万家和谐增长混合型证券投资基金 2010年年度报告摘要

2010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:兴业银行股份有限公司
送出日期: 2011年3月30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。

基金托管人兴业银行根据本基金合同规定,于2011年3月25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本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2010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	万家和谐增长混合		
基金主代码	519181		
交易代码	前端:519181	后端:519182	
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2006年11月30日		
基金管理人	万家基金管理有限公司		
基金托管人	兴业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	3,148,699,367.44份		
基金合同存续期	不定期		

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过有效配置股票、债券投资比例,平衡长期买入持有和事件驱动投资的优化选择策略,控制投资风险,谋取基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金最大特点是突出和谐增长,主要包含二层含义:一、资产配置的和谐,通过有效配置股票、债券资产比例,谋求基金资产在股票、债券投资中风险、收益的和谐平衡;二、长期买入持有和事件驱动投资的和谐,通过对不同行业、不同股票内在价值与市场价格的偏离程度和其市场价格向内在价值的回归速度的分析, 谋求基金资产在不同行业和不同股票投资中长期投资和事件驱动投资的和谐平衡。
业绩比较基准	沪深300指数×65%+中证全债指数×30%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金是混合型基金,其预期收益及风险水平介于股票型基金与债券型基金之间,属于中等风险收益水平基金。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	张志永
	联系电话	021-38619810	021-62677777*212004
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		4008880800	95561
传真		021-38619888	021-62159217

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	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	2010年	2009年	2008年
本期已实现收益	33,016,972.10	501,223,160.35	-1,906,526,397.59
本期利润	-128,831,579.83	821,287,824.79	-2,353,379,023.28
加权平均基金份额本期利润	-0.0405	0.2323	-0.5993
本期基金份额净值增长率	-5.52%	48.47%	-56.09%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末	2009年末	2008年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1817	-0.1933	-0.3364
期末基金资产净值	2,049,569,397.19	2,226,803,225.64	1,746,021,973.04
期末基金份额净值	0.6509	0.6889	0.4640

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)所述基金业绩指标不包括持有人认购或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3个月	-1.44%	1.71%	3.74%	1.16%	-5.18%	0.55%
过去6个月	10.15%	1.41%	13.87%	1.01%	-3.72%	0.40%
过去1年	-5.52%	1.25%	-6.80%	1.02%	1.28%	0.23%
过去3年	-38.40%	1.79%	-21.59%	1.51%	-16.81%	0.28%
自基金合同生效起至今	34.57%	1.86%	65.48%	1.50%	-30.91%	0.36%

注:业绩比较基准= 沪深300指数×65%+中证全债指数×30%+同业存款利率×5%

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:本基金成立于2006年11月30日,建仓期为六个月,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。

3.2.3 过去五年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

注:2006 年实际存续期为2006年11月30日至2006年12 月31 日。

3.3过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未分配利润。

§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。公司现股东为齐鲁证券有限公司、上海久事公司、深圳市中航投资管理有限公司和山东省国有资产投资控股有限公司,住所地及办公地点均为上海市浦东新区福山路450号,注册资本1亿元人民币。目前管理八只开放式基金,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、万家公用事业行业股票型证券投资基金、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投资基金、万家精选股票型证券投资基金和万家稳健增利债券型证券投资基金。

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		
李洪雨	本基金基金经理	2008年9月1日	2010年6月26日	6年	男,复旦大学经济学硕士,CFA,曾任东北证券研究员、高级研究员、国联安基金管理有限公司高级研究员、基金经理助理。
鞠英利	本基金经理、万家公事业基金基金经理	2010年6月26日	-	11年	南开大学企业管理博士,曾任汕头证券上海总部研究中心投资主管、渤海证券上海资产管理部投资主管、华林证券有限责任公司投资经理、上海鑫地投资管理有限公司证券投资部总经理、万家双引擎基金基金经理等职。

注:1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《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

本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《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 公平交易制度的执行情况

本公司严格遵循公平交易的原则,在投资管理活动中公平对待不同基金品种,无直接或间接在不同投资组合之间进行利益输送的行为,报告期内无异常交易。

公司根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,制订和完善了公平交易内部控制制度,通过制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时,公司通过对投资交易行为的监控、分析评估来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

组合	报告期组合收益
本基金	-5.52%
万家双引擎灵活配置混合型基金	-2.98%
差异	-2.54%

基金同单收益率差异绝对值为2.54%,小于5%,不存在非公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内无异常交易。

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

2010中国A股市场成为全球跌幅最大的市场之一,上海综合指数自开盘的3289点下跌至2808点,跌幅达14.31%。 2010年我国GDP增长强劲,CPI涨幅在可控范围之内,我国经济总量首次超过日本成为全球第二大经济体,在国际上产生较大反响。然而,我国证券市场表现似乎与经济的强劲增长不一致,主要原因在于,宏观经济增长恢复得到确认之后的流动性回收。

2010年证券市场,呈现出"高-低-高"的走势,政策及对政策预期的影响,大于经济基本面的自身运行规律,我们认为中国经济的内生性增长增劲,而这一点并未被市场充分重视。在流动性依然宽松的背景下,一些"不可估值"的品种被推高到前所未有的程度,比如部分消费类股票的大幅上涨,创业板的超高市盈率发行。2010年的市场,最大的两个新变量,一个是股指期货的推出,另一个是创业板的"超预期繁荣",于是一些传统的经验在市场的东西不再适用。

国际主要证券市场整体表现较好,其原因为:首先,美国量化宽松导致的全球流动性泛滥的再次被预期,2010年初以来,由于欧盟债务问题而导致的欧元对美元大幅贬值,欧盟主要经济体出口情况好转,经济恢复强劲,基本面推动欧洲股票市场上涨。国际大宗商品的期货价格表现来看,原油达到90美元以上,黄金、锡价、铜均创出了历史新高。

2010年国内国际经济政治环境极为复杂,是波动较大,分歧较大的一年。本基金投资过程中,上半年积极主动,4月下旬坚决降低了仓位,取得了较好的效果,下半年在中小板及大消费类中有所投资,但比例不高,没有取得超额收益。本投资周期内,我们在基金合同规定的范围内积极投资,努力把握市场的运行脉络,以持有人利益最大化的原则指导下,为基金业绩的增长而持续努力。

4.4.2报告期内基金业绩的表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.6509元,本报告期份额净值增长率为-5.52%,同期业绩比较基准增长率为-6.80%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011年我们将面对好坏参半的国内外环境。全球主要大的经济体将进一步向好的方面发展, 不排除在个别时段还可能超出市场的预期,只有确认经济复苏以后才可能退出宽松的经济政策;中国综合国力进一步提升,国际知名度进一步增加,这些是有利的国际环境,另一方面,国际大宗商品价格居高不下,成本推动型通货膨胀预期增加,个别国家动荡不安,也会使投资人产生不良的预期,甚至局部冲突升级对全球资本市场造成较大的短期波动。

国内方面,新房地调控政策严厉程度前所未有。各地方限购令相继出台,上海、重庆房产税终于成为现实,将对地产需求产生较大的抑制,从而影响相关的产业链。农产品价格居高不下,通货膨胀预期依然强烈。这些构成了A股市场投资的不确定因素。另一方面来看,2011年是"十二五"开局之年,结构调整及经济转型的力度将超出预期,对民生问题的重视,保障房的建设等,将产生相应的投资机会。区域经济规划的持续及战略性新兴产业政策的相继出台也将产生局部的市场热点。

综合而言,2011年的市场环境将更加难以把握,市场波动将更加剧烈。本基金的投资过程,我们将更加注重灵活性,在行业的选择方面,我们将重点关注,进口替代型的装备制造业,战略性新兴产业,侧重于自下而上的选股策略,注重研究及投资的深入性及全面性,力争为基金获取更大收益。

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

基金管理人

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。估值委员会主要由分管基金估值业务的公司领导、督察长、基金估值业务的负责人、监察稽核部负责人、研究发展部负责人等组成。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。

托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算等复核和核查的责任。

会计师事务所

会计师事务所对基金管理公司所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与和决定基金估值。

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。

§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,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本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运作遵规守信、净值计算等情况的说明

报告期内,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为;基金管理人在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

兴业银行股份有限公司资产托管部
2011年3月25日

§6 审计报告

本基金2010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(2011)审字第60778298_B06号标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容,应阅读年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:万家和谐增长混合型证券投资基金

报告截止日:2010年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资 产:		
银行存款	527,901,216.92	302,436,064.27
结算备付金	20,329,321.33	5,437,387.65
存出保证金	3,245,045.73	2,386,049.02
交易性金融资产	1,428,062,369.59	1,935,221,457.45
其中:股票投资	1,387,528,438.39	1,546,410,315.73
债券投资	40,533,931.20	388,811,141.72
资产支持证券投资	0.00	0.00
衍生金融资产	0.00	0.00
买入返售金融资产	50,065,195.10	0.00
应收证券清算款	32,705,510.44	88,325,986.30
应收利息	215,332.68	8,070,298.82
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	106,541.97	66,933.94
其他资产	0.00	0.00
资产总计	2,062,630,533.76	2,341,944,177.45
负债和所有者权益	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
负 债:		
短期借款	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	0.00
应付证券清算款	0.00	106,163,964.38
应付赎回款	638,425.54	2,631,794.15
应付管理人报酬	2,629,495.13	2,829,429.95
应付托管费	438,249.21	471,571.66
应付销售服务费	0.00	0.00
应付交易费用	8,204,595.12	1,892,530.60
应交税费	0.00	0.00
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00
其他负债	1,150,371.57	1,151,661.07
负债合计	13,061,136.57	115,140,951.81
所有者权益:		
实收基金	1,801,360,600.33	1,849,351,670.90
未分配利润	248,208,796.86	377,451,554.74
所有者权益合计	2,049,569,397.19	2,226,803,225.64
负债和所有者权益总计	2,062,630,533.76	2,341,944,177.45

注:报告截止日2010年12月31日,基金份额净值 0.6509元,基金份额总额3,148,699,367.44份。

7.2利润表

会计主体:万家和谐增长混合型证券投资基金

本报告期:2010年1月1日至2010年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
一、收入	-54,504,295.44	877,845,771.29
1.利息收入	10,070,749.92	11,798,840.50
其中:存款利息收入	2,273,663.37	1,601,267.01
债券利息收入	7,005,224.00	9,939,632.48
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售金融资产收入	791,862.55	257,941.01
其他利息收入	0.00	0.00
2.投资收益(损失以"-"填列)	97,257,613.64	545,805,166.28
其中:股票投资收益	92,007,514.04	534,941,295.51
债券投资收益	-3,444,927.02	-610,658.49
资产支持证券投资收益	0.00	0.00
衍生工具收益	0.00	279,277.60
股利收益	8,695,026.62	11,195,251.66
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-161,848,551.93	320,064,664.44
4.其他收入(损失以"-"号填列)	15,892.93	177,100.07
减:二、费用	74,327,284.39	56,557,946.50
1.管理人报酬	31,084,225.91	32,039,154.37
2.托管费	5,180,704.44	5,339,858.97
3.销售服务费	0.00	0.00
4.交易费用	37,507,148.39	18,471,390.99
5.利息支出	126,360.27	280,639.92
其中:卖出回购金融资产支出	126,360.27	280,639.92
6.其他费用	428,845.38	426,902.25
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-128,831,579.83	821,287,824.79

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:万家和谐增长混合型证券投资基金

本报告期:2010年1月1日至2010年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010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)	1,849,351,670.90	377,451,554.74	2,226,803,225.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-128,831,579.83	-128,831,579.83
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)	-47,991,070.57	-411,178.05	-48,402,248.62
其中:1.基金申购款	167,413,508.33	36,387,156.22	203,800,664.55
2.基金赎回款	-215,404,578.90	-36,798,334.27	-252,202,913.17
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)	-	0.00	0.00
五、期末所有者权益(基金净值)	1,801,360,600.33	248,208,796.86	2,049,569,397.19
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009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)	2,152,769,254.75	-406,747,281.71	1,746,021,973.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	821,287,824.79	821,287,824.79
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)	-303,417,583.85	-37,088,988.34	-340,506,572.19
其中:1.基金申购款	56,595,471.50	1,797,822.08	58,393,293.58
2.基金赎回款	-360,013,055.35	-38,886,810.42	-398,899,865.77
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)	-	0.00	0.00
五、期末所有者权益(基金净值)	1,849,351,670.90	377,451,554.74	2,226,803,225.64

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:

基金管理公司负责人:毕玉国 主管会计工作负责人:杨峰 会计机构负责人:陈广益

7.4报表附注

7.4.1 基金基本情况

万家和谐增长混合型证券投资基金(以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字[2006]211号文《关于同意万家和谐增长混合型证券投资基金募集的批复》的核准,由万家基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集,基金合同于2006年11月30日正式生效,首次设立的募集规模为491,748,090.03份基金份额。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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

2007年7月19日(拆分日),本基金管理人万家基金管理有限公司对本基金进行了基金份额拆分。拆分前,本基金的基金份额净值为人民币1.7480元,根据基金份额拆分公式,计算精确到小数点后第9位(第9位以后舍去)为人民币1.747971119元。本基金管理人于拆分日,按照1:1.747971119的拆分比例对本基金进行拆分。拆分后,基金份额净值为人民币1.0000元,基金份额面值为人民币0.5721元。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,主要包括国内依法发行上市的股票、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金通过配置股票、债券投资比例,平衡长期买入持有和事件驱动投资的优化选择策略,谋取基金资产的长期稳定增值。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数×65%+中证全债指数×30%+同业存款利率×5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、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,也参考了中国证券业协会制定的《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》、证监会公告[2010]5号关于发布《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>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

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2010年12月31日的财务状况以及2010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

本期会计政策、估计与最近一期年度报告相一致

7.4.5 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,债券的利息收入及储蓄利息收入,由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定,自2005年6月13日起,对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得,按照财税[2005]102号文规定,扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时,减按50%计算应纳税所得额;

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。

7.4.6 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,发起人,基金销售机构
兴业银行股份有限公司	基金托管人,基金代销机构
齐鲁证券有限公司	基金管理人股东,基金代销机构
上海久事公司	基金管理人股东
深圳市中航投资管理有限公司	基金管理人股东
山东省国有资产投资控股有限公司	基金管理人股东
中国证券登记结算有限责任公司	基金注册与登记过户人

注:关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.7.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
齐鲁证券	998,924,162.77	4.07%	0.00	0.00%

7.4.7.1.2 权证交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易

7.4.7.1.3 债券交易

本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易

7.4.7.1.4 债券回购交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易

7.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
齐鲁证券	849,086.12	4.13%	353,285.24	4.31%
关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
齐鲁证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%

注: 上述佣金按市场佣金率计算,扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买(卖)证管费等)。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	31,084,225.91	32,039,154.37
其中:支付销售机构的客户维护费	7,622,539.15	8,011,929.93

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.50%÷当年天数

H为每日应支付的基金管理费

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。若遇不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

7.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,180,704.44	5,339,858.97

注: 基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应支付的基金托管费

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,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托管人。若遇不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
兴业银行	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
兴业银行	0.00	49,940,568.49	0.00	0.00	0.00	0.00

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
基金合同生效日(2006年11月30日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	9,540,394.40	0.00
期间申购/买入总份额	15,579,619.82	32,235,373.98
期间因拆分变动的份额	0.00	0.00
减:期间赎回/卖出总份额	0.00	22,694,979.58
期末持有的基金份额	25,120,014.22	9,540,394.40
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.80%	0.30%

注:本基金的基金管理人于本年度申购及赎回本基金份额时适用的费率与本基金公告的费率一致。

7.4.7.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于2010年年末及2009年年末均未投资本基金。

7.4.7.5 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 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009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
兴业银行	527,901,216.92	2,121,310.41	302,436,064.27	1,476,931.22

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,2010年度获得的利息收入为人民币141,895.21元(2009年度:人民币124,314.11元),2010年末结算备付金余额为人民币20,329,321.33元(2009年末:人民币5,437,387.65元)。

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本年度及上年度未在承销期内直接购入关联方所承销的证券。

7.4.8 期末(2010年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002528	英飞拓	2010-12-17	2011-03-24	网下新股锁定	53.80	51.54	670,000	36,046,000.00	34,531,800.00	-

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。7.4.8.2 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
000059	辽通化工	2010-12-02	资产重组	11.59	-	-	4,740,536	59,811,297.35	54,942,812.24	-

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无债券正回购,因此没有在债券正回购交易中作为抵押的债券。

§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	1,387,528,438.39	67.27
	其中:股票	1,387,528,438.39	67.27
2	固定收益投资	40,533,931.20	1.97
	其中:债券	40,533,931.20	1.97
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	50,065,195.10	2.43
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	548,230,538.25	26.58
6	其他各项资产	36,272,430.82	1.76
7	合计	2,062,630,533.76	100.00

8.2 期末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	62,733,277.50	3.06
B	采掘业	99,706,539.80	4.86
C	制造业	925,354,858.19	45.15
C0	食品、饮料	60,001,931.47	2.93
C1	纺织、服装、皮毛	15,747,200.00	0.77
C2	木材、家具	0.00	0.00
C3	造纸、印刷	0.00	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	156,510,557.67	7.64
C5	电子	43,989,632.94	2.15
C6	金属、非金属	178,568,173.12	8.71
C7	机械、设备、仪表	462,385,362.99	22.56
C8	医药、生物制品	8,152,000.00	0.40
C99	其他制造业	0.00	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	7,899,794.60	0.39
E	建筑业	8,637,075.00	0.42
F	交通运输、仓储业	0.00	0.00
G	信息技术业	87,706,158.36	4.28
H	批发和零售贸易	14,087,318.38	0.69
I	金融、保险业	0.00	0.00
J	房地产业	32,948,000.00	1.61
K	社会服务业	77,892,216.56	3.80
L	传播与文化产业	2,575,200.00	0.13
M	综合类	67,988,000.00	3.32
	合计	1,387,528,438.39	67.70

8.3 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

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	600468	百利电气	2,799,901	100,684,439.96	4.91
2	000598	兴蓉投资	3,000,000	61,890,000.00	3.02
3	000059	辽通化工	4,740,536	54,942,812.24	2.68
4	601678	滨化股份	2,800,000	53,228,000.00	2.60
5	000792	盐湖钾肥	800,000	52,992,000.00	2.59
6	600123	兰花科创	1,108,301	52,178,811.08	2.55
7	600251	冠农股份	1,800,000	51,174,000.00	2.50
8	000878	云南铜业	1,700,000	46,750,000.00	2.28
9	600481	双良节能	2,649,960	43,989,336.00	2.15
10	600362	江西铜业	900,000	40,653,000.00	1.98

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

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	600000	浦发银行	227,035,100.22	10.20
2	600193	创兴置业	198,993,233.16	8.94
3	601678	滨化股份	188,007,325.25	8.44
4	601318	中国平安	183,543,306.31	8.24
5	601601	中国太保	179,823,998.01	8.08
6	600468	百利电气	154,191,425.70	6.92
7	601628	中国人寿	149,378,097.46	6.71
8	601766	中国南车	137,563,219.57	6.18
9	600837	海通证券	137,409,266.95	6.17
10	600176	中国玻纤	135,784,624.63	6.10
11	600068	葛洲坝	129,868,650.25	5.83
12	600197	伊力特	128,912,483.90	5.79
13	600030	中信证券	126,291,565.10	5.67
14	600843	上工申贝	125,570,110.96	5.64
15	600125	铁龙物流	123,798,066.17	5.56
16	002298	鑫龙电器	111,548,260.51	5.01
17	600048	保利地产	109,328,224.67	4.91
18	000546	光华控股	103,537,519.02	4.65
19	600036	招商银行	102,927,805.09	4.62
20	000933	神火股份	101,440,693.53	4.56
21	601958	金钼股份	101,365,086.91	4.55
22	300080	新大新材	100,901,455.41	4.53
23	600589	广东榕泰	100,025,463.35	4.49
24	600523	贵航股份	99,305,162.26	4.46
25	601607	上海医药	97,989,758.40	4.40
26	000612	焦作万方	96,928,349.00	4.35
27	601111	中国国航	95,177,148.76	4.27
28	000960	锡业股份	94,772,119.16	4.26
29	601299	中国北车	90,854,212.29	4.08
30	000792	盐湖钾肥	88,112,598.42	3.96
31	600123	兰花科创	86,932,832.14	3.90
32	600535	天士力	85,491,582.62	3.84
33	600016	民生银行	85,212,628.17	3.83
34	600208	新湖中宝	85,134,867.55	3.82
35	600362	江西铜业	83,669,880.29	3.76
36	002069	獐子岛	81,563,743.19	3.66
37	600309	烟台万华	80,040,254.22	3.59
38	000965	天保基建	79,127,965.25	3.55
39	600038	哈飞股份	78,518,572.45	3.53
40	600089	特变电工	78,294,610.25	3.52
41	000983	西山煤电	78,112,824.38	3.51
42	000059	辽通化工	78,061,920.41	3.51
43	000893	东凌粮油	77,716,061.74	3.49
44	600673	东阳光铝	77,032,811.03	3.46
45	600251	冠农股份	76,427,442.84	3.43
46	000878	云南铜业	74,596,698.74	3.35
47	601717	郑煤机	74,333,937.56	3.34
48	600581	八一钢铁	73,260,729.25	3.29
49	600410	华胜天成	72,492,795.58	3.26
50	601898	中煤能源	72,320,580.82	3.25
51	601169	北京银行	70,000,189.79	3.14
52	600888	新疆众和	69,686,077.31	3.13
53	600365	通葡股份	69,223,016.32	3.11
54	600509	天富热电	68,518,147.08	3.08
55	002302	西部建设	68,035,585.02	3.06
56	000060	中金岭南	66,860,819.14	3.00
57	000680	山推股份	66,823,576.81	3.00
58	600266	北京城建	66,636,003.06	2.99
59	600221	海南航空	66,190,418.19	2.97
60	600664	哈药股份	66,131,731.97	2.97
61	002128	露天煤业	65,379,092.66	2.94
62	601989	中国重工	64,966,293.47	2.92
63	600737	中粮屯河	64,923,569.36	2.92
64	600595	中孚实业	64,784,377.54	2.91
65	000858	五 粮 液	64,561,215.38	2.90
66	600256	广汇股份	63,407,262.44	2.85
67	600141	兴发集团	62,730,654.82	2.82
68	600111	包钢稀土	62,474,604.85	2.81
69	601988	中国银行	61,859,397.86	2.78
70	600545	新疆城建	61,576,138.84	2.77
71	600586	金晶科技	61,263,361.52	2.75
72	600467	好当家	61,029,516.11	2.74
73	000897	津滨发展	60,075,688.66	2.70
74	600351	亚宝药业	59,660,890.52	2.68
75	000999	华润三九	58,681,851.78	2.64
76	000002	万 科A	58,260,013.09	2.62
77	600202	哈空调	57,357,734.80	2.58
78	000937	冀中能源	57,005,061.23	2.56
79	601168	西部矿业	56,458,902.26	2.54
80	600805	悦达投资	55,679,477.72	2.50
81	300096	易联众	55,659,358.19	2.50
82	600383	金地集团	54,571,264.80	2.45
83	002008	大族激光	53,355,495.52	2.40
84	601398	工商银行	53,188,118.18	2.39
85	600106	重庆路桥	51,629,720.02	2.32
86	600488	天药股份	51,560,238.48	2.32
87	600800	一汽轿车	51,433,871.61	2.31
88	600481	双良节能	51,385,481.20	2.31
89	600900	长江电力	51,264,908.78	2.30
90	600426	华鲁恒升	50,457,789.06	2.27
91	002272	川润股份	50,118,742.54	2.25
92	600502	安徽水利	49,910,123.28	2.24
93	600809	山西汾酒	49,809,201.62	2.24
94	600895	张江高科	49,806,145.52	2.24
95	600823	世茂股份	49,201,500.06	2.21
96	600858	银座股份	49,010,218.89	2.20
97	000598	兴蓉投资	48,491,426.43	2.18
98	600271	航天信息	47,274,760.77	2.12
99	601328	交通银行	47,091,250.23	2.11
100	000046	泛海建设	46,972,281.90	2.11
101	000001	深发展A	46,604,834.45	2.09
102	002115	三维通信	45,895,220.96	2.06
103	000780	平庄能源	45,788,787.10	2.06
104	600295	鄂尔多斯	45,082,519.64	2.02
105	601288	农业银行	44,724,720.00	2.01

注:本项买入金额均按买入成交金额(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	600000	浦发银行	243,394,256.92	10.93
2	601318	中国平安	230,650,262.21	10.36
3	601601	中国太保	221,353,115.16	9.94
4	600193	创兴置业	192,886,962.55	8.66
5	600036	招商银行	148,960,352.76	6.69
6	600837	海通证券	139,175,363.14	6.25
7	600016	民生银行	138,639,402.34	6.23
8	601628	中国人寿	138,495,771.31	6.22
9	000933	神火股份	133,586,613.30	6.00
10	600197	伊力特	131,572,155.61	5.91
11	601766	中国南车	130,643,405.13	5.87
12	601678	滨化股份	129,600,303.74	5.82
13	600068	葛洲坝	126,610,414.42	5.69
14	600030	中信证券	126,255,210.30	5.67
15	000612	焦作万方	121,899,980.42	5.47
16	600125	铁龙物流	117,550,484.69	5.28
17	600089	特变电工	114,496,762.33	5.14
18	600664	哈药股份	112,407,609.96	5.05
19	601958	金钼股份	111,101,933.82	4.99
20	600176	中国玻纤	108,125,903.83	4.86
21	600048	保利地产	105,334,204.34	4.73
22	000999	华润三九	103,782,563.14	4.66
23	600589	广东榕泰	103,060,825.36	4.63
24	600843	上工申贝	101,102,164.10	4.54
25	000546	光华控股	100,603,111.59	4.52
26	600523	贵航股份	96,959,887.99	4.35
27	000680	山推股份	96,272,488.56	4.32
28	601328	交通银行	94,445,937.42	4.24
29	601607	上海医药	93,966,858.02	4.22
30	600468	百利电气	93,260,874.87	4.19
31	002069	獐子岛	92,402,675.75	4.15
32	601111	中国国航	91,373,294.49	4.10
33	600737	中粮屯河	91,359,389.45	4.10
34	600502	安徽水利	90,302,590.81	4.06
35	000063	中兴通讯	89,887,992.20	4.04
36	000937	冀中能源	88,933,597.83	3.99
37	300080	新大新材	86,842,047.72	3.90
38	002298	鑫龙电器	84,682,923.51	3.80
39	600535	天士力	83,615,768.06	3.75
40	600038	哈飞股份	82,773,251.58	3.72
41	600581	八一钢铁	81,631,818.66	3.67
42	600208	新湖中宝	80,152,418.59	3.60
43	601717	郑煤机	78,708,079.05	3.53
44	600111	包钢稀土	75,958,437.09	3.41
45	000983	西山煤电	75,670,174.32	3.40
46	600309	烟台万华	74,393,166.25	3.34
47	000060	中金岭南	73,634,296.97	3.31
48	600498	烽火通信	73,413,071.64	3.30
49	000893	东凌粮油	72,084,493.21	3.24
50	600509	天富热电	71,229,576.01	3.20
51	000965	天保基建	71,227,193.12	3.20
52	601169	北京银行	70,785,952.19	3.18
53	601898	中煤能源	70,735,253.53	3.18
54	601088	中国神华	69,265,896.26	3.11
55	002029	七 匹 狼	69,149,076.65	3.11
56	601168	西部矿业	67,970,533.41	3.05
57	600595	中孚实业	67,754,756.05	3.04
58	600365	通葡股份	67,080,473.87	3.01
59	000897	津滨发展	66,946,360.18	3.01
60	000960	锡业股份	66,847,970.98	3.00
61	600266	北京城建	66,199,614.03	2.97
62	000759	武汉中百	64,691,807.00	2.91
63	600673	东阳光铝	64,529,069.67	2.90
64	002024	苏宁电器	64,294,660.82	2.89
65	600888	新疆众和	63,380,758.47	2.85
66	002302	西部建设	62,738,007.09	2.82
67	000858	五 粮 液	62,250,923.74	2.80
68	600410	华胜天成	61,928,953.99	2.78
69	601299	中国北车	61,913,899.22	2.78
70	600545	新疆城建	61,748,082.18	2.77
71	000002	万 科A	61,304,559.14	2.75
72	600738	兰州民百	60,914,313.45	2.74
73	600858	银座股份	60,704,765.05	2.73
74	601699	潞安环能	60,015,740.59	2.70
75	000623	吉林敖东	59,799,160.23	2.69
76	601988	中国银行	59,573,788.11	2.68
77	600586	金晶科技	58,710,237.83	2.64
78	600202	哈空调	58,519,857.16	2.63
79	600106	重庆路桥	56,231,338.13	2.53
80	600467	好当家	54,944,154.77	2.47
81	600383	金地集团	54,373,606.43	2.44
82	600488	天药股份	53,559,472.95	2.41
83	002008	大族激光	53,547,476.20	2.40
84	600221	海南航空	52,732,776.45	2.37
85	600256	广汇股份	52,567,884.66	2.36
86	601989	中国重工	52,488,239.73	2.36
87	600805	悦达投资	52,290,381.27	2.35
88	601398	工商银行	51,391,959.88	2.31
89	600660	福耀玻璃	50,956,305.80	2.29
90	600900	长江电力	50,477,168.05	2.27
91	600359	新农开发	50,227,116.97	2.26
92	600823	世茂股份	49,931,415.92	2.24
93	600426	华鲁恒升	48,605,897.90	2.18
94	000046	泛海建设	48,320,583.59	2.17
95	600362	江西铜业	48,056,330.16	2.16
96	600295	鄂尔多斯	47,289,909.92	2.12
97	600141	兴发集团	47,156,300.78	2.12
98	002128	露天煤业	46,511,719.45	2.09
99	000800	一汽轿车	46,276,917.77	2.08
100	000001	深发展A	45,110,403.08	2.03
101	600895	张江高科	44,806,281.82	2.01
102	600693	东百集团	44,783,482.67	2.01
103	601788	光大证券	44,676,495.80	2.01

注:本项卖出金额均按卖出成交金额(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	12,259,540,232.69
卖出股票收入(成交)总额	12,342,752,111.51

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	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	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	40,533,931.20	1.98
7	其他	-	-
8	合计	40,533,931.20	1.98

8.6 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	359,380	39,481,486.80	1.93
2	128233	塔牌转债	6,980	1,052,444.40	0.05

8.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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 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

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 本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。

8.9.3 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	3,245,045.73
2	应收证券清算款	32,705,510.44
3	应收股利	0.00
4	应收利息	215,332.68
5	应收申购款	106,541.97
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
8	其他	-
9	合计	36,272,430.82

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	39,481,486.80	1.93

8.9.5 期末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	000059	辽通化工	54,942,812.24	2.68	重大资产重组事项停牌

§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
156,319	20,142.78	296,786,217.98	9.43%	2,851,913,149.46	90.57%

9.2期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	1,513.29	0.00%

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2006年11月30日)基金份额总额	491,748,090.03
本报告期期初基金份额总额	3,232,580,458.34
本报告期基金总申购份额	292,635,262.27
减:本报告期基金总赎回份额	376,516,353.17
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,148,699,367.44

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

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:

1、经中国证券监督管理委员会证监许可[2010]274号文核准,钱华先生担任我公司副总经理职务,我公司于2010年3月20日在《证券时报》发布"万家基金管理有限公司关于聘任公司副总经理的公告"。

2、2010年6月26日发布《万家基金管理有限公司关于调整基金经理的公告》,聘任鞠英利为万家和谐增长混合型证券投资基金基金经理,李洪雨不再担任该基金基金经理。

3、2010年9月18日发布《万家基金管理有限公司关于公司副总经理离任的公告》,钱华先生不再担任公司副总经理职务。

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

报告期期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自2009年4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2010年度需向安永华明会计师事务所支付审计费100,000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

报告期内,本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

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	
国信证券	1	3,494,712,399.14	14.24%	2,970,491.95	14.44%	-
申银万国	1	3,361,472,432.14	13.70%	2,857,233.63	13.89%	-
中金	1	2,932,277,204.27	11.95%	2,382,500.74	11.58%	-
光大证券	1	2,121,017,403.56	8.64%	1,802,858.51	8.76%	-
国泰君安	1	2,115,576,106.15	8.62%	1,718,919.21	8.35%	-
联合证券	1	1,990,654,429.13	8.11%	1,692,043.84	8.22%	-
招商证券	2	1,910,754,165.03	7.79%	1,568,896.63	7.63%	-
海通证券	1	1,666,218,233.78	6.79%	1,416,273.01	6.88%	-
华泰证券	1	1,338,471,107.08	5.45%	1,137,689.52	5.53%	-
中投证券	1	1,045,517,849.79	4.26%	849,492.11	4.13%	-
齐鲁证券	1	998,924,162.77	4.07%	849,086.12	4.13%	-
英大证券	1	654,071,162.17	2.67%	555,960.59	2.70%	-
东北证券	1	455,981,296.97	1.86%	387,580.96	1.88%	-
山西证券	1	453,906,391.93	1.85%	385,819.62	1.88%	-
江南证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
东海证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
中信建投	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-

注:本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基字[2007]48号)的有关规定要求,我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后,向多家券商租用了基金专用交易席位。

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:

2010年席位增加:中信建投、中投证券各一个。

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	
	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
国信证券	113,935,889.43	63.80%	90,000,000.00	6.82%
申银万国	4,153,129.51	2.33%	100,000,000.00	7.58%
中金	2,248,000.00	1.26%	0.00	0.00%
光大证券	0	0.00%	0.00	0.00%
国泰君安	30,135,539.39	16.87%	0.00	0.00%
联合证券	1,607,710.00	0.90%	120,000,000.00	9.09%
招商证券	8,050,924.55	4.51%	280,000,000.00	21.21%
海通证券	0	0.00%	640,000,000.00	48.48%
华泰证券	0	0.00%	0.00	0.00%
中投证券	18,456,243.30	10.33%	0.00	0.00%
齐鲁证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
英大证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
东北证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
山西证券	0.00	0.00%	90,000,000.00	6.82%
江南证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
东海证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
中信建投	0.00	0.00%	0.00	0.00%

万家基金管理有限公司
2011年3月30日