万家180指数证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2011年10月25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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年10月24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2011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180指数
基金主代码	519180
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年3月17日
报告期末基金份额总额	9,651,114,267.76份
投资目标	本基金通过运用指数化投资方法,力求基金的股票组合收益率拟合上证180指数的增长率。伴随中国经济增长和资本市场的发展,实现利用指数化投资方法谋求基金资产长期增值的目标。
投资策略	本基金以跟踪目标指数为原则,实现与市场同步成长为基本理念。指数化投资是一种充分考虑投资者利益的投资方法,采取拟合目标指数收益率的投资策略,分散投资于目标指数所包含的股票中,力求股票组合的收益率拟合目标指数所代表的资本市场的平均收益率。
业绩比较基准	95%×上证180指数收益率+5%×银行同业存款利率
风险收益特征	本基金追踪上证180指数,是一种风险适中、长期资本收益稳健的投资产品,并具有长期稳定的投资风格
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§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(2011年7月1日至2011年9月30日)
1.本期已实现收益	–66,838,476.37
2.本期利润	–959,428,958.34
3.加权平均基金份额本期利润	–0.0998
4.期末基金资产净值	5,426,721,130.47
5.期末基金份额净值	0.5623

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。

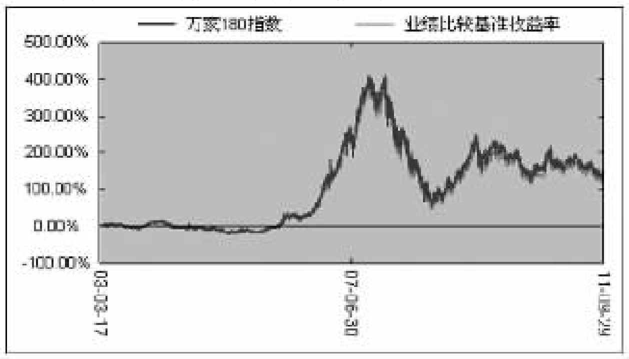
2、上表中本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	–15.06%	1.28%	–14.93%	1.28%	–0.13%	0.00%

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:本基金成立于2003年3月17日,建仓期为三个月,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。

§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		
吴涛	本基金基金经理、权益投资部副总监	2010年3月31日	–	16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、南方总部副总经理等职,2002年至2010年3月任万家基金管理有限公司监察稽核部总监,负责公司投资风险管理、监察稽核等工作。
欧庆铃	本基金基金经理、万家精选基金基金经理、本公司投资管理部总监	2007年5月31日	2011年8月13日	11年	理学博士,曾任华南理工大学应用数学系副教授、广州证券有限责任公司任研究中心常务副总经理、金鹰基金管理有限公司研究副总监、万家公用事业基金、万家双引擎基金基金经理等职

注:1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

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》、《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

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

在本报告期,我公司没有和本基金投资风格相似的其他投资组合品种。

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报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内市场大幅下跌,本基金作为被动操作的指数基金,严格执行基金合同规定的投资策略,按照规定的投资策略和方法进行投资操作,努力拟合标的指数,减小跟踪误差。

本基金报告期内日跟踪误差为0.01%,符合基金合同规定的日跟踪误差低于0.5%的规定。跟踪误差主要是由于基金申购赎回、标的指数成分股调整等因素所造成。

本基金标的指数所代表的大中盘蓝筹股具有一定的估值优势,有望在今后一段时间内取得较稳定的市场表现。本基金管理人将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,为基金份额持有人谋求长期、稳定回报。

4.5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0.5623元,本报告期份额净值增长率为–15.06%,业绩比较基准收益率–14.93%。

§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	5,150,821,393.04	94.77
	其中:股票	5,150,821,393.04	94.77
2	固定收益投资	119,310,585.00	2.20
	其中:债券	119,310,585.00	2.20
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	–	–
	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	161,192,868.25	2.97
6	其他资产	3,489,065.81	0.06
7	合计	5,434,813,912.10	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	34,481,782.20	0.64
B	采掘业	757,947,777.92	13.97
C	制造业	1,319,310,997.95	24.31
C0	食品、饮料	221,224,963.13	4.08
C1	纺织、服装、皮毛	33,773,062.96	0.62
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	60,806,067.03	1.12
C5	电子	36,047,712.51	0.66
C6	金属、非金属	368,121,410.60	6.78
C7	机械、设备、仪表	444,274,559.70	8.19
C8	医药、生物制品	136,469,124.30	2.51
C99	其他制造业	18,594,097.72	0.34
D	电力、煤气及水的生产和供应业	123,353,661.94	2.27
E	建筑业	178,764,712.68	3.29
F	交通运输、仓储业	196,636,616.13	3.62
G	信息技术业	167,992,894.56	3.10
H	批发和零售贸易	63,973,991.19	1.18
I	金融、保险业	1,924,806,820.85	35.47
J	房地产业	244,856,614.16	4.51
K	社会服务业	31,622,044.38	0.58
L	传播与文化产业	8,650,749.06	0.16
M	综合类	98,422,730.02	1.81
	合计	5,150,821,393.04	94.92

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	600036	招商银行	19,215,997	212,528,926.82	3.92
2	600016	民生银行	35,090,296	193,698,433.92	3.57
3	601318	中国平安	5,191,231	174,269,624.67	3.21
4	601328	交通银行	35,666,313	159,785,082.24	2.94
5	600000	浦发银行	17,405,885	148,646,257.90	2.74
6	601166	兴业银行	11,742,118	145,484,842.02	2.68
7	601088	中国神华	5,218,698	132,241,807.32	2.44
8	600519	贵州茅台	645,077	122,945,225.43	2.27
9	600030	中信证券	10,816,975	121,690,968.75	2.24
10	600837	海通证券	12,789,548	101,165,324.68	1.86

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	119,310,585.00	2.20
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	其他	–	–
9	合计	119,310,585.00	2.20

5.5 报告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

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	010203	02国债(3)	890,340	89,256,585.00	1.64
2	010112	21国债⑿	300,000	30,054,000.00	0.55

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	71,849.12
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	847,742.17
4	应收利息	1,895,659.81
5	应收申购款	673,814.71
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
8	其他	0.00
9	合计	3,489,065.81

5.8.4 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。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	9,537,870,597.19
报告期期间基金总申购份额	295,036,737.93
报告期期间基金总赎回份额	181,793,067.36
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"–"填列)	0.00
报告期期末基金份额总额	9,651,114,267.76

§7 备查文件目录

7.1备查文件目录

1、中国证监会批准万家180指数证券投资基金发行及募集的文件
2、《万家180指数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180指数证券投资基金2011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

7.2存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所,并登载于基金管理人网站:www.wjasset.com

7.3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
2011年10月25日

万家增强收益债券型证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2011年10月25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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年10月24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2011年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家增强收益债券
基金主代码	161902
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年9月28日
报告期末基金份额总额	609,662,113.36份
投资目标	在满足基金资产良好流动性的前提下,谋求基金资产的稳健增值。
投资策略	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,追求基金资产的长期稳定增值。并通过新股申购和投资于相对价值被低估的成长型股票谋取增强收益。
业绩比较基准	中证全债指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型和混合型基金,高于货币市场基金。
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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(2011年7月1日至2011年9月30日)
1.本期已实现收益	6,497,814.13
2.本期利润	–7,700,942.75
3.加权平均基金份额本期利润	–0.0118
4.期末基金资产净值	618,569,914.19
5.期末基金份额净值	1.0146

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。

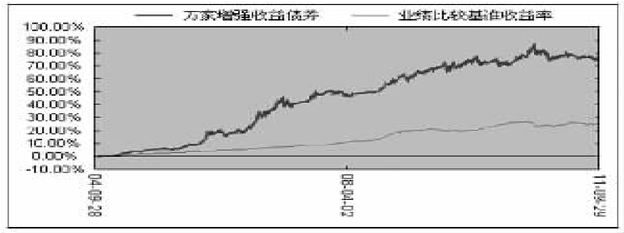
2、上表中本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	–1.27%	0.16%	0.03%	0.13%	–1.30%	0.03%

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:本基金成立于2004年9月28日,于2007年9月29日转型为债券型基金,转型后建仓期为半年,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		
朱颖	本基金基金经理	2010年8月4日	–	5年	中国科技大学硕士,2006年10月进入万家基金管理有限公司,担任行业分析师,基金经理助理等职务。2010年8月4日起任本基金基金经理,2011年3月起任万家红利基金基金经理。
孙驰	本基金基金经理、万家货币基金基金经理	2011年3月19日	–	4年	复旦大学硕士,2007年7月至2010年4月在中海信托股份有限公司从事固定收益投资研究工作,担任投资经理职务。2010年4月加入万家基金管理有限公司,历任固定收益研究员、基金经理助理。
李泽祥	本基金基金经理	2011年6月28日	–	3年	浙江大学世界经济博士,曾经在攀枝花钢铁公司从事技术与工艺工作5年。2008年3月起加入万家基金管理有限公司,从事证券投资和研究工作,历任研究发展部宏观策略分析师和钢铁、汽车行业分析

注:1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

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》、《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

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

在本报告期,我公司没有和本基金投资风格相似的其他投资组合品种。

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报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度,央行货币政策没有任何放松迹象,7月初天量的货币回笼以及8月末出台调整存款准备金缴款基数政策,均对市场资金面预期产生不利影响。回购利率长时间处于高位,最高时曾达到7%以上。高企的回购利率使得市场对债券需求很小,各品种收益率迅速上行,10年国债最高达4.1%以上,信用产品收益率更是屡创新高。9月份资金的紧张也导致转债市场出现暴跌,很多转债已经跌进债底区域。

本基金三季度净值增长为负,主要受整个债券市场下跌所致。但由于所持品种主要是利率产品及高等级信用债,城投债及转债相对而言比例较低,所以债券组合受市场下跌影响较小。股票方面,由于对股市一直持谨慎态度,股票仓位维持在比较低的水平,受股市下跌影响也相对有限。

4.5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1.0146元,本报告期份额净值增长率为–1.27%,同期业绩比较基准增长率为0.03%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下一阶段,资金面是决定债券市场走势的重要因素。基本面上,PMI、工业增加值等指标均显示经济处于缓慢下行走势;通胀压力有所缓解,将步入下行通道,市场对二者的预期均比较一致。就资金面而言,我们认为资金面最紧的时刻已经过去,虽然年内还需要补缴存款准备金,但央行也会通过公开市场操作来调节市场资金,其稳定资金面的意图非常明显。在这种情况下,7天回购利率可能会维持在4%上下,前期高涨的债券收益率就显的比较有吸引力。

基于以上的判断,四季度我们会对债券进行主动增持,主要以AA+以上高评级信用债券为主,同时也要拉长久期,期限以5年以上为主。对中低评级债券处于观望阶段,寻找机会。转债市场目前已经跌至底部,问题在于短期看不到趋势上涨的机会,同样密切关注,择机增持。

§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	40,690,967.44	5.71
	其中:股票	40,690,967.44	5.71
2	固定收益投资	503,439,403.60	70.59
	其中:债券	503,439,403.60	70.59
	资产支持证券	0.00	0.00
3	金融衍生品投资	0.00	0.00
4	买入返售金融资产	145,500,538.25	20.40
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	15,799,638.27	2.22
6	其他资产	7,732,064.81	1.08
7	合计	713,162,612.37	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	0.00	0.00
B	采掘业	0.00	0.00
C	制造业	25,233,747.04	4.08
C0	食品、饮料	3,155,219.04	0.51
C1	纺织、服装、皮毛	0.00	0.00
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	0.00	0.00
C5	电子	0.00	0.00
C6	金属、非金属	0.00	0.00
C7	机械、设备、仪表	22,078,528.00	3.57
C8	医药、生物制品	0.00	0.00
C99	其他制造业	0.00	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00
E	建筑业	0.00	0.00
F	交通运输、仓储业	0.00	0.00
G	信息技术业	15,457,220.40	2.50
H	批发和零售贸易	0.00	0.00
I	金融、保险业	0.00	0.00
J	房地产业	0.00	0.00
K	社会服务业	0.00	0.00
L	传播与文化产业	0.00	0.00
M	综合类	0.00	0.00
	合计	40,690,967.44	6.58

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	300068	南都电源	1,199,920	22,078,528.00	3.57
2	300098	高新兴	480,280	13,414,220.40	2.17
3	002157	正邦科技	325,616	3,155,219.04	0.51
4	002095	生意宝	150,000	2,043,000.00	0.33

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	33,909,562.50	5.48
2	央行票据	0.00	0.00
3	金融债券	100,800,000.00	16.30
	其中:政策性金融债	100,800,000.00	16.30
4	企业债券	219,928,349.00	35.55
5	企业短期融资券	89,749,000.00	14.51
6	中期票据	0.00	0.00
7	可转债	59,052,492.10	9.55
8	其他	0.00	0.00
9	合计	503,439,403.60	81.39

5.5 报告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

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	090213	09国开13	1,000,000	100,800,000.00	16.30
2	0411610001	11陕延油CP002	500,000	50,130,000.00	8.10
3	010203	02国债(3)	338,250	33,909,562.50	5.48
4	126011	08石化债	350,000	31,325,000.00	5.06
5	122065	11上港01	300,000	29,220,000.00	4.72

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	960,000.00
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	0.00
4	应收利息	6,625,414.81
5	应收申购款	146,650.00
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
8	其他	0.00
9	合计	7,732,064.81

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	23,657,400.00	3.82
2	110003	新钢转债	13,249,047.50	2.14
3	113002	工行转债	10,196,000.00	1.65
4	110016	川投转债	247,744.00	0.04
5	110011	歌华转债	145,366.20	0.02

5.8.5 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	300098	高新兴	13,414,220.40	2.17	重大资产重组事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	892,048,710.90
报告期期间基金总申购份额	13,231,040.27
报告期期间基金总赎回份额	295,617,637.81
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"–"填列)	0.00
报告期期末基金份额总额	609,662,113.36

§7 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、《万家增强收益债券型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及其他临时公告
5、万家增强收益债券型证券投资基金2011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办公场所,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
2011年10月25日

万家稳健增利债券型证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2011年10月25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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年10月24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2011年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家稳健增利债券	
基金主代码	519186	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年8月12日	
报告期末基金份额总额	219,966,411.16份	
投资目标	严格控制投资风险的基础上,追求稳定的当期收益和基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上,采取积极主动地投资管理策略,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、信用利差等影响债券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,把握各类套利的机会。在风险可控的前提下,实现基金收益的最大化。	
业绩比较基准	中国债券总指数	
风险收益特征	本基金是债券型证券投资基金,属于具有中低风险收益特征的基金品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	万家稳健增利债券A	万家稳健增利债券C
下属两级基金的交易代码	519186	519187
报告期末下属两级基金的份额总额	165,307,298.38份	54,659,112.78份

§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	万家稳健增利债券A报告期(2011年7月1日至2011年9月30日)	万家稳健增利债券C报告期(2011年7月1日至2011年9月30日)
1.本期已实现收益	–2,177,320.17	–1,455,962.22
2.本期利润	–13,646,652.20	–3,433,165.48
3.加权平均基金份额本期利润	–0.0588	–0.0517
4.期末基金资产净值	157,410,077.95	51,633,597.92
5.期末基金份额净值	0.9522	0.9446

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

万家稳健增利债券A

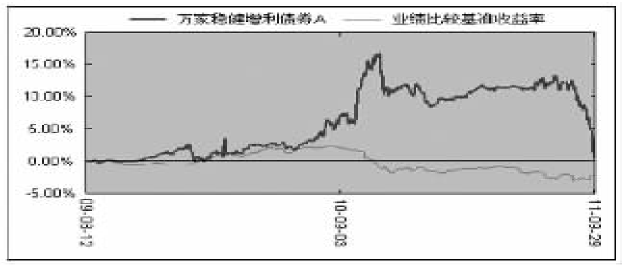
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
过去三个月	–8.78%	0.61%	–0.26%	0.13%	–8.52%	0.48%

万家稳健增利债券C

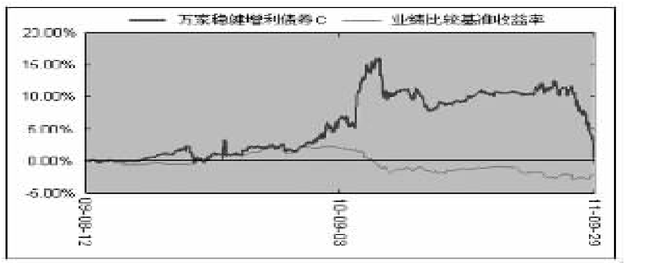
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
过去三个月	–8.80%	0.61%	–0.26%	0.13%	–8.54%	0.48%

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

万家稳健增利债券A



万家稳健增利债券C



注:本基金于2009年8月12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		
邹昱	本基金基金经理;万家货币基金基金经理;万家添利分级债券基金基金经理;固定收益部总监	2010年8月4日	–	5年	复旦大学硕士,曾在南京银行股份有限公司从事固定收益研究。2008年4月进入本公司,从事固定收益投资研究工作,并担任基金经理助理。

注:1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

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》、《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

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

在本报告期,我公司没有和本基金投资风格相似的其他投资组合品种。

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报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金三季度净值大幅下跌,主要原因有两点,首先,期初没有正确判断信用风险担忧会迅速上升,没有及时降低信用债的投资比例,因此季末基金持有的信用债出现较大幅度下跌。其次,因巨额赎回导致的新股仓位被动上升,在股市下跌的过程中也对净值造成了一定的负贡献。期间市场的波动和基金的赎回量均远超预期,二者叠加导致基金净值大跌。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,万家稳健增利债券A份额净值为0.9522元,本报告期份额净值增长率为–8.78%,业绩比较基准收益率–0.26%;万家稳健增利债券C份额净值为0.9446元,本报告期份额净值增长率为–8.80%,业绩比较基准收益率–0.26%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度经济增速继续缓慢回落,但CPI仍创出了新高,在经济增速稳定而通胀仍处于高位的情况下,紧缩政策维持了原有的力度,表现为地产、信贷受到严格控制,银行表外资产的扩张开始减速,部分表外资产被迫回流表内,降低了整个金融体系的杠杆率。加之地方融资平台违约风险的担忧蔓延到整个信用债市场,实体经济的的实际融资利率处于历史高位。由于房地产销售增速已经开始下降,外需迅速好转的可能性微小,因此未来经济增速加速下滑的概率较大。而通胀也会随之回落,CPI受基数效应的影响四季度将继续回落。

基于上述判断,我们认为经济增速和通胀的趋势性下滑对债券市场构成较强支撑,同时考虑到各金融机构在今年已经逐步调整了资产负债表的结构,实体经济的下滑也将减少对资金的需求,未来资金面也会好于三季度,债券市场将迎来趋势机会。但受制于投资者对信用风险的担忧,债券市场的行情也很可能是结构化的,信用风险较低的券种表现将更为突出。

经济增速回落并不支持股市持续上涨,因此可转债市场也会受到影响,但因为转债市场前期跌幅巨大,因此可以关注有债底价值保护的个券。

§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	25,926,343.80	8.78
	其中:股票	25,926,343.80	8.78
2	固定收益投资	235,051,793.30	79.64
	其中:债券	235,051,793.30	79.64
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	–	–
	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	25,519,656.16	8.65
6	其他资产	8,658,913.40	2.93
7	合计	295,156,706.66	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	采掘业	–	–
C	制造业	13,770,000.00	6.59
C0	食品、饮料	–	–
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	13,770,000.00	6.59
C6	金属、非金属	–	–
C7	机械、设备、仪表	–	–
C8	医药、生物制品	–	–
C99	其他制造业	–	–
D	电力、煤气及水的生产和供应业	–	–
E	建筑业	1,502,143.80	0.72
F	交通运输、仓储业	10,654,200.00	5.10
G	信息技术业	–	–
H	批发和零售贸易	–	–
I	金融、保险业	–	–
J	房地产业	–	–
K	社会服务业	–	–
L	传播与文化产业	–	–
M	综合类	–	–
	合计	25,926,343.80	12.40

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	300241	瑞丰光电	900,000	13,770,000.00	6.59
2	300240	飞力达	540,000	10,654,200.00	5.10
3	601886	江河幕墙	77,510	1,502,143.80	0.72

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	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	235,051,793.30	112.44
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	–	–
8	其他	–	–
9	合计	235,051,793.30	112.44

5.5 报告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

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	122958	09长经开	391,670	36,296,058.90	17.36
2	1180032	11鹰投债	300,000	29,604,000.00	14.16
3	1180033	11粤云浮债	300,000	29,598,000.00	14.16
4	1180044	11文登债	300,000	29,370,000.00	14.05
5	122834	11牡国投	267,640	23,279,327.20	11.14

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	8,389,627.68
5	应收申购款	19,285.72
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	8,658,913.40

5.8.4 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

5.8.5 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	300241	瑞丰光电	13,770,000.00	6.59	网下新股中签
2	300240	飞力达	10,654,200.00	5.10	网下新股中签
3	601886	江河幕墙	1,502,143.80	0.72	网下新股中签

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	万家稳健增利债券A	万家稳健增利债券C
报告期期初基金份额总额	386,194,592.54	61,522,289.40
报告期期间基金总申购份额	20,133,423.08	263,946,021.03
报告期期间基金总赎回份额	241,020,717.24	270,809,197.65
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"–"填列)	–	–
报告期期末基金份额总额	165,307,298.38	54,659,112.78

§7 备查文件目录

7.1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、《万家稳健增利债券型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、万家稳健增利债券型证券投资基金2011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。

7.2存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所,并登载于基金管理人网站:<www.wjasset.com>

7.3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
2011年10月25日

万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011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:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2011年10月25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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年10月24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2011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
报告期末基金份额总额	85,864,611.07份
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。
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

§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(2011年7月1日至2011年9月30日)
1.本期已实现收益	1,106,920.29
2.本期利润	–3,670,341.30
3.加权平均基金份额本期利润	–0.0365
4.期末基金资产净值	73,707,696.27
5.期末基金份额净值	0.8584

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。

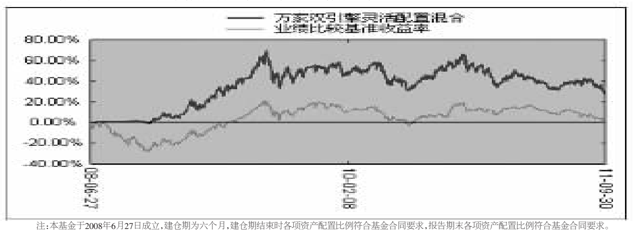
2、上表中本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益.

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	–6.58%	0.92%	–8.95%	0.79%	2.37%	0.13%

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:本基金于2008年6月27日成立,建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同要求,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		
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。

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》、《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

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	–6.58%
万家和谐增长混合型证券投资基金	–12.26%
差异	5.68%

基金间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

2011年三季度,国内A股市场大幅下跌。主要原因在于通胀形势严峻,货币政策不断收紧,同时经济数据不断走低使得市场对于经济二次探底的担忧越加强烈,另一方面,欧债危机愈演愈烈,美国经济也不如预期。

期间,本基金操作主要以调整结构为主,大幅度减持了周期类股票,而重点配置消费类与高增长的个股。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,这些情况都加深了经济增速下滑的风险,而转型中的优势企业则展现出了明确的增长潜力。

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0.8584元,本报告期份额净值增长率为–6.58%,业绩比较基准收益率为–8.95%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度市场,我们认为在宏观经济层面,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,但是大概率上仍然是软着陆的格局,而欧美的危机则会呈现出不断折腾的局面。

总体来看,市场经历了前期剧烈的下跌,风险得到了逐步释放,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,双引擎四季度第一方面是寻找前期跌幅较大的板块,市场经过大幅回调,很多个股已经进入了相对的价值区间;第二方面是坚定选择确定性高增长的板块与个股,在宏观经济与市场不断波动之中,具备强大竞争力的优秀企业才是真正穿越周期的长期优胜者。

§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	49,337,654.41	66.40
	其中:股票	49,337,654.41	66.40
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	–	–
	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	23,051,255.91	31.02
6	其他资产	1,918,229.75	2.58
7	合计	74,307,140.07	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	2,008,800.00	2.73
B	采掘业	1,932,420.00	2.62
C	制造业	36,056,244.41	48.92
C0	食品、饮料	7,959,410.86	10.80
C1	纺织、服装、皮毛	3,937,200.00	5.34
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	–	–
C4	石油、化学、塑胶、塑料	–	–
C5	电子	6,443,893.60	8.74
C6	金属、非金属	692,400.00	0.94
C7	机械、设备、仪表	9,972,700.00	13.53
C8	医药、生物制品	7,050,639.95	9.57
C99	其他制造业	–	–
D	电力、煤气及水的生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	交通运输、仓储业	–	–
G	信息技术业	2,993,600.00	4.06
H	批发和零售贸易	3,938,340.00	5.34
I	金融、保险业	–	–
J	房地产业	–	–
K	社会服务业	–	–
L	传播与文化产业	2,408,250.00	3.27
M	综合类	–	–
	合计	49,337,654.41	66.94

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	002236	大华股份	65,000	2,767,700.00	3.75
2	300146	汤臣倍健	37,000	2,514,890.00	3.41
3	002293	罗莱家纺	30,000	2,490,000.00	3.38
4	600519	贵州茅台	13,000	2,477,670.00	3.36
5	300058	蓝色光标	97,500	2,408,250.00	3.27
6	002410	广联达	70,000	2,401,700.00	3.26
7	002099	海翔药业	120,000	2,385,600.00	3.24
8	002535	林州重机	150,000	2,355,000.00	3.20
9	002563	森马服饰	42,000	2,119,740.00	2.88
10	600422	昆明制药	150,000	2,106,000.00	2.86

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	500,000.00
2	应收证券清算款	1,391,593.39
3	应收股利	–
4	应收利息	4,387.62
5	应收申购款	22,248.74
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	1,918,229.75

5.8.4 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。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	317,875,741.15
报告期期间基金总申购份额	3,720,069.20
报告期期间基金总赎回份额	235,731,199.28
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"–"填列)	–
报告期期末基金份额总额	85,864,611.07

§7 备查文件目录

7.1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、《万家双引擎灵活配置混合型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、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金2011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。

7.2存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所,并登载于基金管理人网站:<www.wjasset.com>

7.3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
2011年10月25日