

基金管理人:万家基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月21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合同规定，于2014年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，保证复核后没有发现虚假记载、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。

本报告中财务数据未经审计。

§ 2 基金产品概况**万家行业优选股票型证券投资基金(LOF)****基金简称****基金代码****交易代码****基金运作方式****基金合同生效日****报告期末基金份额总额****投资目标****业绩比较基准****风险收益特征****基金管理人****基金托管人****§ 3 主要财务指标和基金净值表现****主要财务指标****报告期(2013年10月1日 - 2013年12月31日)****1.本期已实现收益****-10,490,334.45****2.本期利润****-7,516,043.69****3.加权平均基金份额本期利润****-0.0053****4.期末基金份额净值****867,066,142.63****5.期末基金份额净值****0.5499**

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，计价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 本基金本期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率① 净值增长标准差 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准差 ③ 收益率标准差 ④ ①-③ ②-④

过去三个月 -0.79% 0.98% -2.45% 0.90% 1.66% 0.08%

3.2.2 本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

阶段 净值增长率① 净值增长标准差 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准差 ③ 收益率标准差 ④ ①-③ ②-④

过去三个月 -0.79% 0.98% -2.45% 0.90% 1.66% 0.08%

注: 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.3 本基金本期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率① 净值增长标准差 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准差 ③ 收益率标准差 ④ ①-③ ②-④

过去三个月 -0.79% 0.98% -2.45% 0.90% 1.66% 0.08%

注: 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.4 本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

阶段 净值增长率① 净值增长标准差 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准差 ③ 收益率标准差 ④ ①-③ ②-④

过去三个月 -0.79% 0.98% -2.45% 0.90% 1.66% 0.08%

注: 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.5 本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

阶段 净值增长率① 净值增长标准差 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准差 ③ 收益率标准差 ④ ①-③ ②-④

过去三个月 -0.79% 0.98% -2.45% 0.90% 1.66% 0.08%

注: 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.6 本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

阶段 净值增长率① 净值增长标准差 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准差 ③ 收益率标准差 ④ ①-③ ②-④

过去三个月 -0.79% 0.98% -2.45% 0.90% 1.66% 0.08%

注: 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.7 本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

阶段 净值增长率① 净值增长标准差 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准差 ③ 收益率标准差 ④ ①-③ ②-④

过去三个月 -0.79% 0.98% -2.45% 0.90% 1.66% 0.08%

注: 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.8 本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

阶段 净值增长率① 净值增长标准差 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准差 ③ 收益率标准差 ④ ①-③ ②-④

过去三个月 -0.79% 0.98% -2.45% 0.90% 1.66% 0.08%

注: 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.9 本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

阶段 净值增长率① 净值增长标准差 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准差 ③ 收益率标准差 ④ ①-③ ②-④

过去三个月 -0.79% 0.98% -2.45% 0.90% 1.66% 0.08%

注: 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.10 本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

阶段 净值增长率① 净值增长标准差 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准差 ③ 收益率标准差 ④ ①-③ ②-④

过去三个月 -0.79% 0.98% -2.45% 0.90% 1.66% 0.08%

注: 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.11 本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

阶段 净值增长率① 净值增长标准差 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准差 ③ 收益率标准差 ④ ①-③ ②-④

过去三个月 -0.79% 0.98% -2.45% 0.90% 1.66% 0.08%

注: 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.12 本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

阶段 净值增长率① 净值增长标准差 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准差 ③ 收益率标准差 ④ ①-③ ②-④

过去三个月 -0.79% 0.98% -2.45% 0.90% 1.66% 0.08%

注: 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.13 本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

阶段 净值增长率① 净值增长标准差 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准差 ③ 收益率标准差 ④ ①-③ ②-④

过去三个月 -0.79% 0.98% -2.45% 0.90% 1.66% 0.08%

注: 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.14 本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

阶段 净值增长率① 净值增长标准差 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准差 ③ 收益率标准差 ④ ①-③ ②-④

过去三个月 -0.79% 0.98% -2.45% 0.90% 1.66% 0.08%

注: 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.15 本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

阶段 净值增长率① 净值增长标准差 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准差 ③ 收益率标准差 ④ ①-③ ②-④

过去三个月 -0.79% 0.98% -2.45% 0.90% 1.66% 0.08%

注: 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.16 本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

阶段 净值增长率① 净值增长标准差 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准差 ③ 收益率标准差 ④ ①-③ ②-④

过去三个月 -0.79% 0.98% -2.45% 0.90% 1.66% 0.08%

注: 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.17 本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

阶段 净值增长率① 净值增长标准差 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准差 ③ 收益率标准差 ④ ①-③ ②-④

过去三个月 -0.79% 0.98% -2.45% 0.90% 1.66% 0.08%

注: 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.18 本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

阶段 净值增长率① 净值增长标准差 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准差 ③ 收益率标准差 ④ ①-③ ②-④

过去三个月 -0.79% 0.98% -2.45% 0.90% 1.66% 0.08%

注: 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.19 本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

阶段 净值增长率① 净值增长标准差 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准差 ③ 收益率标准差 ④ ①-③ ②-④

过去三个月 -0.79% 0.98% -2.45% 0.90% 1.66% 0.08%

注: 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.20 本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

阶段 净值增长率① 净值增长标准差 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准差 ③ 收益率标准差 ④ ①-③ ②-④

过去三个月 -0.79% 0.98% -2.45% 0.90% 1.66% 0.08%

注: 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.21 本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

阶段 净值增长率① 净值增长标准差 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准差 ③ 收益率标准差 ④ ①-③ ②-④

过去三个月 -0.79% 0.98% -2.45% 0.90% 1.66% 0.08%

注: 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.22 本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

阶段 净值增长率① 净值增长标准差 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准差 ③ 收益率标准差 ④ ①-③ ②-④

过去三个月 -0.79% 0.98% -2.45% 0.90% 1.66% 0.08%

注: 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.23 本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

阶段 净值增长率① 净值增长标准差 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准差 ③ 收益率标准差 ④ ①-③ ②-④

过去三个月 -0.79% 0.98% -2.45% 0.90% 1.66% 0.08%