万家强化收益定期开放债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

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]1518号文核准。本基金的基金合同于2013年5月7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11月7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。

独立董事陈增歌先生,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,上海财经大学公共经济学院副教授,现任上海财经大学商学院副院长。2、基金管理人监事会成员

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)

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,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,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

孙驰:男,复旦大学经济学专业硕士,2007年7月至2010年4月在中海信托股份有限公司从事固定收益投资研究工作,担任投资经理职务。2010年4月加入万家基金管理有限公司,历任固定收益研究员、基金经理助理。现任固定收益部总监,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。

苏谋东:男,复旦大学经济学硕士,CFA,2008年7月至2013年2月在宝钢集团财务有限公司从事固定收益投资研究工作,担任投资经理职务。2013年3月加入万家基金。现任万家强化收益定期开放债券基金基金经理、万家日日薪货币基金基金经理、万家添利债券型基金(LOF)基金经理、万家信用恒利债券基金基金经理、万家城市建设主题纯债债券型基金基金经理。

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:徐昊光

电话:(010)85238982

传真:(010)85238680

(二)主要人员情况

华夏银行资产托管部内设市场一室、市场二室、运营室、风险管理室4个职能处室。资产托管部共有员工30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:400-888-8888

网址:www.chinastock.com.cn

(13)招商证券股份有限公司

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:400-888-8108

网址:www.c.108.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

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:上海市浦东新区世纪大道100号环球国际金融中心24层

负责人:刘逸星

经办律师:夏火仙、华涛

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

万家强化收益定期开放债券型证券投资基金

五、基金的类型

基金类别:债券型证券投资基金

基金运作方式:契约型开放式

六、基金的投资目标

在合理控制风险的基础上,追求基金资产的长期稳定增值,力争获得超过业绩比较基准的收益。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的国债、央行票据、地方政府债、次级债、金融债、公司债、企业债、中小企业私募债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、短期融资券、资产支持证券、中期票据、银行存款、货币市场工具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(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金不投资股票,不直接从二级市场买入可转换债券、权证,但可以参与一级市场可转换债券(含可分离交易的可转换债券)的申购。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%,投资于主体信用评级在A(含)至AA(含)之间的信用债券的比例不低于债券类资产的80%,投资于中小企业私募债券的比例不高于债券类资产的20%;但在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内,基金投资不受上述比例限制;在开放期内,本基金持有的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%。

八、基金的投资策略

本基金将主要投资于主体信用评级在A(含)至AA(含)之间的的信用类固定收益金融工具。本基金在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上,通过对利率变化趋势、债券收益率曲线移动方向、信用利差等影响债券价格的因素进行评估,采取积极的债券投资管理策略,并充分利用市场的非有效性,把握各类套利的机会,在信用风险可控的前提下,寻求组合流动性与收益的最佳配比,力求持续取得达到或超过业绩比较基准的债券组合投资收益。

本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。

1. 封闭期投资策略

1)期限配置策略

为合理控制本基金开放期的流动性风险,并满足每次开放期的流动性需求,本基金在每个封闭期将适当地采取期限配置策略,即原则上将基金资产所投资标的的平均剩余存续期限与基金剩余封闭期限进行适当的匹配。

2)利率预期策略

利率变化是影响债券价格的最重要的因素,利率预期策略是本基金的基本投资策略。本基金通过对宏观经济、金融政策、市场供需、市场结构变化等因素的分析,采用定性分析与定量分析相结合的方法,形成对未来利率走势的判断,并在此基础上对债券组合的久期结构进行有效配置,以达到降低组合利率风险,获取较高投资收益的目的。

3)期限结构配置策略

利率期限结构表明了债券的到期收益率与到期期限之间的关系。本基金通过数量化方法对利率进行建模,在各种情形、各种假设下对未来利率期限结构变动进行模拟分析,并在运作中根据期限结构不同变动情形在子弹式组合、梯式组合和杠铃式组合当中进行选择适当的配置策略。

4)信用债券投资策略

本基金的投资重点为主体信用评级在A(含)至AA(含)之间的的信用债券。本基金将在万家基金内部信用评级的基础上和内部信用风险控制的框架下,积极投资信用债券。对信用利差的评估直接决定了对信用债券的定价结果。信用利差是信用债券相对于可比国债在信用利差扩大风险和到期兑付违约风险上的补偿。信用利差的变化受经济周期、行业周期和发行主体财务状况等综合因素的影响。本基金围绕上述因素综合评估发行主体的信用风险,确定信用债券的信用利差,有效管理组合的整体信用风险。

在信息反映充分的债券市场中,信用利差的变化有规律可循且在一定时期内较为稳定。当债券收益率曲线上移时,信用利差通常会扩大,而在债券收益率曲线下移的过程中,信用利差会收窄;行业盈利增加、处于上升周期中,信用利差会缩小、行业盈利缩减、处于下降周期中,信用利差会扩大,提前预测并制定相应投资策略,就可能获得收益或者减少损失。本基金将通过定性与定量相结合的方式,综合考虑监管环境、市场供求关系、行业分析,并运用财务数据统计模型和现金流分析模型等对整个市场的信用利差结构进行全面分析,在有效控制整个组合信用风险的基础上,采取积极的投资策略,发现价值被低估的信用类债券产品,挖掘投资机会,获取超额收益。

5)信用债券投资的风险管理

本基金采用自上而下、定性与定量相结合、动态与静态相结合的办法,对信用债券面临的信用风险进行综合评估,同时给出内部的信用评分,建立信用债券的投资库。在具体操作上,首先按照标准普尔全球行业分类系统(GICS)将全部发债企业划分行业,对主要行业的整体信用状况做出基本判断和定期跟踪;其次针对具体行业的运行模式、竞争状况和盈利特点选取对该行业中企业信用资质最为重要的若干因素,包括企业基本面、竞争优势、成本控制方面的各项因素以及财务数据中最能够体现企业信用资质差异的指标,对每项因素和指标赋予一定的权重,形成该行业的评分体系;最后评估行业内主要发债企业每项指标的表现,定量给予评分,并综合得到企业的信用资质评分。在定量评分体系基础之上,信用研究员针对企业特有的竞争优势或者潜在风险对评分进行相应的调整,并充分提示风险。债券入库后,信用研究员定期动态跟踪所持债券的信用资质状况,并建立相应的预警指标,具体操作包括但不限于:

(1)定期对当前的宏观环境以及对企业可能产生的影响进行评估;

(2)定期对企业所在行业的整体信用状况进行跟踪;

(3)定期跟踪企业财务数据,财务数据涉及净利润、经营性利润等利润指标,经营活动产生的现金流量、经营活动现金流短期债务覆盖倍数、投资活动现金流等现金流指标以及资产负债率、流动比率、速动比率等偿债能力指标;

如果企业信用资质有恶化的迹象,信用研究员会及时向基金经理汇报,并集中讨论解决方案以提早规避可能出现的各种风险。

6)杠杆投资策略

在信用风险和流动性风险可控的前提下,以组合现有债券为基础,利用买断式回购、质押式回购等方式融入低成本资金,并购买剩余年限相对较长并具有较高收益的债券,以获取超额收益。

7)资产支持证券投资策略

资产支持证券,定价受多种因素影响,包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、违约率等。本基金将深入分析上述基本面因素,并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型,评估其内在价值。

8)中小企业私募债券投资策略

本基金将综合运用类别资产配置、久期管理、收益率曲线、个券选择和利差定价管理等策略,在严格遵守法律法规和基金合同基础上,进行中小企业私募债券的投资。

本基金将特别注重中小企业私募债券的信用风险和流动性管理,本着风险调整后收益最大化的原则,确定中小企业私募债券类资产的合理配置比例,保证本金相对安全和资产流动性,以期获得长期稳定收益。在投资决策过程中,将评估中小企业私募债券的流动性对基金资产流动性的影响,分散投资,确保所投资的中小企业私募债券具有适当的流动性;同时密切关注影响中小企业私募债券价值的因素,并进行相应的投资操作。

本基金将对中小企业私募债券进行深入研究,由债券研究员根据公司内部《信用债券库管理办法》对中小企业私募债券的信用风险和投资价值进行分析并给予内部信用评分和投资评级。本基金可投资于内部评级界定为可配置类的中小企业私募债券;对于内部评级界定为风险规避类的中小企业私募债券,禁止进行投资。

9)其他衍生工具的投资策略

对于未来推出的国债期货等新型金融工具或衍生金融工具,如法律法规或监管机构允许基金投资,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金对衍生金融工具的投资主要以套期保值或无风险套利为主要目的。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,同时结合对衍生工具的研究,在充分考虑衍生产品风险和收益特征的前提下,谨慎进行投资。

2.开放期投资策略

开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,减小基金净值的波动。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为三年期银行定期存款税后收益率。

三年期定期存款利率是指基金合同生效日或每个申购赎回开放起始日中国人民银行网站上发布的三年期"金融机构人民币存款基准利率"。

本基金每三年开放一次申购和赎回。以三年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准,能够使本基金投资人理性判断本基金产品的风险收益特征,合理地衡量比较本基金的业绩表现。

如果今后法律法规发生变化,或证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意,并报中国证监会备案。基金管理人应在调整前2个工作日在至少一种指定媒体上予以公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金,主要投资品种为发行主体信用评级在A(含)至AA(含)之间的信用债券,并预期的风险收益水平高于开放式纯债基金。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	388,612,164.80	92.08
	其中:债券	388,612,164.80	92.08
	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	12,100,000.00	2.87
	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	1,246,556.49	0.30
7	其他资产	20,067,177.15	4.75
8	合计	422,025,898.44	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期未未持有股票。

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

本基金本报告期未未持有股票。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	334,905,108.40	125.17
5	企业短期融资券	20,203,000.00	7.55
6	中期票据	30,171,000.00	11.28
7	可转债	3,333,056.40	1.25
8	其他	-	-
9	合计	388,612,164.80	145.25

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	112142	12格林债	273,427	27,028,258.95	10.10
2	112119	12恒邦债	266,229	26,010,573.30	9.72
3	112172	13普邦债	257,430	25,743,000.00	9.62
4	112161	13传化债	257,399	25,508,240.90	9.53
5	112174	13广田01	255,780	25,053,651.00	9.36

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

本基金本报告期未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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、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,本基金暂不可投资股指期货。

9、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。

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	16,791.37
2	应收证券清算款	8,485,516.55
3	应收股利	-
4	应收利息	11,564,869.23
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,067,177.15

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

本基金本报告期末未持有股票。

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11月28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5月7日-2013年12月31日	0.69%	0.14%	2.78%	0.00%	-2.09%	0.14%
2014年1月1日-2014年9月30日	10.64%	0.16%	3.18%	0.00%	7.46%	0.16%
基金成立日——2014年9月30	11.41%	0.15%	5.96%	0.00%	5.45%	0.15%

注:业绩比较基准为三年期银行定期存款税后收益率

(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(2013年5月7日至2014年9月30日)

注: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。

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.基金财产按划支付的银行费用;

4.基金合同生效后的基金信息披露费用;

5.基金份额持有人大会费用;

6.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;

7.基金的证券交易费用;

8.基金的开户费用、账户维护费用

9.基金上市费用(包括上市初费和上市月费);

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,本基金合同已有规定的和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0.70%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5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0.20%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5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.除管理费、托管费之外的基金费用,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低基金管理费率、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6月23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,更新了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"绪言部分"部分,更新了绪言的有关内容。

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"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"二十二、基金份额持有人服务"部分,更新了本公司的客服传真电话。

9、在招募说明书"二十三、其他应披露事项"部分,更新了上一次招募说明书刊登以来的公告事项。

万家基金管理有限公司
2014年12月20日

证券代码:000566 证券简称:海南海药 公告编号:2014-069

海南海药股份有限公司第八届董事会第十八次会议决议公告

本公司董事会及全体董事保证公告内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

海南海药股份有限公司(以下简称"公司")第八届董事会第十八次会议,于2014年12月17日以传真及电子邮件的方式向全体董事发出书面通知,并于2014年12月19日以通讯表决方式召开。会议应到董事9人,实到9人,会议由董事长刘悉承先生主持。会议符合《公司法》、《公司章程》的有关规定。本次会议审议通过了如下议案:

一、以7票同意,0票反对,0票弃权审议通过了《<关于调整公司非公开发行股票方案>决议有效期调整的议案》

本次非公开发行股票的认购对象深圳市南方园正投资有限公司为公司的控股股东。根据《深圳证券交易所股票上市规则》有关规定,南方园正为本公司的关联人,本次交易构成关联交易。公司2名董事刘悉承先生、裘婉萍女士因与南方园正存在关联关系回避表决。

本议案需提交公司2015年第一次临时股东大会审议。

具体内容详见同日于《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》及巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)刊载的《关于调整非公开发行股票方案决议有效期和授权有效期的公告》。

二、以9票同意,0票反对,0票弃权审议通过了《<关于提请股东大会授权董事会办理本次非公开发行股票具体事宜>授权有效期调整的议案》

本议案需提交公司2015年第一次临时股东大会审议。

具体内容详见同日于《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》及巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)刊载的《关于调整非公开发行股票方案决议有效期和授权有效期的公告》。

三、以9票同意,0票反对,0票弃权审议通过了《关于召开2015年第一次临时股东大会的议案》

具体内容详见同日于《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》及巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)刊载的《关于召开2015年第一次临时股东大会的通知》。

特此公告

海南海药股份有限公司
董 事 会
二〇一四年十二月二十日

证券代码:000566 证券简称:海南海药 公告编号:2014-070

海南海药股份有限公司关于召开2015年第一次临时股东大会的通知

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

根据海南海药股份有限公司(以下简称:"公司")第八届董事会第十八次会议决议,公司决定于2015年1月5日召开2015年第一次临时股东大会,现将有关事项通知如下:

一、召开会议的基本情况

1. 会议召集人:公司第八届董事会

2. 经公司第八届董事会第十八次会议审议通过决定召开2015年第一次临时股东大会,召集程序符合有关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和《公司章程》的规定。

3. 会议时间:

现场会议召开时间:2015年1月5日 14:30

网络投票时间:2015年1月4日-2015年1月5日

(1)通过深圳证券交易所交易系统进行网络投票的具体时间为:2015年1月5日交易日上午9:30~11:30,下午13:00~15:00;

(2)通过深圳证券交易所互联网投票系统投票的时间为2015年1月4日15:00—2015年1月5日15:00期间的任意时间。

4. 现场会议地点:海南省海口市秀英区南海大道西66号公司会议室

5. 会议的召开方式:本次股东大会采用现场表决与网络投票相结合的方式召开

6.本次会议投票表决方式

(1)现场投票:包括本人出席及通过填写授权委托书授权他人出席。

(2)网络投票:公司将通过深圳证券交易所交易系统和互联网投票系统向股东提供网络形式的投票平台(http://wltp.cninfo.com.cn),公司股东应在本通知列明的有关时限内通过深圳证券交易所的交易系统或互联网投票系统进行网络投票。

公司股东只能选择上述投票方式中的一种表决方式。同一表决权出现重复投票的以第一次有效投票结果为准。

7. 会议出席对象:

(1)截止2014年12月25日(星期四)下午15:00 交易结束后,在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的本公司全体股东。股东可以书面委托代理人出席会议和参加表决(该股东代理人不必是公司的股东)。

(2)公司董事、监事、高级管理人员、见证律师。

二、会议审议事项

1.审议《关于调整公司非公开发行股票方案>决议有效期调整的议案》;

2.审议《<关于提请股东大会授权董事会办理本次非公开发行股票具体事宜>授权有效期调整的议案》。

上述议案内容详见2014年12月20日于《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)披露的相关公告。

三、会议登记方法

1.登记时间:2014年12月26日(上午9:00-11:00,下午14:00-16:00);

2.登记方式:法人股东持营业执照复印件、股东帐户卡、持股凭证、法定代表人证明书或法人授权委托书和出席人身份证进行登记;

个人股东持本人身份证、股东帐户卡及持股凭证进行登记;委托代理人持本人身份证、委托人股东帐户卡、持股凭证及授权委托书到公司进行登记;异地股东可以传真或信函方式登记(授权委托书见附件)。

3.登记地点:海南省海口市南海大道西66号 海南海药股份有限公司董事会秘书处 。

四、参加网络投票的具体操作流程

在本次股东大会上,公司将向股东提供网络投票平台,股东可以通过深交所交易系统或互联网系统(http://wltp.cninfo.com.cn)参加网络投票,网络投票程序如下:

(一)通过深交所交易系统