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 8 月 26 日

万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

§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。本半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股份有限公司根据本基金合同规定,于 2011 年 8 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	万家双引擎灵活配置混合
基金主代码	519183
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年 6 月 27 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	317,875,741.15 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过股票、债券的有效配置,把握价值、成长风格特征,精选个股,构造风格类资产组合。在有效控制风险的前提下,谋求基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金根据对宏观经济环境、经济增长前景及证券市场发展状况的综合分析,确定大类资产的动态配置。本基金股票投资组合采取自下而上的策略,以量化指标分析为基础,结合定性分析,精选具有明显价值、成长风格特征且具备估值优势的股票,构建投资组合,在有效控制风险的前提下,谋求基金资产的持续稳健增值。
业绩比较基准	60%×沪深 300 指数收益率+40%×上证国债指数收益率
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,属于中高风险、中高预期收益的证券投资基金。

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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.wjasset.com
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区福山路 450 号新天国际大厦 23 楼基金管理人办公场所

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-3,820,371.37
本期利润	-3,947,516.74
加权平均基金份额本期利润	-0.0732
本期基金份额净值增长率	-9.74%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0811
期末基金资产净值	292,101,132.62
期末基金份额净值	0.9189

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
过去一个月	2.07%	0.66%	0.95%	0.72%	1.12%	-0.06%
过去三个月	-3.34%	0.70%	-3.00%	0.66%	-0.34%	0.04%
过去六个月	-9.74%	0.92%	-0.71%	0.74%	-9.03%	0.18%
过去一年	3.26%	1.08%	12.53%	0.84%	-9.27%	0.24%
过去三年	36.25%	1.18%	14.85%	1.20%	21.40%	-0.02%
自基金合同生效起至今	36.25%	1.18%	10.44%	1.21%	25.81%	-0.03%

注:业绩比较基准收益率=60%×沪深 300 指数收益率+40%×上证国债指数收益率

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 2008 年 6 月 27 日成立,建仓期为六个月,建仓期结束时和报告期末各项资产配置比例符合基金合同要求。

§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、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。目前管理十只开放式基金,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、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数型证券投资基金和万家添利分级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		
吴印	本基金基金经理,万家公用事业行业股票型证券投资基金基金经理	2010年 7 月 3 日	-	5年	工学学士,经济学硕士,2006 年加入万家基金,从事证券投资和研究工作,历任研究发展部行业分析师、基金经理助理等职。

注:1、任职日期以及离任日期均以公告日为准。

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发布的《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	-9.74%
万家和谐增长混合型证券投资基金	-10.43%
差异	0.69%

基金间年收益率差异绝对值为 0.69%,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

2011 年上半年,国内 A 股市场大幅震荡。主要原因在于通胀形势严峻,货币政策不断收紧,触发市场对于经济二次探底的担忧越加强烈。

期间,本基金操作主要以调整结构为主,第一季度增加了煤炭、化工等低估值行业景气向上的行业比重,减持了消费零售等板块。二季度则适当降低了仓位,期末则加仓了周期股。主要逻辑在于,基于通货膨胀风险,中央展现出明确的调控趋向,货币政策进一步收紧,这些情况都加深了市场继续走低的可能性。

4.4.2 报告期内基金业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为 0.9189 元,本报告期份额净值增长率为-9.74%,业绩比较基准收益率为-0.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年市场,我们认为宏观经济层面,虽然仍有很多不利因素,包括经济有可能将进一步下滑,通胀继续高企等等,但是这些因素基本上都已经在市场的预期之内。全年的经济增长确定性并没有减弱,整体的增长态势还是会比较明确。

总体来看,市场经历了前期剧烈的下跌,风险得到释放,虽然悲观预期仍然笼罩市场,但是我们认为市场已经逐步进入探底回升阶段。

在策略方面,双引擎下半年第一方面是寻找前期超跌的板块,市场经过大幅回调,尤其是创业板、中小板经过了年初以来的大幅度下跌之后,很多个股已经进入了相对的价值区间;第二方面是房地产产业链,政策压制正在逐渐放松,低估值有回归的需求,第三方面将逐渐增加长期看好的消费类配置。

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

本基金报告期内未进行利润分配。

§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

本托管人依据《万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金基金合同》与《万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金托管协议》,自 2008 年 6 月 27 日起托管万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金(以下称本基金)的全部资产。

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、利润分配等情况的说明

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 托管人对本半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。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2011 年 6 月 30 日

单位:人民币元

资产	本期末 2011年 6 月 30 日	上年度末 2010年 12 月 31 日
资产:		
银行存款	83,682,122.47	21,804,393.88
结算备付金	177,396.40	336,609.34
存出保证金	184,040.09	91,796.06
交易性金融资产	119,081,648.82	33,253,385.22
其中:股票投资	119,081,648.82	33,253,385.22
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	10,000,000.00	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	8,821.50	3,996.57
应收股利	-	-
应收申购款	138,184,728.44	21,564,486.02
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	351,318,757.72	77,054,667.09
负债和所有者权益	本期末 2011年 6 月 30 日	上年度末 2010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	58,043,832.49	3,609,572.45
应付赎回款	747,546.44	969.16
应付管理人报酬	61,515.45	60,218.89
应付托管费	10,252.59	10,036.49
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	190,001.81	229,336.33
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	164,476.32	360,003.65
负债合计	59,217,625.10	4,270,136.97
所有者权益:		
实收基金	317,875,741.15	71,488,163.99
未分配利润	-25,774,608.53	1,296,366.13
所有者权益合计	292,101,132.62	72,784,530.12
负债和所有者权益总计	351,318,757.72	77,054,667.09

注:报告截止日 2011 年 6 月 30 日,基金份额净值 0.9189 元,基金份额总额 317,875,741.15 份。

6.2 利润表

会计主体:万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
一、收入	-2,549,740.98	-11,183,325.23
1.利息收入	77,324.83	88,418.55
其中:存款利息收入	73,391.49	88,418.55
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	3,933.34	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-2,532,194.50	-3,879,588.88
其中:股票投资收益	-2,704,235.35	-4,036,614.41
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	172,040.85	157,025.53
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-127,145.37	-7,431,064.12
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	32,274.06	38,909.22
减:二、费用	1,397,775.76	2,572,446.06
1.管理人报酬	380,639.76	673,570.87
2.托管费	63,440.02	112,261.80
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	782,627.72	1,631,214.37
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	171,068.26	155,399.02
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-3,947,516.74	-13,755,771.29
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-3,947,516.74	-13,755,771.29

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 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)	71,488,163.99	1,296,366.13	72,784,530.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,947,516.74	-3,947,516.74
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)	246,387,577.16	-23,123,457.92	223,264,119.24
其中:1.基金申购款	277,825,107.51	-23,520,936.05	254,304,171.46
2.基金赎回款	-31,437,530.35	397,478.13	-31,040,052.22
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)	317,875,741.15	-25,774,608.53	292,101,132.62
项目	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 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)	110,802,401.69	5,478,212.05	116,280,613.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-13,755,771.29	-13,755,771.29
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)	-26,670,059.28	-989,271.59	-27,659,330.87
其中:1.基金申购款	4,183,408.80	-1,118.85	4,182,289.95
2.基金赎回款	-30,853,468.08	-988,152.74	-31,841,620.82
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)	84,132,342.41	-9,266,830.83	74,865,511.58

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

毕玉国 杨峰 陈广益

基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

万家双引擎灵活配置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”)证监许可[2008]316 号文《关于核准万家双引擎灵活配置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 2008 年 6 月 27 日正式生效,首次设立的募集规模为 353,835,521.84 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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

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、上市的股票、债券、现金、短期金融工具、资产支持证券、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。本基金通过股票、债券的有效配置,谋求基金资产的持续稳健增值。本基金的业绩比较基准为:60%×沪深 300 指数收益率+40%×上证国债指数收益率。

6.4.2 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。

6.4.3 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 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年 1 月 1 日至 6 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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

本半年度报告所采用的会计政策、会计估计与上年度报告相一致。

本报告期无重大会计差错事项。

6.4.5 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。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	380,639.76	673,570.87
其中:支付销售机构的客户维护费	61,928.89	51,417.08

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。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	63,440.02	112,261.80

注:

依照基金合同,在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%÷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

基金托管费在基金合同生效后每日计提,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。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

6.4.7.3 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度可比期间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。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 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 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
基金合同生效日(2008 年 6 月 27 日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	10,021,602.16	10,021,602.16
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,021,602.16	10,021,602.16
期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.15%	11.91%

注:基金管理人认购本基金的认购费符合基金招募说明书规定。

6.4.7.4.2 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

除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度可比期间均未投资本基金。

6.4.7.5 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 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	83,682,122.47	67,735.49	24,229,910.94	78,889.03

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公司,2011 年 1 月 1 日至 6 月 30 日度获得的利息收入为 2,908.98 元,(2010 年 1 月 1 日至 6 月 30 日获得的利息收入为 9,514.42 元),2011 年 6 月 30 日结算备付金余额为人民币 177,396.4 元(2010 年 6 月 30 日为人民币 712,044.16 元)。

6.4.7.6 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所承销证券。

6.4.8 期末本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

报告期末未持有新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

报告期末未持有流通受限股票

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

报告期末不存在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

报告期末不存在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券

§7 投资组合报告

7.1 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	119,081,648.82	33.90
	其中:股票	119,081,648.82	33.90
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	10,000,000.00	2.85
	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	83,859,518.87	23.87
6	其他各项资产	138,377,590.03	39.39
7	合计	351,318,757.72	100.00

7.2 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	-	-
B	采掘业	8,176,600.00	2.80
C	制造业	65,092,869.80	22.28
C0	食品、饮料	14,907,650.65	5.10
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	15,771,341.20	5.40
C7	机械、设备、仪表	24,156,727.98	8.27
C8	医药、生物制品	10,257,149.97	3.51
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,196,500.00	1.44
F	交通运输、仓储业	3,292,800.00	1.13
G	信息技术业	4,860,695.84	1.66
H	批发和零售贸易	1,942,739.00	0.67
I	金融、保险业	4,478,000.00	1.53
J	房地产业	17,677,274.18	6.05
K	社会服务业	5,316,000.00	1.82
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	4,048,170.00	1.39
	合计	119,081,648.82	40.77

7.3 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	600519	贵州茅台	28,000	5,953,640.00	2.04
2	601117	中国化学	600,000	5,316,000.00	1.82
3	600376	首开股份	399,908	5,282,784.68	1.81
4	600809	山西汾酒	70,825	4,961,291.25	1.70
5	600048	保利地产	450,000	4,945,500.00	1.69
6	002410	广联达	139,997	4,860,695.84	1.66
7	600267	海正药业	129,900	4,850,466.00	1.66
8	600585	海螺水泥	172,415	4,786,240.40	1.64
9	600395	盘江股份	140,000	4,646,600.00	1.59
10	300217	东方电热	159,950	4,635,351.00	1.59

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 http://www.wjasset.com 的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600395	盘江股份	9,339,769.10	12.83
2	600267	海正药业	8,890,380.51	12.21
3	600048	保利地产	8,366,473.73	11.49
4	000630	铜陵有色	6,941,885.54	9.54
5	600188	兖州煤业	6,543,784.45	8.99
6	601601	中国太保	6,509,411.21	8.94
7	600585	海螺水泥	6,499,599.64	8.93
8	000157	中联重科	6,309,788.78	8.67
9	600519	贵州茅台	6,162,923.00	8.47
10	600801	华新水泥	6,022,346.42	8.27
11	601678	滨化股份	5,455,407.25	7.50
12	600068	葛洲坝	5,397,702.96	7.42
13	601117	中国化学	5,288,105.24	7.27
14	300146	汤臣倍健	5,135,774.70	7.06
15	600376	首开股份	5,069,435.44	6.96
16	600809	山西汾酒	4,854,084.38	6.67
17	600031	三一重工	4,806,225.37	6.60
18	002410	广联达	4,755,779.49	6.53
19	000002	万 科 A	4,710,145.80	6.47
20	600104	上海汽车	4,490,632.22	6.17
21	300217	东方电热	4,393,339.08	6.04
22	002430	杭氧股份	4,244,302.09	5.83
23	000776	广发证券	4,156,782.42	5.71
24	600805	悦达投资	3,954,135.92	5.43
25	600594	益佰制药	3,933,569.08	5.40
26	002244	滨江集团	3,580,950.68	4.92
27	000877	天山股份	3,371,532.39	4.63
28	600029	南方航空	3,323,000.00	4.57
29	000937	冀中能源	3,305,501.79	4.54
30	601216	内蒙君正	3,211,609.78	4.41
31	601318	中国平安	3,133,148.91	4.30
32	600523	贵航股份	3,122,528.00	4.29
33	600089	特变电工	3,072,417.53	4.22
34	600589	广东榕泰	3,071,958.90	4.22
35	600549	厦门钨业	3,071,119.58	4.22
36	601179	中国西电	3,055,191.48	4.20
37	600362	江西铜业	2,916,482.96	4.01
38