万家上证380交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要

（2014年2号）

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

本基金经2013年7月31日中国证券监督管理委员会证监许可【2013】1047号文注册募集，基金合同生效日为2013年10月31日。

【重要提示】

投资有风险，投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

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。

本招募说明书所载内容截止日为2014年10月31日，有关财务数据和净值表现截止日为2014年9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

住所：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

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：021-38909626

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。

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

监事会主席李润虹先生，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。

监事崔明朋先生，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）

代总经理：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，曾任综合管理部总监、董事会秘书、总经理助理，2013年4月起任公司副总经理，2014年10月起代任公司总经理。

副总经理兼代督察长：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，任直销部副总监等职；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月起任公司副总经理，2014年10月起代为履行公司督察长职责。

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月起任本基金基金经理。现任量化投资部总监、兼任万家中证红利指数基金（LOF）基金经理、万家中证创业成长指数分级基金及万家180指数型证券投资基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

委员会主席：李杰

委员：吴涛、华光磊、孙驰、刘荆

李杰先生，万家基金管理有限公司代总经理

吴涛先生，量化投资部总监、万家180指数基金基金经理、万家中证红利指数基金（LOF）基金经理、万家中证创业成长指数分级基金基金经理、万家上证380ETF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、万家精选股票型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

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人概况

一、基金托管人概况

（一）基本情况

名称：华夏银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街22号（100005）

办公地址：北京市东城区建国门内大街22号（100005）

法定代表人：吴建

成立时间：1992年10月14日

组织形式：股份有限公司

注册资本：8,904,643,509元人民币

批准设立机关和设立文号：中国人民银行[银复（1992）391号]

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]25号

联系人：郑鹏

电话：（010）85238667

传真：（010）85238680

（二）主要人员情况

华夏银行资产托管部内设市场综合室、交易管理室、风险管理室和销售管理室4个职能处室。资产托管部共有员工29人，高管人员拥有硕士以上学位或高级职称。

（三）基金托管业务经营情况

华夏银行于2005年2月23日经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会核准，获得证券投资基金托管资格，是《证券投资基金法》和《证券投资基金托管资格管理办法》实施后取得证券投资基金托管资格的第一家银行。自成立以来，华夏银行资产托管部本着“诚实信用、勤勉尽责”的行业精神，始终遵循“安全保管基金资产，提供优质托管服务”的原则，坚持以客户为中心的服务理念，依托严格的内控管理、先进的技术系统、优秀的业务团队、丰富的业务经验，严格履行法律和托管协议所规定的各项义务，为广大基金份额持有人和资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务，取得了优异业绩。截至2014年6月末，已托管长城货币市场证券投资基金、国联安德盛精选股票证券投资基金、万家货币市场证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、益民红利成长混合型证券投资基金、东吴行业轮动股票型证券投资基金、申万菱信稳益宝债券型证券投资基金、诺德双翼分级债券型证券投资基金、浙商沪深300指数分级证券投资基金、华商大盘量化精选灵活配置混合型证券投资基金、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及其它受托资产产品，托管各类资产规模9703.56亿元。

三、相关服务机构

一、基金份额销售机构

1、申购赎回代理券商（简称“一级交易商”）

（1）齐鲁证券有限公司

客户服务电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

（2）东北证券股份有限公司

客户服务电话：4006000686

网址：www.nesc.cn

（3）光大证券股份有限公司

客户服务电话：95525

网址：www.ebscn.com

（4）国泰君安证券股份有限公司

客户服务电话：400-8888-666

网址：www.gtja.com

（5）海通证券股份有限公司

客户服务电话：400-8888-001，（021）962503

网址：www.htsec.com

（6）宏源证券股份有限公司

客服电话：4008-000-562

网址：www.hysec.com

（7）华鑫证券有限责任公司

公司网站：www.cfsc.com.cn

客户服务电话：021-32109999；029-68918888；4001099918

（8）上海证券有限责任公司

客户服务电话：（021）962518

网址：www.962518.com.cn

（9）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

（10）信达证券股份有限公司

客服热线：400-800-8899

网址：www.cindasc.com

（11）兴业证券股份有限公司

客户服务电话：400-8888-123

网址：www.xyzq.com.cn

（12）中国银河证券股份有限公司

客户服务电话：400-8888-111，95565

网址：www.newone.com.cn

（14）浙商证券有限责任公司

客户服务电话：0571-967777

网址：www.stocke.com.cn

（15）中信建投证券有限责任公司

客户服务电话：400-8888-8108

网址：www.csc108.com

（16）中航证券有限公司

统一客服电话：4008866567

公司网站地址：http://www.avicsec.com

（17）中国中投证券有限责任公司

开放式基金咨询电话：4006008008

网址：www.cjis.cn

（18）中信证券（浙江）有限责任公司（原中信金通证券）

客户服务电话：（0571）96598

网址：www.96598.com.cn

（19）中信万通证券有限责任公司

客户服务电话：（0532）96577

网址：www.zxwt.com.cn

（20）中信证券股份有限公司

统一客服电话：95558

网址：www.citic.com

（21）东兴证券股份有限公司

客户服务电话：400-888-8993

公司网站：www.dxzq.net

2、二级市场交易代理券商

包括具有经纪业务资格及上海证券交易所会员资格的所有证券公司

3、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）登记结算机构

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

负责人：刘逸星

经办律师：华涛、夏火仙

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

万家上证380交易型开放式指数证券投资基金

五、基金的类型

基金类型：股票型基金

基金运作方式：交易型开放式

六、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

七、基金的投资方向

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%。

八、基金的投资策略

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。

1、组合复制策略

本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应调整。

2、替代性策略

由于市场流动性不足、限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的某成分股股票时，基金管理人将通过投资其他成份股、非成份股以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具进行替代。

3、股指期货投资策略

本基金选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，根据风险管理的原则，以套期保值为目的投资，从而降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，有助于更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

4、权证投资策略

本基金将通过对权证标的证券的基本面研究，结合多种定价模型，根据基金资产组合情况适度进行权证投资。

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。

(四)投资管理程序

本基金是交易型开放式指数基金，旨在以最小的跟踪误差追踪目标指数。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

1、研究：基金经理、研究人员依托公司整体研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、成份股替代分析、流动性分析、误差及其归因分析、衍生品分析等工作。

2、组合构建：结合上述研究工作，基金经理以复制指数成份股权重及其他合理方法构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，以降低买入成本、控制投资风险。

3、交易执行：交易部门负责具体执行交易，履行一线监控的职责。

4、投资绩效评估：合规稽核部定期或不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。

5、组合再平衡：基金经理跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

为更好地实现投资目标，基金管理人可以根据环境变化和实际需要对上述投资管理程序做出调整，并在基金招募说明书更新中公告。

(五)投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

（2）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

（3）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

（4）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

（5）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

（6）本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

（7）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

（8）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

（9）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（10）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%；

（11）在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%，在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值合计（轧差计算）不得超过基金资产净值的100%。

（12）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；

（5）向其基金管理人、基金托管人出资；

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（7）依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，符合国务院证券监督管理机构的规定，并履行信息披露义务。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

九、基金的业绩比较基准

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。

十、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。

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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年10月23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9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	11,617,568.98	97.14
	其中：股票	11,617,568.98	97.14
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	318,864.78	2.67
7	其他资产	23,060.84	0.19
8	合计	11,959,494.60	100.00

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值，而2的合计项中不含可退替代款估值增值。

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	77,464.85	0.67
B	采矿业	443,182.80	3.81
C	制造业	6,135,781.45	52.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	748,629.63	6.43
E	建筑业	497,625.93	4.28
F	批发和零售业	1,184,380.28	10.18
G	交通运输、仓储和邮政业	1,076,691.29	9.25
H	住宿和餐饮业	25,070.20	0.22
I	信息传输、软件和信息技术服务业	632,304.57	5.43
J	金融业	-	-
K	房地产业	287,465.93	2.47
L	租赁和商务服务业	93,763.70	0.81
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	39,931.35	0.34
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	111,624.38	0.96
S	综合	263,652.62	2.27
	合计	11,617,568.98	99.84

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	600570	恒生电子	3,289	138,730.02	1.19
2	600660	福耀玻璃	9,404	98,930.08	0.85
3	601618	中国中冶	32,282	83,933.20	0.72
4	601018	宁波港	24,419	83,024.60	0.71
5	600879	航天电子	5,255	82,293.30	0.71
6	601991	大唐发电	19,401	79,350.09	0.68
7	601929	吉视传媒	6,028	78,906.52	0.68
8	600153	建发股份	11,475	73,669.50	0.63
9	600068	葛洲坝	15,433	73,615.41	0.63
10	601727	上海电气	13,166	71,359.72	0.61

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

9.1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

9.2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金将选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，根据风险管理的原则，以套期保值为目的投资，从而降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，由于更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

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情况，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	863.97
2	应收证券清算款	7,003.71
3	应收股利	-
4	应收利息	69.02
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	15,124.14
8	其他	-
9	合计	23,060.84

11.4、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。

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

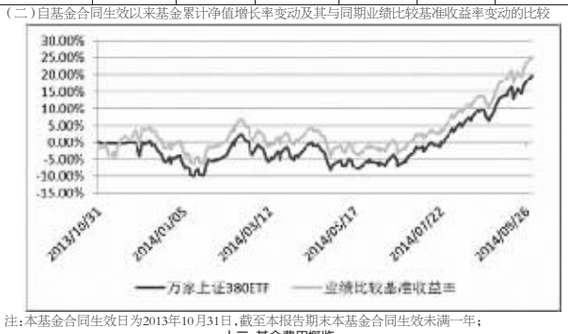
基金业绩截止日为2014年9月30日，托管人华夏银行于2014年10月23日复核了本招募说明书中的基金净值表现。

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10月31日-2013年12月31日	-4.03%	0.96%	0.08%	1.26%	-4.11%	-0.30%
2014年1月1日-2014年9月30日	24.68%	1.09%	24.98%	1.09%	-0.30%	0.00%
基金成立日——2014年9月30	19.66%	1.07%	25.08%	1.13%	-5.42%	-0.06%

（二）自基金合同生效以来基金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：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；

十三、基金费用概览

（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、标的指数许可使用费；

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、基金的证券交易或结算产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费、融资融券费、证券账户相关费用及其他类似性质的费用等）。

8、基金的银行汇划费用；

9、基金上市初费及年费；

10、基金的登记结算费用；

11、基金收益分配中发生的费用；

12、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。

在中国证监会允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明。

（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0.50%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0.10%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、标的指数许可使用费

基金合同生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定从基金财产中向中证指数有限公司支付。标的指数使用费按前一日基金资产净值的0.03%的年费率计提。标的指数许可使用费每日计算，逐日累计。

计算方法如下：

H=E×0.03%/当年天数

H为每日应付的标的指数许可使用费，E为前一日的基金资产净值。

标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币伍万元（50,000）。

中证指数有限公司根据相应指数使用许可协议变更上述标的指数许可使用费费率和计算方法的，基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率和计算方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

如果中证指数有限公司根据指数使用许可协议的约定要求变更标的指数许可使用费费率和计算方法，应按照变更后的标的指数许可使用费从基金财产中支付给指数许可方。此项变更无需召开基金份额持有人大会。

上述“（一）基金费用的种类中第4—12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不得列入基金费用的项目。

(四)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6月13日刊登的本基金2014年第1号招募说明书内容进行了更新，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、更新了招募说明书的目录。

2、更新了招募说明书的绪言部分

3、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。

4、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。

5、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。

6、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年第三季度）投资组合报告内容。

7、在招募说明书中增加“十一、基金的业绩”部分，更新了基金成立以来的投资业绩。

8、在招募说明书的“二十二、基金份额持有人服务”部分，更新了咨询服务的有关内容。

9、在招募说明书中增加“二十三、其他应披露事项”部分，并增加了招募说明书公告以来本基金的公告事项。

万家基金管理有限公司

二〇一四年十二月十五日

证券代码:600681 证券简称:万鸿集团 公告编号:2014-041

万鸿集团股份有限公司关于投资者说明会召开情况及相关内容的公告

本公司及董事会全体成员保证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、准确和完整承担个别及连带责任。

重要提示：

●公司股票将于2014年12月15日复牌。

●万鸿集团股份有限公司承诺在本投资者说明会结果公告刊登日（2014年12月15日）之后的3个月内，不再筹划重大资产重组事项。

一、本次说明会召开情况

万鸿集团股份有限公司于2014年12月12日上午9:30-10:30通过上海证券交易所"上证E互动"网络平台以网络方式召开关于终止本次重大资产重组事项的投资者说明会。

二、本次说明会投资者提出的主要问题及公司回复情况

大家好，欢迎投资者参与万鸿集团股份有限公司关于终止本次重大资产重组事项的投资者说明会，出席本次说明会的人员包括万鸿集团董事长、总经理兼董事会秘书，独立财务顾问的代表，并就投资者普遍关注的问题予以回答，互动交流。

1、投资者问题：所有人都知道宾馆行业受国家政策影响了，公司现在才知道?重组失败，小股民叫好，公司对此怎么看?

回答：本次重组的目的在于突出上市公司主营业务，减少关联交易，增强上市公司持续盈利能力和独立性。本次重组事项最终需要股东大会共同决定，大股东回避表决。相关程序均符合重组管理办法的相关规定的。

2、投资者问题：万鸿公司2011年报持有非上市金融企业股权情况：对南方证券有限公司最初投资成本 8333.9718万元，占股权比例2.19% 。请问南方证券现在的存在中投证券有没有承认公司的股东权利?

回答：关于公司持有南方证券股权的相关事项已在公司年度报告中予以披露，详情请查阅公司年度报告。

3、投资者问题：万鸿公司下属三子公司无资质经营如何解释?股改时承诺的利润何时兑现?公司股份已质押给安信证券，拿什么重组?

回答：此问题之前已有答复，根据我们的了解，目前广东腾远装修工程有限公司已具备工程设计与施工资质证书；佛山市阳光棕榈园林绿化工程公司的资质正在办理中；顺德高盛装饰设计工程有限公司由于与前述公司业务重合，今后拟不开展业务。其余两问题与本次重组事项无关，敬请谅解!谢谢!

4、投资者问题：未来公司还有没有重组计划?本人还有没有继续持有贵公司股票的必要?

回答：万鸿集团已承诺在本次投资者说明会结果刊登日之后3个月内，不再筹划重大资产重组事项。谢谢!

5、投资者问题：公司是否会开始新的并购重组?

回答：本公司承诺在本投资者说明会结果刊登日之后3个月内，不再筹划重大资产重组事项。

6、投资者问题：有传言，3个月后公司重启重组网商，是否真实 。

回答：根据相关规定，公司3个月内不再筹划重大重组事项，公司会严格遵守信披规定，如实履行信披义务!

7、投资者问题：董事会何时换届?

回答：根据相关规则规定，董事会三年一届，公司本届董事会为第七届董事会，任期为2012年6月至2015年6月。

8、投资者问题：戚总，据你所知，大股东是否决心自己注入资产，绝对排除转让股权，或者引入外部资产重组的可能?

回答：公司暂未收到任何关于大股东对于此事的相关信息。公司将会严格遵守相关规定，及时履行信披义务。

9、投资者问题：安信证券与万鸿集团的此次项目合作是否随着重大资产事项的终止而同时终止?万鸿与安信证券是否还有进一步委托事项或者合作项目?

回答：因本次重大资产重组事项终止，我们此次财务顾问的合作事项也随之终止了。

10、投资者问题：停盘期间大盘飙涨 此时终止重组股价是否会受到负面的影响?

回答：公司已按要求定期披露财务报表，并如实披露公司实际情况，请广大投资者注意投资风险。

11、投资者问题：公司净资产接近0 有退市风险，未来准备怎么办?

回答：公司管理层在积极推动本次重大资产重组交易的过程中，仍努力维护现有经营成果，积极开展园林装修业务，公司将不断深化完善公司整体发展战略，努力提升持续盈利能力，实现公司可持续发展。

12、投资者问题：万鸿以后是否有重组计划和方向?

回答：公司承诺3个月内不进行重组，3个月后是否重组要看公司的实际情况及未来的机遇再行判断!

13、投资者问题：公司今年的主营业务如何?

回答：公司目前以园林装修为主业，具体情况需要看公司2014年年度报告。

14、投资者问题：公司什么时候披露2014年年度报告?

回答：公司将按照上海证券交易所的相关规定，在年度结