万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

基金管理人:万家基金管理有限公司
基金托管人:上海银行股份有限公司
报告送出日期:2015 年 10 月 26 日

§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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2015 年 10 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 7 月 23 日(基金合同生效日)起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家瑞兴灵活配置
基金主代码	001518
交易代码	001518
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年 7 月 23 日
报告期末基金份额总额	36,814,024.45 份
投资目标	本基金投资于具有成长潜力的上市公司,以获取未来资本增值的机会,并谋求基金资产的中长期稳定增值,同时通过分散投资提交基金资产的流动性。
投资策略	基金管理人在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上,采取积极主动的投资管理策略,通过定性与定量分析,对利率变化趋势、债券收益率曲线移动方向、信用利差等影响固定收益投资品价格的因素进行评估,对不同投资品种运用不同的投资策略,并充分利用市场的非有效性,把握各类资料的机会,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,力求持续取得选到或超过业绩比较基准的收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率＊50%+中证全债指数收益率＊50%
风险收益特征	本基金是混合型基金,风险高于货币市场基金和债券型基金但低于股票型基金,属于中高风险、中高预期收益的证券投资基金。
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	上海银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015 年 7 月 23 日 – 2015 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	1,036,029.84
2.本期利润	620,427.84
3.加权平均基金份额本期利润	0.0028
4.期末基金资产净值	37,849,542.88
5.期末基金份额净值	1.0281

注:1、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。

2、上表中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。

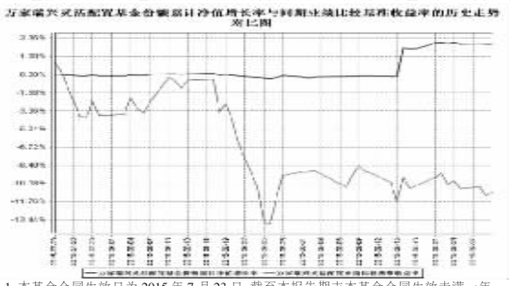
3、由于基金合同在当期生效,本报告期不足一个季度。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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
过去三个月	2.81%	0.40%	-10.86%	1.59%	13.67%	-1.19%

3.2.2 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:1、本基金合同生效日为 2015 年 7 月 23 日,截至本报告期末本基金合同生效未满一年;

2、本基金于 2015 年 7 月 23 日成立,根据基金合同规定,基金合同生效后六个月内为建仓期,截至本报告期末本基金尚在建仓期。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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
高翰昆	本基金经理、现任公司万家新利灵活配置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、万家现金宝货币型证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资和万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2015年 7 月 23 日	-	5年	美国诺丁汉大学硕士,2009 年 7 月加入万家基金管理有限公司,历任研究部助理、交易员、交易部总监助理、交易部副总监。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《公开募集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 公平交易专项说明

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。

本报告期内无下列情况: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%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度各项经济数据依然继续走低,但幅度收窄逐渐显现出企稳趋势。同时管理层问增长的意愿表现的越发强烈,各类刺激政策层出不穷尤以对房地产的刺激为甚。此外央行连续降准降息并不断扩大再贷款范围也为市场及经济企稳提供了充足的流动性,并抵补了外汇占款减小对基础货币投放的负面冲击。值得注意的是在管理层的推动下股市快速而剧烈地基本完成了杠杆去化,在政策底后逐渐寻找到了市场底。本组合在本报告期内基于如上判断精选个股逐步加大对权益类资产得配置力度静待中级反弹的到来。

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 1.0281 元,本报告期份额净值增长率为 2.81%,业绩比较基准收益率为-10.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济在积极的财政政策及房地产救市政策的刺激下未来半年企稳的概率很大。同时管理层在治理好全社会的杠杆率及杠杆结构并采取措施有效降低热钱流出意愿后极有可能继续维持宽松的货币政策配合积极的财政政策。在股市经历了一轮快速下跌后已经有很多个股估值长期看具有较强吸引力,受益于中国经济转型的很多个股板块依然具有较强的成长性也具有了介入的价值。值得注意的是,经过本轮快速下跌管理层未来必定会加大对杠杆资金入市的管控。加之市场上最活跃风险偏好最高的资金基本被消耗殆尽。我们没法乐观预期未来市场还会快速上涨创新高,应该会步入一个逐步分化的反弹行情。下阶段本组合将基于以上判断继续灵活操作规避较大的回撤风险,逢低加大对价值股及成长股的配置精选并持有那些可能引领未来中国经济增长的行业个股。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金没有出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情况。

§5 投资组合报告

5.1 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	1,559,610.00	4.10
	其中:股票	1,559,610.00	4.10
2	固定收益投资	3,758,464.80	9.88
	其中:债券	3,758,464.80	9.88
	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	10,000,135.00	26.28
	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	22,653,628.70	59.54
7	其他资产	75,694.64	0.20
8	合计	38,047,533.14	100.00

5.2 报告期末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	-	-
C	制造业	1,559,610.00	4.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
	合计	1,559,610.00	4.12

5.3 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

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	000513	丽珠集团	39,000	1,559,610.00	4.12

5.4 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	3,758,464.80	9.93
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	回业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,758,464.80	9.93

5.5 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	019506	15国债06	37,420	3,758,464.80	9.93

5.6 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。

5.7 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投资。

5.8 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。

5.9 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	13,307.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	62,387.24
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	75,694.64

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000513	丽珠集团	1,559,610.00	4.12	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2015 年 7 月 23 日)基金份额总额	268,905,352.87
报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	232,091,328.42
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	36,814,024.45

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申赎及买卖本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。

2、《万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

3、《万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。

4、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。

5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金净值、更新招募说明书及其他临时公告。

6、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第三季度报告原文。

7、万家基金管理有限公司董事会决议。

8.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所,并登载于基金管理人网站:www.wjasset.com。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司
2015 年 10 月 26 日

万家中证创业成长指数分级证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

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
报告送出日期:2015 年 10 月 26 日

§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。

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 2015 年 10 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 7 月 01 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	成长分级		
基金主代码	161910		
交易代码	161910		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年 8 月 2 日		
报告期末基金份额总额	42,897,119.71 份		
投资目标	本基金采用被动式指数化投资方法,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%。		
投资策略	本基金为指数型基金,采用完全复制的方法进行投资运作,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。		
业绩比较基准	95%×中证创业成长指数收益率+5%×银行同业存款利率。		
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。		
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		
下属分级基金简称	成长 A	成长 B	成长分级
下属分级基金交易代码	150090	150091	161910
下属分级基金报告期末基金份额总额	9,818,444.00 份	9,818,444.00 份	23,260,231.71 份
下属分级基金的风险收益特征	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。	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。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015 年 7 月 1 日 – 2015 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	-57,520,980.22
2.本期利润	-45,248,474.36
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2926
4.期末基金资产净值	43,119,433.88
5.期末基金份额净值	1.0052

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。

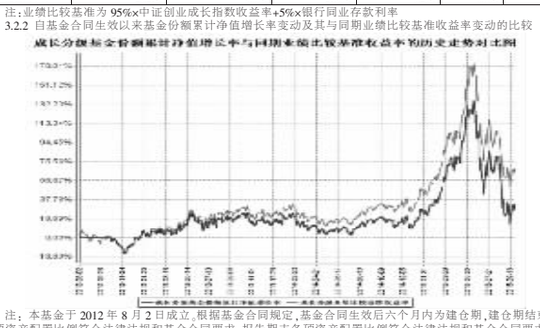
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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
过去三个月	-28.21%	4.05%	-21.43%	3.23%	-6.78%	0.82%

注: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

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:本基金于 2012 年 8 月 2 日成立,根据基金合同规定,基金合同生效后六个月内为建仓期,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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
卞勇	本基金基金经理、万家 180 指数证券投资基金、万家中证红利指数型证券投资基金(LOF)、万家上证 380 交易型开放式指数证券投资基金和万家上证 380ETF 基金经理。	2015年 8 月 18 日	-	7年	硕士研究生,2008 年进入上海双隆投资管理有限公司,任金融工程师;2010 年进入上海尚雅投资管理有限公司,从事高级量化分析师工作;2010 年 10 月进入在国泰基金管理有限公司,历任产品开发、专户投资经理助理等职务;2014 年 4 月进入广发证券担任投资经理职务;2014 年 11 月进入中融基金管理有限公司担任产品开发部总监职务;2015 年 4 月加入本公司,现任量化投资部总监。
姚震天	本基金基金经理、万家 180 指数基金、万家中证创业成长指数分级基金和万家上证 380ETF 基金经理。	2015年 5 月 22 日	2015年 8 月 18 日	7年	基金经理,复旦大学金融学硕士,2007 年 7 月至 2008 年 6 月任泰信基金管理有限公司量化分析师;2008 年 9 月至 2009 年 5 月任上海金程国际金融学院 FRM 讲师;2009 年 9 月加入万家基金管理有限公司,历任风险分析师、量化分析师、基金经理助理、投资经理、基金经理等职。

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

本报告期内,本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《公开募集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 公平交易专项说明

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。

本报告期内无下列情况: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%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年三季度,在经历了前期较大幅度的调整后,市场随着去杠杆化过程的演进以及政府各项相关政策效果的逐步显现而趋于平稳。进入 9 月份以来,市场整体的波动性和交易量都有了明显的回落,市场情绪已逐步趋于理性。展望第四季度,虽然实体经济总体来看仍然偏弱,但由于市场风险已经得到了较大程度的释放,估值也已回归到合理区间,并且预期宽松和微刺激的政策环境仍将延续,部分基本面良好及估值合理的企业有望取得较好的市场表现。

本基金作为被动投资型的指数基金,其投资目标是通过跟踪、复制中证红利指数,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 2015 年 9 月 30 日,本基金份额净值为 1.0052 元,本报告期份额净值增长率为-28.21%,业绩比较基准收益率-21.43%。本基金本报告期跟踪偏离度为 1.09%,与标的指数产生偏离的主要原因为成份股分红、申购赎回、成份股权重调整、日常运作费用等产生的差异。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情况。

§5 投资组合报告

5.1 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	40,634,961.63	91.99
	其中:股票	40,634,961.63	91.99
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	2,576,358.76	5.83
7	其他资产	960,929.50	2.18
8	合计	44,172,249.89	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	1,923.68	0.00
C	制造业	22,328,765.62	51.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	316,422.84	0.73
E	建筑业	449,371.95	1.04
F	批发和零售业	262,115.28	0.61
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,083,112.17	14.11
J	金融业	1,343,580.75	3.12
K	房地产业	2,055,018.62	4.77
L	租赁和商务服务业	2,468,057.69	5.72
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	535,787.82	1.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	132,576.00	0.31
Q	卫生和社会工作	770,043.99	1.79
R	文化、体育和娱乐业	3,887,162.66	9.01
S	综合	1,022.56	0.00
	合计	40,634,961.63	94.24

5.2.2 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。

5.3 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

5.3.1 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	97,338	3,078,800.94	7.14
2	300059	东方财富	56,703	2,040,173.94	4.73
3	002030	达安基因	54,562	1,855,108.00	4.30
4	300058	蓝色光标	151,287	1,614,232.29	3.74
5	002450	康得新	53,023	1,606,066.67	3.72
6	002415	海康威视	45,174	1,471,768.92	3.41
7	300104	乐视网	34,284	1,401,529.92	3.25
8	002219	恒康医疗	35,707	1,252,601.56	2.90
9	600565	迪马股份	111,700	1,068,969.00	2.48
10	300017	网宿科技	18,093	953,682.03	2.21

5.3.2 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

本基金本报告期末持有积极投资股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末持有债券。

5.5 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

本基金本报告期末持有债券。

5.6 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

本基金本报告期末持有资产支持证券。

5.7 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

本基金本报告期末持有贵金属投资。

5.8 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

本基金本报告期末持有权证。

5.9 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,本基金暂时不可投资于股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同,本基金暂不可投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	123,061.82
2	应收证券清算款	686,567.81
3	应收股利	-
4	应收利息	703.44
5	应收申购款	150,596.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	960,929.50

5.11.4 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转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300027	华谊兄弟	3,078,800.94	7.14	-
2	002030	达安基因	1,855,108.00	4.30	-
3	300058	蓝色光标	1,614,232.29	3.74	-
4	002219	恒康医疗	1,252,601.56	2.90	-
5	600565	迪马股份	1,068,969.00	2.48	-

5.11.5.2 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	成长 A	成长 B	成长分级
报告期期初基金份额总额	80,400,026.00	80,400,027.00	16,658,791.14
报告期期间基金总申购份额	-	-	127,209,013.21
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	171,464,823.24
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-70,581,582.00	-70,581,583.00	50,857,250.60
报告期期末基金份额总额	9,818,444.00	9,818,444.00	23,260,231.71

注:本报告期基金拆分变动份额包含基金份额折算所带来的变动数。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申赎及买卖本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。

2、《万家中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同》。

3、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。

4、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金净值、更新招募说明书及其他临时公告。

5、万家中证创业成长指数分级证券投资基金 2015 年第三季度报告原文。

6、万家基金管理有限公司董事会决议。

8.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所,并登载于基金管理人网站:www.wjasset.com。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司
2015 年 10 月 26 日

万家中证红利指数证券投资基金(LOF)

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

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
报告送出日期:2015 年 10 月 26 日

§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。

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 2015 年 10 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务数据未经审计。

本报告期自 2015 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家中证红利指数(LOF)
场内简称	万家红利
基金主代码	161907
交易代码	161907
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2011年 3 月 17 日
报告期末基金份额总额	40,238,980.70 份
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。
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。
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。
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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015 年 7 月 1 日 – 2015 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	3,499,320.73
2.本期利润	-23,326,938.66
3.加权平均基金份额本期利润	-0.5570
4.期末基金资产净值	50,710,473.78
5.期末基金份额净值	1.2602

注:1、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。

2、上表中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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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
过去三个月	-30.05%	3.92%	-28.41%