

万家添利分级债券型证券投资基金 2013 年 年度报告摘要

2013 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2014 年 3 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2014 年 3 月 26 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计。安永华明会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	万家添利分级债券（场内简称：万家添利）	
基金主代码	161908	
基金运作方式	创新型封闭式	
基金合同生效日	2011 年 6 月 2 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1, 265, 374, 757. 05 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2011-08-29	
下属分级基金的基金简称:	万家利 A	万家利 B
下属分级基金的交易代码:	161909	150038
报告期末下属分级基金的份额总额	492, 103, 345. 68 份	773, 271, 411. 37 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险的基础上, 追求当期较高收入和投资总回报。	
投资策略	本基金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, 充分发挥在封闭期内基金规模稳定的优势, 寻求组合流动性与收益的最佳配比, 实现基金收益的最大化。此外, 本基金通过对首次发行 (IPO) 股票和增发新股的上市公司内在价值和一级市场申购收益率的全面分析, 制定相应的新股申购策略, 以获得较为安全的新股申购收益。	
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基金、混合基金, 高于货币市场基金。	
	万家利 A	万家利 B
下属分级基金的风险收益特征	封闭期内, A 级份额将表现出低风险、低收益的明显特征, 其预期收益和预期风险要低于普通的债券型基金份额	封闭期内, B 级份额则表现出高风险、高收益的显著特征, 其预期收益和预期风险要高于普通的债券型基金份额

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	中国邮政储蓄银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	兰剑	胡涛
	联系电话	021-38619810	010-68858112
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	hutao@psbcoa.com.cn
客户服务电话		95538 转 6、4008880800	95580
传真		021-38619888	010-66858120

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.wjasset.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区浦电路 360 号陆家嘴投资大厦 9 楼 基金管理人办公场所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2013 年	2012 年	2011 年 6 月 2 日(基金合同生效日)-2011 年 12 月 31 日
本期已实现收益	137,649,657.40	188,047,409.62	51,727,171.09
本期利润	77,002,633.81	287,589,355.28	-6,096,074.61
加权平均基金份额本期利润	0.0368	0.1330	-0.0025
本期基金份额净值增长率	5.53%	15.38%	-1.80%
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末
期末可供分配基金份额利润	0.1715	0.0809	-0.0178
期末基金资产净值	1,513,005,277.49	2,169,951,337.85	1,579,608,132.32
期末基金份额净值	1.1957	1.1330	0.9820

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) 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。

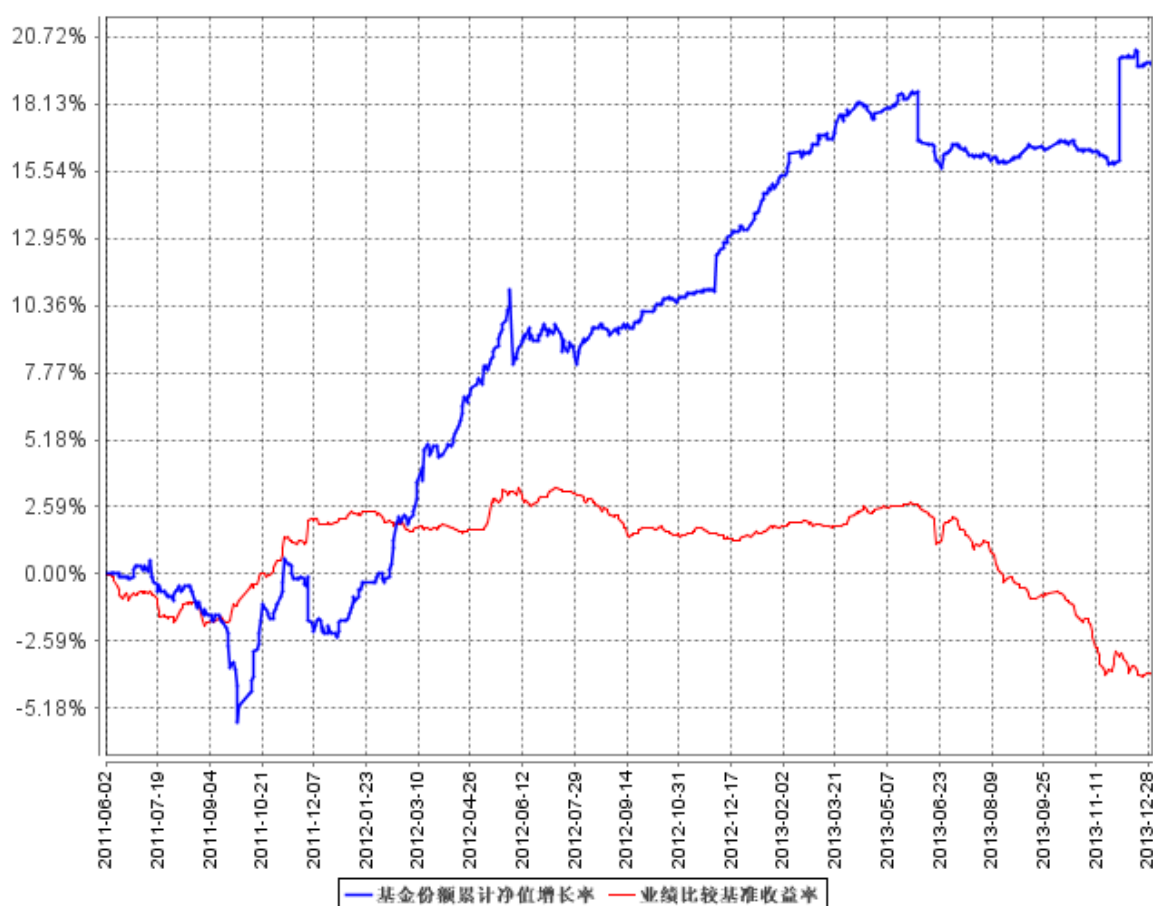
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	2.69%	0.44%	-3.13%	0.14%	5.82%	0.30%
过去六个月	2.85%	0.31%	-5.73%	0.12%	8.58%	0.19%
过去一年	5.53%	0.26%	-5.28%	0.11%	10.81%	0.15%
自基金合同 生效起至今	19.57%	0.27%	-3.88%	0.10%	23.45%	0.17%

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

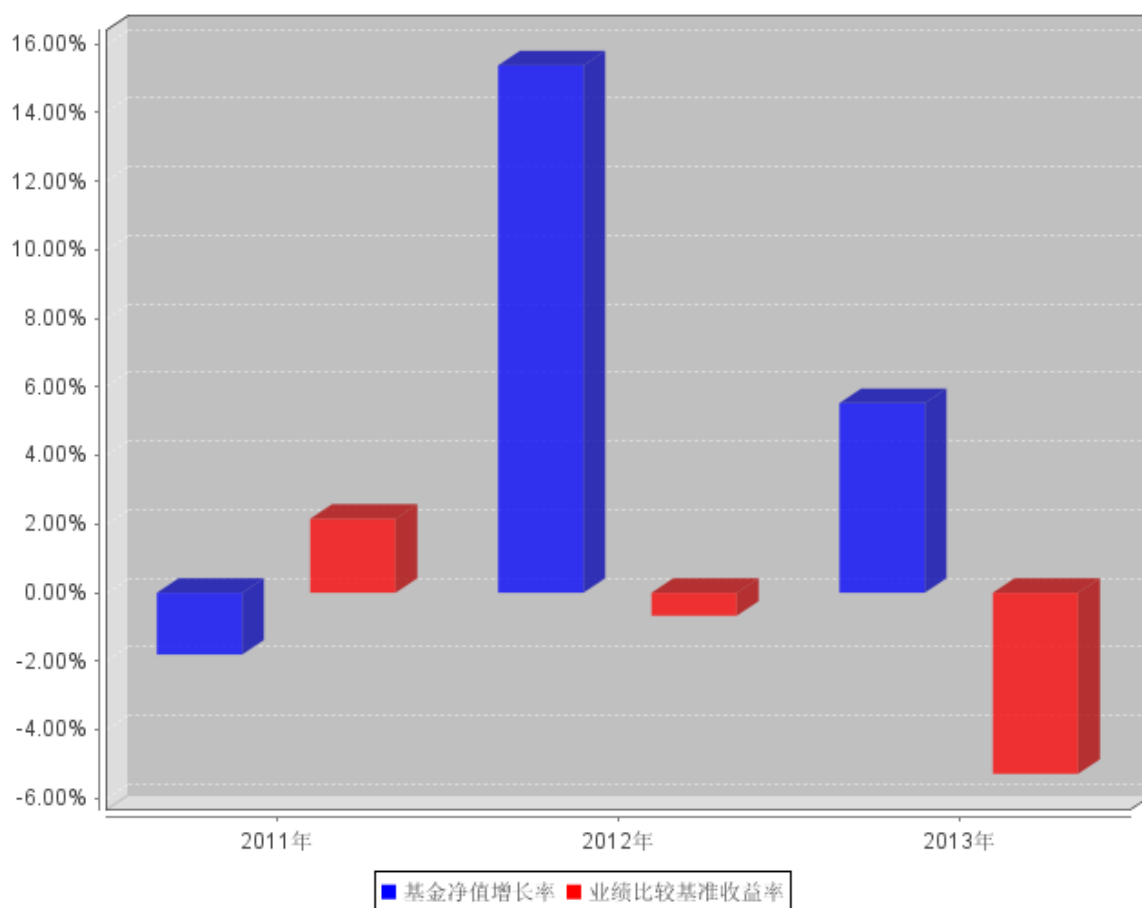
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2011 年 6 月 2 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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金于 2011 年 6 月 2 日成立，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期末（2013 年 12 月 31 日）
万家利 A 与万家利 B 基金份额配比	0.63639149:1
期末万家利 A 参考净值	1.1174
期末万家利 B 参考净值	1.2455
万家利 A 年收益率	4.10%

3.4 过去三年基金的利润分配情况

根据基金合同的规定，在封闭期内，本基金不单独对 A 级和 B 级基金份额进行收益分配。

§ 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 号陆家嘴投资大厦 9 楼，注册资本 1 亿元人民币。目前管理十八只基金，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、万家行业优选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、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家市政纯债定期开放债券型证券投资基金、万家上证 380 交易型开放式指数证券投资基金和万家城市建设主题纯债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		
朱虹	本基金基金经理、万家信用恒利债券基金基金经理、万家稳健增利债券基金基金经理、万家岁得利定期开放债券基金基金经理、万家市政纯债定期开放债券基金基金经理、万家城市建设主题纯债基金基金经理、固定收益部总监	2013 年 4 月 17 日	-	6 年	经济学硕士，曾任长城保险股份有限公司债券投资助理，天弘基金管理有限公司基金经理，2012 年 1 月加入万家基金管理有限公司。
邹昱	本基金基金经理、万家 14 天	2011 年 6 月 2 日	2013 年 4 月 17 日	6 年	硕士学位，曾就职于南京银行股份

	理财债券基金基金经理、万家岁得利定期开放债券型发起式基金基金经理				有限公司，从事固定收益投资研究工作。2008 年 4 月加入本公司，曾担任基金经理助理。
--	----------------------------------	--	--	--	--

注：①任职日期和离任日期以公告为准。

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合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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《万家基金管理有限公司公平交易管理办法》，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，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送，确保公平对待不同投资组合。

在投资决策上：（1）公司对不同类别的投资组合分别设定独立的投资部门，公募基金经理和特定客户资产管理投资经理不得互相兼任。（2）公司投资管理实行分层次决策，投资决策委员会下设的公募基金投资决策小组和专户投资决策小组分别根据公募基金和专户投资组合的规模、风格特征等因素合理确定各投资组合经理的投资权限，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需经过严格的逐级审批程序。（3）公司接受的外部研究报告、研究员撰写的研究报告等均通过统一的投研管理平台发布，确保各投资组合经理在获得投资信息、投资建议和实施决策方面享有公平的机会。

在交易执行上：（1）公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度；（2）对于交易公开竞价交易，所有指令必须通过系统下达，公司执行交易系统内的公平交易程序；（3）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，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；

(4) 对于银行间交易，交易部按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。

在行为监控上，公司定期对不同投资组合的同向交易价差、反向交易，场外交易对手议价的价格公允性及其他异常交易情况进行监控及分析，基金经理对异常交易情况进行合理性解释并留存记录，并定期编制公平交易分析报告，由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司定期进行同向交易价差分析，即采集公司旗下管理的所有组合，连续四个季度期间内，不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的同向交易样本，对两两组合之间的同向交易价差均值进行原假设为 0，95%的置信水平下的 t 检验，并对结论进行跟踪分析，分析结果显示在样本数量大于 30 的前提下，组合之间在同向交易方面不存在违反公平交易行为。

4.3.3 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 年债券的跌幅较大，主要是表现为从 5 月末开始的利率债券的调整及 10 月开始的长期信用债券调整。全年市场表现为利率债损失较大，而信用债则流动性危机，估值也相应失灵，尤其是民营企业信用债。交易所债券在近两个月的调整非常剧烈，这与基金整体遭遇大额赎回有较高相关性。

我们在 2013 年初认为银行提供竞争性利率会影响到债券估值中枢向上抬升，因此整体的投资均偏向保守。

本基金在 4 月初减持了所有可转债的仓位，此后一直维持一定的现金比例。以长期回购或存款为主。6 月底配置了 AAA 短期融资券，减持了固息利率债。在 10 月和 9 月少量配置了一年期短融。9、10、11 月均减持了交易所信用债。

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 1.1957 元，本报告期份额净值增长率为 5.53%，业绩比较基

准收益率-5.28%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

延续我们在一季度的投资逻辑，银行提供竞争性利率会对其他的资产有所挤出。因此低波动性的资产会有一定幅度的价格下跌。虽然 2013 年整体下跌幅度超出了我们及市场的预期，但万家旗下基金整体表现仍然比较平稳。

虽然当前债券市场较为悲观，但利率市场化的过程一定伴随着风险市场化。随着影子银行监管逐步被纳入管理层的重点监测视线，信托和银行理财经过三年的发展，不得不面临到风险暴露的时点。

我们认为 2014 年债券市场生出一丝曙光，策略确定的基金将会有良好的回报。房地产及其他高利率的提供者将会在这一年将被迫大幅度减少资金需求。由于 2013 年这些行业是高利率的提供者，因此 2014 年随着风险的暴漏，全社会可获得收益的水平将会向着相对低的水平回归。

万家添利基金将于 2014 年 6 月打开成为 LOF 基金，因此我们主要的投资是以期限匹配为第一考虑要素。中间如遇到重大市场转变也会积极参与，原则上不再参与转债投资。

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

本基金在报告期内未实施利润分配。

§ 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

基金托管人依据《万家添利分级债券型证券投资基金基金合同》与《万家添利分级债券型证券投资基金托管协议》，自 2011 年 6 月 2 日起托管万家添利分级债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的全部资产。

本报告期内，本托管人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、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

本报告期内，本托管人依据国家相关法律法规、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。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本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、利润分配情况、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 审计报告

本基金 2013 年年度财务会计报告已经安永华明会计师事务所审计，注册会计师签字出具了安永华明（2014）审字第 60778298_B11 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：万家添利分级债券型证券投资基金

报告截止日：2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资 产:		
银行存款	400,097,626.95	63,587,503.48
结算备付金	1,822,297.42	1,781,691.16
存出保证金	402,361.06	500,000.00
交易性金融资产	967,224,826.78	1,981,665,665.28
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	965,844,826.78	1,944,979,965.28
资产支持证券投资	1,380,000.00	36,685,700.00
贵金属投资		
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	132,000,380.00	459,001,523.50
应收证券清算款	5,358,534.12	-
应收利息	23,351,802.37	46,254,631.97
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,530,257,828.70	2,552,791,015.39
负债和所有者权益	本期末 2013 年 12 月 31 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	13,400,000.00	370,898,811.65
应付证券清算款	-	8,291,758.71
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	972,289.37	1,341,237.33
应付托管费	277,796.97	383,210.68
应付销售服务费	486,144.66	670,618.63
应付交易费用	35,019.08	64,194.14
应交税费	1,658,968.16	53,187.96
应付利息	4,138.05	256,658.44
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	418,194.92	880,000.00
负债合计	17,252,551.21	382,839,677.54
所有者权益:		
实收基金	1,265,374,757.05	1,915,255,244.76
未分配利润	247,630,520.44	254,696,093.09
所有者权益合计	1,513,005,277.49	2,169,951,337.85

负债和所有者权益总计	1, 530, 257, 828. 70	2, 552, 791, 015. 39
------------	----------------------	----------------------

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1957 元，基金份额总额 1,265,374,757.05 份，其中添利 A 份额参考净值 1.1174 元，份额总额 492,103,345.68 份；添利 B 份额参考净值 1.2455 元，份额总额 773,271,411.37 份。

7.2 利润表

会计主体：万家添利分级债券型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
一、收入	117,480,677.84	334,590,103.13
1.利息收入	115,179,308.61	125,736,724.18
其中：存款利息收入	7,929,673.91	1,756,415.99
债券利息收入	92,796,528.24	110,825,864.92
资产支持证券利息收入	662,028.45	222,267.53
买入返售金融资产收入	13,791,078.01	12,932,175.74
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	62,658,392.82	109,308,679.41
其中：股票投资收益	6,633,266.91	29,171,045.92
基金投资收益	-	-
债券投资收益	55,988,238.91	79,888,512.49
资产支持证券投资收益	36,887.00	10,621.00
贵金属投资收益		
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	238,500.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-60,647,023.59	99,541,945.66
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	290,000.00	2,753.88
减：二、费用	40,478,044.03	47,000,747.85
1. 管理人报酬	17,076,059.62	16,221,010.54
2. 托管费	4,878,874.10	4,634,574.42
3. 销售服务费	8,538,029.86	8,110,505.11
4. 交易费用	181,070.10	708,163.43
5. 利息支出	9,327,610.35	16,850,094.35
其中：卖出回购金融资产支出	9,327,610.35	16,850,094.35
6. 其他费用	476,400.00	476,400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	77,002,633.81	287,589,355.28

减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	77,002,633.81	287,589,355.28

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家添利分级债券型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 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）	1,915,255,244.76	254,696,093.09	2,169,951,337.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	77,002,633.81	77,002,633.81
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）	-649,880,487.71	-84,068,206.46	-733,948,694.17
其中：1.基金申购款	1,090,150,576.56	101,482,874.74	1,191,633,451.30
2.基金赎回款	-1,740,031,064.27	-185,551,081.20	-1,925,582,145.47
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）	1,265,374,757.05	247,630,520.44	1,513,005,277.49
项目	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 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）	1,608,305,096.65	-28,696,964.33	1,579,608,132.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	287,589,355.28	287,589,355.28
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）	306,950,148.11	-4,196,297.86	302,753,850.25
其中：1.基金申购款	1,934,003,116.84	96,993,195.62	2,030,996,312.46
2.基金赎回款	-1,627,052,968.73	-101,189,493.48	-1,728,242,462.21

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）	1, 915, 255, 244. 76	254, 696, 093. 09	2, 169, 951, 337. 85

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

万家添利分级债券型证券投资基金(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[2011]242 号文《关于核准万家添利分级债券型证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人万家基金管理有限公司自 2011 年 5 月 16 日至 2011 年 5 月 27 日止向社会公开发行募集,基金合同于 2011 年 6 月 2 日正式生效,首次设立募集规模为 2,635,617,840.86 份基金份额。本基金为契约型。本基金合同生效后三年内(含三年)为封闭期。封闭期间,添利 A 自基金合同生效日起每满半年开放一次申购赎回,添利 B 在深圳证券交易所上市交易。封闭期届满后,本基金转为上市开放式基金(LOF)。本基金的基金管理人为万家基金管理有限公司,基金注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

本基金通过基金收益分配的安排,将基金份额分成预期收益与风险不同的两个级别,即稳健收益级基金份额(基金份额简称“添利 A”)和积极收益级基金份额(基金份额简称“添利 B”)。在封闭期末,本基金净资产优先分配添利 A 基金份额的本金及约定应得收益,即添利 A 为低风险且预期收益相对稳定的基金份额;本基金在优先分配添利 A 基金份额的本金及约定应得收益后的剩余净资产分配予添利 B 基金份额,即添利 B 为高风险且预期收益相对较高的基金份额。按照上述本基金资产及收益分配规则,在封闭期末对添利 A 与添利 B 单独进行基金份额净值计算,并按各自的基金份额净值进行资产分配。

本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%。本基金投资于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、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规获中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金还可以参与一级市场新股申购或增发新股,并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而

产生的权证等以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非固定收益类品种，但不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产。本基金在封闭运作期间，投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的 20%，其中，现金或者到期日在一年以内政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为中国债券总指数。

7.4.2 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，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《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 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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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。

7.4.5 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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。

7.4.6.3 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、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]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、国家税务总局财税字[2008]132 号文《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》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

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。

7.4.7 关联方关系

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，基金销售机构

中国邮政储蓄银行股份有限公司	基金托管人，基金代销机构
齐鲁证券有限公司	基金管理人股东，基金代销机构
新疆国际实业股份有限公司	基金管理人股东
山东省国有资产投资控股有限公司	基金管理人股东
上海久事公司	基金管理人原股东
深圳市中航投资管理有限公司	基金管理人原股东
万家共赢资产管理有限公司	基金管理人控股子公司

注：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。

3、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	
	成交金额	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
齐鲁证券有限公司	-	-	54,334,887.92	18.33%

债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	
	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 成交总额的 比例
齐鲁证券有限公司	3,112,235,186.14	67.04%	2,589,951,150.07	54.10%

债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	
	回购成交金额	占当期回购 债券 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期回购 债券 成交总额的 比例
齐鲁证券有限公司	10,023,000,000.00	98.57%	60,424,500,000.00	100.00%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
齐鲁证券有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
齐鲁证券有限公司	47,390.82	18.69%	8.40	18.78%

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	17,076,059.62	16,221,010.54
其中：支付销售机构的客户维护费	3,131,068.75	3,431,689.80

注:基金管理费按前一日基金资产净值的 0.70%年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times 0.70\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费自基金合同生效之日起每日计提,逐日累计至每个月月末,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,基金托管人复核无误后于次月首日起 5 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,878,874.10	4,634,574.42

注:基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20%年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费自基金合同生效之日起每日计提,逐日累计至每个月月末,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,基金托管人复核无误后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
万家基金管理有限公司	4,837,163.84
中国邮政储蓄银行股份有限公司	3,235,145.16
合计	8,072,309.00
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
万家基金管理有限公司	4,239,378.28

中国邮政储蓄银行股份有限公司	2,916,556.30
合计	7,155,934.58

注：基金销售服务费用用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.35% 年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日基金资产净值

基金销售服务费自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核无误后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国邮政储蓄银行股份有限公司	-	19,939,690.41	243,460,000.00	52,577.93	-	-
上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国邮政储蓄银行股份有限公司	20,010,566.99	99,964,896.71	0.00	0.00	0.00	0.00

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金

7.4.8.4.2 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

份额单位：份

万家利 A

关联方名称	本期末 2013 年 12 月 31 日		上年度末 2012 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份 额 占基金总份额 的比例
齐鲁证券有限公司	0.00	0.00%	186,915,887.85	16.37%

份额单位：份

万家利 B				
关联方名称	本期末 2013 年 12 月 31 日		上年度末 2012 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份 额 占基金总份额 的比例
齐鲁证券有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金添利 B 份额

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期		上年度可比期间	
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日		2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行 股份有限公司	97,626.95	617,645.94	63,587,503.48	1,193,452.16

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有限责任公司，2013 年度获得的利息收入为人民币 89,678.31 元（2012 年度获得的利息收入为 552,184.54 元），2013 年末结算备付金余额为 1,822,297.42 元（2012 年末结算备付金余额为 1,781,691.16 元）。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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承销的证券。

7.4.9 期末（2013 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2013 年 12 月 31 日止，本基金无银行间市场债券正回购余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2013 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 13,400,000.00 元，于 2014 年 1 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.10 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	967,224,826.78	63.21
	其中：债券	965,844,826.78	63.12
	资产支持证券	1,380,000.00	0.09
3	贵金属投资		
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	132,000,380.00	8.63
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	401,919,924.37	26.26
7	其他各项资产	29,112,697.55	1.90
8	合计	1,530,257,828.70	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

8.3 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	000731	四川美丰	54,086,602.17	2.49

8.4.2 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	000731	四川美丰	60,719,869.08	2.80

8.4.3 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	54,086,602.17
卖出股票收入（成交）总额	60,719,869.08

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	92,680,000.00	6.13
	其中：政策性金融债	92,680,000.00	6.13
4	企业债券	407,273,826.78	26.92
5	企业短期融资券	338,725,000.00	22.39
6	中期票据	127,166,000.00	8.40
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	965,844,826.78	63.84

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	041364024	13 甘国投 CP001	1,000,000	99,420,000.00	6.57
2	122980	09 津投 3	1,000,000	98,000,000.00	6.48
3	130224	13 国开 24	1,000,000	92,680,000.00	6.13
4	122928	09 铁岭债	800,000	79,760,000.00	5.27
5	041361026	13 津城建 CP001	700,000	69,566,000.00	4.60

8.7 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	061202001	12 通元 1A	200,000	1,380,000.00	0.09

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据基金合同, 本基金暂不投资于股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同, 本基金暂不投资于国债期货

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	402,361.06
2	应收证券清算款	5,358,534.12
3	应收股利	-
4	应收利息	23,351,802.37
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,112,697.55

8.12.4 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。

8.12.5 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不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	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
万 家 利 A	18,843	26,115.98	14,119,005.90	2.87%	477,984,339.78	97.13%
万 家 利 B	1,328	582,282.69	707,688,781.07	91.52%	65,582,630.30	8.48%
合计	20,171	62,732.38	721,807,786.97	57.04%	543,566,970.08	42.96%

9.2 期末上市基金前十名持有人

万家利 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
----	-------	---------	--------------

1	全国社保基金二零七组合	50,000,000.00	7.90%
2	华宝投资有限公司	49,892,600.00	7.89%
3	易方达资产管理（香港）有限公司易方达投资基金系列—易方达人	44,595,030.00	7.05%
4	中信信托有限责任公司—中信证券安鑫 2 号信托金融投资项目资	42,494,972.00	6.72%
5	全国社保基金一零零二组合	36,947,563.00	5.84%
6	天平汽车保险股份有限公司—自有资金	24,417,424.00	3.86%
7	中信证券—华夏—中信证券贵宾定制 2 号集合资产管理计划	18,412,285.00	2.91%
8	兴业证券—农行—兴业证券金麒麟 3 号优选基金组合集合资产管	18,054,959.00	2.85%
9	中信证券—华夏—中信证券贵宾定制 1 号集合资产管理计划	17,870,800.00	2.83%
10	辽宁省电力有限公司 01 号企业年金计划—农行	14,055,209.00	2.22%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	万家利 A	3,118.74	0.00%
	万家利 B	0.00	0.00%
	合计	3,118.74	0.00%

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。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家利 A	万家利 B
基金合同生效日（2011 年 6 月 2 日）基金份 额总额	1,862,346,429.49	773,271,411.37
本报告期期初基金份额总额	1,141,983,833.39	773,271,411.37

本报告期基金总申购份额	1,090,150,576.56	-
减：本报告期基金总赎回份额	1,740,031,064.27	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	492,103,345.68	773,271,411.37

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

基金管理人：

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。

3、2013 年 4 月 17 日本公司发布公告聘请朱虹为本基金基金经理，邹昱不再担任本基金基金经理。

基金托管人：

报告期内，基金托管人中国邮政储蓄银行托管业务部总经理变更为胡涛先生，并已完成监管报备程序。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同成立时起聘请安永华明会计师事务所为本基金提供审计服务。本报告期末改聘会计师事务所。本基金本报告期需向安永华明会计师事务所支付审计费 80,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内,管理人、托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
东方证券	2	60,719,869.08	100.00%	55,016.80	100.00%	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	-

注: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

11.7.2 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
东方证券	1,530,387,522.74	32.96%	145,000,000.00	1.43%	-	-
齐鲁证券	3,112,235,186.14	67.04%	10,023,000,000.00	98.57%	-	-

万家基金管理有限公司
2014 年 3 月 28 日