万家中证红利指数型证券投资基金（LOF）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：中国建设银行股份有限公司

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2010年10月11日证监许可［2010］1388号文核准。本基金的基金合同于2011年3月17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。

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9月17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楼
办公地址：上海市浦东新区浦电路360号陆家嘴投资大厦9楼
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：021-38909626
传真：021-38909627

（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

吴涛，男，硕士学位，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。2010年3月起任180基金基金经理。2012年2月起任本基金基金经理。现任量化投资部总监、兼任万家180指数基金基金经理、万家中证创业成长指数分级基金基金经理。

张鹏，男，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。2012年7月起任本基金基金经理。现任量化投资部副总监，兼任万家上证380ETF基金基金经理。

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、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、万家双引擎灵活配置混合型基金基金经理、万家精选股票证券投资基金基金经理

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和万家现金宝货币市场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、基金托管人情况

（一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）
住所：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
成立时间：2004年09月17日
组织形式：股份有限公司
注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
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］12号
联系人：田青
联系电话：（010）6759 5096

中国建设银行拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于1954年成立，1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行（股票代码：939）于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486股（包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股）。

截至2013年12月31日，中国建设银行资产总额153,632.10亿元，较上年增长9.95%；客户贷款和垫款总额85,900.57亿元，增长14.35%；客户存款总额122,230.37亿元，增长7.76%。营业收入5,086.08亿元，较上年增长10.39%，其中，利息净收入增长10.29%，净利息收益率（NIM）为2.74%；手续费及佣金净收入1,042.83亿元，增长11.52%，占营业收入比重为20.50%。成本费用开支得到有效控制，成本收入比为29.65%。实现利润总额2,798.06亿元，较上年增长11.28%；净利润2,151.22亿元，增长11.12%。资产质量保持稳定，不良贷款率0.99%，拨备覆盖率268.22%；资本充足率与核心一级资本充足率分别为13.34%和10.75%，保持同业领先。

中国建设银行在中国内地设有分支机构14,650个，服务于306.54万公司客户、2.91亿个人客户，与中国经济战略性行业的主导企业和大量高端客户保持密切合作关系；在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、大阪、首尔、纽约、胡志明市、悉尼、墨尔本、台北、卢森堡设有海外分行，拥有建行亚洲、建银国际、建行伦敦、建行俄罗斯、建行迪拜、建行欧洲、建信基金、建信租赁、建信信托、建信人寿等多家子公司。

2013年，本集团的出色业绩与良好表现受到市场与业界的充分认可，先后荣获国内外102项奖项，多项综合排名进一步提高，在英国《银行家》杂志“全球银行1000强排名”中位列第5，较上年上升2位；在美国《福布斯》杂志发布的“2013年度全球上市公司2000强排名”中，位列第2，较上年上升13位。此外，本集团还荣获了国内外重要机构授予的包括公司治理、中小企业服务、私人银行、现金管理、托管、投行、养老金、国际业务、电子商务和企业社会责任等领域的多个专项奖。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工220余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

杨新丰，投资托管业务部总经理，曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2013年12月31日，中国建设银行已托管349只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至2012年连续四年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”；获和讯网的中国“最佳资产托管银行”奖；境内权威经济媒体《每日经济观察》的“最佳基金托管银行”奖；中央国债登记结算有限责任公司的“优秀托管机构”奖。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1.直销机构

本基金直销机构为本公司以及本公司的网上交易平台。

办公地址：上海市浦东新区浦电路360号陆家嘴投资大厦9楼
法定代表人：毕玉国
联系人：李忆莎
电话：（021）38909771
传真：（021）38909798
客户服务热线：95538转6；（021）68644599；400-888-0800；
网址：http://www.wjasset.com

投资人可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、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：http://trade.wjasset.com/

2.代销机构

（1）中国建设银行股份有限公司
客户服务电话：95533
公司网站：www.ccb.com

（2）中国银行股份有限公司
客户服务电话：95566
网址：www.boc.cn

（3）中国工商银行股份有限公司
客户服务电话：95588
网址：www.icbc.com.cn

（4）华夏银行股份有限公司
客服电话：95577
网址：www.hxb.com.cn

（5）上海浦东发展银行股份有限公司
客户服务热线：95528
公司网站：www.spdb.com.cn

（6）中国农业银行股份有限公司
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

（7）中国银河证券股份有限公司
客户服务电话：400-888-8888
网址：www.chinastock.com.cn

（8）齐鲁证券有限公司
客服电话：95538
网址：www.qlzq.com.cn

（9）招商证券股份有限公司
客户服务或投诉电话：95565、0755-26951111、4008888111
公司电子邮箱：sbox@cmschina.com.cn
公司网址：http://www.newone.com.cn/

（10）江海证券有限公司
客户服务热线：400-666-2288
网址：www.jhzq.com.cn

（11）广发证券股份有限公司
统一客户服务电话：95575或致电各营业网点
网址：www.gf.com.cn

（12）中航证券有限公司
客服电话：4008866567
网址：www.avicsec.com

（13）中信证券股份有限公司
统一客服电话：95558
公司网站地址：http://www.citics.com

（14）海通证券股份有限公司
注册地址：上海市淮海中路98号
客服电话：400-8888-001、（021）95553 或拨打各城市营业网点咨询电话
网址：www.htsec.com

（15）天相投资顾问有限公司
客服电话：010-66045678
传真：010-66045500
天相投顾网-网址：www.txsec.com
天相基金网-网址：www.txjijin.com

（16）国泰君安证券股份有限公司
客户服务热线：4008888666
网址：www.gtja.com

（17）上海证券有限责任公司
客户服务电话：（021）962518
网址：www.962518.com.cn

（18）中信建投有限责任公司
客户服务电话：400-888-8108
网址：www.csc108.com

（19）华泰证券股份有限公司
客服电话：95597
网址：www.htsc.com.cn

（20）信达证券股份有限公司
客服电话：400-800-8899
公司网址：www.cindasc.com

（21）申银万国证券股份有限公司
客户服务电话：（021）962505
网址：www.sw2000.com.cn

（22）国信证券股份有限公司
联系电话：0755-82130833
传真：0755-82133952
客户服务电话：95536
公司网址：www.guosen.com.cn

（23）山西证券股份有限公司
客服电话：400-666-1618
网址：www.i618.com.cn

（24）民生证券有限责任公司
联系传真：010-85127917
客服电话：4006198888
公司网址：www.mszq.com

（25）五矿证券有限责任公司
客服电话：40018-40028
网址：www.wkzq.com.cn

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

（27）宏源证券股份有限公司
客服电话：4008-000-562
网址：www.hysec.com

（28）中国国际金融有限公司
电话：010-65051166
网址：www.cicc.com.cn

（29）光大证券股份有限公司
客服电话：4008888788
网址：www.ebscn.com

（30）中信万通证券有限责任公司
客服电话：96577
网址：www.zxwt.com.cn

（31）东吴证券股份有限公司
客户服务电话：0512-96288
网址：www.dwjq.com.cn

（32）中信证券（浙江）有限责任公司（原中信金通证券）
客服电话：0571-96598
网址：www.bigsun.com.cn

（33）日信证券有限责任公司
客服电话：4006609839
网址：http://www.rxzq.com.cn

（34）中银国际证券有限责任公司
客服电话：4006208888
网址：http://www.bocichina.com

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

（36）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司
客服电话：400-821-5399
网址：www.noah-fund.com

（37）上海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

（38）上海好买基金销售有限公司
客服电话：400-700-9665
网址：www. ehowbuy.com

（39）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

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

（41）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

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

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

（44）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/

（45）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

（46）万银财富基金销售有限公司
客服电话：400-808-0069
网站：www.wy-fund.com

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

场内代销机构是指具有基金销售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

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）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：010-59378888
传真：010-59378828

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：东方昆仑（上海）律师事务所
住所：上海延安西路728号华敏·翰尊国际大厦13楼F座
负责人：陈冉
经办律师：田卫红、汪年俊
电话：021-62113098
联系人：田卫红

（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（邮编：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（邮编：200120）
联系电话：（021）22288888
传真：（021）22280000
联系人：徐艳

四、基金的名称

万家中证红利指数型证券投资基金（LOF）

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：上市契约型开放式

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%，实现对中证红利指数的有效跟踪。

七、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证红利指数的成份股及经中证指数公司公告将要被选入中证红利指数的股票、新股（一级市场初次发行或增发）、债券以及法律法规或中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他金融产品出现后，本基金在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于中证红利指数成份股及经中证指数公司公告将要被选入中证红利指数的股票的组合比例不低于基金资产净值的90%，现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。

八、基金的投资策略

本基金为指数型基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在中证红利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

本基金投资于中证红利指数成份股及经中证指数公司公告将要被选入中证红利指数的股票的组合比例不低于基金资产净值的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

本基金原则上采用完全复制法来跟踪中证红利指数，按照中证红利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红利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，中证红利指数成份股因增发、送配、分红或其他原因所造成的临时成份股调整，本基金将根据中证红利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。

4.其他金融衍生产品投资策略

在法律法规许可时，本基金可在充分考虑金融衍生产品风险和收益特征的前提下，结合对金融衍生产品的研究，运用金融衍生工具谨慎进行投资，提高投资效率。如有新的产品推出市场，本基金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。

九、基金的业绩比较基准

95%×中证红利指数收益率 + 5%×银行同业存款利率

十、基金的风险收益特征

本基金为股票型指数基金，预期风险高于货币市场基金、债券型基金及混合型基金，属于较高风险，较高预期收益的证券投资基金品种。

十一、投资组合报告

万家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16日复核了本报告中的财务指标、净值表现及投资组合报告的等内容，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	142,024,393.26	94.38
	其中：股票	142,024,393.26	94.38
2	固定收益投资	6,519,386.00	4.33
	其中：债券	6,519,386.00	4.33
	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	1,561,800.98	1.04
7	其他资产	379,555.53	0.25
8	合计	150,485,135.77	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	-	-
B	采矿业	12,220,015.31	8.16
C	制造业	71,698,644.89	47.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,417,605.23	7.63
E	建筑业	2,334,924.51	1.56
F	批发和零售业	3,021,123.24	2.02
G	交通运输、仓储和邮政业	8,765,007.13	5.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,000,447.35	0.67
J	金融业	23,603,245.48	15.77
K	房地产业	6,895,035.44	4.61
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	1,068,344.68	0.71
	合计	142,024,393.26	94.89

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	000559	万向钱潮	411,979	4,235,144.12	2.83
2	000541	佛山照明	329,583	3,282,646.68	2.19
3	002085	万丰奥威	153,782	3,269,405.32	2.18
4	601288	农业银行	1,280,428	3,226,678.56	2.16
5	601988	中国银行	1,264,025	3,223,263.75	2.15
6	601515	东风股份	269,806	3,205,295.28	2.14
7	601398	工商银行	922,964	3,128,847.96	2.09
8	000631	顺发恒业	644,902	2,914,957.04	1.95
9	601799	星宇股份	164,984	2,824,526.08	1.89
10	002269	美邦服饰	326,360	2,712,051.60	1.81

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	6,519,386.00	4.36
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	-	-
8	其他	-	-
9	合计	6,519,386.00	4.36

5.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	45,000	4,501,350.00	3.01
2	019322	13国债22	20,120	2,018,036.00	1.35

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。

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名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

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

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。

10.投资组合报告附注

10.1

在本基金期末持有的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司作为债务融资工具主承销商，涉及未按规定开展后续管理工作、未合规履行持有人会议有关职责以及未按业务规范要求开展尽职调查等多项违反自律规则指引的情形。于2013年10月22日被中国银行间市场交易商协会给予通报批评处分，并责令改正。

本公司投资农业银行股票履行了相应的内部投资决策程序，并按指数化投资的要求配置该股票。

本报告期内，本基金投资的其他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。

10.2

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。

10.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	169,524.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	209,438.21
5	应收申购款	592.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	379,555.53

10.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

10.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

10.5.1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。

10.5.2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

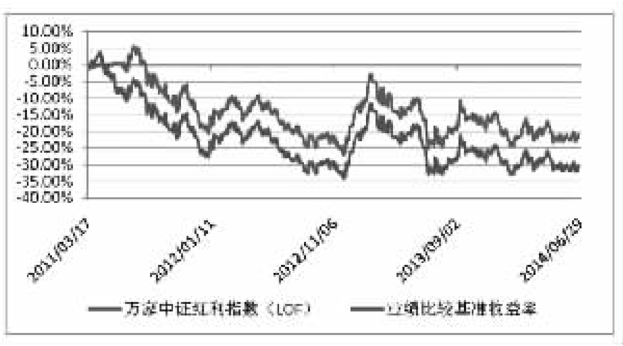
基金业绩截止日为2014年6月30日，托管人中国建设银行于2014年7月16日复核了本招募说明书中的基金净值表现。

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	②-③	②-④
2014年上半年	-0.56%	1.03%	-1.69%	1.02%	1.13%	-0.01%
2013年	-7.98%	1.40%	-9.52%	1.41%	1.54%?	0.00%
2012年	6.93%	1.15%	6.82%	1.15%	0.11%	-0.13%
基金成立日至2011年12月31日	-18.51%	1.01%	-26.16%	1.14%	7.65%	-0.04%
基金成立日至2014年6月30日	-20.26%	1.18%	-29.84%	1.22%	9.58%	0.01%

（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（2011年3月17日至2014年6月30日）



注：本基金成立于2011年3月17日，建仓期为6个月，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.基金上市费用；
4.基金财产拨划支付的银行费用；
5.基金合同生效后的基金信息披露费用；
6.基金份额持有人大会费用；
7.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
8.基金的证券交易费用；
9.基金的指数使用费

本基金指数许可使用基点费的收取标准为以中证红利指数作为跟踪标的的基金资产净值的万分之二，许可使用基点费的收取下限为每季度人民币伍万元；

10.依法可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

（三）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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.75%年费率计提。计算方法如下：

H=E×年管理费率÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经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管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

2.基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。计算方法如下：

H=E×年托管费率÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经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、休息日，支付日期顺延。

3.基金的指数使用费

在通常情况下，指数许可使用基点费按前一日基金资产净值的0.02%年费率计提。计算方法如下：

H=E×年托管费率÷当年天数
H为每日应计提的指数许可使用基点费
E为前一日基金资产净值

指数使用费从基金合同生效日开始每日计提，按季支付。收取下限为每季度人民币伍万元。

4.除管理费、托管费、指数使用费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（四）不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（五）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

（六）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

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4月30日刊登的本基金招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

1、更新了招募说明书的目录。
2、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。
3、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。
4、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。
5、在招募说明书的“十、基金的投资”部分，增加了基金最近一期（2014年第2季度）投资组合报告内容。
6、在招募说明书的“十一、基金的业绩”部分，更新了基金成立以来的投资业绩。
7、在招募说明书的“二十二、基金份额持有人”部分，更新了客户服务传真
8、在招募说明书的“二十三、其他应披露事项”部分，更新了招募说明书上次公告以来本基金的公告事项。

万家基金管理有限公司
2014年10月30日

华安基金管理有限公司关于华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金（2014年第4期）投资组合构建情况说明的公告

华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）2014年第4期已于2014年10月10日开始正式运作，现就相关事项公告如下：

本基金2014年第4期的运作期为2014年10月10日至2014年12月29日。本基金管理人已于2014年10月23日完成对本期产品的投资组合构建，截至2014年10月23日基金资产中各大类资产比例如下：

本基金2014年第4期投资组合构建情况	
资产类别	占基金总资产的比例（%）
银行定期存款	97.52%
买入返售金融资产	1.68%
其他各项资产	0.80%
合计	100.00%

风险提示：

本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将来表现。本公告中的投资组合构建情况及其他相关信息不构成对基金运作期实际收益的承诺或保证。

特此公告

华安基金管理有限公司
2014年10月30日

华安基金管理有限公司关于华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金2014年第10期收益支付公告

公告送出日期：2014年10月30日

1.公告基本信息

基金名称	华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金
基金简称	华安月安鑫短期理财债券
基金主代码	040033
基金合同生效日	2012年6月14日
基金管理人名称	华安基金管理有限公司
公告依据	《华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同》、《华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金招募说明书》及《华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同生效公告》
收益集中支付日期	2014年10月28日
收益累计期间	自2014年9月26日至2014年10月28日止

2. 与收益支付相关的其他信息

累计收益计算公式	投资者累计收益=∑投资者日收益（即投资者日收益逐日累加）；投资者日收益=投资者当日持有的基金份额/10000＊当日每万份基金单位收益（保留到分，即保留两位小数后去尾）
再投资的基金份额可赎回起始日	2014年11月24日
收益支付对象	2014年10月28日在华安基金管理有限公司登记在册的本基金全体持有人。
收益支付办法	本基金收益支付方式默认为现金分红，现金分红款将于2014年10月29日从托管户划出；投资者若选择红利再投资，再投资的基金份额将于2014年10月29日直接计入其基金账户，2014年10月30日起可查询。
税收相关事项的说明	根据财政部、国家税务总局财税字［2002］128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》及财税［2008］1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。
费用相关事项的说明	本基金本次收益分配免收分红手续费和再投资手续费。

3.其他需要提示的事项

（1）华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金2014年第10期已于2014年10月28日结束本期运作，运作期共33天。该运作期本基金A类份额（基金代码：040033）的年化收益率为3.485%，本基金B类份额（基金代码：040034）的年化收益率为3.726%。

（2）投资者于2014年10月23日至2014年10月27日集中申购的基金份额不享有当期的收益，于2014年10月27日赎回的基金份额享有当期的收益。

（3）若投资者于2014年10月27日全部赎回基金份额，本基金将计算其累计收益，并以现金形式支付。

（4）本公告仅对本基金2014年第10期的收益支付的有关事项进行说明，投资者欲了解既往各运作期收益情况，请参见刊登在2014年10月20日《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上的《华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金2014年第10期赎回开放日及2014年第11期集中申购开放期相关安排的公告》。

（5）截至2014年10月28日被冻结的基金份额应分得的现金红利按现金红利再投资方式处理。

（6）基金份额持有人可以选择现金红利或将所获红利再投资于本基金，如果基金份额持有人未选择本基金具体分红方式，则默认为现金方式。基金份额持有人可对A类和B类基金份额分别选择不同的分红方式。选择采取红利再投资形式的，同一类别基金份额的分红资金将按红利划出日该类别的基金份额净值转成相应的同一类别的基金份额。

（7）投资者可以在每个基金工作日的交易时间内到销售网点查询和修改分红方式，也可以通过华安基金管理公司网站或电话交易系统查询和变更基金收益分配方式。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，将按照投资者在2014年10月28日之前（含该日）最后一次选择的分红方式为准。

（8）如有其它疑问，请拨打本公司客户服务电话（40088-50099）或登陆本公司网站（www.huaan.com.cn）获取相关信息。

风险提示：

本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将来表现。本公告中的收益支付情况及其他相关信息不构成对其后基金运作期实际收益的承诺或保证。

特此公告。

华安基金管理有限公司
2014年10月30日

华安基金管理有限公司关于华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金增加代销机构的公告

根据华安基金管理有限公司与中国银行股份有限公司签署的销售代理协议，中国银行股份有限公司自2014年10月30日起开始代理销售华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金（基金代码：A类：000373，C类：000376）。投资者可到中国银行股份有限公司在全国的营业网点办理上述基金的认购及其他相关业务。

详情请咨询：

（1）中国银行股份有限公司
客户服务电话：95566
网址：www.boc.cn

（2）华安基金管理有限公司
客户服务电话：40088-50099
网址：www.huaan.com.cn

风险提示：本公司承诺以诚实信用、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，也不保证最低收益。投资者投资于本公司管理的基金时应认真阅读基金合同、招募说明书等法律文件，并注意投资风险。

特此公告

华安基金管理有限公司
二〇一四年十月三十日

股票代码：002730　　股票简称：电光科技　　公告编号：2014-013

电光防爆科技股份有限公司关于2014年第三季度报告的更正公告

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。

重要提示：

公司于2014年10月28日在巨潮网上刊登了《电光防爆科技股份有限公司2014年第三季度报告》全文及正文，现将《2014年第三季度报告》全文及正文中"二、报告期末股东总数及前十名股东持股情况表中1、报告期末普通股股东总数及前十名普通股股东持股情况表中的‘报告期末普通股股东总数’"的内容更新如下：

1、"报告期末普通股股东总数146,670,000"改为"报告期末普通股股东总数59,138"。

除上述更正外，《电光防爆科技股份有限公司2014年第三季度报告》全文及正文的其他内容不变，由此给投资者带来的不便，公司深表歉意，敬请广大投资者谅解。

特此公告！

电光防爆科技股份有限公司
董事会
2014年10月29日

股票代码：002730　　股票简称：电光科技　　公告编号：2014-012

电光防爆科技股份有限公司关于签署募集资金三方监管协议的公告

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。

经中国证券监督管理委员会证监许可［2014］955号文核准，电光防爆科技股份有限公司（以下简称"公司"）向社会公众公开发行人民币普通股（A股）股票3,667.00万股，发行价为每股人民币8.07元，共计募集资金29,592.69万元，坐扣承销和保荐费用2,120.00万元后的募集资金为27,472.69万元，已由主承销商财通证券股份有限公司于2014年9月29日汇入本公司募集资金监管账户。另减除上网发行费、招股说明书印刷费、申报会计师费、律师费、评估费等与发行权益性证券直接相关的新增外部费用1,053.69万元后，公司本次募集资金净额为26,419.00万元。上述募集资金到位情况业经天健会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并由其出具《验资报告》（天健验［2014］208号）。公司对募集资金采取了专户存储管理。

为规范公司募集资金管理和使用，保护投资者的利益，根据《深圳证券交易所股票上市规则》、《深圳证券交易所中小企业板上市公司规范运作指引》等法律、法规和规范性文件的规定，公司于2014年10月29日分别与中国农业银行股份有限公司乐清市支行、交通银行股份有限公司温州分行及保荐机构财通证券股份有限公司（以下简称"财通证券"或"保荐机构"）签订了《募集资金三方监管协议》（以下简称"监管协议"），主要内容约定如下：

一、公司已在开户银行开设募集资金专项账户（以下称"专户"），该专户仅用于募集资金投资项目募集资金的存储和使用，不得用作其他用途。相关专户开立和存储情况如下：

1、银行名称：中国农业银行浙江省乐清市柳市支行
账户名称：电光防爆科技股份有限公司
银行账号：19270501040081432
银行地址：乐清市柳市镇惠丰路1号
金额（人民币元）：142,580,000.00
用途：生产及辅助非生产用房建设项目（救生舱等井下安全避险设备）

2、银行名称：乐清市交行柳市支行
账户名称：电光防爆科技股份有限公司
银行账号：333037311018010038977
银行地址：柳市镇柳青南路1508号
金额（人民币元）：121,610,000.00
用途：生产及辅助非生产用房建设项目（高低压防爆开关等系列产品）

公司若将专户中的部分募集资金以存单方式另行存放，公司承诺在存单到期后及时将本息全额转入监管协议规定的募集资金专户进行管理或以存单方式续存，并通知保荐机构。公司转存的存单不得进行质押。

二、公司和开户银行双方应当共同遵守《中华人民共和国票据法》、《支付结算办法》、《人民币银行结算账户管理办法》等法律、法规、规章。

三、财通证券作为公司的保荐机构，应当依据有关规定指定保荐代表人或其他工作人员对公司募集资金使用情况进行监督。保荐机构应当依据《中小企业板上市公司规范运作指引》以及公司制订的募集资金管理制度履行其督导职责，并有权采取现场调查、书面问询等方式行使其监督权。公司和开户银行应当配合保荐机构的调查与查询。保荐机构每季度对公司现场调查时应同时检查募集资金专户存储情况。

四、公司授权保荐机构指定的保荐代表人何斌辉、许金洋可以随时到开户银行查询、复印公司专户的资料；开户银行应及时、准确、完整地向其提供所需的有关专户的资料。

保荐代表人向开户银行查询公司专户有关情况时应出具本人的合法身份证明；保荐机构指定的其他工作人员向开户银行查询公司专户有关情况时应出具本人的合法身份证明和单位介绍信。

五、开户银行按月（每月20日前）向公司出具对账单，并抄送保荐机构。开户银行应保证对账单内容真实、准确、完整。

六、公司一次或12个月以内累计从专户中支取的金额超过1,000万元或募集资金净额的5%的，开户银行应及时以传真方式通知保荐机构，同时提供专户的支出清单。

七、保荐机构有权根据有关规定更换指定的保荐代表人。保荐机构更换保荐代表人的，应将相关证明文件书面通知开户银行，同时按监管协议第十一条的要求向公司、开户银行书面通知更换后的保荐代表人联系方式。更换保荐代表人不影响监管协议的效力。

八、开户银行连续三次未及时向保荐机构出具对账单或向保荐机构通知专户大额支取情况，以及存在未配合保荐机构调查专户情形的，公司有权单方面终止监管协议并注销募集资金专户。

九、监管协议自公司、开户银行、保荐机构三方法定代表人或其授权代表签署并加盖各自单位公章之日起生效，至专户资金全部支出完毕且保荐机构督导期结束之日起失效。

备查文件：

1、公司、开户银行、财通证券签署的《募集资金三方监管协议》
2、天健会计师事务所（特殊普通合伙）天健验［2014］208号《验资报告》

特此公告！

电光防爆科技股份有限公司董事会
2014年10月29日