

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8月27日
重要提示
基金管理人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...

2014 半年度报告摘要

用利差则高于历史均值,反映了信用环境较差的现状。二季度各期限收益率下行幅度相近,导致半年末时债券收益率曲线较为平坦。
3.1 行业分析
一季度我们看好市场,并且增加了利率债的仓位,取得了较好的投资收益。到了二季度,尽管我们继续看好市场,但是由于本基金面临转型,因而总体投资策略以确保封闭后转型的流动性为主...

2.1 基金基本情况
基金简称: 万家添利
基金代码: 161908
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

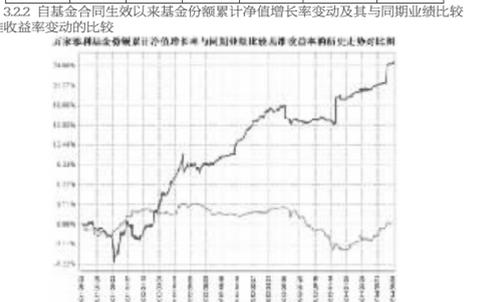
2.2 基金产品说明
在严格控制投资风险的基础上,追求当期长期化投资收益目标。
本基金在充分研究宏观经济形势以及政策导向的基础上,采取积极主动的投资管理策略,通过自上而下对行业配置,自下而上对个股精选,力求在控制风险的前提下,实现基金资产的长期增值...

2.3 基金管理人及基金托管人
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
基金管理人地址: 上海浦东新区世纪大道1500号陆家嘴基金大厦
基金托管人地址: 北京市西城区宣武门大街100号

2.4 信息披露方式
基金年度报告正文及审计报告全文披露网站: http://www.wjfund.com
基金半年度报告摘要披露网站: 上海浦东新区世纪大道1500号陆家嘴基金大厦

3 主要财务指标和基金净值表现
3.1 主要会计数据和财务指标
报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)
基金净值增长率: 25.78%
基金份额净值: 1.0724

3.2 基金净值表现
基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
基金净值增长率: 25.78%
业绩比较基准收益率: 25.78%



注:本基金于2011年6月2日成立,根据基金合同约定,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约定,报告期末各项资产配置比例符合基金合同约定。

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...

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: 王亚伟
职务: 基金经理
任职日期: 2014年5月24日
证券从业年限: 3年

4.2 基金管理人及基金经理的承诺
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 基金管理人及基金经理的承诺
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...

4.3 公平交易制度的执行情况
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《公平交易管理办法》和《异常交易监控及报告管理办法》等规章制度,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,确保公平对待不同投资品种...

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
上半年宏观经济总体维持偏弱的走势,主导经济走势的总逻辑为房地产产业的周期性下滑,制造业继续受制于产能过剩问题而处于调整阶段,但逐步趋向于稳定。信用扩张方面,由于监管部门对地方政府信用扩张的强监管约束,民间融资主体受制于需求不振或者是结构性融资困难等原因,一季度全社会的广义信贷扩张较缓...

4.5 报告期内基金业绩表现
报告期内基金净值增长率为25.78%,同期业绩比较基准收益率为25.78%。
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

4.6 管理人对于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...

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
根据基金合同约定,“在封闭期内,本基金不单独对添利A和添利B基金份额进行收益分配,封闭期届满并转换为上市开放式基金(LOF)后,符合有关基金分红的前提下,本基金收益最多分配12次,每次基金收益分配比例不低于期末可供分配利润的20%”。
2014年6月20日,本基金进行利润分配,每10份基金份额分红1.50元,共计分配利润1,644,913,417.30元,符合基金合同约定的规定。

4.8 基金管理人对于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...

4.9 基金管理人对于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...

4.10 基金管理人对于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...

4.11 基金管理人对于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...

4.12 基金管理人对于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...

4.13 基金管理人对于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...

4.14 基金管理人对于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...

4.15 基金管理人对于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...

4.16 基金管理人对于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...

4.17 基金管理人对于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...

4.18 基金管理人对于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...

4.19 基金管理人对于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...

Table with columns: 关联方, 本期, 上期, 本期, 上期. Rows include 中国工商银行, 中国建设银行, 中国工商银行, 中国建设银行.

注:本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户存于中国证券登记结算有限责任公司,2014年1月1日至2014年6月30日获得的利息为人民币18,899.12元(2013年1月1日至2013年6月30日为人民币51,662.50元),2014年6月30日结算资产余额为人民币960,231.77元(2013年6月30日余额为人民币1,870,176.97元)。

6.4.9.1 银行间市场债券交易
截至本报告期末2014年6月30日止,本基金无银行间市场债券正回购余额。
6.4.9.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2014年6月30日止,本基金无交易所市场债券正回购余额。
6.4.10 有助于理解和分析会计报表重要项目的其他重要事项
截至资产负债表日,本基金无需说明的其他重要事项。

Table: 7.1 期末基金资产组合情况. Columns: 序号, 代码, 名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例.

Table: 7.2 期末按行业分类的股票投资组合. Columns: 序号, 代码, 名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例.

Table: 7.3 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. Columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例.

Table: 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细. Columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例.

Table: 7.5 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. Columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例.

Table: 7.6 期末持有的处于转股期的可转换债券明细. Columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例.

Table: 7.7 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明. Columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例.

Table: 7.8 期末基金资产组合情况. Columns: 序号, 代码, 名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例.

Table: 7.9 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. Columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例.

Table: 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明. Columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例.

Table: 7.11 投资组合报告. Columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例.

Table: 7.12 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之外的股票. Columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例.

Table: 7.13 期末其他各项资产构成. Columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例.