万家中证创业成长指数分级证券投资基金更新招募说明书摘要

(2014年第2号)

基金管理人:万家基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

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]324号文核准募集,基金合同生效日为2012年8月2日。

【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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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资产,但不保证基金一定盈利,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8月2日,有关财务数据和净值表现截止日为 2014年6月30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
注册地址:上海市浦东新区浦电路360号陆家嘴投资大厦9层
办公地址:上海市浦东新区浦电路360号陆家嘴投资大厦9层
法定代表人:毕玉国
总经理:吕宜振
成立日期:2002年8月23日
批准设立机关:中国证券监督管理委员会
批准设立文号:中国证监会证监基金字[2002]44号
组织形式:有限责任公司
注册资本:1亿元人民币
存续期间:持续经营
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。
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。

董事吕祥友先生,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,曾任公司副总经理,2012年12月起任公司总经理。

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。

独立董事黄磊先生,中国民主建国会成员,经济学博士,教授,曾任贵州财经学院财政金融系教师、山东财经大学金融学院院长、山东省政协常委,现任山东财经大学资本市场研究中心主任、山东金融产业优化与区域管理协同创新中心副主任、山东省人大常委、山东省人大财经委员会委员、教育部高校金融类专业教学指导委员会委员。

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:詹志令先生,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。2007年9月加入万家基金,历任总经理、监事会主席等职,2012年4月起任公司督察长。

4、本基金基金经理简历

吴涛先生,硕士。曾任天同证券有限责任公司上海营业部副总经理、天同证券有限责任公司深圳营业部总经理、南方总部副总经理等职,2002年起任万家基金管理有限公司监察稽核部总监,负责公司投资风险管理、监察稽核等工作,现任量化投资部总监。2012年8月起任本基金基金经理,兼任万家180指数证券投资基金基金经理、万家中证红利指数证券投资基金(LOF)基金经理。

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、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)、研究部总监(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,权益投资部副总监、万家和谐基金基金经理、万家双引擎基金基金经理

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、万家日日薪货币市场证券投资基金基金经理、万家岁得利基金基金经理

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:中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间:1984年1月1日
法定代表人:姜建清
注册资本:人民币349,018,545,827元
联系电话:010-66105799
联系人:赵会军

(二)主要人员情况

截至2014年6月末,中国工商银行资产托管部共有员工170人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

(三)基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2014年6月,中国工商银行共托管证券投资基金380只。自2003 年以来,本行连续十年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的44项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、场外发售机构

(1)直销机构

万家基金管理有限公司直销中心及网上交易平台
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
电话:021-38619837
传真:021-38619998
联系人:周慧
客户服务热线:95538转6;400-888-0800
网址:http://www.wjasset.com/

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)场外代销机构

1)中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人:姜建清
联系人:王均山
传真:(010)66107914
客户服务电话:95588
公司网站: www.icbc.com.cn

2)中国建设银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:王洪章
客户服务电话:95533
网址:www.ccb.com

3) 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

4)上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址:上海市北京东路689号
法定代表人:吉晓辉
客户服务电话:95528
公司网站:www.spdb.com.cn

5)中国民生银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街2 号
法定代表人:董文标
客户服务电话:95568
网址:www.cmbc.com.cn

6)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

7)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:薛峰
客服电话:400-888-8788,10108998,95525
网址:www.ebscn.com

8)兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路268号
办公地址:上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21层
法定代表人:兰荣
客户服务电话:95562
网址:www.xyzq.com.cn

9)海通证券股份有限公司
注册地址:上海市淮海中路98号
办公地址:上海市广东路689号海通证券大厦10层
法定代表人:王开国
客户服务热线:400-8888-001、95553
网址:www.htsec.com

10)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

11)广发证券股份有限公司
注册地址:广州市天河北路183-187号大都会广场43楼
办公地址:广东广州天河北路大都会广场18、19、36、38、41和42楼
法定代表人:林治海
客户服务电话:95575
网址:www.gf.com.cn

12)中信证券股份有限公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦A层
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法人代表:王东明
客户服务电话:95558
网址:www.cs.ecitic.com

13)中信证券(浙江)有限责任公司(原中信金通证券)
注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588 号恒鑫大厦主楼19、20 层
法人代表:沈强
客服电话:0571-96598
网址:www.bigsun.com.cn

14)信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心
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

15)宏源证券股份有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233 号
法定代表人:冯戎
客户服务电话:4008-000-562
网址:www.hysec.com

16) 中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号2-6层
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

17)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
网站:www.guosen.com.cn

18)爱建证券有限责任公司
注册地址:上海市南京西路758号24楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
法定代表人:张建华
客户服务电话:021-32229888转25115
网址:www.ajzq.com

19)华宝证券有限责任公司
注册地址:上海市陆家嘴环路166 号未来资产大厦27 层
法定代表人:陈林
客户服务电话:400-820-9898
网址:www.cnhbstock.com

20)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.sxzq.com

21)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

22)中信建投证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:王常青
客户服务电话:400-888-8108
网址:www.csc108.com

23)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
法定代表人:吴永敏
客户服务电话:6008601555
网址:www.dwjq.com.cn

24)五矿证券有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心47层01单元
法定代表人:高竹
客户服务电话:400-184-0028
网址:http://wkzq.com.cn

25) 华泰证券股份有限公司
注册地址:江苏省南京市中山东路90 号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
客户服务电话:95579
网址:www.htsc.com.cn

26) 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:孔佑杰
客户服务电话:400-660-9839
网址: www.rxzq.com.cn

27) 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

28)申银万国证券股份有限公司
注册地址:上海市常熟路171号
法定代表人:储晓明
客户服务电话:4008895523
网址:www.sywg.com

29) 深圳众禄基金销售有限公司
客服电话:4006-788-887
网址:www.zlfund.cn及www.jjmmw.com

30) 北京展恒基金销售有限公司
客服电话:400-888-6661
网址:www.myfund.com

31) 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

32) 杭州数米基金销售有限公司
客服电话:4000-766-123
网址:www.fund123.cn

33) 华鑫证券有限责任公司
客服电话:021-32109999;029-68918888
网址:www.cfsc.com.cn

34)和讯信息技术有限公司
客服电话: 400-920-0022
公司网站:licaike.hexun.com

35) 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

36)万银财富基金销售有限公司
客服热线:400-808-0069
公司网站:www.wy-fund.com

37)华龙证券有限责任公司
客服电话:4006898888
网址:www.hlzqgs.com

38)东海证券股份有限公司
客服电话:95531;400-8888-588
网址:www.longone.com.cn

2、场内发售机构

场内代销机构是指具有基金代销资格的深圳证券交易所会员,具体会员单位名单详见深圳证券交易所网站:
http://www.szse.cn/main/marketdata/catalog_hylb.aspx

本基金募集结束前获得基金代销资格的深圳证券交易所会员单位可通过深圳证券交易所系统办理本基金的场内认购业务。具体名单可在深圳证券交易所网站查询,基金管理人将不就此事项进行公告。

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)基金注册登记机构
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

万家中证创业成长指数分级证券投资基金

五、基金的类型

基金类别:股票型证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金采用被动式指数化投资方法,通过严格的投资纪律约束和数量化风险控制手段,在正常市场情况下,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪偏离度不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%,实现对中证创业成长指数的有效跟踪。

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,包括中证创业成长指数成份股及其备选成份股(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、新股(一级市场初次发行或增发)、债券、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,中证创业成长指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的90%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

本基金还可投资于法律法规或监管机构允许基金投资的其他金融工具,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

本基金为指数型基金,采用完全复制方法进行投资运作,按照成份股在中证创业成长指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金管理人会对实际投资组合进行适当调整,以便实现对跟踪误差的有效控制。

1、资产配置策略

本基金投资于中证创业成长指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产的90%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%。本基金将根据市场的实际情况,适当调整基金资产的配置比例,以保证对标的指数的有效跟踪。

2、股票投资策略

本基金采用完全复制方法来跟踪中证创业成长指数,按照中证创业成长指数成份股的基准权重构建股票指数化投资组合。为求基金实际投资组合尽量贴近标的指数的表现,减小跟踪误差,基金管理人将根据实际情况对基金投资组合进行适当调整:

(1)本基金股票组合根据所跟踪的中证创业成长指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整;

(2)根据指数编制规则,中证创业成长指数成份股因增发、送配、分红或其他原因所造成的临时成份股调整,本基金将根据中证创业成长指数成份股临时调整决定及其需调整的权重比例,进行相应调整;

(3)根据指数编制规则及调整公告,本基金在指数成份股调整生效前,对投资组合进行优化调整,以尽量减小指数成份股变动所造成的跟踪误差;

(4)根据本基金的申购、赎回、分红等情况对投资组合的影响,以尽可能贴近标的指数表现为目的,对投资组合进行相应调整;

(5)指数成份股因受股票停牌限制、股票流动性限制等市场因素限制或法律法规、基金合同等合规因素限制,使本基金无法依据指数购买某成份股的情况,本基金可以根据实际情况对投资组合进行调整;

(6)其他影响指数复制的因素,本基金可以根据实际情况,结合以往经验,对本基金资产进行适当调整,力争在控制风险的前提下,获得更接近标的指数的收益率。

3、债券投资策略

本基金基于流动性管理的需要,以保证基金资产流动性为目的,可以投资于国债、金融债等到期日在一年以内的债券。本基金在构建债券投资组合时,合理评估收益性、流动性和信用风险,有效利用基金资产,提高基金资产投资收益。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:95%×中证创业成长指数收益率+5%×银行同业存款利率

如果今后法律法规发生变化,或是本基金的标的指数被中证指数有限公司停止发布、或由其他指数替代,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的业绩基准的股票指数时,本基金管理人在征得基金托管人同意的情况下,履行适当程序并报中国证监会核准后按实际情况变更基金的标的指数和业绩比较基准,并在变更前提前2个工作日在中国证监会指定的媒体上公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为指数分级基金,不同的基金份额具有不同的风险收益特征。万家创业成长份额为常规指数基金份额,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金;万家创业成长A份额,具有较低风险、收益相对稳定的特征;万家创业成长B份额具有高风险、高预期收益的特征。

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年9月2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及重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2014年6月30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	权益投资	15,388,962.25	93.33
	其中:股票	15,388,962.25	93.33
2	固定收益投资	701,813.63	4.26
	其中:债券	701,813.63	4.26
	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	362,423.56	2.20
7	其他资产	35,150.72	0.21
8	合计	16,488,350.16	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	68,037.44	0.42
B	采矿业	–	–
C	制造业	8,233,858.09	50.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	53,999.40	0.33
E	建筑业	1,097,778.28	6.78
F	批发和零售业	236,081.88	1.46
G	交通运输、仓储和邮政业	112,457.80	0.70
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,161,325.85	13.36
J	金融业	–	–
K	房地产业	502,886.92	3.11
L	租赁和商务服务业	1,154,608.07	7.14
M	科学研究和技术服务业	196,584.34	1.21
N	水利、环境和公共设施管理业	498,163.50	3.08
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	134,724.06	0.83
R	文化、体育和娱乐业	938,456.62	5.80
S	综合	–	–
	合计	15,388,962.25	95.11

2.2报告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。

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

3.1报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300027	华谊兄弟	25,896	619,432.32	3.83
2	002415	海康威视	36,096	611,466.24	3.78
3	002241	歌尔声学	22,849	609,154.34	3.76
4	300104	乐视网	12,491	548,354.90	3.39
5	002450	康得新	22,615	514,491.25	3.18
6	002236	大华股份	17,481	471,112.95	2.91
7	300070	碧水源	15,906	465,250.50	2.88
8	002353	杰瑞股份	11,439	460,419.75	2.85
9	300058	蓝色光标	17,014	451,551.56	2.79
10	002065	东华软件	22,034	443,324.08	2.74

3.2报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票

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	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	698,209.40	4.32
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	3,604.23	0.02
8	其他	–	–
9	合计	701,813.63	4.34

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019314	13国债14	6,980	698,209.40	4.32
2	128002	东华转债	21	3,604.23	0.02

注:本基金本报告期末仅有上述债券投资持仓。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据基金合同,本基金暂不可投资于股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同,本基金暂不可投资国债期货。

11、投资组合报告附注

11.1

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,在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

11.2

基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	10,471.61
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	24,185.04
5	应收申购款	494.07
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	35,150.72

11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128002	东华转债	3,604.23	0.02

11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

11.5.1报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

11.5.2报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票

十二、基金的业绩

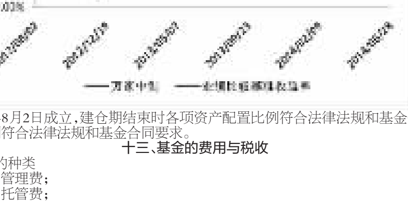
基金业绩截止日为2014年6月30日, 托管人中国工商银行于2014年9月2日复核了本招募说明书中的基金净值表现。

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
2014年上半年	-5.36%	1.36%	-4.05%	1.35%	-1.31%	0.01%
2013年	15.51%	1.53%	23.12%	1.51%	-7.61%	0.02%
2012年	0.30%	0.94%	0.78%	1.39%	-0.48%	-0.45%
基金成立日至2014年6月30日	9.65%	1.37%	19.04%	1.45%	-9.39%	-0.08%

(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(2012年8月2日至2014年6月30日)



本基金于2012年8月2日成立,建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

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、基金的指数许可使用费;
4、基金上市初费及上市年费;
5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
7、基金份额持有人大会费用;
8、基金的证券交易费用;
9、基金的银行汇划费用;
10、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1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H = E \times 1.00\% \div$ 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0.22%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H = E \times 0.22\% \div$ 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前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。

3、基金的指数许可使用费

本基金作为指数基金,需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付标的指数许可使用费。

通常情况下,标的指数许可使用费按前一日的基金资产净值的0.02%的年费率计提。计算方法如下:

$H = E \times 0.02\% \div$ 当年天数

H为每日应计提的指数许可使用费

E为前一日的基金资产净值

指数许可使用费的收取下限为每季度人民币5万元。

指数许可使用费自基金合同生效日起每日计提,按季支付。由基金管理人向基金托管人发送指数许可使用费划付指令,经基金托管人复核后于次季初十个工作日前从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。

上述(一)基金费用的种类中第4—10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,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒体及基金管理人网站上公告。

标的指数供应商根据相应指数许可协议变更本基金标的指数的使用许可费费率和计费方式,基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率和计费方式实施日前2日在指定媒体上刊登公告。

(五)基金税收

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2014年3月17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“五、相关服务机构”部分,更新了代销机构的有关内容。
5、更新了招募说明书的“九、万家创业成长份额的申购与赎回”部分,更新了基金转换等内容。
6、在招募说明书的“十三、基金的投资”部分,更新了基金最近一期(2014年第2季度)投资组合报告内容。
7、在招募说明书“十四、基金的业绩”部分,更新了基金成立以来的投资业绩。
8、在招募说明书中“二十八、其他应披露事项”部分,更新了本基金自上次更新以来的公告事项。

万家基金管理有限公司
2014年9月15日

上投摩根纯债债券型证券投资基金基金经理变更公告

公告送出日期:2014年9月16日

1.公告基本信息

基金名称	上投摩根纯债债券型证券投资基金
基金简称	上投摩根纯债债券
基金主代码	371020
基金管理人名称	上投摩根基金管理有限公司
公告依据	《证券投资基金信息披露管理办法》
基金经理变更类型	解聘基金经理
共同管理本基金的其他基金经理姓名	聂曙光
离任基金经理姓名	王亚南

2.离任基金经理的相关信息

离任基金经理姓名	王亚南
离任原因	因工作需要
离任日期	2014年9月15日
是否已按规定在中国证券投资基金业协会办理变更手续	是

3.其他需要提示的事项

因工作需要,经上投摩根基金管理有限公司批准,王亚南先生不再担任上投摩根纯债债券型证券投资基金的基金经理。

上述事项已在中国证券投资基金业协会完成变更备案手续,并报中国证监会上海监管局备案。

上投摩根基金管理有限公司
2014年9月16日

证券代码:600832　证券简称:东方明珠　公告编号:临2014-041

上海东方明珠(集团)股份有限公司
重大资产重组进展公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

因上海文化广播影视集团有限公司拟对本公司实施业务梳理、资产整合及注入文化传媒类资产并募集配套资金等重大事项,公司分别于2014年6月18日、2014年7月18日、2014年8月18日发布了《重大资产重组停牌公告 (临2014-023)》、《重大资产重组停牌公告 (临2014-030)》、《重大资产重组停牌公告 (临2014-037)》,公司股票继续停牌。

截至本公告发布之日,相关中介机构已进场,尽职调查等各项工作正在积极推进中。因有关事项尚存在不确定性,尚需进一步研究论证,并获得国有资产监督管理委员会和国家新闻出版广电总局对相关事项的批准,为保证公平信息披露,维护投资者利益,避免造成公司股价异常波动,本公司股票将继续停牌。

本次重大资产重组停牌期间,将根据《上市公司重大资产重组管理办法》及其他有关规定,结合停牌期间相关事项的进展情况,及时履行信息披露义务,每五个交易日发布一次有关事项的进展情况。

特此公告。

上海东方明珠(集团)股份有限公司
2014年9月16日

证券代码:002422　证券简称:科伦药业　公告编号:2014-064

四川科伦药业股份有限公司
关于公司股东部分股份质押的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

四川科伦药业股份有限公司(以下简称"本公司")于2014年9月15日收到本公司股东刘革新先生关于其持有的本公司股份部分质押的通知。

刘革新先生于2014年9月12日将其持有的本公司股份 (股份性质为首发后个人类限售股) 合计54,000,000股质押给民生加银资产管理有限公司,并在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司办理了股份质押登记手续,质押登记日为2014年9月12日,质押期限自质押登记日至解除质押时止。

截至本公告披露日, 刘革新先生持有本公司股份187,680,740股, 占本公司股份总数720,000,000股的26.07%,其中累计质押71,250,000股,占本公司股份总数的9.9%。

特此公告。

四川科伦药业股份有限公司
董事会
2014年9月16日

证券代码:603555　证券简称:贵人鸟　公告编号:临2014-32

贵人鸟股份有限公司2014年第二次临时股东大会决议公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

重要内容提示:

? 本次会议是否有否决提案的情况:否

? 本次股东大会是否有变更前次股东大会决议的情况:有,本次变更2013年度股东大会审议通过的《关于发行公司债券的议案》之股东大会决议有效期限。

一、会议召开和出席情况

(一)股东大会召开时间和地点:

1、召开时间

现场会议时间:2014年9月15日下午13:00

网络投票时间:2014年9月15日9:30-11:30和13:00-15:00(当天交易时间)。

2、现场会议召开地点:厦门市湖里区泗水道629号翔安商务大厦18楼会议室。

(二)会议出席情况:

出席会议的股东和代理人人数	4
其中:内资股股东人数(有外资股公司适用)	2
外资股股东人数(有外资股公司适用)	2
所持有表决权的股份总数(股)	525,000,000
其中:内资股股东持有股份总数(有外资股公司适用)	15,750,000
外资股股东持有股份总数(有外资股公司适用)	509,250,000
占公司有表决权股份总数的比例(%)	85.50
其中:内资股股东持股占股份总数的比例(有外资股公司适用)	2.57%
外资股股东持股占股份总数的比例(有外资股公司适用)	82.94%
通过网络投票出席会议的股东人数	9
所持有表决权的股份数(股)	106,000
占公司有表决权股份总数的比例(%)	0.02

(三)本次股东大会采取现场投票和网络投票相结合的方式,因董事长林天福先生因公出差未能参加会议,经半数以上董事推举,现场会议由董事程立军先生主持,本次股东大会会议召开符合有关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和公司章程的有关规定。

(四)公司董事、监事和董事会秘书的出席情况:公司在任董事11人,出席3人,董事林天福先生、林清辉先生、周世勇先生因公出差未能参加会议,独立董事焦文俊先生、王松奇先生、宋常先生、叶林先生、李玉中先生因事请假未能出席会议;公司在任监事3人,出席2人,监事黄惠泉先生因公出差未能参加会议;公司董事会秘书周世勇先生因公出差未能出席会议,公司其余高管列席了会议。

二、提案审议情况

议案序号	议案内容	同意票数(股)	同意比例(%)	反对票数(股)	反对比例(%)	弃权票数(股)	弃权比例(%)	是否通过
1	关于变更《关于发行公司债券的议案》之股东大会决议有效期限的议案	525,019,700	99.98	83,800	0.02	2,500	0.00	是
2	关于修改《公司章程》部分条款的议案	525,018,900	99.98	86,300	0.02	800	0.00	是

三、律师见证情况

北京市中伦律师事务所律师对本次股东大会进行现场见证并出具了法律意见,认为:公司2014年第二次临时股东大会的召集、召开和表决程序符合《证券法》、《公司法》、《股东大会规则》和《公司章程》的规定,召集人和出席会议人员均具有合法有效的资格,本次股东大会的表决程序和表决结果合法有效。

四、备查文件

1、贵人鸟股份有限公司2014年第二次临时股东大会决议
2、北京市中伦律师事务所关于贵人鸟股份有限公司2014年第二次临时股东大会的法律意见书

特此公告。

贵人鸟股份有限公司
2014年9月15日

证券代码:000693　证券简称:华泽钴镍　公告编号:2014-041

成都华泽钴镍材料股份有限公司
关于召开2014年上半年网上业绩说明会的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、完整和准确,没有虚假记载、误导性陈述和重大遗漏。

本公司已于2014 年8月18日发布了2014 年半年报。为便于广大投资者更深入全面地了解公司情况,公司定于2014年9 月18日(星期四)15:00-17:00 举行2014 年半年报业绩说明会,现将有关事项公告如下:

本次业绩说明会将在深圳证券信息有限公司提供的网上平台采取网络远程的方式举行, 投资者可以登录上市公司投资者关系互动平台(http://irm.p5w.net/)参与交流。

出席本次业绩说明会的人员有:公司总经理陈胜利先生、董事会秘书吴锋先生、财务总监郭立红女士 。

欢迎广大投资者积极参与。

特此公告

成都华泽钴镍材料股份有限公司
董 事 会
二〇一四年九月十五日