万家上证50交易型开放式指数证券投资基金

2015 年度 报告摘要

2015年12月31日

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
送出日期：2016年3月25日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2015年3月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计，安永华明会计师事务所为基金财务出具了标准无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	万家上证50ETF
场内简称	万家50
基金主代码	510680
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年10月31日
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
报告期末基金份额总额	3,724,652.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013-12-02

2.2 基金产品说明

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。
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。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。
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。
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		万家基金管理有限公司	华夏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	徐昊光
	联系电话	021-38909626	010-85238982
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	bjxhg@hxb.com.cn
客户服务电话		95538转6、4008880800	95577
传真		021-38909627	010-85238680

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.wjasset.com
基金年度报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区浦电路360号8层（名义楼层9层）基金管理人办公场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年	2013年10月31日（基金合同生效日）-2013年12月31日
本期已实现收益	4,492,185.06	5,410,903.47	-8,327,297.04
本期利润	4,164,852.55	10,722,531.05	-13,308,916.52
加权平均基金份额本期利润	0.8628	0.2366	-0.0372
本期基金份额净值增长率	24.78%	42.86%	-4.03%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.7108	0.3710	-0.0403
期末基金资产净值	6,372,260.73	9,219,771.56	142,733,186.22
期末基金份额净值	1.7108	1.3710	0.9597

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。

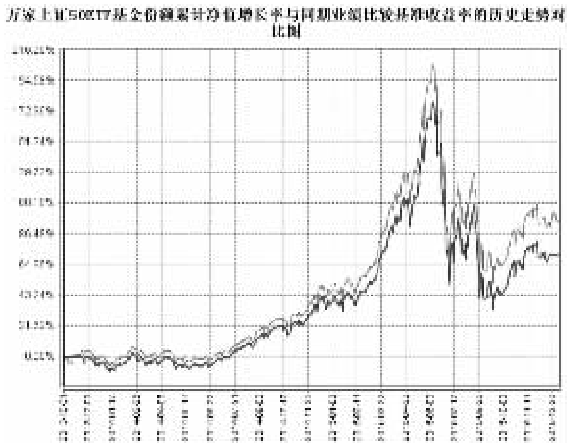
3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

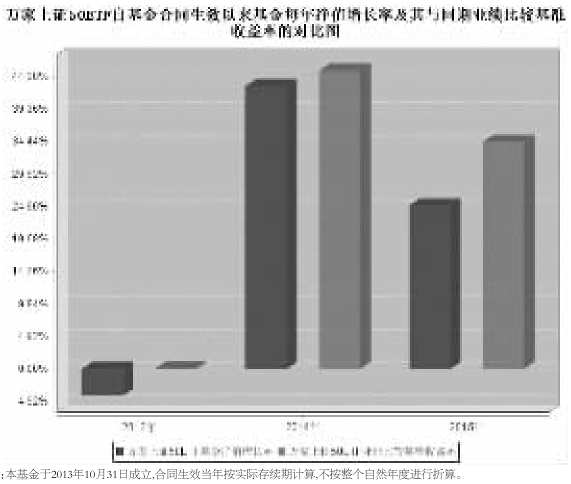
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	19.34%	1.86%	19.59%	2.02%	-0.25%	-0.16%
过去六个月	-21.41%	3.54%	-17.93%	3.51%	-3.48%	0.03%
过去一年	24.78%	3.02%	34.41%	3.02%	-9.63%	0.00%
自基金合同生效起至今	71.08%	2.21%	95.28%	2.23%	-24.20%	-0.02%

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


万家上证50ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注：本基金成立于2013年10月31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。本基金已于2015年12月15日召开基金持有人大会，对本基金的名称、投资标的指数、基金投资范围等事项进行相应修改。基金管理人已将修改后的《万家上证50交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《万家上证50交易型开放式指数证券投资基金托管协议》和《万家上证50交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》报中国证监会进行变更注册，修订和更新后的文件于2015年12月15日生效，目前处于建仓期。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较


万家上证50ETF自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

注：本基金于2013年10月31日成立，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金成立至今尚未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44号文批准设立。公司现股东为中泰证券股份有限公司、新疆国际实业股份有限公司和山东省国有资产投资控股有限公司，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），注册资本1亿元人民币。目前管理二十三只开放式基金，分别为万家180指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选混合型证券投资基金（LOF）、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券基金、万家精选混合型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金（LOF）、万家添利债券型证券投资基金（LOF）、万家中证创业成长指数分级证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家上证50交易型开放式指数证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、万家瑞丰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、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞益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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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)、万家中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理、量化投资部总监。	2015年8月18日	-	7	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。
姚霞天	本基金基金经理、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	2015年5月22日	2015年8月18日	7	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、投资经理等职。
吴涛	本基金基金经理、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基金经理、万家中证创业成长指数分级基金基金经理	2014年11月14日	2015年5月22日	21年	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、万家基金管理有限公司监察稽核部总监等职。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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《万家基金管理有限公司公平交易管理办法》，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，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送，确保公平对待不同投资组合。

在投资决策上：（1）公司对不同类别的投资组合分别设定独立的投资部门，公募基金经理和特定客户资产管理投资经理不得互相兼任。（2）公司投资管理实行分层次决策，投资决策委员会下设的公募基金投资决策小组和专户投资决策小组分别根据公募基金和专户投资组合的规模、风格特征等因素合理确定各投资组合经理的投资权限，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需经过严格的逐级审批程序。（3）公司接受的外部研究报告、研究员撰写的研究报告等均通过统一的投研管理平台发布，确保各投资组合经理在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

在交易执行上：（1）公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度；（2）对于交易公开竞价交易，所有指令必须通过系统下达，公司执行交易系统中的公平交易程序；（3）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，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；（4）对于银行间交易，交易部按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。

在行为监控上，公司定期对不同投资组合的同向交易价差、反向交易，场外交易对手议价的价格公允性及其他异常交易情况进行监控及分析，基金经理对异常交易情况进行合理性解释并留存记录，并定期编制公平交易分析报告，由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司定期进行同向交易价差分析，即采集公司旗下管理的所有组合，连续四个季度期间内，不同时间窗下（日内、3日内、5日内）的同向交易样本，对两两组合之间的同向交易价差均值进行原假设为0，95%的置信水平下的t检验，并对结论进行跟踪分析，分析结果显示在样本数量大于30的前提下，组合之间在同向交易方面未发现违反公平交易的行为。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年上半年，货币政策持续宽松，无风险利率下行等因素驱动增量资金入市，推动市场上涨。但随着下半年去杠杆过程的演进，市场自6月中旬起开始大幅调整。3季度，由于场外配资等基本清理完成及恐慌情绪逐渐释放，市场逐步企稳并在4季度迎来修复行情。本基金自2015年12月15日起由万家上证380ETF基金转型成万家上证50ETF，转型前本基金投资标的指数——上证380指数在报告期内的收益率为34.09%。

本基金作为被动投资的指数基金，其投资目标是通过跟踪、复制标的指数，为投资者获取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，原则上采取完全复制的方法进行投资管理，努力拟合标的指数，减小跟踪误差，将基金跟踪误差控制在较低范围之内。同时，本基金采用有效的量化跟踪技术，降低管理成本。导致跟踪误差的主要原因是基金申购赎回、标的指数成分股调整、日常运作费用等因素。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日，本基金份额净值为1.7108元。本基金由万家上证380ETF转型而来，本报告期内且万家上证380ETF转型完成前，份额净值增长率为23.96%，业绩比较基准收益率34.09%，日跟踪误差为0.19%，年化跟踪误差为3.04%。与标的指数产生偏离的主要原因为基金整体规模较小、成份股停牌、基金申购赎回、成份股定期调整、日常运作费用等。本基金于2015年12月15日正式转型为万家上证50ETF，目前处于建仓期。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年，在供给侧改革和持续宽松的货币政策的配合下，经济结构调整有望初见成效，对中国经济的信心有望加速回升。但与此同时，受到美联储加息、人民币汇率波动、信用风险加大等内外部因素的影响，市场仍存在一定的阶段性风险。虽然经济增速总体持续回落，但随着结构转型不断推进，市场在适应经济“新常态”的同时不排除给予较好的呼应。受益于结构性调整和企业升级转型对基本面的切实改善，部分估值合理且具有较好基本面的企业预计将有比较好的市场表现。

本基金将继续贯彻被动投资理念，恪守基金合同规定的投资目标和投资策略，一如既往地规范、勤勉运作，将本基金打造为稳定有效的指数投资工具，为基金份额持有人谋求长期、稳定回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了估值委员会，定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。估值委员会由督察长、基金运营部负责人、合规稽核部负责人、权益投资部负责人、固定收益部负责人等组成。估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉政策法规，并具有丰富的实践经验。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不介入基金日常估值业务。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金在报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内自1月5日至12月31日，基金资产净值连续244个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情况。为了更好地保护基金持有人利益以及切实做大基金规模，经与托管人华夏银行股份有限公司协商一致，并经中国证监会核准，我司已于2015年12月15日召开基金持有人大会，对本基金的名称、投资标的指数、基金投资范围等事项进行相应修改。基金管理人已将修改后的《万家上证50交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《万家上证50交易型开放式指数证券投资基金托管协议》和《万家上证50交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》报中国证监会进行变更注册，修订和更新后的文件于2015年12月15日生效。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金2015年年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

本基金2015年年度财务会计报告已经安永华明会计师事务所审计，注册会计师签字出具了安永华明（2016）审字第60778298_B17号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：万家上证50交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产：		
银行存款	6,322,494.53	399,372.29
结算备付金	14,497.27	5,509.45
存出保证金	5,371.54	709.67
交易性金融资产	337,676.74	9,217,242.84
其中：股票投资	337,676.74	9,217,242.84
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	5,987.57
应收利息	1,387.36	101.14
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	6,681,427.44	9,628,922.96
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	2,697.44	4,412.53
应付托管费	539.49	882.51
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	5,929.78	3,856.36
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	300,000.00	400,000.00
负债合计	309,166.71	409,151.40
所有者权益：		
实收基金	3,724,652.00	6,724,652.00
未分配利润	2,647,608.73	2,495,119.56
所有者权益合计	6,372,260.73	9,219,771.56
负债和所有者权益总计	6,681,427.44	9,628,922.96

注：报告截止日2015年12月31日，基金份额净值1.7108元，基金份额总额3,724,652.00份。

7.2 利润表

会计主体：万家上证50交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	4,750,697.71	11,640,053.40
1.利息收入	5,410.01	6,948.98
其中：存款利息收入	5,410.01	6,948.98
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	4,770,525.78	6,302,492.32
其中：股票投资收益	4,717,133.61	5,584,386.86
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	53,392.17	718,105.46
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-327,332.51	5,311,627.58
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	302,094.43	18,984.52
减：二、费用	585,845.16	917,522.35
1.管理人报酬	40,987.93	227,751.09
2.托管费	8,197.64	45,550.22
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	26,659.59	50,199.38
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	510,000.00	594,021.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	4,164,852.55	10,722,531.05
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	4,164,852.55	10,722,531.05

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家上证50交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	6,724,652.00	2,495,119.56	9,219,771.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,164,852.55	4,164,852.55
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-3,000,000.00	-4,012,363.38	-7,012,363.38
其中：1.基金申购款	23,000,000.00	15,899,089.29	38,899,089.29
2.基金赎回款	-26,000,000.00	-19,911,452.67	-45,911,452.67
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,724,652.00	2,647,608.73	6,372,260.73
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	148,724,652.00	-5,991,465.78	142,733,186.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,722,531.05	10,722,531.05
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-142,000,000.00	-2,235,945.71	-144,235,945.71
其中：1.基金申购款	33,000,000.00	7,653,387.43	40,653,387.43
2.基金赎回款	-175,000,000.00	-9,889,333.14	-184,889,333.14
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	6,724,652.00	2,495,119.56	9,219,771.56

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

______方一天______	______方一天______	____陈广益____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

万家上证50交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系万家上证380交易型开放式指数证券投资基金转型而来，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]1047号文《关于核准万家上证380交易型开放式指数证券投资基金的批复》的核准，由万家基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集，基金合同于2013年10月31日生效，首次设立募集规模为500,724,652.00份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为万家基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为华夏银行股份有限公司。

本基金自2015年11月12日起至12月14日以通讯方式召开了基金份额持有人大会，并于2015年12月15日表决通过了《关于修改万家上证380交易型开放式指数证券投资基金基金合同有关事项的议案》，决议事项已向中国证监会备案。自2015年12月16日起，《万家上证380交易型开放式指数证券投资基金基金合同》失效且《万家上证50交易型开放式指数证券投资基金基金合同》同时生效。

本基金的标的指数为上证50指数。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%。本基金的业绩比较基准为标的指数。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1、印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2、营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
华夏银行股份有限公司（“华夏银行”）	基金托管人、基金代销机构
中泰证券股份有限公司（“中泰证券”，原“齐鲁证券有限公司”）	基金管理人的股东、基金代销机构
新疆国际实业股份有限公司	基金管理人的股东
山东省国有资产投资控股有限公司	基金管理人的股东
万家共赢资产管理有限公司	基金管理人的子公司
上海承方股权投资管理有限公司（原“上海承方投资管理有限公司”）	基金管理人控制的公司
天津万家财富资产管理有限公司	基金管理人的子公司
深圳前海万家股权投资管理有限公司	基金管理人控制的公司
上海万家朴智投资管理有限公司	基金管理人控制的公司

注：1、报告期内，天津万家财富资产管理有限公司于2015年9月11日由万家基金管理有限公司和自然人李修辞共同出资组建，为基金管理人的子公司。

2、报告期内，深圳前海万家股权投资管理有限公司于2015年11月27日由天津万家财富资产管理有限公司全资设立，受基金管理人间接控制。

3、报告期内，上海万家朴智投资管理有限公司于2015年11月20日由天津万家财富资产管理有限公司与上海灏济投资管理中心（有限合伙）共同出资组建，受基金管理人间接控制。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	40,987.93	227,751.09
其中：支付销售机构的客户维护费	2,230.45	-

注：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首日起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，支付日期顺延至最近可支付日。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	8,197.64	45,550.22

注：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首日起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，支付日期顺延至最近可支付日。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年可比期间均未通过银行间同业市场与关联方进行银行间债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
华夏银行股份有限公司	6,322,494.53	5,165.79	399,372.29	2,489.84

注：本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2015年度获得的利息收入为人民币200.94元（2014年度获得的利息收入为人民币1,482.52元），2015年末结算备付金余额为人民币14,497.27元（2014年末结算备付金余额为人民币5,509.45元）。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.9 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600584	长电科技	2015年11月30日	重大事项	22.02	-	-	1,500	26,531.47	33,030.00	-
600978	宜华木业	2015年6月18日	重大事项	22.33	2016年1月21日	20.10	1,400	17,494.86	31,262.00	-
600200	江苏吴中	2015年11月26日	重大事项	27.89	2016年3月16日	25.10	1,100	25,845.27	30,679.00	-
600654	中安消	2015年12月14日	重大事项	28.84	-	-	800	27,025.21	23,072.00	-
600106	重庆路桥	2015年8月31日	重大事项	10.54	2016年1月11日	11.00	2,058	16,603.68	21,691.32	-
600729	重庆百货	2015年7月24日	重大事项	32.39	2016年1月4日	29.90	638	17,963.88	20,664.82	-
600578	京能电力	2015年11月5日	重大事项	6.07	2016年2月24日	5.49	3,400	22,894.05	20,638.00	-
600420	现代制药	2015年10月21日	重大事项	37.15	-	-	500	16,541.22	18,575.00	-
601000	唐山港	2015年10月29日	重大事项	8.25	2016年2月17日	7.98	2,100	22,403.06	17,325.00	-
600682	南京新百	2015年7月1日	重大事项	37.53	2016年1月27日	33.78	460	8,389.12	17,263.80	-
600120	浙江东方	2015年10月12日	重大事项	19.86	-	-	737	18,728.80	14,636.82	-
600880	博瑞传播	2015年9月16日	重大事项	7.50	2016年1月18日	8.25	1,900	27,254.22	14,250.00	-
600502	安徽水利	2015年10月20日	重大事项	13.67	-	-	1,000	14,654.94	13,670.00	-
600990	四创电子	2015年8月31日	重大事项	62.75	-	-	200	14,225.29	12,550.00	-
600995	文山电力	2015年9月23日	重大事项	9.22	2016年1月8日	10.14	1,023	9,699.34	9,432.06	-
600988	赤峰黄金	2015年8月28日	重大事项	11.57	2016年1月5日	12.73	800	13,039.42	9,256.00	-
600864	哈投股份	2015年10月9日	重大事项	10.88	2016年1月14日	11.97	800	11,177.94	8,704.00	-
600375	华菱星马	2015年11月18日	重大事项	7.73	-	-	1,004	9,199.40	7,760.92	-
600168	武汉控股	2015年10月8日	重大事项	9.68	-	-	800	9,392.40	7,744.00	-
601996	丰林集团	2015年12月10日	重大事项	9.12	-	-	600	5,937.58	5,472.00	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1公允价值

7.4.14.1.1不以公允价值计量的金融工具

银行存款、结算备付金、存出保证金、应收款项以及其他金融负债，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1各层次金融工具公允价值

于2015年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中无属于第一层次的余额，属于第二层次的余额为人民币337,676.74元，无属于第三层次的余额。（于2014年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币8,737,269.00元，属于第二层次的余额为人民币479,973.84元，无属于第三层次的余额。）

7.4.14.1.2.2公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.1.2. 3第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具本期末和上期末均不以第三层次公允价值计量。

7.4.14.2承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大承诺事项。

7.4.14.3其他事项

截至资产负债表日，本基金的资产净值为人民币6,372,260.73元，已连续超过244个工作日基金资产净值低于人民币5,000万元。本基金资产管理人已就上述情况按照中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定，于2015年2季度向中国证监会说明原因和报送解决方案。为了更好地保护基金持有人利益以及切实做大基金规模，经与托管人华夏银行股份有限公司协商一致，并经中国证监会核准，本基金管理人已于2015 年12 月15 日召开基金持有人大会，将万家上证380交易型开放式指数证券投资基金变更注册为万家上证50交易型开放式指数证券投资基金。

除此之外，本基金无需说明的其他事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	337,676.74	5.05
	其中：股票	337,676.74	5.05
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	6,336,991.80	94.84
7	其他各项资产	6,758.90	0.10
8	合计	6,681,427.44	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	0.00	0.00
B	采矿业	9,256.00	0.15
C	制造业	108,649.92	1.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	46,518.06	0.73
E	建筑业	13,670.00	0.21
F	批发和零售业	52,565.44	0.82
G	交通运输、仓储和邮政业	39,016.32	0.61
H	住宿和餐饮业	0.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,072.00	0.36
J	金融业	0.00	0.00
K	房地产业	0.00	0.00
L	租赁和商务服务业	0.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	0.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	0.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
P	教育	0.00	0.00
Q	卫生和社会工作	0.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	14,250.00	0.22
S	综合	30,679.00	0.48
	合计	337,676.74	5.30

8.2.2 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600584	长电科技	1,500	33,030.00	0.52
2	600978	宜华木业	1,400	31,262.00	0.49
3	600200	江苏吴中	1,100	30,679.00	0.48
4	600654	中安消	800	23,072.00	0.36
5	600106	重庆路桥	2,058	21,691.32	0.34
6	600729	重庆百货	638	20,664.82	0.32
7	600578	京能电力	3,400	20,638.00	0.32
8	600420	现代制药	500	18,575.00	0.29
9	601000	唐山港	2,100	17,325.00	0.27
10	600682	南京新百	460	17,263.80	0.27
11	600120	浙江东方	737	14,636.82	0.23
12	600880	博瑞传播	1,900	14,250.00	0.22
13	600502	安徽水利	1,000	13,670.00	0.21
14	600990	四创电子	200	12,550.00	0.20
15	600995	文山电力	1,023	9,432.06	0.15
16	600988	赤峰黄金	800	9,256.00	0.15
17	600864	哈投股份	800	8,704.00	0.14
18	600375	华菱星马	1,004	7,760.92	0.12
19	600168	武汉控股	800	7,744.00	0.12
20	601996	丰林集团	600	5,472.00	0.09

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站的年度报告正文。

8.3.2 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。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600009	上海机场	146,518.00	1.59
2	600398	海澜之家	119,545.00	1.30
3	600436	片仔癀	101,607.00	1.10
4	600601	方正科技	98,487.00	1.07
5	600201	生物股份	81,199.00	0.88
6	600600	青岛啤酒	78,612.00	0.85
7	600525	长园集团	77,996.00	0.85
8	600522	中天科技	77,573.00	0.84
9	600594	益佰制药	72,788.00	0.79
10	600026	中海发展	72,337.00	0.78
11	601021	春秋航空	68,998.00	0.75
12	601106	中国一重	68,019.00	0.74
13	600021	上海电力	64,500.00	0.70
14	600584	长电科技	62,340.00	0.68
15	600642	申能股份	60,472.00	0.66
16	600880	博瑞传播	59,344.00	0.64
17	601333	广深铁路	59,141.00	0.64
18	600307	酒钢宏兴	57,925.00	0.63
19	600500	中化国际	57,088.00	0.62
20	601258	庞大集团	56,073.00	0.61

注：买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600009	上海机场	117,347.00	1.27
2	600415	小商品城	95,032.48	1.03
3	600029	南方航空	88,840.81	0.96
4	601106	中国一重	85,786.88	0.93
5	603993	洛阳钼业	82,678.00	0.90
6	601727	上海电气	80,451.30	0.87
7	600398	海澜之家	74,778.54	0.81
8	600436	片仔癀	74,191.00	0.80
9	601718	际华集团	68,688.00	0.75
10	600635	大众公用	66,027.00	0.72
11	600201	生物股份	55,816.40	0.61
12	600068	葛洲坝	55,151.70	0.60
13	600153	建发股份	53,873.75	0.58
14	600219	南山铝业	53,192.00	0.58
15	600005	武钢股份	53,057.92	0.58
16	600498	烽火通信	52,784.93	0.57
17	600777	新潮实业	51,386.40	0.56
18	600038	中直股份	51,271.64	0.56
19	600160	巨化股份	51,052.60	0.55
20	600820	隧道股份	50,837.00	0.55

注：卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	8,682,707.70
卖出股票收入（成交）总额	9,348,457.90

注：买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,371.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,387.36
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,758.90

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600584	长电科技	33,030.00	0.52	重大事项
2	600978	宜华木业	31,262.00	0.49	重大事项
3	600200	江苏吴中	30,679.00	0.48	重大事项
4	600654	中安消	23,072.00	0.36	重大事项
5	600106	重庆路桥	21,691.32	0.34	重大事项
6	600729	重庆百货	20,664.82	0.32	重大事项
7	600578	京能电力	20,638.00	0.32	重大事项
8	600420	现代制药	18,575.00	0.29	重大事项
9	601000	唐山港	17,325.00	0.27	重大事项
10	600682	南京新百	17,263.80	0.27	重大事项

8.12.5.2 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
186	20,025.01	1,065,618.00	28.61%	2,659,034.00	71.39%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国证券金融股份有限公司	1,000,000.00	26.85%
2	朱昱	412,614.00	11.08%
3	赵兴春	411,300.00	11.04%
4	何言	155,800.00	4.18%
5	周焱	126,500.00	3.40%
6	李秉其	102,500.00	2.75%
7	万强	100,000.00	2.68%
8	吴志明	96,000.00	2.58%
9	王伯英	90,550.00	2.43%
10	朱永安	82,400.00	2.21%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年10月31日）基金份额总额	500,724,652.00
本报告期期初基金份额总额	6,724,652.00
本报告期基金总申购份额	23,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	26,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
本报告期期末基金份额总额	3,724,652.00

注：本基金合同生效日为2013年10月31日。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

2015年12月15日召开基金份额持有人大会，会议通过将上证380交易型开放式指数证券投资基金变更为万家上证50交易型开放式指数证券投资基金，并按照相关法律法规及中国证监会的有关规定对本基金的名称、投资标的指数、基金投资范围等事项进行相应修改。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

董事长变更：2015年7月25日，本公司发布公告，聘任方一天为万家基金管理有限公司董事长，毕玉国先生工作原因不再担任本公司董事长职务。

总经理变更：2015年2月17日，本公司发布公告，聘任方一天为万家基金管理有限公司总经理。

督察长变更：2015年4月11日，本公司发布公告，聘任兰剑为万家基金管理有限公司督察长。

副总经理变更：2015年2月3日，本公司发布公告，聘任李修辞为万家基金管理有限公司副总经理。2015年3月11日，本公司发布公告，詹志令因个人原因离职，不再担任公司副总经理。2015年10月9日，本公司发布公告，李修辞因个人原因离职，不再担任公司副总经理。

基金经理变更：2015年5月23日本公司发布公告，聘任姚霞天为本基金基金经理，原基金经理吴涛因个人原因离职，不再担任本基金基金经理。2015年8月19日本公司发布公告，聘任卞勇为本基金基金经理，原基金经理姚霞天因个人原因离职，不再担任本基金基金经理。

基金托管人：

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

2015年12月15日，由《上证380交易型开放式指数证券投资基金合同》修订而成的《万家上证50交易型开放式指数证券投资基金基金合同》生效，修改基金标的指数为上证50指数，投资范围增加期权，融资和转融通业务，增加期权投资策略。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自2013年10月起，本基金聘请安永华明会计师事务所为本基金提供审计服务。

本基金2015年度需向安永华明会计师事务所支付审计费50,000.00元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	2	18,031,165.60	100.00%	15,490.66	100.00%	-

注：1、基金专用交易席位的选择标准如下：

（1）经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

（2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

（3）具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

（1）本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；

（2）基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

3、报告期内基金租用证券公司交易单元的变更情况：

无。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	-	-	-	-	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

2015年3月31日，万家基金管理有限公司发布关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告，经与相关托管银行、会计事务所协商一致，自2015年3月30日起，本公司对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格数据处理进行估值。于2015年3月30日，相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过0.50%。

万家基金管理有限公司
2016年3月25日