万家180指数证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013年6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:2013年7月17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2013年7月15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2013年4月1日起至6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
交易代码	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	5,924,250,669.73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(2013年4月1日 - 2013年6月30日)
1.本期已实现收益	-44,079,630.48
2.本期利润	-329,899,315.79
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0544
4.期末基金资产净值	3,016,510,099.25
5.期末基金份额净值	0.5092

注:1、上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(例如,开放式基金的申购、赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

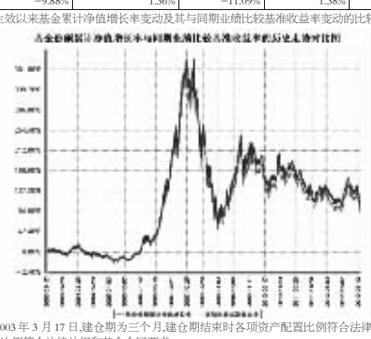
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-9.88%	1.36%	-11.09%	1.38%	1.21%	-0.02%

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、万家中证红利基金基金经理、万家中证创业成长指数分级基金基金经理、量化投资部总监	2010年3月31日	-	17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、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

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《公平交易管理办法》和《异常交易监控及报告管理办法》等规章制度,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,确保公平对待不同投资组合,防范导致不公平交易以及利益输送的异常交易发生。

公司制订了明确的投资授权制度,并建立了统一的投资管理平台,确保不同投资组合获得公平的投资决策机会。实行集中交易制度,对于交易所公开竞价交易,执行交易系统中的公平交易程序;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,按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;对于银行间交易,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。为保证公平交易原则的实现,通过制度规范、流程审批、系统风控参数设置等进行事前控制,通过对投资交易系统的实时监控进行事中控制,通过对异常交易的监控和分析实现事后控制。

4.3.2 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 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

二季度市场市场结构分化特征进一步加剧,期间沪深300指数下跌11.8%,同期创业板指数涨幅超16.76%,转型预期主导市场的风格。市场在5月份进入一轮明显的热点轮动,但其后6月份个股分化加剧,流动性的变化成为主导因素。分化的市场结构,充分体现了市场参与者对未来经济发展方向的预期,和对不同企业盈利前景的预期。行业配置上延续了重点布局了建筑、医药和电子,基金资产组合中以成长和大消费类为核心资产,在5-6月份期间大幅度减持了电子的持仓,整体仓位略降。整体方向上基本正确,但组合中与投资相关度较高的企业估值波动比较显著,造成净值波动较大。二季度净值正收益,较大超越基准。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	9,589,415.41	0.32
B	采矿业	243,302,107.35	8.07
C	制造业	734,128,231.62	24.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	91,375,559.22	3.03
E	建筑业	105,009,137.71	3.48
F	批发和零售业	31,262,023.68	1.04
G	交通运输、仓储和邮政业	59,634,186.96	1.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	63,279,502.45	2.10
J	金融业	1,230,422,585.02	40.79
K	房地产业	146,344,837.32	4.85
L	租赁和商务服务业	12,859,569.90	0.43
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	5,575,098.33	0.18
S	综合	39,946,376.80	1.32
	合计	2,772,728,631.77	91.92

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	20,518,347	175,842,233.79	5.83
2	600036	招商银行	13,326,412	154,586,379.20	5.12
3	601318	中国平安	2,982,167	103,660,124.92	3.44
4	601166	兴业银行	6,740,114	99,551,483.78	3.30
5	600000	浦发银行	9,931,477	82,232,629.56	2.73
6	600519	贵州茅台	367,986	70,789,466.82	2.35
7	601328	交通银行	17,346,173	70,598,924.11	2.34
8	600837	海通证券	7,379,452	69,219,259.76	2.29
9	600030	中信证券	6,306,442	63,884,257.46	2.12
10	601288	XD农业银	22,316,162	54,897,758.52	1.82

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	99,680,000.00	3.30
3	金融债券	29,835,000.00	0.99
	其中:政策性金融债	29,835,000.00	0.99
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	61,637,565.90	2.04
8	其他	-	-
9	合计	191,152,565.90	6.34

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	1001079	10央行票据79	1,000,000	99,680,000.00	3.30
2	113002	工行转债	449,330	49,147,715.40	1.63
3	130201	13国开01	300,000	29,835,000.00	0.99
4	110022	同仁转债	96,350	12,489,850.50	0.41

注:本基金本报告期末仅有上述债券投资持仓。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和拟益明细

本基金本报告期末未持有股指期货.

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同,本基金暂不能投资于股指期货.

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.9.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,608,606.64
2	应收证券清算款	23,507,284.80
3	应收股利	13,021,794.49
4	应收利息	2,900,265.71
5	应收申购款	511,604.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,549,555.70

5.9.4 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	110022	同仁转债	12,489,850.50	0.41
2	113002	工行转债	49,147,715.40	1.63

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.9.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.9.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	6,270,106,194.80
本报告期基金总申购份额	121,577,583.78
减:本报告期基金总赎回份额	467,433,108.85
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,924,250,669.73

§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2013年第二季度报告原文

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
2013年7月17日

万家和谐增长混合型证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013年6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:2013年7月17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2013年7月15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,投资者在做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2013年4月1日起至2013年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家和谐增长混合
基金主代码	519181
交易代码	519181
前端交易代码	519181
后端交易代码	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
报告期末基金份额总额	3,119,176,237.20份
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。
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(2013年4月1日 - 2013年6月30日)
1.本期已实现收益	58,338,617.81
2.本期利润	-28,841,768.82
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0092
4.期末基金资产净值	1,647,400,773.38
5.期末基金份额净值	0.5282

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;

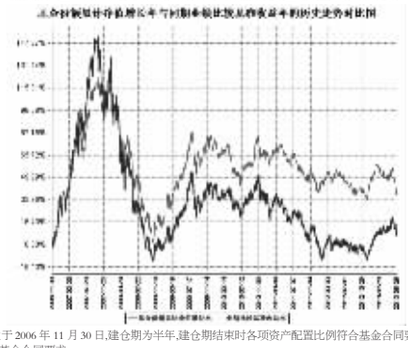
(2)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 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	-1.57%	1.18%	-7.43%	0.95%	5.86%	0.23%

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2006年11月30日,建仓期为半年,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		
刘芳洁	本基金基金经理、投资总监、总经理助理	2013年6月1日	-	8年	硕士研究生,2004年6月进入易方达基金管理有限公司工作,历任行业研究员、基金经理。2012年11月加入万家基金,现任本公司投资总监、总经理助理。
华光磊	本基金基金经理、研究总监	2013年1月4日	-	8年	学士学位,2004年8月进入光大证券研究所工作,于2008年获得新财富房地产行业最佳分析师第三名(团队);2008年12月加入光大证券资产管理总部,2009年9月加入天弘基金,分别担任研究员、基金经理助理等职务;2011年5月加入万家基金,先后担任研究总监助理、研究总监等职务。
宁冬莉	本基金基金经理	2011年6月3日	-	6年	博士学位、曾任东方证券管理有限公司宏观与股票策略高级分析师。2008年4月加入万家基金管理有限公司,曾担任行业研究员、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

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《公平交易管理办法》和《异常交易监控及报告管理办法》等规章制度,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,确保公平对待不同投资组合,防范导致不公平交易以及利益输送的异常交易发生。

公司制订了明确的投资授权制度,并建立了统一的投资管理平台,确保不同投资组合获得公平的投资决策机会。实行集中交易制度,对于交易所公开竞价交易,执行交易系统中的公平交易程序;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,按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;对于银行间交易,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。为保证公平交易原则的实现,通过制度规范、流程审批、系统风控参数设置等进行事前控制,通过对投资交易系统的实时监控进行事中控制,通过对异常交易的监控和分析实现事后控制。

4.3.2 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 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

2013年二季度,市场先扬后抑,6月开始出现了大幅下跌,经济持续下行伴随6月初开始的资金面异常紧张,使得市场出现重挫.同时,对IPO重启的担忧以及美国QE政策的退出预期,投资者风险偏好显著下降,市场陷入震荡格局。在行业表现上差异也非常显著,TMT,医药,食品饮料等表现优异,而传统周期股煤炭,有色,钢铁,化工等负收益明显。从风格上来看,中小板、创业板指相对较好,大盘股指则很弱。

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0.5282元,本报告期份额净值增长率为-1.57%,业绩比较基准收益率为-7.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,宏观经济整体在仍存在下行的较大不确定性。主要工业部门受制于库存和产能情况,价格上升和盈利改善的空间有限。我们总体认为整体宏观背景还是不支持股市整体趋势性反转,但经济逐步探明底部可以对股市形成底部起到支撑作用。

基于经济指标仍不稳定,本基金以精选个股和防御为主要策略,增加了食品饮料,医药等大消费板块中的优质个股.

工业品价格下行、企业盈利受压制以及经济总量放缓收缩的趋势还将在7月延续,并在9月之前难以看到反转要素出现。但是,经济上未来两个月需要越来越多的将注意力转向政策变化,包括经济下行时期开始逐步展现的稳增长政策、预期在三季度最终公布的城镇化规划和10月进行的三中全会。货币市场近期的波动仅是市场层面的,未来针对资金业务、同业业务和表外融资的政策变化对经济的实际影响会较货币市场波动更大。从短期趋势来看,二季度经济整体上可能依然处于下行通道。从长期来看,新一届政府体制改革有利于经济结构的优化,虽然必须付出经历经济可能短期弱势下行的阵痛,但有助于提高市场未来的估值中枢。

投资策略偏向均衡配置.配置方向:(1)医药,食品饮料中业绩优异,稳定增长前景广阔的个股仍值得重点配置;(2)智慧城市(3)传媒以及消费电子(4)节能环保,(5)金融地产。在个股选择上稳定成长股仍然是是较好的穿越周期的品种。二季度主要关注半年业绩优质的个股以及政策倾向的变化以及关注的主题板块. 从中长期角度,我们认为改革与民生是贯穿未来市场的持续重要主题。另外,食品安全、能源、环保,新型城镇化等投资主线也是重点关注的方向。

§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	1,252,462,840.64	75.80
	其中:股票	1,252,462,840.64	75.80
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	110,050,848.60	6.66
6	其他资产	289,877,611.95	17.54
7	合计	1,652,391,301.19	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	采矿业	-	-
C	制造业	827,547,337.99	50.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	113,894,731.08	6.91
F	批发和零售业	44,557,008.00	2.70
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	50,872,322.16	3.09
J	金融业	-	-
K	房地产业	139,537,767.18	8.47
L	租赁和商务服务业	31,672,315.80	1.92
M	科学研究和技术服务业	26,580,518.43	1.61
N	水利、环境和公共设施管理业	145,215.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,103,625.00	0.13
S	综合	15,552,000.00	0.94
	合计	1,252,462,840.64	76.03

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	601886	江河创建	7,540,459	91,993,599.80	5.58
2	600887	伊利股份	2,806,217	87,778,467.76	5.33
3	300006	莱美药业	2,776,800	61,172,904.00	3.71
4	000002	万 科A	5,999,931	59,099,320.35	3.59
5	600521	华海药业	3,221,691	49,130,787.75	2.98
6	600436	片仔癀	330,000	43,718,400.00	2.65
7	600600	青岛啤酒	1,105,304	41,979,445.92	2.55
8	000848	承德露露	1,745,000	39,628,950.00	2.41
9	000895	双汇发展	984,024	37,825,882.56	2.30
10	000651	格力电器	1,500,000	37,590,000.00	2.28

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末本基金未持有债券。

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

报告期末本基金未持有债券。

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

报告期末本基金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

报告期末本基金未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和拟益明细

报告期末本基金未持有股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同,本基金暂不可投资于股指期货。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

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。

5.9.2

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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,635,933.99
2	应收证券清算款	288,136,646.47
3	应收股利	-
4	应收利息	89,274.17
5	应收申购款	15,757.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	289,877,611.95

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有可转换债券。

5.9.5 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	601886	江河创建	91,993,599.80	5.58	非公开发行股票停牌
2	600436	片仔癀	43,718,400.00	2.65	配股期间停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	3,179,787,159.47
本报告期基金总申购份额	188,476,597.62
减:本报告期基金总赎回份额	249,087,519.89
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,119,176,237.20

§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和谐增长混合型证券投资基金发行及募集的文件。

2、《万家和谐增长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及其他临时公告。

5、万家和谐增长混合型证券投资基金2013年第二季度报告原文。

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:<http://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
2013年7月17日

万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013年6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:2013年7月17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2013年7月15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,投资者在做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2013年4月1日起至6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
交易代码	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	59,167,617.25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(2013年4月1日 - 2013年6月30日)
1.本期已实现收益	4,222,088.34
2.本期利润	864,152.21
3.加权平均基金份额本期利润	0.0132
4.期末基金资产净值	54,696,483.28
5.期末基金份额净值	0.9244

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。

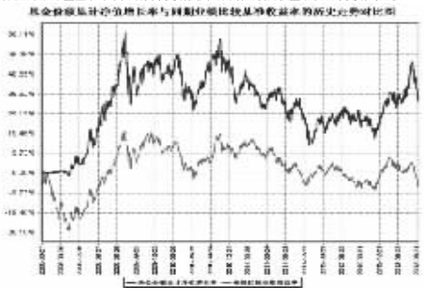
2、上表中本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	0.31%	1.30%	-6.81%	0.87%	7.12%	0.43%

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基金基金经理,万家精选股票型基金基金经理,权益投资部副总监	2010年7月3日	-	6	硕士学位,2006年加入万家基金,曾担任研究发展部行业分析师、基金经理助理。
朱颖	本基金基金经理,万家公用事业行业股票型基金基金经理	2012年2月4日	-	6	硕士学位,2006年10月加入万家基金管理有限公司,曾担任行业分析师,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

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《公平交易管理办法》和《异常交易监控及报告管理办法》等规章制度,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,确保公平对待不同投资组合,防范导致不公平交易以及利益输送的异常交易发生。

公司制订了明确的投资授权制度,并建立了统一的投资管理平台,确保不同投资组合获得公平的投资决策机会。实行集中交易制度,对于交易所公开竞价交易,执行交易系统中的公平交易程序;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,按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;对于银行间交易,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。为保证公平交易原则的实现,通过制度规范、流程审批、系统风控参数设置等进行事前控制,通过对投资交易系统的实时监控进行事中控制,通过对异常交易的监控和分析实现事后控制。

4.3.2 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 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

二季度市场市场结构分化特征进一步加剧,期间沪深300指数下跌11.8%,同期创业板指数涨幅超16.76%,转型预期主导市场的风格。市场在5月份进入一轮明显的热点轮动,但其后6月份个股分化加剧,流