万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金

2013 半年度 报告摘要

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
送出日期:2013年8月28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2013年8月23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2013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	59,167,617.25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		95538转6、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	上海市浦东新区浦电路360号陆家嘴投资大厦9楼

§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(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	7,433,319.71
本期利润	4,532,228.98
加权平均基金份额本期利润	0.0616
本期基金份额净值增长率	5.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0756
期末基金资产净值	54,696,483.28
期末基金份额净值	0.9244

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。

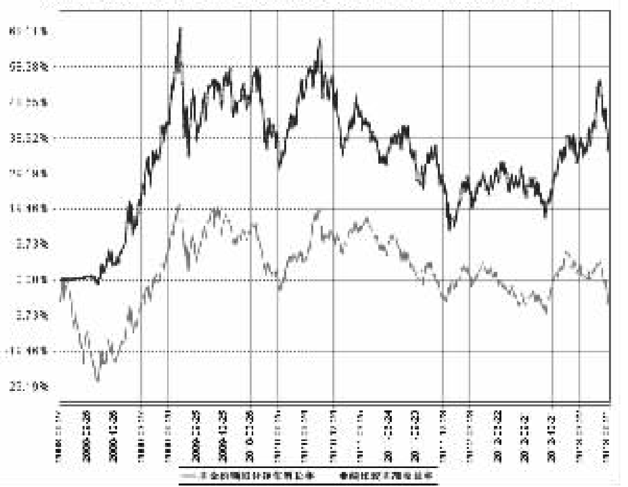
3.2 基金净值表现

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	-10.87%	1.47%	-9.44%	1.12%	-1.43%	0.35%
过去三个月	0.31%	1.30%	-6.81%	0.87%	7.12%	0.43%
过去六个月	5.94%	1.23%	-6.96%	0.90%	12.90%	0.33%
过去一年	5.56%	1.08%	-4.77%	0.82%	10.33%	0.26%
过去三年	3.88%	1.08%	-3.65%	0.82%	7.53%	0.26%
自基金合同生效起至今	37.07%	1.14%	-5.44%	1.07%	42.51%	0.07%

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、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,住所地及办公地点均为上海市浦东新区浦电路360号9楼,注册资本1亿元人民币。目前管理是十五只开放式基金,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、万家添利分级债券型证券投资基金、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14天理财债券型证券投资基金、万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金和万家强化收益定期开放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基金基金经理,万家精选股票型基金基金经理	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、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

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 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

2013年上半年A股市场发生剧烈的结构分化。沪深300指数处于下跌趋势中,中小板指数微涨,而创业板指数则持续上升。结构性机会在行业上体现为TMT、医药、环保等方向,比较符合管理人在2012年报中做出的预判,但大盘的持续下跌超出预期,源于经济的下行惯性明显超过了管理人年初较为乐观的预期。

实际操作中,基金管理人坚持在投研团队的充分研究基础上,集中于两类标的进行投资:一是符合中国社会和经济中长期发展方向的优质企业,二是在经历过去的经济大周期波动后,占据明显优势的行业龙头企业。在行业配置上以电子、医药、建筑装饰较为集中,同时规避景气度在下行中的一些强周期的行业。这部分投资在今年获得较好的正收益,大幅超于指数和基准。另外,根据市场阶段性演变,管理人努力在主题投资上做出一些积极的应对,阶段性的重点配置了军工和环保,该部分主题投资整体的正贡献不明显,且造成了业绩短期的波动较大。

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0.9244元,本报告期份额净值增长率为5.94%,业绩比较基准收益率为-6.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

管理人维持在年初对于经济和政治周期的整体判断:新的政治周期的起点和经济周期的转换期。下半年市场面临的最重要变化是对货币政策和流动性的预期恶化,经济整体的不确定性加大。金融市场监管的进一步完善发展也在短期内对市场流动性造成一定的影响。

我们对于未来主要机会存在的主要方向判断未发生变化,各种提高经济效率的新兴产业、收入分配变化后受益的消费品类、经济要素配置方向变化带来的新机会。在上半年我们在另一个长期机会的方向不够重视,即满足新一代年轻群体诉求的服务业,未来我们会加强这方面的研究。另一类机会是风险释放充分的行业龙头,如经历了彻底去产能的光伏行业中未来的领军企业 。

经历了上半年的结构性行情后,市场目前在成长股标的上整体估值水平和隐含预期都过高,而流动性的预期变化对高估值构成较大的潜在风险,因此下半年市场风险较上半年大。未来管理人将更加审慎,严格甄别风险,挑选出真正可持续的成长标的。我们将加大一些新兴产业方向和盈利模式研究上的投入,争取在2013年下半年为持有人创造更多的价值,贡献更好的收益。

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

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,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:2013年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资 产:		
银行存款	7,965,444.39	6,759,639.51
结算备付金	208,731.42	37,164.43
存出保证金	117,758.21	500,000.00
交易性金融资产	33,504,189.03	44,568,370.71
其中:股票投资	33,504,189.03	37,775,068.71
基金投资	-	-
债券投资	-	6,793,302.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	15,800,000.00	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	22,929.79	251,371.76
应收股利	-	-
应收申购款	11,824.83	5,002,165.56
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	57,630,877.67	57,118,711.97
负债和所有者权益	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012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	2,581,323.68	-
应付赎回款	6,215.69	33,294.67
应付管理人报酬	71,540.15	62,963.52
应付托管费	11,923.35	10,493.95
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	74,860.33	90,742.59
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	188,531.19	360,044.38
负债合计	2,934,394.39	557,539.11
所有者权益:		
实收基金	59,167,617.25	64,822,254.60
未分配利润	-4,471,133.97	-8,261,081.74
所有者权益合计	54,696,483.28	56,561,172.86
负债和所有者权益总计	57,630,877.67	57,118,711.97

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.9244元,基金份额总额59,167,617.25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: 2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	5,808,306.81	2,999,660.34
1.利息收入	284,216.69	209,262.48
其中:存款利息收入	109,950.99	97,434.21
债券利息收入	145,399.71	96,175.50
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	28,865.99	15,652.77
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	8,349,551.00	2,418,500.66
其中:股票投资收益	7,773,375.73	464,068.16
基金投资收益	-	-
债券投资收益	267,695.84	1,564,817.49
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	308,479.43	389,615.01
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-2,901,090.73	348,228.89
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	75,629.85	23,668.31
减:二、费用	1,276,077.83	1,298,300.01
1.管理人报酬	518,418.06	407,116.35
2.托管费	86,403.01	67,852.74
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	483,110.27	646,717.99
5.利息支出	-	3,480.87
其中:卖出回购金融资产支出	-	3,480.87
6.其他费用	188,146.49	173,132.06
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	4,532,228.98	1,701,360.33
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	4,532,228.98	1,701,360.33

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:2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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)	64,822,254.60	-8,261,081.74	56,561,172.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,532,228.98	4,532,228.98
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)	-5,654,637.35	-742,281.21	-6,396,918.56
其中:1.基金申购款	63,869,302.54	-4,967,654.76	58,901,647.78
2.基金赎回款	-69,523,939.89	4,225,373.55	-65,298,566.34
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)	59,167,617.25	-4,471,133.97	54,696,483.28
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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)	81,781,863.68	-12,432,150.37	69,349,713.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,701,360.33	1,701,360.33
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)	-22,655,672.00	3,379,459.10	-19,276,212.90
其中:1.基金申购款	2,052,147.16	-337,000.65	1,715,146.51
2.基金赎回款	-24,707,819.16	3,716,459.75	-20,991,359.41
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)	59,126,191.68	-7,351,330.94	51,774,860.74

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	李杰	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

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3号《半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2013年6月30日的财务状况以及2013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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 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、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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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 [2008]132号《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》,自2008年10月9日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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

1、本报告期内,新疆国际实业股份有限公司受让上海久事公司和深圳市中航投资管理有限公司持有的本基金管理人万家基金管理有限公司各20%的股权,该两起股权转让事项于2013年2月经中国证券监督管理委员会核准,并已办理完毕工商变更登记手续。本次股权转让后,基金管理人的股权结构变更为:齐鲁证券有限公司持股49%,新疆国际实业股份有限公司持股40%,山东省国有资产投资控股有限公司持股11%。

2、报告期内,基金管理人子公司万家共赢资产管理有限公司于2013年2 月正式成立,基金管理人持有其51%股份。

6.4.7.2 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、基金发起人、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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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。

6.4.8.1 关联方报酬

6.4.8.1.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	518,418.06	407,116.35
其中:支付销售机构的客户维护费	87,995.35	48,937.21

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。

6.4.8.1.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	86,403.01	67,852.74

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前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。

6.4.8.1.3 销售服务费

无。

6.4.8.2 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。

6.4.8.3 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.3.1 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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	16.94%	16.95%

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。

6.4.8.3.2 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

注: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。

6.4.8.4 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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	7,965,444.39	106,454.99	5,066,107.54	94,230.11

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,2013年1月1日至6月30日度获得的利息收入为2,670.72元,(2012年1月1日至6月30日获得的利息收入为3,203.47元),2013年6月30日结算备付金余额为人民币208,731.42元(2012年6月30日为人民币238,253.09元)。

6.4.8.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注: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。

6.4.9 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
000999	华润三九	2013年6月3日	重大事项停牌	26.55	2013年8月19日	26.51	40,000	1,063,658.20	1,062,000.00	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金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	33,504,189.03	58.14
	其中:股票	33,504,189.03	58.14
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	15,800,000.00	27.42
	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	8,174,175.81	14.18
6	其他各项资产	152,512.83	0.26
7	合计	57,630,877.67	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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	15,970,306.24	29.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,962,582.79	14.56
F	批发和零售业	2,481,300.00	4.54
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	2,745,500.00	5.02
J	金融业	2,385,100.00	4.36
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,959,400.00	3.58
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	33,504,189.03	61.25

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	002063	远光软件	190,000	2,745,500.00	5.02
2	601117	中国化学	260,000	2,475,200.00	4.53
3	002663	普邦园林	140,000	2,109,800.00	3.86
4	002271	东方雨虹	110,000	2,035,000.00	3.72
5	002482	广田股份	90,000	1,890,000.00	3.46
6	300241	瑞丰光电	149,988	1,882,349.40	3.44
7	002140	东华科技	59,959	1,487,582.79	2.72
8	601258	庞大集团	250,000	1,477,500.00	2.70
9	600030	中信证券	140,000	1,418,200.00	2.59
10	600079	人福医药	50,000	1,304,000.00	2.38

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于万家基金管理有限公司网站的半年度报告正文。

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	002241	歌尔声学	4,794,692.63	8.48
2	600383	金地集团	4,200,448.12	7.43
3	002063	远光软件	3,646,429.34	6.45
4	002477	雏鹰农牧	3,498,484.37	6.19
5	000100	TCL 集团	3,438,125.00	6.08
6	300241	瑞丰光电	3,418,954.75	6.04
7	600048	保利地产	3,171,135.00	5.61
8	600511	国药股份	3,092,268.56	5.47
9	000999	华润三九	3,013,870.98	5.33
10	002482	广田股份	3,010,091.22	5.32
11	600062	华润双鹤	2,996,335.00	5.30
12	002385	大北农	2,982,913.91	5.27
13	000562	宏源证券	2,951,630.42	5.22
14	600223	鲁商置业	2,935,725.58	5.19
15	000401	冀东水泥	2,876,131.90	5.08
16	002663	普邦园林	2,837,351.21	5.02
17	600401	海润光伏	2,743,494.79	4.85
18	000970	中科三环	2,694,497.60	4.76
19	600079	人福医药	2,694,280.47	4.76
20	601788	光大证券	2,676,100.00	4.73
21	002234	民和股份	2,640,533.71	4.67
22	601117	XD中国化	2,525,500.00	4.47
23	002262	恩华药业	2,412,679.35	4.27
24	600409	三友化工	2,327,206.39	4.11
25	300210	森远股份	2,313,124.20	4.09
26	002568	百润股份	2,312,707.85	4.09
27	600720	祁连山	2,305,400.00	4.08
28	601233	桐昆股份	2,237,126.00	3.96
29	002557	洽洽食品	2,101,860.08	3.72
30	002146	荣盛发展	2,049,000.00	3.62
31	000951	中国重汽	2,042,449.01	3.61
32	601555	东吴证券	2,019,643.90	3.57
33	002400	省广股份	2,009,849.33	3.55
34	002271	东方雨虹	2,002,889.40	3.54
35	000961	中南建设	2,001,710.46	3.54
36	000848	承德露露	1,956,515.53	3.46
37	600030	中信证券	1,934,751.50	3.42
38	002140	东华科技	1,919,544.00	3.39
39	600372	中航电子	1,885,996.02	3.33
40	600109	国金证券	1,884,160.00	3.33
41	002277	友阿股份	1,843,760.14	3.26
42	002007	华兰生物	1,813,000.00	3.21
43	300187	永清环保	1,700,341.64	3.01
44	002431	棕榈园林	1,688,595.36	2.99
45	300058	蓝色光标	1,654,290.75	2.92
46	601258	庞大集团	1,625,414.00	2.87
47	600118	中国卫星	1,609,909.90	2.85
48	002332	仙琚制药	1,540,199.00	2.72
49	002041	登海种业	1,522,794.00	2.69
50	300054	鼎龙股份	1,501,829.00	2.66
51	600280	南京中商	1,454,974.22	2.57
52	300159	新研股份	1,447,683.79	2.56
53	000063	中兴通讯	1,441,937.36	2.55
54	002672	东江环保	1,422,947.86	2.52
55	300015	爱尔眼科	1,410,331.00	2.49
56	300309	吉艾科技	1,383,362.15	2.45
57	600420	现代制药	1,358,070.36	2.40
58	002437	誉衡药业	1,313,616.80	2.32
59	002064	华峰氨纶	1,294,395.50	2.29
60	000826	桑德环境	1,249,436.87	2.21
61	600435	北方导航	1,206,354.67	2.13
62	000625	长安汽车	1,200,081.40	2.12
63	600316	洪都航空	1,191,800.00	2.11
64	002465	海格通信	1,190,139.88	2.10

7.4.2 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	002241	歌尔声学	5,516,662.39	9.75
2	002477	雏鹰农牧	4,810,119.50	8.50
3	000848	承德露露	4,341,916.12	7.68
4	600383	金地集团	3,873,100.00	6.85
5	002385	大北农	3,624,813.72	6.41
6	000826	桑德环境	3,473,430.36	6.14
7	300241	瑞丰光电	3,261,393.67	5.77
8	600280	南京中商	3,218,405.63	5.69
9	002041	登海种业	3,178,454.66	5.62
10	600062	华润双鹤	2,993,984.99	5.29
11	000625	长安汽车	2,976,263.75	5.26
12	000961	中南建设	2,873,404.29	5.08
13	600223	鲁商置业	2,810,271.60	4.97
14	002234	民和股份	2,690,614.23	4.76
15	000970	中科三环	2,675,854.66	4.73
16	600048	保利地产	2,659,661.76	4.70
17	002568	百润股份	2,604,334.56	4.60
18	000401	冀东水泥	2,593,939.36	4.59
19	600409	三友化工	2,566,611.52	4.54
20	601788	光大证券	2,535,788.61	4.48
21	002262	恩华药业	2,513,213.40	4.44
22	300210	森远股份	2,508,143.21	4.43
23	600720	祁连山	2,295,705.29	4.06
24	300253	卫宁软件	2,279,972.00	4.03
25	601233	桐昆股份	2,275,134.01	4.02
26	000049	德赛电池	2,271,059.41	4.02
27	000999	华润三九	2,263,959.34	4.00
28	600511	国药股份	2,157,783.17	3.81
29	000725	京东方A	2,139,000.00	3.78
30	000100	TCL 集团	2,118,125.00	3.74
31	002400	省广股份	2,029,964.95	3.59
32	601555	东吴证券	1,982,939.00	3.51
33	002557	洽洽食品	1,950,039.50	3.45
34	002146	荣盛发展	1,881,311.00	3.33
35	300058	蓝色光标	1,869,662.95	3.31
36	000562	宏源证券	1,863,567.94	3.29
37	000951	中国重汽	1,862,356.84	3.29
38	600109	国金证券	1,801,310.24	3.18
39	002007	华兰生物	1,712,286.05	3.03
40	600239	云南城投	1,696,536.73	3.00
41	600079	人福医药	1,684,956.45	2.98
42	002138	顺络电子	1,664,851.64	2.94
43	600309	万华化学	1,586,406.22	2.80
44	002431	棕榈园林	1,579,838.45	2.79
45	002277	友阿股份	1,574,301.50	2.78
46	600231	凌钢股份	1,498,554.15	2.65
47	600372	中航电子	1,491,366.86	2.64
48	000778	新兴铸管	1,473,230.56	2.60
49	002672	东江环保	1,468,524.00	2.60
50	002064	华峰氨纶	1,463,806.46	2.59
51	600261	阳光照明	1,449,909.20	2.56
52	600354	敦煌种业	1,445,000.00	2.55
53	002332	仙琚制药	1,430,496.52	2.53
54	300159	新研股份	1,417,285.82	2.51
55	300015	爱尔眼科	1,414,821.30	2.50
56	600118	中国卫星	1,413,577.75	2.50
57	000651	格力电器	1,402,263.37	2.48
58	002465	海格通信	1,343,787.49	2.38
59	600600	青岛啤酒	1,327,085.00	2.35
60	002437	誉衡药业	1,306,500.79	2.31
61	600401	海润光伏	1,300,550.00	2.30
62	600559	老白干酒	1,214,398.33	2.15
63	002309	中利科技	1,192,334.00	2.11
64	000002	万 科A	1,190,851.00	2.11
65	600435	北方导航	1,187,307.95	2.10
66	601886	江河创建	1,174,620.90	2.08
67	600426	华鲁恒升	1,157,294.20	2.05

7.4.3 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	153,381,780.63
卖出股票收入(成交)总额	162,524,096.92

7.5 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。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金报告期末未持有股指期货。

7.9.2 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。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1

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。

7.10.2

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。

7.10.3 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	117,758.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	22,929.79
5	应收申购款	11,824.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	152,512.83

7.10.4 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。

7.10.5 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 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
2,012	29,407.36	28,657,479.72	48.43%	30,510,137.53	51.57%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	40,377.16	0.07%

注: 1、截止本报告期末,本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间均为0;

2、截止本报告期末,本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2008年6月27日)基金份额总额	353,835,521.84
本报告期期初基金份额总额	64,822,254.60
本报告期基金总申购份额	63,869,302.54
减:本报告期基金总赎回份额	69,523,939.89
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	59,167,617.25

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

1、经公司2013年第一次临时股东会一致通过,选举毕玉国、马永春、吕祥友、吕宜振、刘兴云、陈增敬、骆玉鼎为万家基金管理有限公司第四届董事会董事,其中刘兴云、陈增敬、骆玉鼎为第四届董事会独立董事。

2、经本公司第四届董事会第一次会议审议通过,聘请詹志令、李杰为本公司副总经理。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	1	150,768,725.11	47.73%	134,843.49	47.52%	-
海通证券	1	61,020,749.14	19.32%	55,553.04	19.58%	-
招商证券	2	55,903,436.60	17.70%	49,468.85	17.43%	-
国信证券	1	48,212,966.70	15.26%	43,892.29	15.47%	-
联合证券	1	-	-	-	-	-
中金	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	-

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:

无。

10.7.2 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	-	-	-	-	-	-
海通证券	20,402,159.12	100.00%	64,800,000.00	100.00%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-
中金	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-

万家基金管理有限公司
2013年8月28日