

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
送出日期:2014年8月27日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员声明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责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人对本报告书所载资料的合规性、准确性、完整性和及时性承担法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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及其更新。

本半年度报告摘要自 年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告财务数据未经审计。

报告期为2014年1月1日起至2014年6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

项目	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资产:		
银行存款	11,853,421.03	1,251,276.59
结算备付金	1,095,892.02	1,993,431.20
在途资金	366,015.33	407,038.25
交易金融资产	499,796,928.58	611,635,316.34
其中：股票投资	26,479,055.46	1,675,000.00
基金投资	-	-
债券投资	473,317,678.12	609,978,516.34
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生品投资	-	-
其他金融资产	1,000,000.00	14,000,000.00
应收证券清算款	563,537.91	10,759,215.12
应收利息	9,453,137.44	9,655,615.25
应收股利	-	-
应收申购款	460,534.90	141,227.01
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	524,589,467.21	649,818,319.76
负债和所有者权益		
负债:		
短期借款	2014年6月30日	2013年12月31日
应付票据	-	-
应付账款	-	-
应付职工薪酬	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	83,504.99	27.78
应付股利	-	-
应付手续费	-	-
应付交易费用	-	-
应付交割费用	-	-
应付其他费用	-	-
应付合同负债	-	-
应交税金	369,553,107.95	631,484,460.19
应付利润	22,386,292.55	8,318,263.69
应付股利	391,939,400.50	630,801,723.88
应付合同负债	524,589,467.21	649,818,319.76
所有者权益		
实收基金	369,553,107.95	631,484,460.19
未分配利润	22,386,292.55	8,318,263.69
所有者权益合计	391,939,400.50	630,801,723.88
所有者权益总计	524,589,467.21	649,818,319.76

2.2 基金产品说明

投资目标 在满足基金资产良好流动性的前提下,谋求基金资产的稳健增长。

投资策略 本基金在固有风险控制的基础上,通过资产配置,运用杠杆效应,追求在控制风险的前提下获取超越基准的长期回报率。

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和混合型基金,高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	万家基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
办公地址	上海市静安区新闸路360号16楼	北京市东城区建国门内大街1号
信息披露负责人	王群航	李国华
联系电话	021-38619810	6010-66060060
电子邮箱	lunji@wjasset.com	lunji@abchina.com
客户服务电话	95588999,4008880800	95599
传真	021-38619888	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 http://www.wjasset.com

基金半年度报告备置地点 上海市浦东新区陆家嘴环路300号陆家嘴国际大厦9楼基金管理人 办公场所

§ 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 金额单位:人民币元

项目	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)	本年累计
本期已实现收益	2,747,960.73	18,952,002.95
本期利润	18,952,002.95	0.402
加权平均基金份额本期利润	0.468%	-
期末基金资产净值增长率	4.68%	-
3.1.2 期末利润和年末利润	报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)	-0.402
3.1.3 期末可供分配利润	391,939,400.50	391,939,400.50
3.1.4 期末基金资产净值	1,0159	-

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所述基金绩效指标不包括认购或申购本基金的各项费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.期末可供分配利润采用期末资产负责表中应分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率为及其同期间比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长 率(%)	份额净值 增长标准差(%)	业绩比较基准 收益率(%)	①-③	②-④
过去一个月	1.55%	0.15%	0.79%	0.05%	0.76%
过去三个月	3.40%	0.11%	2.94%	0.06%	0.46%
过去六个月	4.68%	0.13%	5.68%	0.07%	-1.00%
过去一年	4.40%	0.12%	2.08%	0.10%	2.32%
过去二年	18.67%	0.12%	13.09%	0.09%	5.58%
自基组合同期	109.57%	0.26%	42.18%	0.08%	67.39%

注:基金业绩比较基准为中证全债指数

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其同期间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,建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期内各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

§ 4 管理人报告

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是中国证监会批准设立的公司,现股东为齐鲁证券有限公司、新财富国际实业有限公司和山东华信国有资产投资控股有限公司,住所地及办公地点均为上海市浦东新区陆家嘴环路360号陆家嘴国际大厦16楼,注册资本1亿元人民币,目前管理九只基金,分别为万家货币市场基金、万家货币型基金、万家行业股票型基金、万家债券型基金、万家精选股票型基金、万家增强收益型基金、万家双利债券型基金、万家货币型基金和万家货币型基金。

万家货币型基金于2004年1月10日成立,2004年1月10日开始开放申购和赎回,基金代码为161057,基金成立以来总回报率为139.79%,61057份基金份额,经中国证监会批准基金于2004年1月10日成立,2004年1月10日开始开放申购和赎回,基金代码为161057,基金成立以来总回报率为139.79%,61057份基金份额。

万家货币型基金于2004年1月10日成立,2004年1月10日开始开放申购和赎回,基金代码为161057,基金成立以来总回报率为139.79%,61057份基金份额。

万家货币型基金于2004年1月10日成立,2004年1月10日开始开放申购和赎回,基金代码为161057,基金成立以来总回报率为139.79%,61057份基金份额。