

信息披露 Disclosure

万家行业优选股票型证券投资基金(LOF)

2013年度报告摘要

(2014)审字第0076728、B03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。

5 年度财务报表

7.1 资产负债表

万家行业优选股票型证券投资基金(LOF)

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
货币：		
银行存款	18,283,397.84	143,224,436.85
结算备付金	233,394,410.28	1,119,782.55
交易保证金	459,528.56	1,500,000.00
其他金融资产	627,580,937.26	488,902,074.50
其他资产	627,580,937.26	488,902,074.50
负债：		
应付证券清算款	94,453.33	48,324.96
应付利息	32,951.59	34,828.41
其他负债	-	-
资产总计	879,843,680.96	634,829,447.27
负债和所有者权益总计	879,843,680.96	634,829,447.27
所有者权益：		
实收资本	-	-
未分配利润	-	-
所有者权益合计	-	-

项目	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资产：		
货币：		
银行存款	18,283,397.84	143,224,436.85
结算备付金	233,394,410.28	1,119,782.55
交易保证金	459,528.56	1,500,000.00
其他金融资产	627,580,937.26	488,902,074.50
其他资产	627,580,937.26	488,902,074.50
负债：		
应付证券清算款	94,453.33	48,324.96
应付利息	32,951.59	34,828.41
其他负债	-	-
资产总计	879,843,680.96	634,829,447.27
负债和所有者权益总计	879,843,680.96	634,829,447.27
所有者权益：		
实收资本	-	-
未分配利润	-	-
所有者权益合计	-	-

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.2 权证交易

7.4.8.1.3 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

7.4.8.1.5 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.6 权证交易

7.4.8.1.7 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.8 权证交易

7.4.8.1.9 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.10 权证交易

7.4.8.1.11 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.12 权证交易

7.4.8.1.13 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.14 权证交易

7.4.8.1.15 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.16 权证交易

7.4.8.1.17 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.18 权证交易

7.4.8.1.19 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.20 权证交易

7.4.8.1.21 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.22 权证交易

7.4.8.1.23 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.24 权证交易

7.4.8.1.25 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.26 权证交易

7.4.8.1.27 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.28 权证交易

7.4.8.1.29 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.30 权证交易

7.4.8.1.31 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.32 权证交易

7.4.8.1.33 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.34 权证交易

7.4.8.1.35 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.36 权证交易

7.4.8.1.37 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.38 权证交易

7.4.8.1.39 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.40 权证交易

7.4.8.1.41 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.42 权证交易

7.4.8.1.43 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.44 权证交易

7.4.8.1.45 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

券监督管理委员会核准，并已完成工商变更登记手续。本次股权转让后，基金管理人的股权结构变为：齐鲁证券有限公司持股40%，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1%。

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%的股权。

3、下述关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款进行。

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

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

成交金额

占当期股票成交金额的比例

成交金额

占当期股票成交金额的比例

齐鲁证券

434,786,360.82

12.38%

227,515,489.04

8.45%

债券回购

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

成交金额

占当期债券回购成交金额的比例

成交金额

占当期债券回购成交金额的比例

齐鲁证券

0.00

0.00%

46,898,080.20

41.22%

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.2 权证交易

7.4.8.1.3 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

7.4.8.1.5 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.6 权证交易

7.4.8.1.7 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.8 权证交易

7.4.8.1.9 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.10 权证交易

7.4.8.1.11 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.12 权证交易

7.4.8.1.13 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.14 权证交易

7.4.8.1.15 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.16 权证交易

7.4.8.1.17 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.18 权证交易

7.4.8.1.19 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.20 权证交易

7.4.8.1.21 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.22 权证交易

7.4.8.1.23 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.24 权证交易

7.4.8.1.25 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.26 权证交易

7.4.8.1.27 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.28 权证交易

7.4.8.1.29 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.30 权证交易

7.4.8.1.31 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.32 权证交易

7.4.8.1.33 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.34 权证交易

7.4.8.1.35 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.36 权证交易

7.4.8.1.37 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.38 权证交易

7.4.8.1.39 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.40 权证交易

7.4.8.1.41 股指期货交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

序号	股票代码	股票名称	期末资产净值比例(%)	期末资产净值比例(%)
32	600011	华能国际	20,213,454.31	3.33
33	600337	美尚股份	19,157,761.14	3.16
34	600060	海信电器	18,682,271.08	3.08
35	000888	峨边山A	18,479,708.38	3.05
36	600795	国电电力	18,394,034.09	3.00
37	600118	中国神华	18,382,264.44	3.00
38	600256	广汇能源	18,176,828.47	2.95
39	002159	三特索道	18,109,407.14	2.93
40	300030	同德股份	17,893,762.30	2.95
41	000983	西药股份	17,562,136.34	2.87
42	600795	国电电力	17,471,831.12	2.87
43	002538	双轮传动	17,404,324.12	2.87
44	600340	华厦银行	17,057,681.46	2.81
45	000062	万科A	16,559,824.20	2.73
46	002422	科伦药业	16,408,587.44	2.69
47	600548	广汇能源	16,398,491.67	2.65
48	600535	英力士	15,838,298.24	2.54
49	300285	国瓷材料	14,629,027.23	2.41
50	600104	上汽集团	14,229,105.37	2.35
51	601011	江南能源	13,994,402.73	2.29
52	600745	国电电力	13,581,536.66	2.23
53	600546	山推股份	12,696,777.59	2.01
54	300284	苏交科	12,190,548.87	2.01

注：本期末买入金额均按买入成交金额成交均价乘以成交数量计算，不考虑相关交易费用。

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

2	601088	中国神华	48,997,844.55	8.08
3	601006	大秦铁路	48,928,853.78	8.07
4	600900	长江电力	47,706,681.71	7.87
5	601857	中国石油	44,459,679.55	7.33
6	600950	中国能源	39,512,229.13	6.51
7	002701	奥维通信	39,117,038.66	6.45
8	600028	中国石化	37,732,224.20	6.22
9	002376	新北洋	37,579,573.49	6.16
10	600016	民生证券	35,763,779.54	5.96
11	601256	广汇能源	35,574,088.21	5.87
12	600011	华能国际	34,467,418.38	5.67
13	000800	一汽轿车	34,090,352.99	5.62
14	000826	康得环境	31,533,044.61	5.23
15	600037	百视通	28,100,748.54	4.63
16	600795	国电电力	26,439,315.58	4.36
17	600085	同仁堂	24,660,241.36	4.06
18	000983	西山煤电	23,847,577.29	3.93
19	600138	中冶重工	23,008,114.24	3.79
20	300043	星辉农牧	21,452,683.83	3.54
21	601123	华彬国际	21,171,581.06	3.49
22	000937	赣中能源	21,109,853.71	3.49
23	000888	烟台冰厂	20,622,525.59	3.40
24	600348	航发航空	19,565,086.97	3.21
25	600337	美芝股份	19,460,274.17	3.23
26	600060	海信电器	18,675,486.58	3.08
27	000909	上海医药	18,488,276.13	2.97
28	600905	哈药股份	17,974,104.77	2.96
29	300030	鲁普医疗	17,831,040.59	2.94
30	600340	华夏幸福	17,729,037.41	2.92
31	600315	上海家化	17,727,474.84	2.92
32	000708	中航光电	17,679,433.32	2.92
33	000983	南山铝业	16,966,913.57	2.80
34	000917	广电传媒	16,621,162.04	2.73
35	002422	科伦药业	16,543,808.93	2.74
36	002219	恒康医疗	16,004,729.33	2.61
37	000006	深振业A	15,780,317.95	2.64
38	600048	华药股份	15,346,315.65	2.60
39	600886	国投电力	14,889,583.10	2.45
40	300285	国瓷材料	14,846,982.11	2.46
41	601099	鹏安环保	14,645,842.35	2.41
42	001101	华信国际	14,606,266.99	2.39
43	000642	荣信股份	14,379,076.35	2.37
44	601014	上汽集团	14,314,813.69	2.36
45	000002	万科A	14,299,574.51	2.35
46	601991	大智慧云	13,631,405.97	2.25
47	600095	盛京股份	13,416,784.92	2.21
48	000027	华孚时尚	12,745,138.36	2.10
49	300284	东宏科	12,444,115.80	2.05

注：A、B项资产金额均按期末以公允价值计量或以成本法计量的公允价值，不考虑相关交易费用。