

万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金

[2012] 第二季度报告

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:2012年7月19日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中的真实性、准确性、完整性承担个别及连带责任。

基金管理人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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，但不保证本基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中的财务数据未经审计。

本报告期自2012年4月1日起至6月30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

基金运作方式 短期契约开放式

基金合同生效日 2008年6月27日

报告期末基金份额总额 59,126,191.68份

本基金通过投资股票、债券的有效配置，把握价值、成长风格特征，精选个股，构建投资组合，从而在有效控制风险的前提下，谋求基金资产的持续稳健增值。

本基金根据对宏观经济、经济周期及证券市场发展状况的综合分析，确定本基金的动态配置策略。本基金的投资组合采取自上而下的策略，以量化指标分为基本、估值、定价三个部分，筛选具有明显价值、成长风格特征的股票，同时精选债券，构建投资组合，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指数收益+40%×上证国债指数收益

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，中高收益的证券投资基金。

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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年4月1日至2012年6月30日)

1.本期已实现收益 2,242,392.54

2.本期利润 4,388,452.56

3.期初平均基金份额本期利润 0.0715

4.期末基金份额净值 51,774,860.74

5.期末基金份额净值 0.8757

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要低于所列数字。

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.基金净值表现

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

过去三个月 8.46% 0.91% 0.63% 0.67% 7.83% 0.24%

3.2.2 本基金今年以来以基金累计净值增长率变化及其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

—— 业绩比较基准

<p