# 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

## 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2016年2月2日，有关财务数据和净值表现截止日为2015年12月31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：中国（上海）自由贸易试验区浦电路360号8层（名义楼层9层）

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路360号8层（名义楼层9层）

法定代表人：方一天

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

董事长方一天先生，大学本科，学士学位，先后在上海财政证券公司、中国证监会系统、上证所信息网络有限公司任职，2014年10月加入万家基金管理有限公司，2014年12月起任公司董事，2015年2月起任公司总经理，2015年7月起任公司董事长。

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。

董事袁西存先生，中共党员，研究生，工商管理学硕士，曾任莱钢集团财务部科长，副部长，中泰证券股份有限公司计划财务部总经理，现任齐中泰证券股份有限公司财务总监。

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（现更名为山东大学中泰证券金融研究院）常务副院长兼教授，现任山东大学中泰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。

监事张浩先生，中共党员，管理学博士，先后任职于山东东银投资管理有限公司、山东省国有资产控股有限公司。现任山东省国有资产投资控股有限公司综合部（党委办公室）部长（主任）。

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。

监事陈广益先生，中共党员，硕士学位，先后任职于苏州市对外贸易公司、兴业全球基金管理有限公司，2005年3月起任职于万家基金管理有限公司，现任公司运营部总监。

3、基金管理人高级管理人员

董事长：方一天先生（简介请参见基金管理人董事会成员）

总经理：方一天先生（简介请参见基金管理人董事会成员）

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，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。

督察长：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，2005年10月进入万家基金管理有限公司工作，2015年4月起任公司督察长。

4、本基金基金经理简历

卞勇，量化投资部总监，基金经理，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、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)、万家中证创业成长指数分级证券投资基金和万家上证50交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

历任基金经理：

吴涛：2012年8月2日至2015年5月23日

姚霞天：2015年5月22日至2015年8月18日

5、投资决策委员会成员

委员会主任：方一天

委员会副主任：黄海、陈工文

委员：罗毅、张军、莫海波、卞勇、白宇

方一天先生，公司董事长、总经理。

黄海先生，投资总监。

陈工文先生，总经理助理、专户投资经理。

罗毅先生，总经理助理。

张军先生，总经理助理。

莫海波先生，投资研究部总监、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家行业优选混合型证券投资基金、和万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金和万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

卞勇先生，量化投资部总监，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)、万家中证创业成长指数分级证券投资基金和万家上证50交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

白宇先生，交易部总监。

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35,640,625.71万元

联系电话：010-66105799

联系人：洪渊

（二）主要人员情况

截至2015年9月末，中国工商银行资产托管部共有员工205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2015年9月，中国工商银行共托管证券投资基金496只。自2003 年以来，本行连续十一年获得香港《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49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：中国（上海）自由贸易试验区浦电路360号8层（名义楼层9层）

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路360号8层（名义楼层9层）

法定代表人：方一天

电话：021-38909777

传真：021-38909798

联系人：李忆莎

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
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
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
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
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
客户服务电话：95568
网址：www.cmbc.com.cn

6）中泰证券股份有限公司
客服电话：95538
网址：www.zts.com.cn

7）光大证券股份有限公司
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
客户服务电话：95562
网址：www.xyzq.com.cn

9）海通证券股份有限公司
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
客服电话：400-888-8666
网址：www.gtja.com

11）广发证券股份有限公司
客户服务电话：95575
网址：www.gf.com.cn

12）中信证券股份有限公司
客户服务电话：95558
网址：www.cs.ecitic.com

13）信达证券股份有限公司
客户服务电话：400-800-8899
网址：www.cindasc.com

14）申万宏源证券有限公司（申银万国证券与宏源证券2015年1月合并）
客户服务电话：95523
网址：www.swhysec.com

15） 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

16）国信证券股份有限公司
客户服务电话：95536
网站：www.guosen.com.cn

17）爱建证券有限责任公司
客户服务电话：021-32229888转25115
网址：www.ajzq.com

18）华宝证券有限责任公司
客户服务电话：400-820-9898
网址：www.cnhbstock.com

19）山西证券股份有限公司
客户服务电话：400-666-1618
网址：www.sxzq.com

20）上海证券有限责任公司
客户服务电话：400-891-8918，021-962518
网址：www.962518.com

21）中信建投证券有限公司
客户服务电话：400-888-8108
网址：www.csc108.com

22）东吴证券股份有限公司
客户服务电话：6008601555
网址：www.dwjq.com.cn

23）五矿证券有限公司
客户服务电话：400-184-0028
网址：http://wkzq.com.cn

24) 华泰证券股份有限公司
客户服务电话：95579
网址：www.htsc.com.cn

25) 日信证券有限责任公司
客户服务电话：400-660-9839
网址： www.rxzq.com.cn

26) 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

27) 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

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

29) 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

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

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

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

33) 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

34）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

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

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

37）中国国际金融股份有限公司
客户服务电话：400-910-1166
网址：www.cicc.com.cn

38）浙江同花顺基金销售有限责任公司
客服电话：4008-773-772
网址：http://fund.10jqka.com.cn/

39）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
客户服务电话：400-166-1188
网址：http://8.jrj.com.cn/

40）珠海盈米财富管理有限公司
客户服务电话：020-89629066
网址：www.yingmi.cn

41）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司
客户服务电话：400-821-5399
网址： www.noah-fund.com

42）大泰金石投资管理有限公司
客户服务电话：021-22267982
网址：www.dtfortune.com

43）国金证券股份有限公司
客户服务电话：400-660-0109
网址：www.gjzq.com.cn

44）北京乐融多源投资咨询有限公司
客户服务电话： 400-068-1176
网址： www.jimubox.com

45）上海汇付金融服务有限公司
客户服务电话： 400-820-2819
网址： https://tty.chinapnr.com/

46）北京钱景财富投资管理有限公司
客户服务电话： 400-893-6885
网址： fund.qianjing.com

47) 泉州银行股份有限公司
客服电话：4008896312
网址：www.qzccbank.com

48) 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/

49) 上海好买基金销售有限公司
客户服务电话：400-700-9665）
公司网站：www. ehowbuy.com

50）上海利得基金销售有限公司
客服电话：4000676266
网址： www.leadbank.com.cn

51）上海联泰资产有限责任公司
客服电话：4000-466-788
网址： http://www.66money.com/

52）一路财富（北京）信息科技有限公司
客户服务电话： 400-001-1566
网址：www.yilucaifu.com

53）中信期货有限公司
客户服务电话：400-990-8826
网址：www.citicsf.com

54）中证金牛（北京）投资咨询有限公司
客服电话：400-8909-998
网址：www.jnlc.com

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：北京市西城区太平桥大街17号

电话：（010）58598888

传真：（010）58598824

（三）律师事务所

名称：北京大成（上海）律师事务所

住所：上海市世纪大道100号上海环球金融中心24层（200120）

联系地址：上海市浦东南路500号国家开发银行大厦3层、30层

电话：（021）3872 2416

联系人：华涛、夏火仙

（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 （特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室（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：汤骏

经办注册会计师：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等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。

4、根据中基协发[2015]4号文“关于发布《基金参与融资融券及转融通证券出借业务指引》的通知”规定，本基金可以参与转融通证券出借交易。

### 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2016年1月21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2015年12月31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 | 30,934,483.89 | 94.10 |
|  | 其中：股票 | 30,934,483.89 | 94.10 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
|  | 其中：债券 | - | - |
|  | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
|  | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 1,816,484.67 | 5.53 |
| 8 | 其他资产 | 122,690.10 | 0.37 |
| 9 | 合计 | 32,873,658.66 | 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 | 254.54 | 0.00 |
| C | 制造业 | 17,257,166.20 | 53.31 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 215,986.40 | 0.67 |
| E | 建筑业 | 797,100.70 | 2.46 |
| F | 批发和零售业 | 81,378.00 | 0.25 |
| 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 | 6,782,206.97 | 20.95 |
| J | 金融业 | 1,865,010.75 | 5.76 |
| K | 房地产业 | 689,559.64 | 2.13 |
| L | 租赁和商务服务业 | 756,130.80 | 2.34 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 456,345.35 | 1.41 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 119,691.00 | 0.37 |
| Q | 卫生和社会工作 | 487,735.74 | 1.51 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 1,424,895.24 | 4.40 |
| S | 综合 | 1,022.56 | 0.00 |
|  | 合计 | 30,934,483.89 | 95.56 |

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 | 300104 | 乐视网 | 28,984 | 1,744,257.12 | 5.39 |
| 2 | 002219 | 恒康医疗 | 89,267 | 1,622,874.06 | 5.01 |
| 3 | 300059 | 东方财富 | 27,003 | 1,404,966.09 | 4.34 |
| 4 | 002450 | 康得新 | 29,723 | 1,132,446.30 | 3.50 |
| 5 | 002415 | 海康威视 | 29,274 | 1,006,732.86 | 3.11 |
| 6 | 300027 | 华谊兄弟 | 22,838 | 947,320.24 | 2.93 |
| 7 | 002202 | 金风科技 | 37,800 | 861,462.00 | 2.66 |
| 8 | 002673 | 西部证券 | 26,100 | 858,951.00 | 2.65 |
| 9 | 300017 | 网宿科技 | 11,493 | 689,465.07 | 2.13 |
| 10 | 002292 | 奥飞动漫 | 12,604 | 651,752.84 | 2.01 |

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

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 | 118,739.47 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 444.71 |
| 5 | 应收申购款 | 3,505.92 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 122,690.10 |

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。

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

| 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 | 300104 | 乐视网 | 1,744,257.12 | 5.39 | 重大事项停牌 |
| 2 | 002219 | 恒康医疗 | 1,622,874.06 | 5.01 | 重大事项停牌 |

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

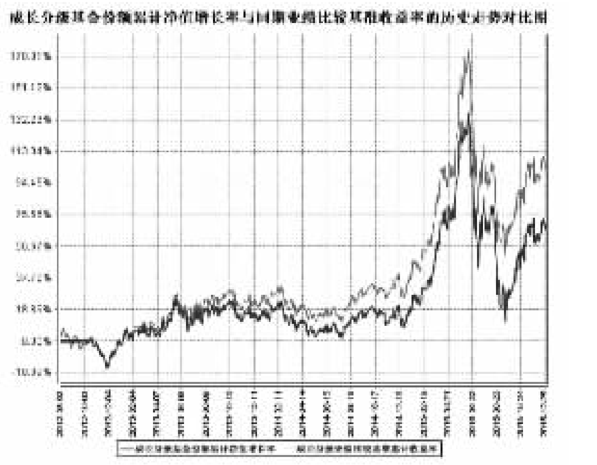
基金业绩截止日为2015年12月31日，托管人中国工商银行于2016年1月21日复核了本招募说明书中的基金净值表现。

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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2015年 | 51.22% | 2.93% | 59.15% | 2.58% | -7.93% | 0.35% |
| 2014年 | -4.77% | 1.31% | 2.89% | 1.28% | -7.66% | 0.03% |
| 2013年 | 15.36% | 1.53% | 23.12% | 1.51% | -7.76% | 0.02% |
| 2012年 | 0.30% | 0.94% | 0.78% | 1.39% | -0.48% | -0.45% |
| 基金成立日至2015年12月31日 | 66.62% | 1.95% | 103.16% | 1.82% | -36.54% | 0.13% |

（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2015年12月31日）



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。

### 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×1.00%÷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×0.22%÷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×0.02%÷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2015年9月16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、在重要提示部分，明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。

3、在“三、基金管理人”部分，更新了基金管理人的有关内容。

4、在“四、基金托管人”部分，更新了基金托管人的有关内容。

5、在“五、相关服务机构”部分，更新了相关服务机构的相关内容。

6、在“九、基金的投资”部分，补充了本基金最近一期（2015年第四季度）投资组合报告内容。

7、在“十、基金的业绩”部分，更新了基金成立以来的投资业绩。

8、在“十九、基金份额折算”部分，更新了基金成立以来进行的定期和不定期折算的内容。

9、增加了“二十三、其他应披露事项”部分，更新了本基金最近一次招募说明书更新以来的公告事项。

万家基金管理有限公司
2016年3月17日

---

# 万家精选混合型证券投资基金分红公告

公告送出日期：2016年3月17日

1、公告基本信息

|  |  |  |
|---|---|---|
| 基金名称 |  | 万家精选混合型证券投资基金 |
| 基金简称 |  | 万家精选 |
| 基金主代码 |  | 519185 |
| 基金合同生效日 |  | 2009年5月18日 |
| 基金管理人名称 |  | 万家基金管理有限公司 |
| 基金托管人名称 |  | 中国建设银行股份有限公司 |
| 公告依据 |  | 《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《万家精选混合型证券投资基金基金合同》、《万家精选混合型证券投资基金招募说明书》 |
| 收益分配基准日 |  | 2015年12月31日 |
| 截止收益分配基准日的相关指标 | 基准日基金份额净值(单位：元) | 1.9483 |
|  | 基准日基金可供分配利润(单位：元) | 57,442,243.43 |
|  | 截止基准日按照基金合同约定的分红比例计算的应分配金额(单位：元) | 5,744,224.34 |

|  |  |
|---|---|
| 本次分红方案(单位：元/10份基金份额) | 0.95 |
| 有关年度分红次数的说明 | 2015年度收益的第1次分红 |

注：本基金的基金合同规定："本基金收益每年最多分配12 次，全年基金收益分配比例不低于可分配收益的10%。"

2、与分红相关的其他信息

|  |  |
|---|---|
| 权益登记日 | 2016年3月22日 |
| 除息日 | 2016年3月22日 |
| 现金红利发放日 | 2016年3月24日 |
| 分红对象 | 权益登记日在中国证券登记结算有限责任公司登记在册的本基金全体份额持有人 |
| 红利再投资相关事项的说明 | 选择红利再投资的投资者其现金红利转换为基金份额的基金份额净值确定日：2016年3月22日；选择红利再投资方式的投资者，其红利再投资所转换的基金份额将于2016年3月23日计入其基金账户，<br>2016年3月24日起可以查询、赎回。 |
| 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》，基金向投资者分配的基金收益，暂免征收所得税 |
| 费用相关事项的说明 | 本基金本次分红免收分红手续费 |

注：本次收益分配方案已经本基金的托管人中国建设银行股份有限公司复核。

3、其他需要提示的事项

（1）权益登记日当日申请申购或转换转入的基金份额不享有本次分红权益，权益登记日当日申请赎回或转换转出的基金份额享有本次分红权益。

（2）本基金分红方式分为两种：现金分红与红利再投资。基金份额持有人可以在基金开放日的交易时间内到相关销售网点选择或更改分红方式，本次分红最终分红方式以权益登记日之前（不含2016年3月22日）最后一次选择或更改并经注册登记机构确认的分红方式为准。敬请基金份额持有人及时到相关销售网点查询分红方式；若希望更改分红方式的，请务必在规定的时间前到相关销售网点办理变更手续。对于未在权益登记日之前选择具体分红方式的基金份额持有人，本基金默认的分红方式为现金分红方式。

（3）本次分红不会改变本基金的风险收益特征，也不会降低本基金的投资风险或提高本基金的投资收益。

（4）因分红导致基金份额净值调整至面值附近，在市场波动等因素的影响下，基金投资仍有可能出现亏损或基金份额净值仍有可能低于面值。

（5） 本基金份额持有人及希望了解本基金其他有关信息的投资者，可以登录本基金管理人网站http://www.wjasset.com或拨打客户服务电话 400-888-0800（免长途话费)或95538转6咨询相关事宜。

特此公告。

万家基金管理有限公司
2016年3月17日

---

证券代码：002412　证券简称：汉森制药　公告编号：2016-020

# 湖南汉森制药股份有限公司
# 关于控股股东股份质押的公告

**本公司及全体董事保证公告内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。**

湖南汉森制药股份有限公司（以下简称“本公司”）近日控股股东新疆汉森股权投资管理有限合伙企业（以下简称“新疆汉森”）通知，新疆汉森将其所持有的本公司部分无限售流通股份进行了质押，具体事项如下：

一、股东股份质押的基本情况

1、股东股份被质押基本情况

| 股东名称 | 是否为第一大股东及一致行动人 | 质押股数 | 质押开始日期 | 质押到期日期 | 质权人 | 本次质押股数占其所持公司股份的比例 | 用途 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 新疆汉森 | 是 | 25,000,000 | 2016-03-15 | 至质权人办理解除质押登记手续之日止 | 华融证券股份有限公司 | 16.25% | 融资 |
| 合计 | - | 25,000,000 | - | - | - | 16.25% | - |

2、股东股份累计被质押的情况

截至公告披露日，新疆汉森共持有本公司股份 153,818,223 股，占公司总股本的51.97%；本次质押股份25,000,000股，占公司总股本的8.45%；累计质押股份105,310,000股，占公司总股本的35.58%。

二、备查文件

1、股份质押登记证明；

2、中国证券登记结算有限责任公司股份冻结明细。

特此公告！

湖南汉森制药股份有限公司
董事会
2016年3月17日

---

股票代码：002424　股票简称：贵州百灵　公告编号：2016-024

# 贵州百灵企业集团制药股份有限公司
# 关于持股5%以上股东进行股票质押式回购交易的公告

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

贵州百灵企业集团制药股份有限公司（以下简称“公司”）近日接到持股5%以上股东姜勇先生函告，获悉姜勇先生所持有本公司的部分股份被质押，具体事项如下：

一、股东股份质押的基本情况

1、股东股份质押的基本情况

| 股东名称 | 是否为第一大股东及一致行动人 | 质押股数 | 质押开始日期 | 质押到期日期 | 质权人 | 本次质押占其所持股份比例 | 用途 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 姜勇 | 非第一大股东，是一致行动人 | 24,000,000 | 2016年3月15日 | 2016年12月10日 | 爱建证券有限责任公司 | 15.39% | 融资担保 |
| 合计 | — | 24,000,000 | — | — | — | 15.39% | — |

2、股东股份累计被质押的情况

截止公告披露日，姜勇先生持有本公司股份155,971,200股，占公司总股本的11.05%。其所持有上市公司股份累计被质押123,150,000股，占其所持公司股份的78.96%，占公司总股本1,411,200,000股的8.73%。

二、备查文件

1、中国证券登记结算有限责任公司股份冻结明细。

特此公告。

贵州百灵企业集团制药股份有限公司
董 事 会
2016年3月16日

---

证券代码：600438　股票简称：通威股份　公告编号：2016-016

# 通威股份有限公司
# 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。**

通威股份有限公司（以下简称"公司"）因筹划重大事项，经申请，公司股票已于2016年2月4日开市起停牌。2016年2月18日，公司发布了《通威股份有限公司重大资产重组停牌公告》（公告编号：2016-009），该重大事项对公司构成了重大资产重组，公司股票自2016年2月18日起预计停牌不超过一个月。

本次重大资产重组标的资产确定为公司控股股东通威集团有限公司旗下的光伏新能源产业相关资产，包括通威太阳能（合肥）有限公司及其下属子公司（以下简称"合肥通威"），主要从事光伏晶硅电池片的研发、生产及销售。目前，合肥通威拥有超过2GW的多晶硅电池片和250MW的组件产能，并计划2016年-2017年在合肥与成都分批启动并完成5GW高效晶硅电池片建设项目，建设完毕后，合肥通威将拥有超过7GW的电池片生产产能，成为国内主要的高效晶硅电池片专业供应商。

公司正与有关各方研究论证重大资产重组方案，积极推动审计、评估、尽职调查等各项工作。因相关程序仍在进行中，有关事项尚存在不确定性，为切实维护投资者利益，在停牌期间，本公司将根据重大资产重组的进展情况，及时履行信息披露义务，每5个交易日发布一次有关事项的进展情况。待有关事项确定后，公司将及时公告并复牌。

公司指定信息披露媒体为《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和上海证券交易所网站（www.sse.com.cn），公司所有信息均以指定媒体正式公告为准。鉴于该事项仍存在不确定性，敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

通威股份有限公司
董事会
二〇一六年三月十六日

---

证券代码：600988　证券简称：赤峰黄金　公告编号：临2016-023

# 赤峰吉隆黄金矿业股份有限公司
# 关于完成工商变更登记及“三证合一”的公告

**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。**

赤峰吉隆黄金矿业股份有限公司（以下简称"公司"）于2016年2月24日召开的第六届董事会第一次会议审议通过了《关于选举公司董事长的议案》，选举吕晓兆先生为公司第六届董事会董事长。根据《公司章程》的规定，公司于近日向内蒙古自治区工商行政管理局提交了变更法定代表人的申请材料；同时，根据《国务院办公厅关于加快推进"三证合一"登记制度改革的意见》(国办发[2015]50 号)及《工商总局等六部门关于贯彻落实<国务院办公厅关于加快推进"三证合一"登记制度改革的意见>的通知》（工商企注字[2015]121号）等相关文件的要求，公司向内蒙古自治区工商行政管理局提交了"三证合一"的申请材料。

2016年3月15日，内蒙古自治区工商行政管理局为公司换发了新的营业执照，公司法定代表人变更为吕晓兆；原营业执照、组织机构代码证、税务登记证"三证合一"，合并后的公司营业执照统一社会信用代码为91150000708204391F。公司营业执照其他登记内容不变。

特此公告。

赤峰吉隆黄金矿业股份有限公司
董 事 会
2016年3月17日