

万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金 2010 年年度报告

2010 年 12 月 31 日

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

送出日期： 2011 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2011 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告财务资料已经审计,安永华明会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算等情况的说明	11
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	11
§ 6 审计报告	12
6.1 审计报告基本信息	12
6.2 审计报告的基本内容	12
§ 7 年度财务报表	13
7.1 资产负债表	13
7.2 利润表	14
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
7.4 报表附注	16
§ 8 投资组合报告	33
8.1 期末基金资产组合情况	33
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	33
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	34
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	35
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	42
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	42

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	42
8.9 投资组合报告附注.....	42
§ 9 基金份额持有人信息	43
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	43
§ 10 开放式基金份额变动.....	43
§ 11 重大事件揭示	43
11.1 基金份额持有人大会决议.....	43
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	43
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
11.4 基金投资策略的改变.....	44
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	44
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
11.8 其他重大事件	45
§ 12 备查文件目录	45
12.1 备查文件名称	45
12.2 备查文件存放地点.....	45
12.3 备查文件查阅方式.....	45

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	万家双引擎灵活配置混合
基金主代码	519183
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 6 月 27 日
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
报告期末基金份额总额	71,488,163.99 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过股票、债券的有效配置,把握价值、成长风格特征,精选个股,构造风格类资产组合。在有效控制风险的前提下,谋求基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金根据对宏观经济环境、经济增长前景及证券市场发展状况的综合分析,确定大类资产的动态配置。本基金股票投资组合采取自下而上的策略,以量化指标分析为基础,结合定性分析,精选具有明显价值、成长风格特征且具备估值优势的股票,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 指数收益率+40%×上证国债指数收益率
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、中高预期收益的证券投资基金。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	张志永
	联系电话	021-38619810	021-62677777*212004
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		4008880800	95561
传真		021-38619888	021-62159217
注册地址		上海市浦东新区福山路 450 号新天国际大厦 23 楼	福州市湖东路 154 号
办公地址		上海市浦东新区福山路 450 号新天国际大厦 23 楼	上海市江宁路 168 号兴业大厦 20 楼
邮政编码		200122	200041
法定代表人		毕玉国	高建平

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.wjasset.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区福山路 450 号新天国际大厦 23 楼 基金管理人办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010 年	2009 年	2008 年 06 月 27 日至 2008 年 12 月 31 日
本期已实现收益	422,666.65	28,570,514.28	3,735,405.77
本期利润	-1,800,993.63	31,974,943.68	4,843,326.04
加权平均基金份额本期利润	-0.0231	0.3220	0.0233
本期加权平均净值利润率	-2.31%	26.45%	2.31%
本期基金份额净值增长率	-2.98%	49.35%	4.19%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
期末可供分配利润	1,296,366.13	2,246,375.53	631,363.29
期末可供分配基金份额利润	0.0181	0.0203	0.0115
期末基金资产净值	72,784,530.12	116,280,613.74	55,907,047.98
期末基金份额净值	1.0181	1.0494	1.0219
3.1.3 累计期末指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
基金份额累计净值增长率	50.96%	55.60%	4.19%

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、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。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

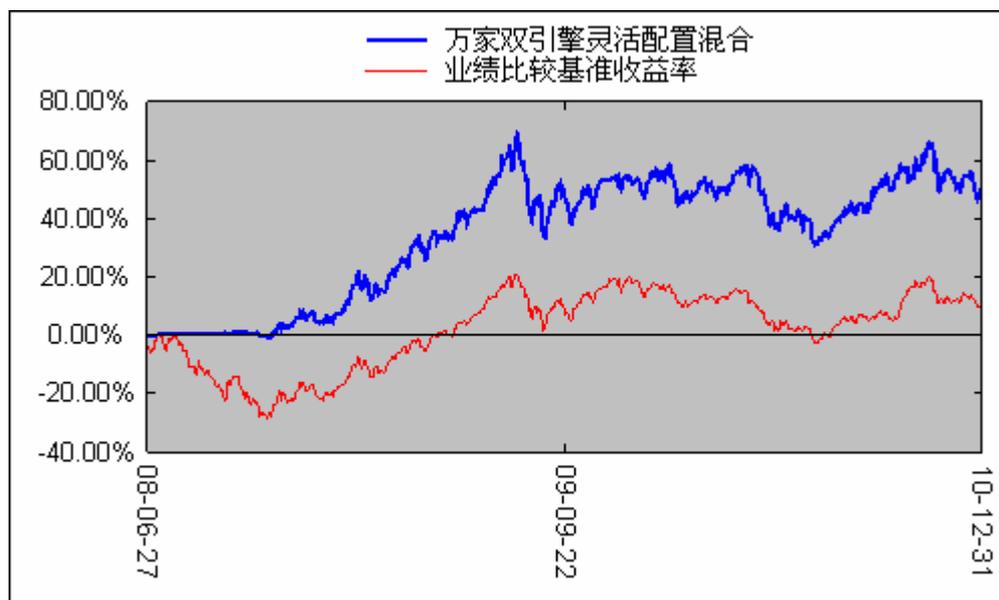
4、本基金于 2008 年 6 月 27 日成立,2008 年的报告期间为 2008 年 6 月 27 日至 2008 年 12 月 31 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

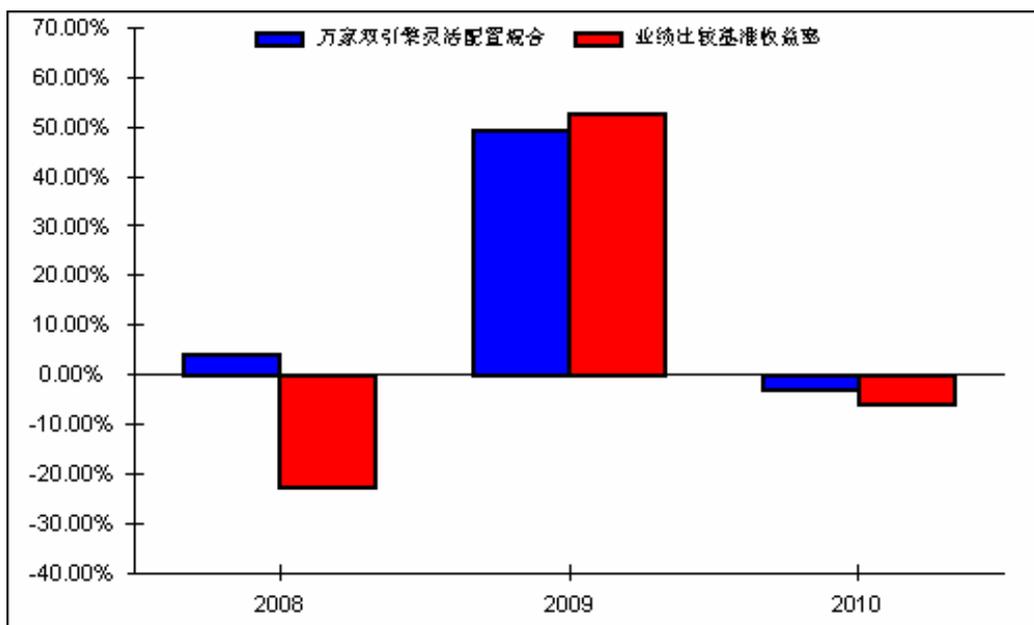
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去 3 个月	-3.19%	1.43%	4.00%	1.06%	-7.19%	0.37%
过去 6 个月	14.41%	1.21%	13.33%	0.93%	1.08%	0.28%
过去 1 年	-2.98%	1.23%	-5.83%	0.95%	2.85%	0.28%
自基金合同生效起至今	50.96%	1.22%	11.23%	1.28%	39.73%	-0.06%

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与同期业绩比较基准收益率变动的比较



本基金于 2008 年 6 月 27 日成立, 建仓期为六个月, 建仓期结束时和报告期末各项资产配置比例符合基金合同要求。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金于 2008 年 6 月 27 日成立，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2010 年	0.000	0.00	0.00	0.00	-
2009 年	4.700	802,624,210.75	12,013,800.25	814,638,011.00	-
2008 年	0.200	915,279.16	158,066.20	1,073,345.36	-
合计	4.900	803,539,489.91	12,171,866.45	815,711,356.36	-

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、上海久事公司、深圳市中航投资管理有限公司、山东省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福山路 450 号，注册资本 1 亿元人民币。目前管理八只开放式基金，分别为万家 180 指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家公用事业行业股票型证券投资基金、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金和万家精选股票型证券投资基金。

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	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
鞠英利	本基金基金经理、万家公用	2009 年 3 月 4 日	2010 年 7 月 3 日	11 年	男、博士学位，曾任汕头证券上海总部研究中心投资主

	事业基金基金经理、万家和谐基金基金经理				管、渤海证券上海资产管理部投资主管、华林证券有限责任公司投资经理、上海鑫地投资管理有限公司证券投资部总经理等职。
吴印	本基金基金经理	2010年7月3日	-	4年	男，工学学士，经济学硕士，2006年加入万家基金，从事证券投资和研究工作，历任研究发展部行业分析师、基金经理助理等职。

注:1、任职日期以及离任日期均以公告日为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律、法规和监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金持有人谋取最大利益,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本公司严格遵循公平交易的原则,在投资管理活动中公平对待不同基金品种,无直接或间接在不同投资组合之间进行利益输送的行为,报告期内无异常交易。

公司根据中国证监会发布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,制订和完善了公平交易内部控制制度,通过制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时,公司通过对投资交易行为的监控、分析评估来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

组合	报告期组合收益
本基金	-2.98%
万家和谐增长混合型证券投资基金	-5.52%
差异	2.54%

基金间年收益率差异绝对值为 2.54%,小于 5%,不存在非公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内无异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2010 年,国内 A 股市场在经济周期波动、宏观政策与国外超宽松货币环境的多方驱动下,呈现出宽幅波动,各板块严重分化的走势。上半年尤其是二季度,在新一轮房地产紧缩的环境下,市场出现大幅度的下滑,下半年在美国二次量化宽松的预期之下,市场大幅反弹。全年整体来看,各个板块之间分化明显,中小板与主板之间,消费与周期之间都呈现出迥然不同的走势,这既是中国经济结构转型带来的增长前景的分化,也是周期波动带来的估值分化,同时也是市场情绪的集中体现。

在 2010 年的操作中,上半年在政策紧缩的强烈预期之下,本基金主要以调整结构为主,初期我们对军工、医药、重组等几个方面进行了配置,进一步加大了实地调研的力度,逐步淡化区域经济中的板块效应,二季度适度增加了医药、节能环保、商业等受调控政策影响不大的行业比重,减持了银行、地产、煤炭以及有色等强周期的行业。三季度国内 A 股市场结构性分化,基金适度增加了医药、节能环保、商业

等受调控政策影响不大的行业比重,减持了部分受调控影响较多的行业。第四季度则增加了煤炭、有色金属等低估值行业景气向上的行业比重,减持了部分受调控影响较多的行业。

在全球经济波云诡谲,全球各国政府强势介入的情况下,市场运行的趋势与驱动因素与以往相比都有了很大的不同,我们尽力作好仓位控制、行业与个股配置,提高投资效率以提升基金业绩。

4.4.2 报告期内基金业绩的表现

截至报告期末,该基金份额净值为 1.0181 元,报告期基金份额净值增长率为-2.98%,同期业绩比较基准增长率-5.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2011 年,从宏观基本面判断,国内经济将逐步进入新一轮的经济增长周期,随着“十二五”开局,保障房建设等民生工程不断展开,海外经济复苏,将拉动资源品、原材料需求。海外方面,虽然中东局势不稳,欧洲债务危机还没有完全解除警报,但是总体经济回稳的局面不会改变。从政策来看,政府进一步收紧流动性的态度异常坚决,打击房地产炒作的政策也会长时间的存在,而美国在二次量化宽松之后的货币政策也存在着紧缩的可能性。

从以上经济基本面与流动性的分析来看,2011 年将会是相当纠结的一年,纠结于经济的强劲增长与流动性不断收紧,纠结于微观主体的兴兴向荣与宏观局势的波云诡谲,纠结于中长期的主导产业发展与短期的行业盈利前景。

在这些条件相互作用下,2011 年本基金将结合国内长期发展格局和短期推动因素,重点布局:第一、新经济周期进入稳定增长阶段带来的投资机会,如:机械设备、通信系统等。第二、政策推动经济结构转型带来的投资机会,其中包括区域经济、低碳/新能源等、节能减排、医疗保健等。另外,我们还将持续重点挖掘具有独特盈利模式,并可以通过复制实现快速扩张的成长型投资标的。2011 年将是震荡的一年,而其中的投资机会预计会是局部性的和结构性的。我们将通过良好的仓位控制和行业个股配置,努力实现基金绩效平稳增长。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内,在完善公司治理结构,内部控制制度和流程体系的同时,加强日常监察力度,推动制度流程的落实工作;强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察,采取实时监控、定期检查、专项检查的方式及时发现问题,提出改进意见和跟踪落实情况,发现违规隐患及时与业务部门沟通并向管理层报告;定期向公司董事会和监管部门出具监察报告。

报告期内,基金管理人为防范和化解经营风险,确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整,主要做了以下工作:

1、继续加强公司风控文化建设

报告期内,通过多种手段向业务人员和管理层提示公司运营中存的风险;通过流程梳理和再造来防范操作风险;通过经常性的各种会议、合规培训等方式提高员工风险意识;通过加大对投资行为监控和从业人员行为监控防范老鼠仓、利益输送、非公平交易等行为。

2、继续完善基金投资风险管理、绩效评估工作

报告期内,监察稽核部对公司管理层及时提供各类业绩数据和业绩归因分析,为经营决策和投资部门的考核提供依据;对风险控制和绩效评估的周报、月报的内容进行了充实,增加了公平交易等有关内容;对基金运作中的风险点及时向基金经理和分管领导进行提示;对各基金的交易出具每日合规监控表,对公平交易和异常交易在周报和月报中进行分析 and 提示,并每季度出具公平交易报告。报告期内未发生大的投资违规情况以及不正当关联交易、利益输送等损害基金份额持有人利益的行为。

3、对公司管理体系进一步完善

在 2009 年对公司全部规章制度和流程进行了整理的基础上,2010 年,公司修订了《风控委员会工作制度》、《办公电话录音及电脑监控系统管理办法》、《万家基金管理公司客户风险等级分类管理办法》、《股票库管理办法》、《公平交易管理办法》、《中央交易室业务流程》等制度流程,同时新制订了《股指期货投资管理办法》和《股指期货风险控制制度》、《针对代销机构的审慎调查问卷》等。

4、进一步加强反洗钱工作

报告期内,反洗钱工作有了比较大的改进,公司加大了对反洗钱工作的检查力度,反洗钱可疑交易报送工作质量有了进一步的提高;加大了人工识别可疑交易的力度;增加了客户身份识别的手段。

5、持续做好事后监督工作

报告期内,公司加大了监察稽核力度,按照年度监察稽核计划,以基金投资和市场营销为重点,对公司各个部门进行定期稽核工作,事后稽核工作质量稳步提高。

4.7 管理人对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

基金管理人

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。估值委员会主要由分管基金估值业务的公司领导、督察长、基金估值业务的负责人、监察稽核部负责人、研究发展部负责人等组成。估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关从业资格,精通各自领域的理论知识,熟悉政策法规,并具有丰富的实践经验。

托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算等复核和核查的责任。

会计师事务所

会计师事务所对基金管理公司所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与和决定基金估值。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4、已签约的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算等情况的说明

报告期内,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为;基金管理人在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

兴业银行股份有限公司资产托管部

2011年3月25日

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2011)审字第 60778298_B07 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“万家双引擎混合基金”)的财务报表,包括 2010 年 12 月 31 日的资产负债表、2010 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是万家双引擎混合基金的基金管理人万家基金管理有限公司的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为,上述财务报表在所有重大方面按照企业

	会计准则的规定编制，公允反映了万家双引擎混合基金 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	徐 艳	汤 骏
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所	
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2011 年 3 月 17 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	21,804,393.88	11,713,312.14
结算备付金		336,609.34	3,211,314.43
存出保证金		91,796.06	494,714.76
交易性金融资产	7.4.7.2	33,253,385.22	89,147,748.46
其中：股票投资		33,253,385.22	89,147,748.46
债券投资		0.00	0.00
资产支持证券投资		0.00	0.00
衍生金融资产	7.4.7.3	0.00	0.00
买入返售金融资产	7.4.7.4	0.00	0.00
应收证券清算款		0.00	23,844,256.12
应收利息	7.4.7.5	3,996.57	119,488.36
应收股利		0.00	0.00
应收申购款		21,564,486.02	139,021.21
其他资产	7.4.7.6	0.00	0.00
资产总计		77,054,667.09	128,669,855.48
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		0.00	0.00
交易性金融负债		0.00	0.00
衍生金融负债	7.4.7.3	0.00	0.00
卖出回购金融资产款		0.00	0.00
应付证券清算款		3,609,572.45	0.00
应付赎回款		969.16	10,320,716.99
应付管理人报酬		60,218.89	268,803.52

应付托管费		10,036.49	44,800.60
应付销售服务费		0.00	0.00
应付交易费用	7.4.7.7	229,336.33	1,356,023.46
应交税费		0.00	0.00
应付利息		0.00	0.00
应付利润		0.00	0.00
其他负债	7.4.7.8	360,003.65	398,897.17
负债合计		4,270,136.97	12,389,241.74
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	71,488,163.99	110,802,401.69
未分配利润	7.4.7.10	1,296,366.13	5,478,212.05
所有者权益合计		72,784,530.12	116,280,613.74
负债和所有者权益总计		77,054,667.09	128,669,855.48

注:报告截止日 2010 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.0181 元,基金份额总额 71,488,163.99 份。

7.2 利润表

会计主体: 万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金

本报告期: 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
一、收入		2,358,182.27	39,359,917.23
1. 利息收入		179,114.07	670,205.77
其中: 存款利息收入	7.4.7.11	179,114.07	599,483.19
债券利息收入		0.00	70,722.58
资产支持证 券利息收入		0.00	0.00
买入返售金 融资产收入		0.00	0.00
其他利息收 入		0.00	0.00
2. 投资收益(损失以 “-”填列)		4,314,206.77	32,957,967.77
其中: 股票投资收益	7.4.7.12	4,031,241.24	32,291,365.50
债券投资收 益	7.4.7.13	0.00	406,110.61
资产支持证 券投资收益	7.4.7.14	0.00	0.00
衍生工具收 益	7.4.7.15	0.00	22,905.32
股利收益	7.4.7.16	282,965.53	237,586.34

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-2,223,660.28	3,404,429.40
4. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	88,521.71	2,327,314.29
减：二、费用		4,159,175.90	7,384,973.55
1. 管理人报酬		1,178,668.99	1,776,484.93
2. 托管费		196,444.81	296,080.76
3. 销售服务费		0.00	0.00
4. 交易费用	7.4.7.19	2,405,491.60	4,933,836.86
5. 利息支出		0.00	0.00
其中：卖出回购金融资产支出		0.00	0.00
6. 其他费用	7.4.7.20	378,570.50	378,571.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,800,993.63	31,974,943.68

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	110,802,401.69	5,478,212.05	116,280,613.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,800,993.63	-1,800,993.63
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-39,314,237.70	-2,380,852.29	-41,695,089.99
其中：1. 基金申购款	38,980,286.19	462,173.64	39,442,459.83
2. 基金赎回款	-78,294,523.89	-2,843,025.93	-81,137,549.82
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	71,488,163.99	1,296,366.13	72,784,530.12
项目	上年度可比期间		
	2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）	54,710,993.49	1,196,054.49	55,907,047.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	31,974,943.68	31,974,943.68
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	56,091,408.20	786,945,224.88	843,036,633.08
其中：1. 基金申购款	1,825,471,761.69	882,149,299.67	2,707,621,061.36
2. 基金赎回款	-1,769,380,353.49	-95,204,074.79	-1,864,584,428.28
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-814,638,011.00	-814,638,011.00
五、期末所有者权益（基金净值）	110,802,401.69	5,478,212.05	116,280,613.74

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：毕玉国 主管会计工作负责人：杨峰 会计机构负责人：陈广益

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]316号文《关于核准万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》的核准，由万家基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集，基金合同于2008年6月27日正式生效，首次设立的募集规模为353,835,521.84份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为万家基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行、上市的股票、债券、现金、短期金融工具、资产支持证券、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金通过股票、债券的有效配置，谋求基金资产的持续稳健增值。本基金的业绩比较基准为：60%×沪深300指数收益率+40%×上证国债指数收益率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、证监会公告[2010]5号关于发布《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金于 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度, 即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外, 均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债), 并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项;

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具(主要系权证投资);

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债; 本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债;

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等, 以及不作为有效套期工具的衍生工具, 按照取得时的公允价值作为初始确认金额, 相关的交易费用在发生时计入当期损益;

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利, 应当确认为当期收益; 每日, 本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益;

处置该金融资产或金融负债时, 其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益, 同时调整公允价值变动收益;

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止, 或该金融资产已转移, 且符合金融资产转移的终止确认条件的, 金融资产将终止确认;

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的, 该金融负债或其一部分将终止确认;

金融资产转移, 是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方); 本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的, 终止确认该金融资产; 保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的, 不终止确认该金融资产; 本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的, 分别下列情况处理: 放弃了对该金融资产控制的, 终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债; 未放弃对该金融资产控制的, 按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产, 并相应确认有关负债;

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下:

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资; 股票投资成本, 按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账; 卖出股票于成交日确认股票投资收益, 卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资；债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益；卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资；权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议(封闭式回购)，以成本列示，按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 股票投资

(1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

C. 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

D. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理；

2) 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

3) 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

4) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 2)、3) 中的相关原则进行估值；

5) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净

值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算,并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账;若提前支取定期存款,按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入,并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失,列入利息收入减项,存款利息收入以净额列示;

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行机构代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提;

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额,扣除应由资产支持证券发行机构代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在证券实际持有期内逐日计提;

(4) 买入返售金融资产收入,按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以使用合同利率),在回购期内逐日计提;

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认,并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账;

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认债券投资收益/(损失),并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;

(8) 股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%的年费率逐日计提;

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提;

(3) 卖出回购证券支出,按卖出回购金融资产摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在回购期内逐日计提;

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用;如果影响基金份额净值小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 每一基金份额享有同等分配权;

(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;

(3) 基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配;

(4) 基金当年收益应先弥补上一年度亏损后,才可进行当年收益分配;

(5) 在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为 6 次,每次分配比例不低于可分配收益的 50%;

(6) 本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利按权益登记日除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(7) 当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的分配权益;当日赎回的基金份额自下一个工作日起不享有基金的分配权益;

(8) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准, 财政部、国家税务总局研究决定, 自 2008 年 4 月 24 日起, 调整证券(股票)交易印花税率, 由原先的 3‰调整为 1‰;

经国务院批准, 财政部、国家税务总局研究决定, 自 2008 年 9 月 19 日起, 调整由出让方按证券(股票)交易印花税率缴纳印花税, 受让方不再征收, 税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定, 股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让, 暂免征收印花税。

2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定, 自 2004 年 1 月 1 日起, 对证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入, 继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定, 股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入, 暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定, 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定, 对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入, 由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定, 自 2005 年 6 月 13 日起, 对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得, 按照财税[2005]102 号文规定, 扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时, 减按 50%计算应纳税所得额;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定, 股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入, 暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
活期存款	21, 804, 393. 88	11, 713, 312. 14
定期存款	0. 00	0. 00
其中: 存款期限 1-3 个	0. 00	0. 00

月		
其他存款	0.00	0.00
合计	21,804,393.88	11,713,312.14

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2010年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		30,964,695.83	33,253,385.22	2,288,689.39
债券	交易所市场	0.00	0.00	0.00
	银行间市场	0.00	0.00	0.00
	债券合计	0.00	0.00	0.00
	资产支持证券	0.00	0.00	0.00
基金		-	-	-
其他		0.00	0.00	0.00
合计		30,964,695.83	33,253,385.22	2,288,689.39
项目		上年度末 2009年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		84,635,398.79	89,147,748.46	4,512,349.67
债券	交易所市场	0.00	0.00	0.00
	银行间市场	0.00	0.00	0.00
	债券合计	0.00	0.00	0.00
	资产支持证券	0.00	0.00	0.00
基金		-	-	-
其他		0.00	0.00	0.00
合计		84,635,398.79	89,147,748.46	4,512,349.67

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

期末本基金未持有买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2010年12月31日	2009年12月31日

应收活期存款利息	3,553.21	12,413.40
应收定期存款利息	0.00	0.00
应收其他存款利息	0.00	0.00
应收结算备付金利息	117.80	1,385.83
应收债券利息	0.00	0.00
应收买入返售证券利息	0.00	0.00
应收申购款利息	325.56	105,689.13
其他	0.00	0.00
合计	3,996.57	119,488.36

7.4.7.6 其他资产

无

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2010年12月31日	2009年12月31日
交易所市场应付交易费用	229,336.33	1,356,023.46
银行间市场应付交易费用	0.00	0.00
合计	229,336.33	1,356,023.46

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2010年12月31日	2009年12月31日
应付券商交易单元保证金	0.00	0.00
应付赎回费	3.65	38,897.17
预提费用—审计费	60,000.00	60,000.00
—信息披露费	300,000.00	300,000.00
合计	360,003.65	398,897.17

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2010年1月1日至2010年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	110,802,401.69	110,802,401.69
本期申购	38,980,286.19	38,980,286.19
本期赎回（以“-”号填列）	-78,294,523.89	-78,294,523.89
本期末	71,488,163.99	71,488,163.99

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	2,246,375.53	3,231,836.52	5,478,212.05
本期利润	422,666.65	-2,223,660.28	-1,800,993.63
本期基金份额交易产生的变动数	1,842,578.36	-4,223,430.65	-2,380,852.29
其中：基金申购款	1,884,944.60	-1,422,770.96	462,173.64
基金赎回款	-42,366.24	-2,800,659.69	-2,843,025.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,511,620.54	-3,215,254.41	1,296,366.13

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
活期存款利息收入	166,493.94	477,573.02
定期存款利息收入	0.00	0.00
其他存款利息收入	0.00	0.00
结算备付金利息收入	12,294.57	16,225.44
其他	325.56	105,684.73
合计	179,114.07	599,483.19

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
卖出股票成交总额	809,190,157.11	1,605,507,648.83
减：卖出股票成本总额	805,158,915.87	1,573,216,283.33
买卖股票差价收入	4,031,241.24	32,291,365.50

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	-	17,945,080.75
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	-	17,390,998.43
减：应收利息总额	-	147,971.71
债券投资收益	0.00	406,110.61

注：本基金本报告期内未投资债券。

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金报告期内未投资资产支持证券。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月 31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月 31日
卖出权证成交总额	0.00	72,971.55
减：卖出权证成本总额	0.00	50,066.23
买卖权证差价收入	0.00	22,905.32

注：本基金报告期内未投资衍生工具。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月 31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月 31日
股票投资产生的股利收益	282,965.53	237,586.34
合计	282,965.53	237,586.34

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2010年1月1日至2010年12 月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12 月31日
1. 交易性金融资产	-2,223,660.28	3,404,429.40
——股票投资	-2,223,660.28	3,875,699.40
——债券投资	0.00	-471,270.00
——资产支持证券投资	0.00	0.00
2. 衍生工具	0.00	0.00
——权证投资	0.00	0.00
3. 其他	0.00	0.00
合计	-2,223,660.28	3,404,429.40

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月 31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月 31日
基金赎回费收入	87,448.27	2,327,314.29
基金转换费收入	1,073.44	-
合计	88,521.71	2,327,314.29

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	2,405,491.60	4,933,661.86
银行间市场交易费用	0.00	175.00
合计	2,405,491.60	4,933,836.86

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行费用	570.50	571.00
账户维护费	18,000.00	18,000.00
其他	0.00	0.00
合计	378,570.50	378,571.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日,本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司	基金管理人, 发起人, 基金销售机构
兴业银行股份有限公司	基金托管人, 基金代销机构
齐鲁证券有限公司	基金管理人股东, 基金代销机构
上海久事公司	基金管理人股东
深圳市中航投资管理有限公司	基金管理人股东
山东省国有资产投资控股有限公司	基金管理人股东
中国证券登记结算有限公司	基金注册与登记过户人

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金 2010 年度及 2009 年度均未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月	2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月

	31 日	月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1, 178, 668. 99	1, 776, 484. 93
其中：支付销售机构的客户维护费	102, 724. 72	138, 528. 88

注：

基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

7.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	196, 444. 81	296, 080. 76

注：

依照基金合同，在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金 2010 年度及 2009 年度均未通过银行间同业市场与关联方进行银行间债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
基金合同生效日(2008 年 6 月 27 日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	10, 021, 602. 16	10, 021, 602. 16
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动的份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10, 021, 602. 16	10, 021, 602. 16
期末持有的基金份额占基金总份额比例	14. 02%	9. 04%

注:基金管理人于本基金募集期间认购本基金份额时所适用的费率与本基金公告的费率一致。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于 2010 年末及 2009 年末均未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	21,804,393.88	166,493.94	11,713,312.14	477,573.02

注:本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算公司,2010 年度获得的利息收入为 12,294.57 元(2009 年度:人民币 16,225.44 元),2010 年末结算备付金余额为人民币 336,609.34 元(2009 年末:人民币 3,211,314.43 元)。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金 2010 年度和 2009 年度均不存在在承销期内直接购入关联方所承销证券的情况。

7.4.11 利润分配情况

本基金于 2010 年度未进行利润分配。

7.4.12 期末(2010 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金报告期末未持有新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
0000059	辽通化工	2010-12-02	资产重组	11.29	-	-	165,000	1,986,260.06	1,862,850.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

报告期末不存在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

报告期末不存在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险,并设定适当的风险限额及内部控制流程,通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理融入各业务层面,建立了三道防线:以各岗位目标责任制为基础,形成第一道防线;通过相关部门、相关岗位之间相互监督制衡,形成第二道防线;由监察稽核部门、督察长对各岗位、各部门、各机构、各项业务实施监督反馈,形成第三道防线。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券,且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%,且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券,不得超过该证券的10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行,申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外,在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算,因此违约风险发生的可能性很小;基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估,以控制相应的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易;因此,除在7.4.12中列示的本基金于年末持有的流通受限的证券外,本年末本基金的其他资产均能及时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并同时通过风险管理人员设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和市场价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

下表统计了本基金资产及负债的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值,并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早进行了分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2010年12月 31日	1个月以内	1-3 个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	21,804,393.88	-	-	-	-	-	21,804,393.88
结算备付金	336,609.34	-	-	-	-	-	336,609.34
存出保证金	-	-	-	-	-	91,796.06	91,796.06
交易性金融资产	-	-	-	-	-	33,253,385.22	33,253,385.22
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	3,996.57	3,996.57

应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	10,493,914.30	-	-	-	-	-11,070,571.72	21,564,486.02
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	32,634,917.52	-	-	-	-	-44,419,749.57	77,054,667.09
负债	-	-	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-3,609,572.45	3,609,572.45
应付赎回款	-	-	-	-	-	-969.16	969.16
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-60,218.89	60,218.89
应付托管费	-	-	-	-	-	-10,036.49	10,036.49
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	-229,336.33	229,336.33
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-360,003.65	360,003.65
负债总计	-	-	-	-	-	-4,270,136.97	4,270,136.97
利率敏感度缺口	32,634,917.52	-	-	-	-	-40,149,612.60	72,784,530.12

上年度末 2009年12 月31日	1个月以内	1-3 个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	11,713,312.14	-	-	-	-	-	11,713,312.14
结算备付金	3,211,314.43	-	-	-	-	-	3,211,314.43
存出保证金	-	-	-	-	-	494,714.76	494,714.76
交易性金融资产	-	-	-	-	-	89,147,748.46	89,147,748.46
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券	-	-	-	-	-	23,844,256.12	23,844,256.12

清算款							
应收利息	-	-	-	-	-	119,488.36	119,488.36
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	98,522.17	-	-	-	-	40,499.04	139,021.21
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	15,023,148.74	-	-	-	-	113,646,706.74	128,669,855.48
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	10,320,716.99	10,320,716.99
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	268,803.52	268,803.52
应付托管费	-	-	-	-	-	44,800.60	44,800.60
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,356,023.46	1,356,023.46
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	398,897.17	398,897.17
负债总计	-	-	-	-	-	12,389,241.74	12,389,241.74
利率敏感度缺口	15,023,148.74	-	-	-	-	101,257,465.00	116,280,613.74

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末只持有少量现金类资产；该类资产包括银行存款和结算备付金，均以活期存款利率计息；假定利率变动仅影响现金类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本期末未持有其他生息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价

值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券,所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险,并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金投资组合中股票投资比例范围为基金资产净值的 30%-80%;债券、现金类资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种为 20%-70%;其中,现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%;权证为 0%-3%;资产支持证券为 0%-20%。于资产负债表日,本基金面临的整体市场价格风险列示如下:

金额单位:人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日		上年度末 2009 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产 -股票投资	33,253,385.22	45.69	89,147,748.46	76.67
交易性金融资产 -债券投资	0.00	0.00	0.00	0.00
衍生金融资产 -权证投资	-	0.00	-	0.00
其他	0.00	0.00	0.00	0.00
合计	33,253,385.22	45.69	89,147,748.46	76.67

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析,反映了在其他变量不变的假设下,证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时,将对基金资产净值产生的影响。

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险,即从长期来看,本基金基金份额净值的变动与业绩比较基准的变动呈线性相关,且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变;		
	2. 以下分析,除市场基准发生变动,其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:万元)	
		2010-12-31	2009-12-31
	业绩比较基准增加1%	21.59	56.97
	业绩比较基准减少1%	-21.59	-56.97

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	1. 在95%的置信水平下采用风险价值模型来管理风险;
	2. 以资产负债表日前244个交易日为观察期;
	3. 风险价值模型采用历史数据来预测未来价格行为,在一般情况下,后者与历史数据无实质性差异。

分析	风险价值(单位: 万元)	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位: 万元)	
		2010-12-31	2009-12-31
	VaR 95%, 一个交易日	95.74	343.85

注: 上述分析衡量了在 95%的置信水平下, 所持有的权益类资产组合在资产负债表日后一个交易日内由于市场价格风险所导致的最大潜在损失。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	33,253,385.22	43.16
	其中: 股票	33,253,385.22	43.16
2	固定收益投资	0.00	0.00
	其中: 债券	0.00	0.00
	资产支持证券	0.00	0.00
3	金融衍生品投资	0.00	0.00
4	买入返售金融资产	0.00	0.00
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	22,141,003.22	28.73
6	其他各项资产	21,660,278.65	28.11
7	合计	77,054,667.09	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位: 人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,762,964.12	3.80
B	采掘业	6,594,700.00	9.06
C	制造业	15,269,603.74	20.98
C0	食品、饮料	1,829,400.00	2.51
C1	纺织、服装、皮毛	0.00	0.00
C2	木材、家具	0.00	0.00
C3	造纸、印刷	0.00	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	1,862,850.00	2.56
C5	电子	1,267,353.74	1.74
C6	金属、非金属	650,000.00	0.89
C7	机械、设备、仪表	5,838,400.00	8.02

C8	医药、生物制品	3,821,600.00	5.25
C99	其他制造业	0.00	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00
E	建筑业	696,000.00	0.96
F	交通运输、仓储业	0.00	0.00
G	信息技术业	570,860.00	0.78
H	批发和零售贸易	1,298,500.00	1.78
I	金融、保险业	1,684,800.00	2.31
J	房地产业	674,000.00	0.93
K	社会服务业	2,130,157.36	2.93
L	传播与文化产业	1,571,800.00	2.16
M	综合类	0.00	0.00
	合计	33,253,385.22	45.69

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600468	百利电气	85,000	3,056,600.00	4.20
2	600123	兰花科创	40,000	1,883,200.00	2.59
3	000059	辽通化工	165,000	1,862,850.00	2.56
4	601699	潞安环能	30,000	1,789,200.00	2.46
5	600348	国阳新能	60,000	1,720,800.00	2.36
6	601318	中国平安	30,000	1,684,800.00	2.31
7	000998	隆平高科	49,916	1,625,764.12	2.23
8	002038	双鹭药业	24,000	1,416,000.00	1.95
9	600519	贵州茅台	7,500	1,379,400.00	1.90
10	600859	王府井	25,000	1,298,500.00	1.78
11	600261	浙江阳光	29,954	1,267,353.74	1.74
12	000937	冀中能源	30,000	1,201,500.00	1.65
13	600251	冠农股份	40,000	1,137,200.00	1.56
14	600038	哈飞股份	35,000	996,800.00	1.37
15	600267	海正药业	25,000	962,000.00	1.32
16	002164	东力传动	50,000	953,000.00	1.31
17	300133	华策影视	8,000	928,000.00	1.27
18	000400	许继电气	25,000	832,000.00	1.14
19	600594	益佰制药	40,000	788,400.00	1.08
20	002400	省广股份	15,000	776,250.00	1.07
21	600068	葛洲坝	60,000	696,000.00	0.96
22	000926	福星股份	50,000	674,000.00	0.93

23	601607	上海医药	30,000	655,200.00	0.90
24	002233	塔牌集团	40,000	650,000.00	0.89
25	300104	乐视网	10,000	643,800.00	0.88
26	601888	中国国旅	20,000	619,400.00	0.85
27	600118	中国卫星	23,000	570,860.00	0.78
28	300146	汤臣倍健	3,000	450,000.00	0.62
29	300015	爱尔眼科	9,964	440,807.36	0.61
30	002245	澳洋顺昌	15,000	293,700.00	0.40

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000965	天保基建	12,548,983.41	10.79
2	601678	滨化股份	11,694,437.21	10.06
3	600176	中国玻纤	11,005,416.30	9.46
4	000537	广宇发展	10,509,297.03	9.04
5	600208	新湖中宝	9,601,633.22	8.26
6	600030	中信证券	9,564,793.50	8.23
7	600256	广汇股份	9,551,667.00	8.21
8	601318	中国平安	9,549,807.20	8.21
9	600535	天士力	9,529,344.48	8.20
10	002008	大族激光	9,265,199.10	7.97
11	600549	厦门钨业	9,232,082.81	7.94
12	000546	光华控股	7,829,044.44	6.73
13	600100	同方股份	7,551,585.23	6.49
14	600489	中金黄金	7,468,354.85	6.42
15	600016	民生银行	7,345,500.00	6.32
16	601601	中国太保	7,310,308.62	6.29
17	600111	包钢稀土	7,244,811.49	6.23
18	600523	贵航股份	7,119,935.16	6.12
19	600193	创兴置业	7,050,885.74	6.06
20	600036	招商银行	6,903,106.01	5.94
21	600137	浪莎股份	6,867,873.54	5.91
22	000422	湖北宜化	6,836,079.92	5.88
23	600188	兖州煤业	6,784,070.50	5.83
24	002013	中航精机	6,757,103.02	5.81
25	300039	上海凯宝	6,525,492.70	5.61
26	600118	中国卫星	6,157,326.16	5.30
27	600581	八一钢铁	5,769,479.86	4.96
28	600197	伊力特	5,720,904.10	4.92

29	600339	天利高新	5,542,972.53	4.77
30	600123	兰花科创	5,499,777.03	4.73
31	002086	东方海洋	5,264,359.62	4.53
32	000898	鞍钢股份	5,222,100.00	4.49
33	600316	洪都航空	5,123,135.34	4.41
34	600038	哈飞股份	5,023,170.06	4.32
35	601899	紫金矿业	4,971,106.91	4.28
36	601788	光大证券	4,830,497.84	4.15
37	601628	中国人寿	4,703,379.02	4.04
38	601168	西部矿业	4,661,578.22	4.01
39	600312	平高电气	4,646,399.99	4.00
40	002358	森源电气	4,583,133.50	3.94
41	601939	建设银行	4,570,766.10	3.93
42	600267	海正药业	4,560,926.13	3.92
43	600456	宝钛股份	4,506,014.00	3.88
44	601607	上海医药	4,440,118.90	3.82
45	600999	招商证券	4,423,071.04	3.80
46	600545	新疆城建	4,421,276.28	3.80
47	002155	辰州矿业	4,413,726.79	3.80
48	600580	卧龙电气	4,381,948.06	3.77
49	600251	冠农股份	4,357,922.56	3.75
50	600348	国阳新能	4,262,637.58	3.67
51	600141	兴发集团	4,222,636.58	3.63
52	000063	中兴通讯	4,152,089.88	3.57
53	601888	中国国旅	4,089,135.57	3.52
54	600547	山东黄金	4,010,089.35	3.45
55	000893	东凌粮油	3,999,182.50	3.44
56	600789	鲁抗医药	3,935,300.88	3.38
57	600823	世茂股份	3,926,033.50	3.38
58	600778	友好集团	3,708,870.40	3.19
59	600893	航空动力	3,696,814.00	3.18
60	000400	许继电气	3,654,873.37	3.14
61	000680	山推股份	3,654,635.70	3.14
62	000551	创元科技	3,600,382.72	3.10
63	600837	海通证券	3,570,814.00	3.07
64	600881	亚泰集团	3,558,927.54	3.06
65	600812	华北制药	3,538,458.20	3.04
66	600859	王府井	3,532,275.50	3.04
67	600590	泰豪科技	3,514,025.33	3.02
68	000623	吉林敖东	3,502,355.35	3.01
69	600777	新潮实业	3,478,271.00	2.99

70	601699	潞安环能	3,467,960.00	2.98
71	002128	露天煤业	3,450,914.04	2.97
72	601169	北京银行	3,437,745.01	2.96
73	601958	金铂股份	3,409,089.81	2.93
74	000046	泛海建设	3,373,218.86	2.90
75	600015	华夏银行	3,358,595.96	2.89
76	300080	新大新材	3,347,926.30	2.88
77	600583	海油工程	3,346,000.00	2.88
78	600438	通威股份	3,333,909.28	2.87
79	000933	神火股份	3,285,055.36	2.83
80	600268	国电南自	3,269,298.00	2.81
81	600531	豫光金铅	3,260,364.94	2.80
82	002123	荣信股份	3,253,877.00	2.80
83	600383	金地集团	3,218,500.00	2.77
84	600368	五洲交通	3,196,989.89	2.75
85	601001	大同煤业	3,163,951.00	2.72
86	601600	中国铝业	3,092,373.00	2.66
87	600000	浦发银行	3,086,833.46	2.65
88	600720	祁连山	3,085,274.00	2.65
89	002092	中泰化学	3,043,854.36	2.62
90	000999	华润三九	3,006,091.85	2.59
91	600509	天富热电	2,986,638.40	2.57
92	601666	平煤股份	2,978,929.40	2.56
93	000860	顺鑫农业	2,919,933.50	2.51
94	600089	特变电工	2,895,692.60	2.49
95	000926	福星股份	2,881,080.05	2.48
96	600697	欧亚集团	2,849,352.00	2.45
97	600048	保利地产	2,824,594.00	2.43
98	000158	常山股份	2,802,515.18	2.41
99	600109	国金证券	2,799,328.00	2.41
100	601106	中国一重	2,786,889.00	2.40
101	600056	中国医药	2,757,395.50	2.37
102	002033	丽江旅游	2,711,462.01	2.33
103	600518	康美药业	2,704,693.62	2.33
104	002110	三钢闽光	2,690,577.32	2.31
105	600470	六国化工	2,686,681.22	2.31
106	600322	天房发展	2,673,488.00	2.30
107	000998	隆平高科	2,668,890.58	2.30
108	600594	益佰制药	2,657,337.96	2.29
109	600037	歌华有线	2,646,215.00	2.28
110	600739	辽宁成大	2,641,508.00	2.27

111	000401	冀东水泥	2,632,834.00	2.26
112	600804	鹏博士	2,620,300.00	2.25
113	600085	同仁堂	2,610,061.65	2.24
114	601857	中国石油	2,602,500.00	2.24
115	600693	东百集团	2,565,192.05	2.21
116	002262	恩华药业	2,554,574.29	2.20
117	600139	西部资源	2,522,431.95	2.17
118	600117	西宁特钢	2,519,900.25	2.17
119	600050	中国联通	2,504,000.00	2.15
120	000983	西山煤电	2,497,298.98	2.15
121	600019	宝钢股份	2,490,000.00	2.14
122	600843	上工申贝	2,475,732.09	2.13
123	002038	双鹭药业	2,472,471.99	2.13
124	000839	中信国安	2,460,689.38	2.12
125	600557	康缘药业	2,458,518.02	2.11
126	600673	东阳光铝	2,423,571.00	2.08
127	002193	山东如意	2,396,982.67	2.06
128	600236	桂冠电力	2,379,010.00	2.05
129	002011	盾安环境	2,348,306.00	2.02
130	600828	成商集团	2,345,708.20	2.02
131	000897	津滨发展	2,345,395.00	2.02
132	600087	长航油运	2,338,750.00	2.01
133	600086	东方金钰	2,336,244.00	2.01
134	600028	中国石化	2,333,000.00	2.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600523	贵航股份	14,254,393.51	12.26
2	600256	广汇股份	13,526,964.10	11.63
3	600468	百利电气	13,423,572.85	11.54
4	000965	天保基建	11,957,253.50	10.28
5	600176	中国玻纤	10,954,909.65	9.42
6	601678	滨化股份	10,850,538.03	9.33
7	000537	广宇发展	10,316,926.62	8.87
8	600208	新湖中宝	9,574,392.09	8.23
9	600535	天士力	9,508,236.36	8.18
10	600030	中信证券	9,411,745.18	8.09
11	600036	招商银行	9,079,779.90	7.81
12	600549	厦门钨业	8,973,098.85	7.72
13	002008	大族激光	8,708,222.11	7.49

14	600111	包钢稀土	8,354,807.17	7.19
15	601318	中国平安	8,164,740.07	7.02
16	000546	光华控股	7,636,182.72	6.57
17	600489	中金黄金	7,295,383.64	6.27
18	601601	中国太保	7,237,995.84	6.22
19	600100	同方股份	7,223,816.76	6.21
20	600193	创兴置业	7,215,971.50	6.21
21	300039	上海凯宝	7,161,020.97	6.16
22	000063	中兴通讯	7,023,072.58	6.04
23	002013	中航精机	6,932,365.93	5.96
24	600660	福耀玻璃	6,902,792.64	5.94
25	600137	浪莎股份	6,844,477.77	5.89
26	600016	民生银行	6,800,796.00	5.85
27	600188	兖州煤业	6,578,179.96	5.66
28	000422	湖北宜化	6,434,855.00	5.53
29	600118	中国卫星	6,359,210.37	5.47
30	600581	八一钢铁	6,128,853.90	5.27
31	600141	兴发集团	6,096,104.00	5.24
32	600019	宝钢股份	5,922,000.00	5.09
33	600197	伊力特	5,918,431.59	5.09
34	002226	江南化工	5,886,472.85	5.06
35	600339	天利高新	5,472,076.35	4.71
36	601857	中国石油	5,247,233.86	4.51
37	002086	东方海洋	5,242,517.44	4.51
38	002092	中泰化学	5,139,046.26	4.42
39	600000	浦发银行	5,065,389.66	4.36
40	000898	鞍钢股份	5,034,282.92	4.33
41	600316	洪都航空	5,030,931.28	4.33
42	600545	新疆城建	4,943,002.58	4.25
43	601899	紫金矿业	4,903,594.00	4.22
44	600028	中国石化	4,885,459.00	4.20
45	600837	海通证券	4,862,190.00	4.18
46	600509	天富热电	4,698,866.80	4.04
47	601168	西部矿业	4,676,244.94	4.02
48	002358	森源电气	4,667,677.01	4.01
49	600456	宝钛股份	4,645,535.70	4.00
50	601788	光大证券	4,555,331.48	3.92
51	600312	平高电气	4,482,973.73	3.86
52	600038	哈飞股份	4,462,341.35	3.84
53	601628	中国人寿	4,431,565.10	3.81
54	601939	建设银行	4,378,400.00	3.77

55	600498	烽火通信	4,238,656.00	3.65
56	002155	辰州矿业	4,231,089.80	3.64
57	600580	卧龙电气	4,200,150.69	3.61
58	600778	友好集团	4,183,970.06	3.60
59	600999	招商证券	4,116,158.80	3.54
60	600547	山东黄金	4,116,103.80	3.54
61	300080	新大新材	4,065,931.20	3.50
62	002024	苏宁电器	4,040,592.47	3.47
63	000893	东凌粮油	3,969,181.63	3.41
64	600693	东百集团	3,910,835.60	3.36
65	600590	泰豪科技	3,899,744.57	3.35
66	601607	上海医药	3,812,653.85	3.28
67	600893	航空动力	3,810,568.10	3.28
68	002128	露天煤业	3,809,779.26	3.28
69	600812	华北制药	3,653,429.96	3.14
70	600789	鲁抗医药	3,645,107.28	3.13
71	600823	世茂股份	3,632,575.94	3.12
72	600123	兰花科创	3,619,774.00	3.11
73	000551	创元科技	3,548,792.52	3.05
74	000680	山推股份	3,527,735.35	3.03
75	600777	新潮实业	3,502,620.00	3.01
76	600570	恒生电子	3,497,113.31	3.01
77	600380	健康元	3,489,619.00	3.00
78	600268	国电南自	3,463,537.00	2.98
79	600881	亚泰集团	3,431,255.06	2.95
80	600720	祁连山	3,429,973.00	2.95
81	600368	五洲交通	3,410,831.20	2.93
82	600251	冠农股份	3,407,968.49	2.93
83	601958	金钼股份	3,379,719.26	2.91
84	000046	泛海建设	3,348,189.00	2.88
85	000400	许继电气	3,299,994.90	2.84
86	000860	顺鑫农业	3,291,845.10	2.83
87	600015	华夏银行	3,260,656.15	2.80
88	600805	悦达投资	3,258,838.00	2.80
89	601888	中国国旅	3,244,889.35	2.79
90	600583	海油工程	3,231,938.64	2.78
91	601169	北京银行	3,193,063.50	2.75
92	600438	通威股份	3,173,853.18	2.73
93	600267	海正药业	3,142,736.40	2.70
94	002123	荣信股份	3,099,021.50	2.67
95	600383	金地集团	3,072,591.12	2.64

96	601001	大同煤业	3,030,748.64	2.61
97	601600	中国铝业	3,006,487.00	2.59
98	600531	豫光金铅	2,973,093.24	2.56
99	600518	康美药业	2,928,112.24	2.52
100	000933	神火股份	2,922,726.00	2.51
101	000999	华润三九	2,921,350.00	2.51
102	002110	三钢闽光	2,880,841.99	2.48
103	000623	吉林敖东	2,865,675.71	2.46
104	600056	中国医药	2,753,387.40	2.37
105	002033	丽江旅游	2,748,349.00	2.36
106	600089	特变电工	2,729,615.00	2.35
107	601666	平煤股份	2,715,964.02	2.34
108	601106	中国一重	2,715,000.00	2.33
109	600219	南山铝业	2,698,000.92	2.32
110	600739	辽宁成大	2,696,356.00	2.32
111	600048	保利地产	2,689,100.00	2.31
112	000401	冀东水泥	2,687,220.59	2.31
113	600804	鹏博士	2,684,676.66	2.31
114	600470	六国化工	2,664,468.58	2.29
115	600322	天房发展	2,638,784.49	2.27
116	600109	国金证券	2,608,781.53	2.24
117	600843	上工申贝	2,586,571.79	2.22
118	600557	康缘药业	2,581,495.50	2.22
119	000897	津滨发展	2,555,236.00	2.20
120	600487	亨通光电	2,536,335.00	2.18
121	000983	西山煤电	2,529,201.60	2.18
122	000158	常山股份	2,525,441.21	2.17
123	600697	欧亚集团	2,510,476.00	2.16
124	600060	海信电器	2,505,791.45	2.15
125	600037	歌华有线	2,502,520.00	2.15
126	600348	国阳新能	2,501,475.62	2.15
127	600497	驰宏锌锗	2,495,201.19	2.15
128	000778	新兴铸管	2,487,227.35	2.14
129	002262	恩华药业	2,478,729.70	2.13
130	600050	中国联通	2,476,000.00	2.13
131	600085	同仁堂	2,453,137.30	2.11
132	600828	成商集团	2,446,187.02	2.10
133	600594	益佰制药	2,424,313.00	2.08
134	600673	东阳光铝	2,402,876.00	2.07
135	000839	中信国安	2,400,729.00	2.06
136	600236	桂冠电力	2,359,180.00	2.03

137	600117	西宁特钢	2,338,161.24	2.01
-----	--------	------	--------------	------

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	751,488,212.91
卖出股票收入（成交）总额	809,190,157.11

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金期末未持有任何债券品种。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金期末未持有任何债券品种。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的,在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.2 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库之外的股票。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	91,796.06
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	0.00
4	应收利息	3,996.57
5	应收申购款	21,564,486.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	0.00
9	合计	21,660,278.65

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000059	辽通化工	1,862,850.00	2.56	重大资产重组事项停牌

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
2,132	33,531.03	34,848,317.18	48.75%	36,639,846.81	51.25%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本 开放式基金	1,244,940.25	1.74%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2008年6月27日)基金份额总额	353,835,521.84
本报告期期初基金份额总额	110,802,401.69
本报告期基金总申购份额	38,980,286.19
减：本报告期基金总赎回份额	78,294,523.89
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	71,488,163.99

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

1、经中国证券监督管理委员会证监许可【2010】274号文核准，钱华先生担任我公司副总经理职务，我公司于2010年3月20日在《证券时报》发布“万家基金管理有限公司关于聘任公司副总经理的公告”。

2、2010年7月3日发布《万家基金管理有限公司关于调整基金经理的公告》，聘任吴印为万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金基金经理，鞠英利不再担任该基金基金经理。

3、2010年9月18日发布《万家基金管理有限公司关于公司副总经理离任的公告》，钱华先生不再担任公司副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期限内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2009 年 4 月起聘请安永华明会计师事务所为本基金提供审计服务。

本基金 2010 年度需向安永华明会计师事务所支付审计费 60000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内, 本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东北证券	1	258,274,802.68	16.55%	219,533.57	16.77%	-
光大证券	1	226,407,256.79	14.51%	192,444.47	14.70%	-
华泰证券	1	487,346,897.30	31.23%	414,243.27	31.64%	-
中投证券	1	349,274,001.40	22.39%	283,788.10	21.68%	-
东海证券	1	104,068,599.31	6.67%	88,457.65	6.76%	-
招商证券	2	134,924,987.54	8.65%	110,768.54	8.46%	-
江南证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
联合证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

注: 1、基金专用交易席位的选择标准如下:

- (1) 经营行为稳健规范, 内控制度健全, 在业内有良好的声誉;
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设施满足基金进行证券交易的需要;
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平, 包括但不限于: 有较好的研究能力和行业分析能力, 能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息; 能根据公司所管理基金的特定要求, 提供专门研究报告, 具有开发量化投资组合模型的能力; 能积极为公司投资业务的开展, 投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下:

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构;
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

3、报告期内基金租用证券公司交易单元的变更情况:

无。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

报告期内本基金未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《万家基金管理有限公司关于新增旗下部分开放式基金转换业务及调整转换费用计算规则的公告》，新增开通旗下部分开放式基金的转换业务，并对本公司原开放式基金转换费用的计算规则予以调整。	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2010-07-15
2	《万家基金管理有限公司关于开通直销柜台修改账户资料关键信息功能的公告》，面向直销客户开通修改客户账户资料关键信息功能。	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2010-07-16

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件名称

- 1、中国证监会批准万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金发行及募集的文件。
- 2、《万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。
- 4、万家基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金净值、季度报告、更新招募说明书及其他临时公告。
- 6、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金 2010 年年度报告原文。

12.2 备查文件存放地点

上海市浦东新区福山路 450 号新天国际大厦 23 楼

12.3 备查文件查阅方式

<http://www.wjasset.com>

万家基金管理有限公司
2011 年 3 月 30 日