

基金管理人:万家基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2014年4月19日

5.1 重要提示

基金管理人的董事会及监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。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2014年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策和基金投资组合报告，确认不存在虚假记载、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。

本报告期利润为2014年1月1日起至3月31日止。

5.2 基金产品概况

基金简称	万家增强收益债券型证券投资基金
基金主代码	161902
交易代码	161902
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年9月28日
报告期末基金份额总额	469,707,022.82份
投资目标	本基金在建仓期内投资组合的长期稳定增值。 本基金在追求基金资产的长期稳定增值。并通过新股申购和股票相对价值投资策略实现股票型基金的超额收益。
投资策略	本基金在建仓期内投资组合的长期稳定增值。 本基金在追求基金资产的长期稳定增值。并通过新股申购和股票相对价值投资策略实现股票型基金的超额收益。
业绩比较基准	中证国债指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

5.3 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1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益	-2,802,510.23
2.本期利润	3,857,059.32
3.加权平均基金份额本期利润	0.0080
4.期末基金份额净值	461,490,971.04
5.期末基金资产净值	461,490,971.04

注:1.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将低于所列示的数字。
2.上表中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。

3.2.1 本基金报告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(①)	净值增长标准差(②)	业绩比较基准收益率(③)	业绩比较基准收益率标准差(④)
过去三个月	1.24%	0.15%	2.60%	0.08%

3.2.2 本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:本基金成立于2004年9月28日，于2007年9月29日转型为债券型基金，转型后建仓期为半年，建仓期结束后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。

万家增强收益债券型证券投资基金

2014 第一季度报告

和基金合同要求。

5.4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理的日期	证券从业年限	说明
孙伟	本基金基金经理，万家增强收益债券型证券投资基金基金经理，万家量化投资部总监，本基金管理公司，担任固定收益研究员、基金经理助理。	2011年3月19日	6年	

注:1. 此处仅列示直接管理本基金的基金经理。

2. 本基金的基金经理除上述人员外，还包括本公司总经理助理、督察长、基金经理助理、基金经理等。

3.2.2 管理人对报告期内基金运作总体评价、是否存在违法违规行为的说明

4.2 管理人报告期内基金运作合规情况说明

4.3 公平交易制度的执行情况

4.4 报告期内基金的业绩表现

4.5 管理人对宏观经济、证券市场走势的展望

4.6 投资组合报告

4.7 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

4.8 报告期内收到基金投诉的情况及处理方法

4.9 其他需要披露的重大事项

4.10 公平交易制度的执行情况

4.11 报告期内基金的业绩表现

4.12 管理人对宏观经济、证券市场走势的展望

4.13 投资组合报告

4.14 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

4.15 报告期内收到基金投诉的情况及处理方法

4.16 其他需要披露的重大事项

4.17 公平交易制度的执行情况

4.18 报告期内基金的业绩表现

4.19 管理人对宏观经济、证券市场走势的展望

4.20 投资组合报告

4.21 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

4.22 报告期内收到基金投诉的情况及处理方法

4.23 其他需要披露的重大事项

4.24 公平交易制度的执行情况

4.25 报告期内基金的业绩表现

4.26 管理人对宏观经济、证券市场走势的展望

4.27 投资组合报告

4.28 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

4.29 报告期内收到基金投诉的情况及处理方法

4.30 其他需要披露的重大事项

4.31 公平交易制度的执行情况

4.32 报告期内基金的业绩表现

4.33 管理人对宏观经济、证券市场走势的展望

4.34 投资组合报告

4.35 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

4.36 报告期内收到基金投诉的情况及处理方法

4.37 其他需要披露的重大事项

4.38 公平交易制度的执行情况

4.39 报告期内基金的业绩表现

4.40 管理人对宏观经济、证券市场走势的展望

4.41 投资组合报告

4.42 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

4.43 报告期内收到基金投诉的情况及处理方法

4.44 其他需要披露的重大事项

4.45 公平交易制度的执行情况

4.46 报告期内基金的业绩表现

4.47 管理人对宏观经济、证券市场走势的展望

4.48 投资组合报告

4.49 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

4.50 报告期内收到基金投诉的情况及处理方法

4.51 其他需要披露的重大事项

4.52 公平交易制度的执行情况

4.53 报告期内基金的业绩表现

4.54 管理人对宏观经济、证券市场走势的展望

4.55 投资组合报告

4.56 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

4.57 报告期内收到基金投诉的情况及处理方法

4.58 其他需要披露的重大事项

4.59 公平交易制度的执行情况

4.60 报告期内基金的业绩表现

4.61 管理人对宏观经济、证券市场走势的展望

4.62 投资组合报告

4.63 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

4.64 报告期内收到基金投诉的情况及处理方法

4.65 其他需要披露的重大事项

4.66 公平交易制度的执行情况

4.67 报告期内基金的业绩表现

4.68 管理人对宏观经济、证券市场走势的展望

4.69 投资组合报告

4.70 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

4.71 报告期内收到基金投诉的情况及处理方法

4.72 其他需要披露的重大事项

4.73 公平交易制度的执行情况

4.74 报告期内基金的业绩表现

4.75 管理人对宏观经济、证券市场走势的展望

4.76 投资组合报告

4.77 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

4.78 报告期内收到基金投诉的情况及处理方法

4.79 其他需要披露的重大事项

4.80 公平交易制度的执行情况

4.81 报告期内基金的业绩表现

4.82 管理人对宏观经济、证券市场走势的展望

4.83 投资组合报告

4.84 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

4.85 报告期内收到基金投诉的情况及处理方法

4.86 其他需要披露的重大事项

4.87 公平交易制度的执行情况

4.88 报告期内基金的业绩表现

4.89 管理人对宏观经济、证券市场走势的展望

4.90 投资组合报告

4.91 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

4.92 报告期内收到基金投诉的情况及处理方法

4.93 其他需要披露的重大事项

4.94 公平交易制度的执行情况

4.95 报告期内基金的业绩表现

4.96 管理人对宏观经济、证券市场走势的展望

4.97 投资组合报告

4.98 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

4.99 报告期内收到基金投诉的情况及处理方法

4.10 其他需要披露的重大事项

</