## 基金管理人:万家基金管理有限公司基金托管人:中国建设银行股份有限公司送出日期:2013年8月28日

§ 1 重要提示及日录

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

。 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

本报告财务资料未经审计。 本报告期自 2013 年 01 月 01 日起至 6 月 30 日止。

	§ 2 基金简介
2.1 基金基本情况	
基金名称	万家精选股票型证券投资基金
基金简称	万家精选股票
基金主代码	519185
交易代码	519185
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年 5 月 18 日
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	496,003,182.64 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品况明	
投资目标	本基金在堅持并不断深化价值投资理念的基础上,充分发挥专业研究优势,通过多层面研究精选出具备持续竞争优势的企业,并结合估值等因素 对投资组合进行积极有效的管理。在有效控制风险的前提下,谋求实现基金财产的长期稳健增值。
投资策略	本基金以"自下而上"精选证券的策略为主,并近度动态配置大类资产。通 过定性与定量分析相结合的方法,精选出具备持续竞争优势且价值被低估 的企业进行重点投资。
业绩比较基准	80% ×沪深 300 指数收益率 + 20% ×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金是股票型基金,风险高于货币市场基金和债券型基金,属于较高风险、较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	

2.3 至並目2	王八州巫並11.1	□ 八	
项目		基金管理人	基金托管人
名称		万家基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
	姓名	兰剑	田青
信息披露负责人	联系电话	021-38619810	010-67595096
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		95538转 6、4008880800	010-67595096
传真		021-38619888	010-66275853
2.4 信自地で	罗方式	•	•

**基金半年度报告备置地点** § 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	14,936,963.54
本期利润	64,657,532.54
加权平均基金份額本期利润	0.1305
本期基金份额净值增长率	15.82%
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額利润	-0.2157
期末基金资产净值	486,916,904.24

98817 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,计人费用后实际收益水平要

·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

3.2 基金净值表现

	3.2.1 基金份额净值增长率及具与问期业绩比较基准収益率的比较							
	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	-6.21%	1.54%	-12.55%	1.49%	6.34%	0.05%	
	过去三个月	2.53%	1.34%	-9.32%	1.16%	11.85%	0.18%	
Ī	过去六个月	15.82%	1.29%	-9.86%	1.20%	25.68%	0.09%	
	过去一年	19.70%	1.21%	-7.65%	1.09%	27.35%	0.12%	
	过去三年	14.46%	1.22%	-8.79%	1.10%	23.25%	0.12%	
	自基金合同生效 起至今	5.59%	1.26%	-13.67%	1.21%	19.26%	0.05%	
	注:业绩比	较基准为 8	80% ×沪深	300 指数收	益率 + 20%	x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

## 基金份額累计净值增长率与同期化线比较基准收益率的历史走势对比图 1,225 .485 5,748 20 485 7.22% 注:本基金于 2009 年 5 月 18 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 41 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 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、万家负币市场证券投资基金、万家和销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、万家精造股票型证券投资基金、万家和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 34 天理财债券型证券投资基金、万家 36 年恒和债券型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和万家强化收益定期开放债券型证券投资基金和12 基金经理(或基金经理小组)及基金经理即理简介

	4.1.2	盔並坛店(以盔)	並程理小组)及基3	医定理助理间升		
	姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业	说明
	81.70	871.55	任职日期	离任日期	年限	150.093
	马云飞	本基金基金经理、万家 公用事业行业股票 (LOF)基金基金经理	2011年8月6日	2013年 5 月 25 日	8年	硕士学位,曾就职于国报 瑞银基金管理有限公司, 齐鲁证券有限责任公司。 2011年6月起加入万家 基金管理有限公司。
	吳印	本基金基金经理、万家 双引擎灵活配置基金 基金经理、万家公用事 业行业股票型基金基 金经理、权益投资部副 总监	2012年 2 月 4 日	-	6年	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。

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 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
大量以下和社会检查的思考方息检查。

安康和父初找门寺以员旨建信动的各十个下间,哪体公子内行不同议员至言,仍记寺这不公子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,对于发易所公开竟价交易,执行交易,疾服价格优先、此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、规 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。

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投资策略和运作分析
2013 年上半年、宏观经济反弹无力、经济增速不断下调、刺激政策效应短暂、不能持续、A股市场也充分地反应了宏观经济的这种局面、大盘指数不断下跌、但是代表未来经济发展方向的医药。电子以及传媒等极块则强劲上涨、反应了市场对于经济转型的憧憬。上半年、精选基金的运作坚持了风格、按照既定的策略、精选企业、按制风险、重点依旧配置在医药、TMT等板块、并且再次仔细梳理了持仓个股、加强了对于风险的控制。
4.4.2 报告期内基金的业绩表现
截至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0.9817元,本报告期份额净值增长率为15.82%,业绩 比较基准收益率-9.86%。

2校基准收益率-9.86%。 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,我们认为宏观经济"去杠杆"的过程将持续,资金面会继续收紧,并会逐渐 从金融市场传导至实体经济,经济增速不会太高。在实质性的改革政策推出并落实之前,宏

观经济很难找寻到新的成长动力 市场层面,也会受制于资金面的收紧以及经济局势的严峻,难以出现趋势性的行情。结

精选基金下一阶段的运作,在坚持长期看好的行业公司的基础上,重点将放在优选目前估值较低且受益于改革措施的板块上。随着市场的不断回落,很多企业已经进入了价值区间,如果经济与市场的风险能够得到有效的释放,那么这些优质企业将迎来难得的投资机

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名

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,并具有丰富的多

公验。
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存在的任何重价服务的性质与程度
4.已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度
本甘本签则。上向,即提供公司签署。
4.已签约的。
4.日签约的。1.目录图:

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 4.7 曾建入对银石湖的造业型相同分比间级的现象。 基金合同规定"本基金收益每年最多分配12次,全年基金收益分配比例不低于可分配收益的10%。若基金合同当年生效不满3个月可不进行收益分配。"本基金2012年度及本报告 万家精选股票型证券投资基金

## **2013 半年度** 报告摘要

## 2013年6月30日

监督,未发现基金管理人目则证验验以现代报告期内,本基金未实施利润分配。 报告期内,本基金未实施利润分配。 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 本托管人复核审查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

\$ 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:万家精选股票型证券投资基金

资产	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年 12 月 31 日
资产:	2013 1 0 77 30 14	2012 1 12 77 71 77
银行存款	122,827,201.98	22,265,768.0
结算备付金	457,948.32	294,025.5
存出保证金	103,780.07	750,000.0
交易性金融资产	365,264,278.17	331,755,115.1
其中:股票投资	365,264,278.17	331,755,115.1
基金投资	-	
债券投资	-	
资产支持证券投资	-	
衍生金融资产	-	
买人返售金融资产	-	
应收证券清算款	-	
应收利息	24,185.27	17,185.7
应收股利	4,417.50	
应收申购款	205,340.24	111,110,116.9
递延所得税资产	=	
其他资产	-	
资产总计	488,887,151.55	466,192,211.4
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	199,483.78	19,932,682.3
应付赎回款	447,475.80	472,496.8
应付管理人报酬	622,613.79	342,947.4
应付托管费	103,768.98	57,157.8
应付销售服务费	-	
应付交易费用	157,863.21	256,178.7
应交税费	-	
应付利息	-	
应付利润	-	
递延所得税负债	-	
其他负债	439,041.75	881,488.5
负债合计	1,970,247.31	21,942,951.7
所有者权益:	404.00	***
实收基金	496,003,182.64	524,106,834.0
未分配利润	-9,086,278.40	-79,857,574.3
所有者权益合计	486,916,904.24	444,249,259.6
负债和所有者权益总计	488,887,151.55 6月30日,基金份额净值 0.9817	466,192,211.4

6.2 平周 会计主体:万家精选股票型证券投资基金 本报告期: 2013年1月1日 至 2013年6月30日

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	单位:人民币5 上年度可比期间
項目		
58 LI	2013年1月1日至2013年6月30日	
		2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	69,625,099.08	31,283,823.91
1.利息收入	374,372.70	126,789.58
其中:存款利息收入	374,372.70	126,789.58
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买人返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	=	=
2.投资收益(损失以"-"填列)	19,374,883.93	-17,779,269.86
其中:股票投资收益	17,312,494.08	-18,620,953.98
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	2,062,389.85	841,684.12
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	49,720,569.00	48,934,845.74
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	155,273.45	1,458.45
减:二、费用	4,967,566.54	2,880,180.42
1.管理人报酬	3,510,715.99	1,505,831.30
2.托管费	585,119.28	250,971.81
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	681,770.27	924,151.13
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	189,961.00	199,226.18
三、利润总额(亏损总额以"="号填列)	64,657,532.54	28,403,643.49
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	64,657,532.54	28,403,643.49

6.3 所有者权益(基金净值)变动表 十主体.万家精选股票型证券投资基金 本报告期:2013年1月1日至 2013年6月30日

项目	2013 <sup>±</sup>	F1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)	524, 106, 834.06	-79,857,574.39	444,249,259.67	
二、本期经营活动产生的基金净 值变动数(本期利润)	=	64,657,532.54	64,657,532.54	
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)	-28,103,651.42	6,113,763.45	-21,989,887.97	
其中:1.基金申购款	159,087,462.15	-7,239,009.78	151,848,452.37	
2.基金赎回款	-187, 191, 113.57	13,352,773.23	-173,838,340.34	
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)	496,003,182.64	-9,086,278.40	486,916,904.24	
项目	2012 <sup>±</sup>	上年度可比期间 手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)	272,542,500.61	-77,661,997.73	194,880,502.88	
二、本期经营活动产生的基金净 值变动数(本期利润)	=	28,403,643.49	28,403,643.49	
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)	-2,496,030.04	667,605.59	-1,828,424.45	
其中:1.基金申购款	5,630,233.09	-1,271,328.60	4,358,904.49	
2.基金赎回款	-8,126,263.13	1,938,934.19	-6,187,328.94	
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)	-	-	-	

即果符者积益(福金净值) 270,046,470.57 报表附注为财务报表的组成部分。 本报告 — 至 — 财务报表由下列负责人签署, 华玉国 — 李杰

基金管理人负责人 会计机构负责人 主管会计工作负责人

6.4.1 基金基本情况 04.1 產並差平16亿 万家精造股票型证券投资基金(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]1394 号文(关于核准万家精选股票型证券投资基金募 集的批复)的核准,由万家基金管理有限公司作为发起人于 2009 年 4 月 13 日至 2009 年 5 12 日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2009)验 12 日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2009) 年 5 月 76 778298 801 号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2009 年 5 月 18 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 1.639,271,577.63 元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币 803,079.88 元,以上实收基金(本金),合计为人民币 1.640,074,657.51 元,折合 1.640,074,657.51 沙基金份额。本基金的基金管理机构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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。本基金的投资范围为具有良好流对性的金融工具。包括国内依法发行、上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为。80%x沪深 300 指数收益率+20%x上证国债指数收益率。64.2 会计报表的编制基础

6.4.2 会计报表的编制基础

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,在具体会计核算和信息按露方面,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》、中国正监会制定的(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 《大丁址亦校设益並积「T<企业尝计准则>匠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常理办法)、(证券投资基金信息披露编录与格式准则第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》及其使中国证监会领布的相关规定。本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

本财务报表以本基金持续经官为基础列报。 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 2013 年 6 月 30 日的 财务状况以及 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日止期间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 本基金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。

v.+... 全爾天正即原明 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

图 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

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,般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,继续犯任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,殷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 是,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、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。

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象 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%计算应始始陈强鑑。

利所得,按照则税[2005]102 亏义规定,扣额义务人住几扣飞源个人所得税时,减按 50% 计异应纳税所得额; 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 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 利所得全额计人应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计人

利斯博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, 質藏按50%计人应纳税所得额; 持股期限超过1年的, 暂减按25%计人应纳税所得额。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 滨问题的通知》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 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可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按股有限公司持股 11%。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。

医自连八行行兵 51%以行。					
6.4.7.2 平报告期与基金友生天联父易	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	基金发起人、基金管理人、基金销售机构				
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、基金代销机构				
齐鲁证券有限公司("齐鲁证券") 基金管理人的股东、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

	■过大味力父易甲兀姓付け 股票交易	刊父芴	金客	颁单位:人民币:
	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	
关联方名称	成交金額	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	13,736,554.73	3.13%	183,364,266.22	29.339

版分文別 报告期间及上年度可比期间,本基金未通过关联方席位进行债券交易。 债券回购交易 报告期间及上年度可比期间,本基金未通过关联方席位进行回购交易。 报告期间及上年度可比期间,本基金未通过关联方席位进行权证交易。

	应支付关联方的佣金 2:人民币元				
关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日				
大帆刀石师	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余額	占期末应付佣金 总额的比例	
齐鲁证券	12,505.84	3.17%	12,505.84	7.92%	
关联方名称			度可比期间 日至 2012 年 6 月 30 日		
大帆刀石师	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余額	占期末应付佣金 总额的比例	
齐鲁证券	149,115.57	28.79%	23,335.05	28.90%	

注:上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管 费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包 括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

0.4.8.2.1 至亚目生贝		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	3,510,715.99	1,505,831.30
其中:支付销售机构的客户维护费	415,616.45	317,984.02

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下:

单位:人民币元

221,455,721.92

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5%的年费率计提。计算方法如下: H=Ex1.5%/当年天教 H为每日应计提的基金管理费 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3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理 人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。 6.4.8.2.2 基金托管费

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

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况 6.4.8.4.1 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 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(2009年5月18日 持有的基金份額

注,基金管理人认购及申购本基金份额时所适用的费率与本基金公告的费率一致 好买人总份额合致利再投,转换人份额,期间赎回/卖出总份额合转换出份额。 64.84.2 报告期未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报告期末及上年度末均未投资本基金。

122,827,201.9

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

注:本基金的证券交易结算贸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,2013年1月1日至2013年6月30日年度获得的利息收入为人民币 4,718.43 元。(2012年1月1日至2012年6月30日:人民币 6,265.53元),2013年6月30日结算备付金余额为人民币 457,948.32元(2012年6月30日:人民币 218.875.30元)。 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况。 报告期内及上年度可比期间。本基金无在承销期内参与关联方承销证券的情况。 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 报告期末本基本未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。 6.4.9 期末有的密贴度施等通语受限证券

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

数量(股) 期末估值总额 成本总额 24.43 9,772,000 600436 片 任 2013 6月 132.48 118.73 196,000 18,979,776.32 25,966,080.00

0.49.3. 对不规定是完全之前。 6.49.3.1 银行间市场债券正回购 本基金期末无银行间市场正回购余额,因此无银行间正回购交易中作为抵押的债券。

0.4.9.3.2 义列川市场顶分正回购。 本基金期末无交易所市场正回购余额,因此无交易所正回购交易中作为抵押的债券。 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项 截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项 § 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5
序号	項目	金額	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	365,264,278.17	74.71
	其中:股票	365,264,278.17	74.71
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	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	123,285,150.30	25.22
6	其他各项资产	337,723.08	0.07
7	合计	488,887,151.55	100.00

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	7,232,000.00	1
В	采矿业	-	
С	制造业	238, 135, 617.25	48.5
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	
E	建筑业	-	
F	批发和零售业	-	
G	交通运输、仓储和邮政业	-	
Н	住宿和餐饮业	-	
I	信息传输、软件和信息技术服务业	420,000.00	0.
J	金融业	28,911,670.00	5.
K	房地产业	1,519,605.00	0.
L	租赁和商务服务业	29,930,160.00	6.
M	科学研究和技术服务业	21,676,300.00	4.
N	水利、环境和公共设施管理业	20,524,925.92	4.
0	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	16,914,000.00	3.
S	综合	-	
	合计	365.264.278.17	75.

				32	微甲位:人民用元
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	300058	蓝色光标	715,000	29,815,500.00	6.12
2	600436	片仔癀	196,000	25,966,080.00	5.33
3	002353	杰瑞股份	364,000	25,116,000.00	5.16
4	002241	歌尔声学	648,000	23,515,920.00	4.83
5	300347	泰格医药	430,000	21,676,300.00	4.45
6	300146	汤臣倍健	470,000	20,675,300.00	4.25
7	002236	大华股份	540,000	20,644,200.00	4.24
8	002415	海康威视	570,000	20,143,800.00	4.14
9	600518	康美药业	960,006	18,460,915.38	3.79
10	300285	国瓷材料	360,000	18,183,600.00	3.73

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读半年报告正文。 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买人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	本期累计买人金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002463	沪电股份	17,752,101.29	4.00
2	600886	国投电力	16,100,564.58	3.62
3	601233	桐昆股份	11,291,660.74	2.54
4	002672	东江环保	10,597,412.30	2.39
5	002299	圣农发展	10,386,604.94	2.34
6	002241	歌尔声学	10,133,458.20	2.28
7	002477	雏鹰农牧	10,005,368.29	2.25
8	600196	复星医药	9,659,361.72	2.17
9	601377	兴业证券	8,383,991.00	1.89
10	300309	吉艾科技	8,267,079.50	1.86
11	002262	思华药业	8,171,730.44	1.84
12	600079	人福医药	7,648,906.42	1.72
13	002588	史丹利	6,377,978.30	1.44
14	002250	联化科技	5,771,830.67	1.30
15	002353	杰瑞股份	5,352,324.97	1.20
16	002453	天马精化	4,386,937.26	0.99
17	600426	华鲁恒升	4,290,013.00	0.97
18	002412	汉森制药	4,272,438.85	0.96
19	600352	浙江龙盛	4,122,247.01	0.93
20	600518	康美药业	4,064,019.01	0.91
注:	买人包括基	金二级市场上主动的	的买人、新股、配股、债转股、换	股及行权等获得的原

票,"买入金额"按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用

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	月细
				金额单位:人民币:
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	600280	南京中商	14,188,563.76	3.19
2	600886	国投电力	12,989,098.11	2.92
3	300285	国瓷材料	12,704,526.87	2.86
4	600436	片仔癀	12,620,829.58	2.84
5	601233	桐尾股份	10,769,986.09	2.42
6	300309	吉艾科技	10,012,286.08	2.25
7	000776	广发证券	9,782,818.49	2.20
8	000338	潍柴动力	9,656,040.54	2.17
9	002477	雏鹰衣牧	9,481,063.00	2.13
10	600801	华新水泥	9,305,322.86	2.09
11	002138	顺络电子	8,957,536.77	2.00
12	002262	恩华药业	8,777,016.45	1.98
13	002299	圣农发展	8,046,458.17	1.8
14	600079	人福医药	7,699,377.65	1.73
15	300124	汇川技术	7,582,197.97	1.71
16	601377	兴业证券	7,404,029.31	1.65
17	002588	史丹利	6,898,362.90	1.55
18	600276	恒瑞医药	6,414,291.50	1.44
19	002241	歌尔声学	5,592,038.98	1.20
20	300291	华录百纳	5,402,437.23	1.22

票,"卖出金额"按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。 7.4.3 买人股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注:买人包括基金二级市场上主动的买人、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股 票,"买人金额"按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。卖出引要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票,"卖出金额"

按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用 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

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名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。
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

7.8 纳米按公元加值白基並與广伊祖比例人小排名的削 本基金本报告期末未并有权证。 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 本基金本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。

7.10.3 期末其他各项资产构成

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 年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

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

单位:人民币元

份额单位:份

序号	名称	金額
1	存出保证金	103,780.07
2	应收证券清算款	=
3	应收股利	4,417.50
4	应收利息	24,185.27
5	应收申购款	205,340.24
6	其他应收款	=
7	待摊费用	-
8	其他	=
9	合计	337,723.08
7.1	0 4 HD + At + At AI T + AD HD AS T + A A A A	- DI /m

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

7.	7.10.5 别未削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	字号 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	600436	片仔癀	25,966,080.00	5.33	配股停牌	
§ 8 基金份额持有人信息						

寺有人户数(户 57.20% 8.2 期末基金管理人的

注:截至本报告期末,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为0,本基金的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 报告期期初基金份额总额 524,106,834.0

496,003,182.6 § 10 重大事件揭示 10.1 基金份额持有人大会决议

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

注實理人。 1. 熱公司 2013 年第一次临时股前会一致通过,造學毕王团,马水泰,吕祥水,吕至縣、刘兴云,陈增敬,骆王鼎为万家基金管理有 2. 新菜四国重報会推修,其中刘兴三,唐博敬,骆王鼎为四国届董事会也立,董事 2. 集集公司周四国董事会看一次改议即设进过,南德士会,李志为司副总处理。 3. 2013 年 5 月 25 日本公司发布公告,马云飞不再担任本基金基金经理。 基金任管人, 本报告别内托管人的专门基金托管部门未发生版大的人事变动。 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、基金托管业务的证 10.4 基金投资策略的改变 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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 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 成交金額 佣金

64,347,376.0 58,581.2 14.83 13,736,554.7 12,505.84

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

(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、基金专用交易席位的变更

本报告期内,本基金专用交易席位无变更。 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 本基金报告期内未通过租用证券交易单元进行其它证券投资

万家基金管理有限公司