

## 万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金

## 2014第四季度报告

2014年12月31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:2015年1月20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。

基金托管人对本基金的报告文本内容、格式和编制时间等没有不同意见,报告文本陈述的事实清楚、准确。

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基金的招募说明书。

本报告中的所有数据均为估计。

本报告期自2014年10月1日起至2014年12月31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:2006年4月27日

报告期末基金份额总额:43,433,809.20份

投资目标:本基金通过股票、债券的有波段配置,把握价值、风格特征,精选个股、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。

业绩比较基准:60%\*沪深300指数量化收益+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。

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(2014年10月1日-2014年12月31日)

1.本期已实现收益 6,053,502.81

2.本期利润 7,504,904.44

3.期末平均基金份额利润 0.1727

4.期末基金资产净值 52,303,424.21

5.期末基金份额净值 1.2042

注:1.本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计算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本收益和利息收入,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③ (%) 业绩比较基准收益差④ (%)

过去三个月 18.28% 1.64% 25.54% 0.99% -7.26% 0.65%

3.2.2 本基金当期实现收益增长率与同期业绩比较基准收益率变化的比较

万家双引擎灵活配置混合基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率变化的走势图

历史走势图

注:本基金于2006年4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

华晓 本基金基金经理,万家双引擎灵活配置混合型基金基金经理,权益投资部总监 2013年8月8日 - 10年 硕士学位,2004年8月进入光大证券研究所工作,于2006年获得薪聘高级分析师第三名。2009年获得薪聘高级分析师第二名。2010年获得薪聘高级分析师第三名。2011年5月加入万家基金管理有限公司,担任权益投资部总监等职务。

朱颖 本基金基金经理,万家行业化基金经理,万家双引擎基金经理 2012年2月4日 - 8年 硕士学位,2006年10月加入万家基金管理有限公司,担任行业分析师,基金经理助理。

注:1.本基金的经理日期和离任日期以公告为准。

2.本基金从行业化基金经理从行业分析师转任基金经理的,从行业分析师的从业时间起算。

3.2.3 管理人报告期内本基金运作合规情况说明

本报告期内基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规,及基金合同的约定,不存在损害基金持有人利益的行为。

4.4 公司治理情况

4.4.1 公司治理的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.2 公司治理的公平交易执行情况

公司已制订了公平交易制度,并建立了公平交易制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.3 公司治理的合规情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.4 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.5 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.6 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.7 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.8 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.9 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.10 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.11 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.12 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.13 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.14 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.15 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.16 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.17 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.18 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.19 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.20 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.21 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.22 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.23 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.24 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.25 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.26 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.27 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.28 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.29 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.30 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.31 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.32 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.33 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.34 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.35 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.36 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.37 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.38 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.39 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.40 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.41 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.42 公司治理的公平交易执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控与报告管理办法》等制度,并严格执行。报告期内,公司严格执行公平交易制度,不存在不公平交易行为。

4.4.43 公司治理的公平交易执行情况