中所列财务数据未经审计。

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	固定收益投资	9,995,109.68	7.42
	其中：债券	9,995,109.68	7.42
	资产支持证券	－	－
2	买入返售金融资产	65,000,000.00	48.25
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	－	－
3	银行存款和结算备付金合计	2,530,168.84	1.88
4	其他资产	57,190,307.51	42.45
5	合计	134,715,586.03	100.00

2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	0.01
	其中：买断式回购融资	0.00
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	－	－
	其中：买断式回购融资	－	－

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注：本基金合同约定：“本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

3 基金投资组合平均剩余期限

3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

序号	项目	天数
	报告期末投资组合平均剩余期限	9
	报告期内投资组合平均剩余期限最高值	44
	报告期内投资组合平均剩余期限最低值	2

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注：本基金合同约定：“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过134天”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.89	17.66
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
2	30天(含)—60天	9.31	－
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	9.31	－
3	60天(含)—90天	－	－
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
4	90天(含)—180天	－	－
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
5	180天(含)—397天（含）	－	－
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
	合计	72.20	17.66

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	摊余成本(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	9,995,109.68	9.31
	其中：政策性金融债	9,995,109.68	9.31
4	企业债券	－	－
5	企业短期融资券	－	－
6	中期票据	－	－
7	其他	－	－
8	合计	9,995,109.68	9.31
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	9,995,109.68	9.31

5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130211	13国开11	100,000	9,995,109.68	9.31

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)－0.5%间的次数	27
报告期内偏离度的最高值	－0.0605%
报告期内偏离度的最低值	－0.3478%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2121%

7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8 投资组合报告附注

8.1

本基金估值采用摊余成本法计价，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销，每日计提损益。

本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.00元。

8.2

本报告期内本基金发生持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

序号	发生日期	该类浮动债占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2013年12月19日	20.28	大额赎回	5个工作日
2	2013年12月20日	20.28	大额赎回	5个工作日
3	2013年12月21日	20.28	大额赎回	5个工作日
4	2013年12月22日	20.28	大额赎回	5个工作日
5	2013年12月23日	20.28	大额赎回	5个工作日
6	2013年12月24日	20.15	大额赎回	5个工作日
7	2013年12月25日	20.70	大额赎回	5个工作日

8.3 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不存在受到公开谴责、处罚的情形。

8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	－
2	应收证券清算款	－
3	应收利息	90,307.51
4	应收申购款	57,100,000.00
5	其他应收款	－
6	待摊费用	－
7	其他	－
8	合计	57,190,307.51

十二、基金的业绩

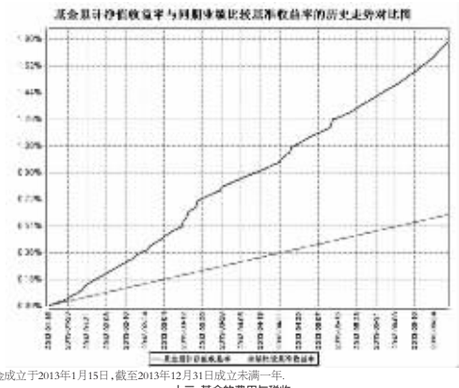
基金业绩截止日为2013年12月31日，托管人中国农业银行于2014年1月7日复核了本招募说明书中的基金净值表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。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。

（一）本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
2013年4季度	0.8304%	0.0035%	0.3403%	0.0000%	0.4901%	0.0035%
基金成立日至2013年12月31日	3.5517%	0.0054%	1.2982%	0.0000%	2.2535%	0.0054%

（二）自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较（2013年1月15日至2013年12月31日）



注：本基金成立于2013年1月15日，截至2013年12月31日成立未满一年.

十三、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

1.基金管理人的管理费；

2.基金托管人的托管费；

3.销售服务费；

4.《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

5.《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

6.基金份额持有人大会费用；

7.基金的证券交易费用；

8.基金的银行汇划费用；

9.按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1.基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.27%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.27%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2.基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.08%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.08%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3.销售服务费

基金销售服务费按前一日的基金资产净值的0.30%的年费率计算。计算方法如下：

H＝E×0.30%÷当年天数

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给注册登记机构，由注册登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第4—9项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1.基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2.基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3.《基金合同》生效前的相关费用；

4.其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（四）税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，对基金管理人于2013年8月28日刊登的本基金招募说明书进行了更新，并根据本基金管理人在本基金成立后对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要更新内容如下：

1、在招募说明书的“重要提示”部分，明确了更新内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。

2、在招募说明书的“三、基金管理人”部分，更新了基金管理人的有关内容。

3、在招募说明书的“四、基金托管人”部分，更新了基金托管人的有关内容。

4、在招募说明书的“九、基金的投资”部分，增加了基金最近一期（2013年第四季度）投资组合报告内容。

5、在招募说明书中增加“十、基金的业绩”部分，更新了基金成立以来的投资业绩。

6、在招募说明书中增加“二十二、其他应披露事项”部分，并增加了自上次招募说明书更新公告以来本基金的公告事项。

万家基金管理有限公司

2014年2月28日

（上接B78版）

法定代表人：李招弟

联系人：高晓芳

联系电话：010－59393923

业务传真：010 －59393074

客服热线：400－808－6069

公司网址：www.wy－fund.com

（82）名称：上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼

法定代表人：其实

联系人：潘世友

联系电话：021－54509998

业务传真：021－64385308

客服热线：4001818188

公司网址：www.1234567.com.cn

（83）名称：杭州数米基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼

法定代表人：陈柏青

联系人：张裕

联系电话：021－60897840

业务传真：0571－26697013

客服热线：4000－766－123

公司网址：www.fund123.cn

（84）名称：和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

法定代表人：王莉

联系人：吴阿娇

联系电话：0755－82721106－8642

业务传真：0755－82029055

客服热线：4009200022

公司网址：www.hexun.com

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）注册登记人

名称：广发基金管理有限公司

住所：广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004－56室

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31－33楼

法定代表人：王志伟

联系人：李尔华

电话：020－89899170

传真：020－89899175

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：国浩律师（广州）事务所

住所：广东省广州市体育西路189号城建大厦9楼

负责人：程秉

电话：020－38799345

传真：020－38799335

经办律师：黄贞、王志宏

联系人：程秉

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

办公地址：上海市延安东路222号外滩中心30楼

法人代表：卢伯卿

联系人：郭增光

电话：021－61418888

传真：021－63