万家上证380交易型开放式指数证券投资基金

2014 半年度 报告摘要

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：华夏银行股份有限公司
送出日期：2014年8月27日

§1 重要提示

1.1 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同意，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2014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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	万家上证380ETF
场内简称	万家380
基金主代码	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
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	51,724,652.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013年12月2日

2.2 基金产品说明

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。
投资策略	本基金采用完全复制法跟踪标的指数，同时引入非成分股、股指期货、权证等金融工具以更好地追踪目标指数。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。未来，根据市场情况，基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为标的指数。若基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更，基金管理人可根据投资情况和市场惯例调整基金业绩比较基准的组成和权重，无需召开基金份额持有人大会，但基金管理人应取得基金托管人同意后，报中国证监会备案。
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金，属于较高风险、较高收益的产品。

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
信息披露负责人	姓名	兰剑	郑鹏
	联系电话	021-38619810	010-85238667
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	zhjitgb@hxb.com.cn
客户服务电话		95538转6，4008880800	95577
传真		021-38619888	010-85238680

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.wjasset.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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	-354,079.63
本期利润	3,423,282.88
加权平均基金份额本期利润	0.0461
本期基金份额净值增长率	0.75%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0331
期末基金资产净值	50,011,321.07
期末基金份额净值	0.9669

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

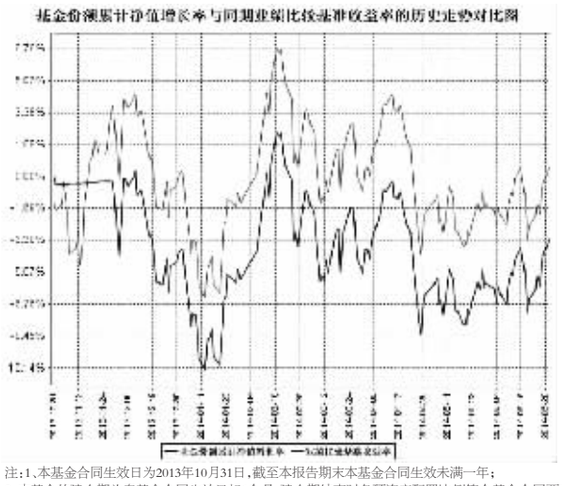
4、本基金合同生效日为2013年10月31日，截至2014年6月30日不满一年。

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①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	2.52%	0.88%	2.09%	0.88%	0.43%	0.00%
过去三个月	1.89%	0.98%	1.34%	0.99%	0.55%	-0.01%
过去六个月	0.75%	1.16%	0.46%	1.17%	0.29%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-3.31%	1.11%	0.54%	1.19%	-3.85%	-0.08%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金合同生效日为2013年10月31日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年；

2、本基金的建仓期为自基金合同生效日起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合基金合同要求。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44号文批准设立。公司现股东为齐鲁证券有限公司、新疆国际实业股份有限公司和山东省国有资产投资控股有限公司，住所地及办公地点均为上海市浦东新区浦电路360号陆家嘴投资大厦9楼，注册资本1亿元人民币。目前管理十八只基金，分别为万家180指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选股票型证券投资基金（LOF）、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家精选股票型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数型证券投资基金（LOF）、万家添利债券型证券投资基金（LOF）、万家中证创业成长指数分级证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家上证380交易型开放式指数证券投资基金、万家市政纯债定期开放债券型证券投资基金和万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张鹏	本基金基金经理、万家中证红利指数证券投资基金(LOF)基金经理、量化投资部副总监	2013年10月31日	-	5年	复旦大学经济学硕士，FRM，长期从事金融工程研究和量化投资工作，曾任上海银行风险管理部副主管、信诚基金量化投资部副总监等职，2012年5月14日加入万家基金管理有限公司任量化投资部副总监。

注：1、任职日期以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律、法规和监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋取最大利益，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《公平交易管理办法》和《异常交易监控及报告管理办法》等规章制度，涵盖了研究、授权、投资决策和交易执行等投资管理活动的各个环节，确保公平对待不同投资组合，防范导致不公平交易以及利益输送的异常交易发生。

公司制订了明确的投资授权制度，并建立了统一的投资管理平台，确保不同投资组合获得公平的投资决策机会。实行集中交易制度，对于交易所公开竞价交易，执行交易系统中的公平交易程序；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；对于银行间交易，按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。为保证公平交易原则的实现，通过制度规范、流程审批、系统风控参数设置等进行事前控制，通过对投资交易系统的实时监控进行事中控制，通过对异常交易的监控和分析实现事后控制。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内所有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当日成交量的5%的交易次数为1次，为指数型基金因被动跟踪标的指数与其他组合发生同日反向交易，不存在不公平交易和利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年上半年，中央出台了多项定向的、结构性的“微刺激”政策，宏观经济稍有好转，工业增加值同比略有反弹，PMI指数改善，PPI环比跌幅收窄，但是地产投资下滑态势没有得到遏制，经济趋势下行的压力依然存在。货币政策保持宽松态势，定向降准，社会融资规模有所回升。从市场表现来看，A股市场仍然处于存量资金博弈阶段，大盘类指数窄幅震荡，创业板指数在一季度创出新高后回落，二季度虽然有所反弹，但见顶迹象明显。报告期本基金投资标的指数——上证380指数收益率为0.46%。

本基金作为被动投资的ETF基金，其投资目标是通过跟踪、复制上证380指数，为投资者获取股票市场长期的平均收益。报告期内我们严格按照基金合同规定，采取了完全复制方法进行投资管理，努力拟合标的指数，减小跟踪误差。

报告期内，本基金采用有效的量化跟踪技术，将基金跟踪误差控制在较低范围内。跟踪误差主要是由于基金申购赎回、标的指数成分股定期调整、各类费用等因素所造成。

4.4.2 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0.9669元，报告期内基金份额净值增长率为0.75%，同期业绩比较基准收益率为0.46%。本基金日均跟踪偏离度为0.0233%，年化跟踪误差0.3609%，符合基金合同中日平均跟踪偏离度低于0.2%和年跟踪误差低于2%的规定。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014年下半年，若后续政策持续，我们预计宏观经济将出现短周期反弹，工业企业盈利将出现改善，货币政策进一步宽松概率较大。从资金面来看，下半年A股市场有望改变存量资金博弈的局面，沪港直通将加速海外资金流入A股的趋势。因此，我们认为下半年A股市场有望出现一波估值修复行情，从行业配置角度，我们认为应该把握政策主线，前期配置价值类行业，后期再轮换成成长类行业。

被动型指数基金的产品设计运作思路下，管理人日常运作中尽量避免用自己的观点判断干扰基金的运作。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了估值委员会，定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。估值委员会由督察长、基金运营部负责人、合规稽核部负责人、权益投资部负责人、固定收益部负责人等组成。估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉政策法规，并具有丰富的实践经验。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不介入基金日常估值业务。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施分配的利润。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金2014年半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

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：2014年6月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产：		
银行存款	575,742.27	129,387.77
结算备付金	2,957.91	4,593,144.92
存出保证金	9,699.64	351,397.87
交易性金融资产	49,714,280.99	137,970,710.48
其中：股票投资	49,714,280.99	137,970,710.48
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	-	473,781.79
应收利息	114.80	2,497.77
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	50,302,795.61	143,520,920.60
负债和所有者权益	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	667.97	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	20,549.95	89,959.91
应付托管费	4,109.99	17,992.01
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	12,831.14	516,086.81
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	253,315.49	163,695.65
负债合计	291,474.54	787,734.38
所有者权益：		
实收基金	51,724,652.00	148,724,652.00
未分配利润	-1,713,330.93	-5,991,465.78
所有者权益合计	50,011,321.07	142,733,186.22
负债和所有者权益总计	50,302,795.61	143,520,920.60

注：报告截止日2014年6月30日，基金份额净值0.9669元，基金份额总额51,724,652.00份。

6.2 利润表

会计主体：万家上证380交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入	3,964,232.28
1.利息收入	5,384.50
其中：存款利息收入	5,384.50
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	-
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	182,070.97
其中：股票投资收益	-340,071.57
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	522,142.54
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	3,777,362.51
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-585.70
减：二、费用	540,949.40
1.管理人报酬	179,757.13
2.托管费	35,951.44
3.销售服务费	-
4.交易费用	37,903.68
5.利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6.其他费用	287,337.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	3,423,282.88
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	3,423,282.88

注：本基金合同生效日为2013年10月31日，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家上证380交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	148,724,652.00	-5,991,465.78	142,733,186.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,423,282.88	3,423,282.88
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-97,000,000.00	854,851.97	-96,145,148.03
其中：1.基金申购款	3,000,000.00	-73,438.76	2,926,561.24
2.基金赎回款	-100,000,000.00	928,290.73	-99,071,709.27
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	51,724,652.00	-1,713,330.93	50,011,321.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

毕玉国　　李杰　　陈广益

基金管理人负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

万家上证380交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]1047号文《关于核准万家上证380交易型开放式指数证券投资基金的批复》的核准，由万家基金管理有限公司作为管理人于2013年10月14日至2013年10月25日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2013）验字第B60778298_B22号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2013年10月31日生效。本基金为交易型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币464,189,000.00元（不含股票部分），在募集期间产生的活期存款利息为人民币3,200.00元，有效认购股票按按认购期最后一日的均价计算的净额为人民币36,532,452.00元，以上实收基金（本息）合计为人民币500,724,652.00元，折合500,724,652.00份基金份额。本基金的基金管理人为万家基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为华夏银行股份有限公司。

本基金的标的指数为上证380指数。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地追踪目标指数，基金还可投资于非成份股、债券、股指期货、权证、新股、存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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。基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的90%。本基金的业绩比较基准为标的指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2014年6月30日的财务状况以及2014年1月1日至6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本半年度报告所采用的会计政策、会计估计与上年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1、印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2、营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司	基金管理人，基金销售机构
华夏银行股份有限公司	基金托管人，基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	179,757.13
其中：支付销售机构的客户维护费	1,879.50

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.50%÷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首日起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，支付日期顺延至最近可支付日。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	35,951.44

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.10%÷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2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延至最近可支付日。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期内未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方本报告期内未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
华夏银行股份有限公司	575,742.27	1,084.54

注：本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2014年1月1日至6月30日获得的利息为人民币1,336.83元，2014年6月30日结算备付金余额为人民币2,957.91元。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.9 期末（2014年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601012	隆基股份	2014年6月19日	重大事项	15.50	2014年7月1日	15.60	11,400	153,650.38	176,700.00	-
600582	天地科技	2014年6月26日	重大事项	7.97	未知	未知	17,190	126,666.03	137,004.30	-
600685	广船国际	2014年4月8日	重大事项	17.13	未知	未知	7,500	123,675.78	128,475.00	-
600210	紫江企业	2014年6月26日	重大事项	2.96	2014年7月3日	3.18	40,601	131,491.82	120,178.96	-
600864	哈投股份	2014年4月11日	重大事项	8.68	2014年7月15日	8.30	11,970	120,455.17	103,899.60	-
600260	凯乐科技	2014年6月9日	重大事项	6.59	未知	未知	14,993	116,638.56	98,803.87	-
600378	天科股份	2014年6月18日	重大事项	12.84	2014年7月23日	13.50	6,600	73,957.09	84,744.00	-
600682	南京新百	2014年3月3日	重大事项	11.64	2014年7月4日	11.20	6,902	81,541.02	80,339.28	-
600227	赤天化	2014年6月6日	重大事项	2.84	未知	未知	27,651	81,214.99	78,528.84	-
600135	乐凯胶片	2014年6月30日	重大事项	8.87	2014年7月14日	9.76	8,500	72,226.82	75,395.00	-
601777	力帆股份	2014年6月24日	重大事项	6.39	2014年7月8日	6.70	10,900	72,276.12	69,651.00	-
600850	华东电脑	2014年4月4日	重大事项	19.56	2014年7月11日	21.52	3,281	66,455.03	64,176.36	-
600295	鄂尔多斯	2014年5月6日	重大事项	7.38	未知	未知	8,124	60,889.13	59,955.12	-
600666	西南药业	2014年4月25日	重大事项	7.31	2014年8月12日	8.04	7,500	52,284.28	54,825.00	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	49,714,280.99	98.83
	其中：股票	49,714,280.99	98.83
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	578,700.18	1.15
7	其他各项资产	9,814.44	0.02
8	合计	50,302,795.61	100.00

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值，而7.2的合计项中不含可退替代款估值增值。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	248,041.07	0.50
B	采矿业	1,836,298.51	3.67
C	制造业	26,694,082.07	53.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,352,363.97	6.70
E	建筑业	2,037,345.22	4.07
F	批发和零售业	5,103,178.36	10.20
G	交通运输、仓储和邮政业	4,420,456.33	8.84
H	住宿和餐饮业	108,043.44	0.22
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,544,692.11	5.09
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,202,886.58	2.41
L	租赁和商务服务业	466,929.82	0.93
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	195,521.25	0.39
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	445,373.01	0.89
S	综合	1,059,069.25	2.12
	合计	49,714,280.99	99.41

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600570	恒生电子	17,803	523,408.20	1.05
2	600660	福耀玻璃	50,304	422,553.60	0.84
3	600594	益佰制药	9,984	410,641.92	0.82
4	601991	大唐发电	107,601	383,059.56	0.77
5	600587	新华医疗	5,011	373,570.05	0.75
6	601929	吉视传媒	31,624	361,778.56	0.72
7	600557	康缘药业	12,576	360,931.20	0.72
8	600642	中能股份	81,683	352,870.56	0.71
9	600879	航天电子	29,855	351,691.90	0.70
10	600312	平高电气	24,483	341,293.02	0.68

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600436	片仔癀	397,762.59	0.28
2	600317	营口港	376,671.00	0.26
3	600820	隧道股份	353,645.63	0.25
4	600398	海澜之家	308,614.00	0.22
5	600029	南方航空	299,279.00	0.21
6	600027	华电国际	286,575.00	0.20
7	600572	康恩贝	226,766.00	0.16
8	600216	浙江医药	211,692.00	0.15
9	600797	浙大网新	209,057.00	0.15
10	601111	中国国航	208,005.00	0.15
11	600777	新潮实业	207,868.00	0.15
12	600366	宁波韵升	187,035.00	0.13
13	600845	宝信软件	182,413.00	0.13
14	600160	巨化股份	167,171.71	0.12
15