

万家市政纯债定期开放债券型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人: 万家基金管理有限公司
基金托管人: 中国建设银行股份有限公司
报告送出日期: 2014年7月21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2014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。

§2 基金产品概况

Table with columns: 基金名称, 基金代码, 交易代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人

§3 主要财务指标和基金净值表现

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2014年4月1日至2014年6月30日), 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金份额净值, 5.期末基金资产净值

注:1.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。
2.上述基金业绩指标为本期实现收益加上本期公允价值变动收益,扣除相关费用后的余额。本期利润为本基金已实现收益加上本期公允价值变动收益。

§4 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限, 证券从业年限, 说明

§5 投资组合报告

4.3.1 基金投资组合资产构成
截至2014年6月30日,本基金资产组合如下:
4.3.2 基金投资组合资产配置比例
截至2014年6月30日,本基金资产配置比例如下:

4.3.3 异常交易行为的专项说明
本基金报告期内未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2季度宏观经济增长呈现出明显的放缓态势,地产投资下滑显著,货币政策出现明显松动,债券收益率大幅快速下行。

4.5 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1.0183元,本报告期份额净值增长率为1.98%,同期业绩比较基准增长率为2.61%。

4.6 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
预计2014年三季度经济在政府的稳增长政策下有所企稳回升;通货膨胀率维持低位,对债券影响相对不大;货币政策短期仍会偏重于稳增长,资金面预期仍将处于相对宽松状态,但进一步大幅宽松的的可能性依然较小。

4.7 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
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
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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
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
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
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
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金报告期内,本基金投资的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也不存在受到公开谴责、处罚的情况。
5.11.2 本基金报告期内,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
5.11.3 其他资产构成

5.12 基金管理人报告
5.1 基金管理人及主要人员情况
5.2 基金管理人内部控制制度
5.3 基金管理人业务执行情况
5.4 基金管理人合规管理情况
5.5 基金管理人风险管理情况
5.6 基金管理人社会责任履行情况

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
5.8 备查文件目录
5.9 基金管理人联系方式

5.10 基金管理人网站
5.11 基金管理人客户服务电话

5.12 基金管理人其他事项
5.13 基金管理人其他事项

5.14 基金管理人其他事项
5.15 基金管理人其他事项

5.16 基金管理人其他事项
5.17 基金管理人其他事项

5.18 基金管理人其他事项
5.19 基金管理人其他事项

5.20 基金管理人其他事项
5.21 基金管理人其他事项

5.22 基金管理人其他事项
5.23 基金管理人其他事项

5.24 基金管理人其他事项
5.25 基金管理人其他事项

5.26 基金管理人其他事项
5.27 基金管理人其他事项

5.28 基金管理人其他事项
5.29 基金管理人其他事项

5.30 基金管理人其他事项
5.31 基金管理人其他事项

5.32 基金管理人其他事项
5.33 基金管理人其他事项

5.34 基金管理人其他事项
5.35 基金管理人其他事项

5.36 基金管理人其他事项
5.37 基金管理人其他事项

5.38 基金管理人其他事项
5.39 基金管理人其他事项

万家上证380交易型开放式指数证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人: 万家基金管理有限公司
基金托管人: 中国建设银行股份有限公司
报告送出日期: 2014年7月21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2014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。

§2 基金产品概况

Table with columns: 基金名称, 基金代码, 交易代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人

§3 主要财务指标和基金净值表现

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2014年4月1日至2014年6月30日), 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金份额净值, 5.期末基金资产净值

注:1.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。
2.上述基金业绩指标为本期实现收益加上本期公允价值变动收益,扣除相关费用后的余额。本期利润为本基金已实现收益加上本期公允价值变动收益。

§4 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限, 证券从业年限, 说明

5.1 基金管理人报告
5.1.1 基金管理人及主要人员情况
5.1.2 基金管理人内部控制制度
5.1.3 基金管理人业务执行情况
5.1.4 基金管理人合规管理情况
5.1.5 基金管理人风险管理情况
5.1.6 基金管理人社会责任履行情况

5.1.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
5.1.8 备查文件目录
5.1.9 基金管理人联系方式

5.1.10 基金管理人网站
5.1.11 基金管理人客户服务电话

5.1.12 基金管理人其他事项
5.1.13 基金管理人其他事项

5.1.14 基金管理人其他事项
5.1.15 基金管理人其他事项

5.1.16 基金管理人其他事项
5.1.17 基金管理人其他事项

5.1.18 基金管理人其他事项
5.1.19 基金管理人其他事项

5.1.20 基金管理人其他事项
5.1.21 基金管理人其他事项

5.1.22 基金管理人其他事项
5.1.23 基金管理人其他事项

5.1.24 基金管理人其他事项
5.1.25 基金管理人其他事项

5.1.26 基金管理人其他事项
5.1.27 基金管理人其他事项

5.1.28 基金管理人其他事项
5.1.29 基金管理人其他事项

5.1.30 基金管理人其他事项
5.1.31 基金管理人其他事项

5.1.32 基金管理人其他事项
5.1.33 基金管理人其他事项

5.1.34 基金管理人其他事项
5.1.35 基金管理人其他事项

5.1.36 基金管理人其他事项
5.1.37 基金管理人其他事项

5.1.38 基金管理人其他事项
5.1.39 基金管理人其他事项

5.1.40 基金管理人其他事项
5.1.41 基金管理人其他事项

5.1.42 基金管理人其他事项
5.1.43 基金管理人其他事项

5.1.44 基金管理人其他事项
5.1.45 基金管理人其他事项

5.1.46 基金管理人其他事项
5.1.47 基金管理人其他事项

5.1.48 基金管理人其他事项
5.1.49 基金管理人其他事项

5.1.50 基金管理人其他事项
5.1.51 基金管理人其他事项

5.1.52 基金管理人其他事项
5.1.53 基金管理人其他事项

5.1.54 基金管理人其他事项
5.1.55 基金管理人其他事项

基金管理人: 万家基金管理有限公司
基金托管人: 中国建设银行股份有限公司
报告送出日期: 2014年7月21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2014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。

§2 基金产品概况

Table with columns: 基金名称, 基金代码, 交易代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人

§3 主要财务指标和基金净值表现

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2014年4月1日至2014年6月30日), 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金份额净值, 5.期末基金资产净值

注:1.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。
2.上述基金业绩指标为本期实现收益加上本期公允价值变动收益,扣除相关费用后的余额。本期利润为本基金已实现收益加上本期公允价值变动收益。

5.1 基金管理人报告
5.1.1 基金管理人及主要人员情况
5.1.2 基金管理人内部控制制度
5.1.3 基金管理人业务执行情况
5.1.4 基金管理人合规管理情况
5.1.5 基金管理人风险管理情况
5.1.6 基金管理人社会责任履行情况

5.1.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
5.1.8 备查文件目录
5.1.9 基金管理人联系方式

5.1.10 基金管理人网站
5.1.11 基金管理人客户服务电话

5.1.12 基金管理人其他事项
5.1.13 基金管理人其他事项

5.1.14 基金管理人其他事项
5.1.15 基金管理人其他事项

5.1.16 基金管理人其他事项
5.1.17 基金管理人其他事项

5.1.18 基金管理人其他事项
5.1.19 基金管理人其他事项

5.1.20 基金管理人其他事项
5.1.21 基金管理人其他事项

5.1.22 基金管理人其他事项
5.1.23 基金管理人其他事项

5.1.24 基金管理人其他事项
5.1.25 基金管理人其他事项

5.1.26 基金管理人其他事项
5.1.27 基金管理人其他事项

5.1.28 基金管理人其他事项
5.1.29 基金管理人其他事项

5.1.30 基金管理人其他事项
5.1.31 基金管理人其他事项

5.1.32 基金管理人其他事项
5.1.33 基金管理人其他事项

5.1.34 基金管理人其他事项
5.1.35 基金管理人其他事项

5.1.36 基金管理人其他事项
5.1.37 基金管理人其他事项

5.1.38 基金管理人其他事项
5.1.39 基金管理人其他事项

5.1.40 基金管理人其他事项
5.1.41 基金管理人其他事项

5.1.42 基金管理人其他事项
5.1.43 基金管理人其他事项

5.1.44 基金管理人其他事项
5.1.45 基金管理人其他事项

5.1.46 基金管理人其他事项
5.1.47 基金管理人其他事项

5.1.48 基金管理人其他事项
5.1.49 基金管理人其他事项

5.1.50 基金管理人其他事项
5.1.51 基金管理人其他事项

5.1.52 基金管理人其他事项
5.1.53 基金管理人其他事项

5.1.54 基金管理人其他事项
5.1.55 基金管理人其他事项

5.1.56 基金管理人其他事项
5.1.57 基金管理人其他事项

5.1.58 基金管理人其他事项
5.1.59 基金管理人其他事项