万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金 2014 年半年度报告

2014 年 6 月 30 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2014 年 8 月 27 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
§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遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
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 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
§5 托管人报告 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 13
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13
6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 15
6.4 报表附注 16
§7 投资组合报告 35
7.1 期末基金资产组合情况 35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 35
7.3 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 36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 36
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 36
7.7 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 37
7.8 报告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 37
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 37
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 37
7.11 投资组合报告附注 37
§8 基金份额持有人信息 38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 38

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....**错误!未定义书签。**
8.3 发起式基金发起资金持有份额情况.....38
§9 开放式基金份额变动.....39
§10 重大事件揭示.....39
10.1 基金份额持有人大会决议.....39
10.2 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.....39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....39
10.4 基金投资策略的改变.....39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....39
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....40
§11 备查文件目录.....41
11.1 备查文件目录.....41
11.2 存放地点.....41
11.3 查阅方式.....41

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	万家岁得利定期开放债券
基金主代码	519190
基金运作方式	契约型发起式。本基金以定期开放方式运作，自基金合同生效之日起（包括基金合同生效之日）或自每一开放期结束之日次日起（包括该日）一年内，本基金封闭运作，不办理基金份额的申购赎回业务。每个封闭期结束后首个工作日起，本基金进入开放期，每个开放期最长不超过 20 个工作日，最短不少于 5 个工作日。
基金合同生效日	2013 年 3 月 6 日
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	596,064,053.73 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在合理控制风险和保持资产流动性的前提下，追求基金资产的长期稳定增值，力争获得超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金每个封闭运作周期的投资策略分为三个阶段：第一阶段，即封闭期前期，将适当提高组合资产平均久期，配置流动性低但收益较高的长期信用债券，运用多种积极投资策略扩大收益；第二阶段，即封闭期后期，将有序减少长期配置，增加与剩余封闭期限匹配且流动性更强的短期国债、货币市场工具等投资品种；第三阶段，即封闭到期，将持有大量现金及货币市场投资工具，降低封闭期和开放期衔接时的流动性风险。围绕着这三个阶段的投资策略，基金管理人还将坚持在组合久期和封闭期限适当匹配的原则下，灵活应用各种投资策略，以追求绝对回报。 开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。
业绩比较基准	1 年期银行定期存款税后利率×1.2
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低风险的品种，其预期的风险收益水平低于股票型基金和混

	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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	赵会军
	联系电话	021-38619810	010-66105799
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95538 转 6、4008880800	95588
传真		021-38619888	010-66105798
注册地址		上海市浦东新区浦电路 360 号陆家嘴投资大厦 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市浦东新区浦电路 360 号陆家嘴投资大厦 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200122	100140
法定代表人		毕玉国	姜建清

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	上海市浦东新区浦电路 360 号 9 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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-4,045,944.41
本期利润	78,900,730.56
加权平均基金份额本期利润	0.0277
本期加权平均净值利润率	2.76%

本期基金份额净值增长率	3.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（ 2014 年 6 月 30 日 ）
期末可供分配利润	2,466,000.85
期末可供分配基金份额利润	0.0041
期末基金资产净值	612,765,864.93
期末基金份额净值	1.0280
3.1.3 累计期末指标	报告期末（ 2014 年 6 月 30 日 ）
基金份额累计净值增长率	3.85%

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。

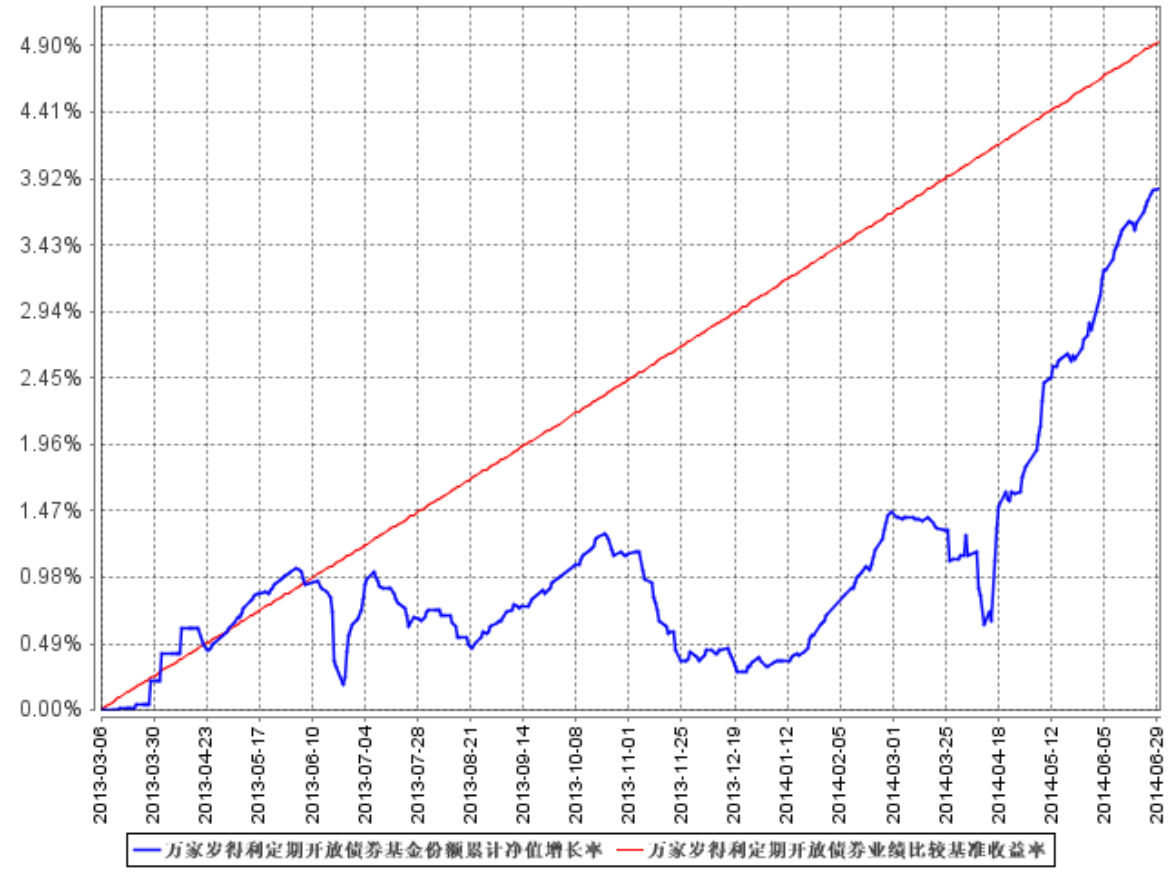
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	1.02%	0.06%	0.31%	0.00%	0.71%	0.06%
过去三个月	2.71%	0.10%	0.90%	0.00%	1.81%	0.10%
过去六个月	3.47%	0.08%	1.79%	0.00%	1.68%	0.08%
过去一年	3.18%	0.06%	3.60%	0.00%	-0.42%	0.06%
自基金合同生效起至今	3.85%	0.07%	4.75%	0.00%	-0.90%	0.07%

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

万家岁得利定期开放债券基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：(1)本基金合同生效日期为 2013 年 3 月 6 日，本基金的建仓期为自基金合同生效日起 6 个月。

§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、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，住所地及办公地点均为上海市浦东新区浦电路 360 号 9 楼，注册资本 1 亿元人民币。目前管理十八只开放式基金，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、万家精选股票型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金、万家添利债券型证券投资基金(LOF)、万家中证创业成长指

数分级证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金、万家上证 380 交易型开放式指数证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家市政纯债债券型证券投资基金和万家城市建设债券型证券投资基金。

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		
孙驰	本基金基金经理、万家货币基金基金经理、万家增强收益基金基金经理、万家日日薪货币基金基金经理、万家强化收益定期开放债券型发起式基金基金经理、固定收益部总监	2014 年 5 月 24 日	-	6 年	硕士学位，曾任中海信托股份有限公司投资经理。2010 年 4 月加入万家基金管理有限公司，曾担任固定收益研究员、基金经理助理。
朱虹	本基金基金经理、万家信用恒利债券基金基金经理、万家稳健增利债券基金基金经理、万家添利分级债券基金基金经理、万家	2013 年 4 月 17 日	2014 年 5 月 24 日	6 年	经济学硕士，曾任长城保险股份有限公司债券投资助理，天弘基金管理有限公司基金经理，2012 年 1 月加入万家基金管理有

	市政纯债定期开放债券基金基金经理、万家城市建设主题纯债债券型基金基金经理、固定收益部总监				限公司。

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,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。

报告期内，针对个别媒体报道，在本基金发售期间有销售机构在推介时称本基金有约定收益率，公司及时进行了澄清。对公司存在的宣传推介材料未按程序报备的问题，上海证监局对相关责任人采取了出具警示函的行政监管措施，并责令公司进行改正。公司对相关责任人进行了处理，并按要求完成了改正。

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

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组合,防范导致不公平交易以及利益输送的异常交易发生。

公司制订了明确的投资授权制度,并建立了统一的投资管理平台,确保不同投资组合获得公平的投资决策机会。实行集中交易制度,对于交易所公开竞价交易,执行交易系统中的公平交易程序;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易,按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;对于银行间交易,按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完

成交易。为保证公平交易原则的实现,通过制度规范、流程审批、系统风控参数设置等进行事前控制,通过对投资交易系统的实时监控进行事中控制,通过对异常交易的监控和分析实现事后控制。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易次数为 1 次，为指数型基金因被动跟踪标的指数与其他组合发生同日反向交易，不存在不公平交易和利益输送行为。

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

上半年，基本面数据一直不好，经济增速继续下行，cpi 压力不大。在这种情况下，政府逐步把重点放到稳增长上来，对货币政策进行实质性的放松，央行先后采取了定向降准、再贷款等货币政策工具，市场资金面一直十分宽松。在这种情况下，债券市场收益率出现了一波客观的降幅。

本基金大量持有中等评级的公司债，所以上半年取得了较好的绝对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期,本基金份额净值为 1.0280 元,本报告期份额净值增长率为 3.47%,业绩比较基准收益率 1.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段，基本面数据可能还会较差，但是有几个对市场有利的因素可能会发生变化：一是在政府不断进行政策托底后，市场会形成经济企稳的预期，且短期也没有办法证伪；二是由于外汇占款的不确定性，资金面在三季度需要观察怎么表现，三是目前如果继续有一波行情，需要货币政策进一步明确宽松，而目前的政府态度不明朗，似乎不愿意露出放松的信号。因此从目前的市场环境看，短期债市有调整的可能。这个判断的风险在于，基本面数据出现超预期的恶化。

基金操作上，继续以持有为主，获得票息收入。

4.6 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

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。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。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不介入基金日常估值业务。

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、已签约的与估值相关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》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同规定:“在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每季度最少分配一次，每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不得低于收益分配基准日单位份额可供分配利润的 50%。”2014 年 2 月 28 日,本基金进行了利润分配,每 10 份基金份额分红为 0.018 元,共计分配利润 11,484,791.31 元。符合基金合同的规定。

§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

本报告期内，本基金托管人在对万家岁得利定期开放债券证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，万家岁得利定期开放债券证券投资基金的管理人——万家基金管理有限公司在万家岁得利定期开放债券证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，万家岁得利定期开放债券证券投资基金对基金份

额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 11,484,791.31 元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对万家基金管理有限公司编制和披露的万家岁得利定期开放债券证券投资基金 2014 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金
报告截止日： 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	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	6.4.7.1	64,179.52	809,464,687.94
结算备付金		862,413.62	15,097,461.22
存出保证金		360,962.26	404,519.19
交易性金融资产	6.4.7.2	620,267,620.35	5,591,133,177.29
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		620,267,620.35	5,591,133,177.29
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	697,556,489.38
应收证券清算款		-	716,286.87
应收利息	6.4.7.5	12,364,422.90	132,306,086.70
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		633,919,598.65	7,246,678,708.59
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2014 年 6 月 30 日**	**上年度末 2013 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		18,771,961.10	833,498,072.95
应付证券清算款		-	56,210,414.88
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		351,185.53	3,776,292.24
应付托管费		100,338.72	1,078,940.61
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	30,005.21	75,334.72
应交税费		1,702,947.10	708,772.04
应付利息		8,858.77	428,942.64
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	188,437.29	320,000.00
负债合计		21,153,733.72	896,096,770.08
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	596,064,053.73	6,380,439,191.18
未分配利润	6.4.7.10	16,701,811.20	-29,857,252.67
所有者权益合计		612,765,864.93	6,350,581,938.51
负债和所有者权益总计		633,919,598.65	7,246,678,708.59

6.2 利润表

会计主体：万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金
本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日
一、收入		97,664,261.98	60,775,754.27
1.利息收入		76,688,768.28	78,140,628.95
其中：存款利息收入	6.4.7.11	17,226,414.11	1,139,481.05
债券利息收入		35,259,727.01	63,140,369.58
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		24,202,627.16	13,860,778.32
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-61,972,217.24	4,884,330.69
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-61,972,217.24	4,884,330.69
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	82,946,674.97	-22,261,977.78
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,035.97	12,772.41
减：二、费用		18,763,531.42	19,448,694.87
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	10,174,309.06	14,270,959.94
2．托管费	6.4.10.2.2	2,906,945.47	4,077,417.09
3．销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4．交易费用	6.4.7.19	75,685.38	69,224.63
5．利息支出		5,380,904.45	880,314.62
其中：卖出回购金融资产支出		5,380,904.45	880,314.62
6．其他费用	6.4.7.20	225,687.06	150,778.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		78,900,730.56	41,327,059.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		78,900,730.56	41,327,059.40

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金
本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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）	6,380,439,191.18	-29,857,252.67	6,350,581,938.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	78,900,730.56	78,900,730.56
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）	-5,784,375,137.45	-20,856,875.38	-5,805,232,012.83
其中：1.基金申购款	191,642,913.00	695,853.71	192,338,766.71
2.基金赎回款	-5,976,018,050.45	-21,552,729.09	-5,997,570,779.54
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）	-	-11,484,791.31	-11,484,791.31

五、期末所有者权益（基金净值）	596,064,053.73	16,701,811.20	612,765,864.93
项目	上年度可比期间 2013 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 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）	6,380,439,193.08	-	6,380,439,193.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	41,327,059.40	41,327,059.40
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）		-	
其中：1.基金申购款		-	
2.基金赎回款	-	-	-
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）	-	-31,902,207.22	-31,902,207.22
五、期末所有者权益（基金净值）	6,380,439,193.08	9,424,852.18	6,389,864,045.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

毕玉国	李杰	陈广益
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金（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[2012]1520 号文《关于核准万家岁得利定期开放债券型发起式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于 2013 年 2 月 1 日至 2013 年 3 月 1 日向社会公开募集，实际募集期限为自 2013 年 2 月 1 日至 2013 年 3 月 1 日，本基金募集期共募集 6,380,439,193.08 份基金份额（含有效认购资金利息结转的基金份额），有效认购户数 30,523 户。募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2013)验字第 60778298_B04 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2013 年 3 月

6 日生效。本基金为契约型开放式基金,以定期开放方式运作，自基金合同生效之日起（包括基金合同生效之日）或自每一开放期结束之日次日起（包括该日）一年内，本基金封闭运作，不办理基金份额的申购赎回业务。

本基金存续期限不定。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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，其中对信用债券的投资比例不低于固定收益类资产的 80%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金所指信用债券包括中期票据、金融债（不含政策性金融债）、企业债、公司债、短期融资券、可转换债券、可分离交易的可转换债券的纯债部分、资产支持证券等除国债、政策性金融债和中央银行票据之外的、非国家信用的债券类金融工具。

6.4.2 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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，也参考了中国证券投资基金业协会制定的《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。

6.4.3 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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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。

6.4.6 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、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
活期存款	64,179.52
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	64,179.52

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2014 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	86,562,634.23	86,394,620.35	-168,013.88
	银行间市场	524,516,678.88	533,873,000.00	9,356,321.12
	合计	611,079,313.11	620,267,620.35	9,188,307.24
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		611,079,313.11	620,267,620.35	9,188,307.24

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	61.52
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	349.29
应收债券利息	12,363,865.93
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	146.16
合计	12,364,422.90

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	30,005.21
合计	30,005.21

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-

预提费用	188,437.29
合计	188,437.29

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,380,439,191.18	6,380,439,191.18
本期申购	191,642,913.00	191,642,913.00
本期赎回(以"-"号填列)	-5,976,018,050.45	-5,976,018,050.45
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以"-"号填列)	-	-
本期末	596,064,053.73	596,064,053.73

注：本基金以定期开放方式运作，自基金合同生效之日起（包括基金合同生效之日）或自每一开放期结束之日次日起（包括该日）一年内，本基金封闭运作，不办理基金份额的申购赎回业务。每个封闭期结束后首个工作日起，本基金进入开放期，每个开放期最长不超过 20 个工作日，最短不少于 5 个工作日。

6.4.7.10 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	43,901,115.05	-73,758,367.72	-29,857,252.67
本期利润	-4,045,944.41	82,946,674.97	78,900,730.56
本期基金份额交易产生的变动数	-25,904,378.48	5,047,503.10	-20,856,875.38
其中：基金申购款	890,582.50	-194,728.79	695,853.71
基金赎回款	-26,794,960.98	5,242,231.89	-21,552,729.09
本期已分配利润	-11,484,791.31	-	-11,484,791.31
本期末	2,466,000.85	14,235,810.35	16,701,811.20

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,955,004.39

定期存款利息收入	15,210,999.84
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	52,757.17
其他	7,652.71
合计	17,226,414.11

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	8,393,719,607.93
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,260,936,181.55
减：应收利息总额	194,755,643.62
债券投资收益	-61,972,217.24

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期未持有贵金属投资。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	82,946,674.97
——股票投资	-
——债券投资	82,946,674.97
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-

——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	82,946,674.97

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	65.97
其他	970.00
合计	1,035.97

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	18,430.76
银行间市场交易费用	57,254.62
合计	75,685.38

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,765.71
账户维护费用	9,000.00
其他	600.00
开户费用	900.00
银行费用	26,749.77
合计	225,687.06

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日,本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日,本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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，基金销售机构
工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人，基金代销机构
齐鲁证券有限公司（“齐鲁证券”）	基金管理人股东，基金代销机构

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。

6.4.9.3 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.3.1 股票交易

本报告期间本基金未通过关联方席位进行股票交易。

债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年3月6日(基金合同生效日)至2013年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
齐鲁证券	334,427,689.85	10.95%	145,495,695.82	54.37%

债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年3月6日(基金合同生效日)至2013年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
齐鲁证券	126,366,000.00	4.86%	226,149,000.00	3.99%

6.4.9.3.2 权证交易

本报告期间本基金未通过关联方席位进行权证交易。

6.4.9.3.3 应支付关联方的佣金

本报告期间本基金无应支付关联方的佣金。

6.4.9.4 关联方报酬

6.4.9.4.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013年3月6日(基金合同生效日)至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,174,309.06	14,270,959.94
其中：支付销售机构的客户维护费	3,105,477.6	5,132,475.11

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.70%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.70%/当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

6.4.9.4.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年3月6日(基金合同生效日)至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,906,945.47	4,077,417.09

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.20%/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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节

假日、公休日等,支付日期顺延。

6.4.9.5 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
工商银行	-	201,030,680.00	-	-	-	-
上年度可比期间 2013 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
工商银行	-	10,104,754.25	100,000,000.00	106,579.32	-	-

6.4.9.6 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.6.1 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日
基金合同生效日（ 2013 年 3 月 6 日 ）持有的基金份额	10,001,250.00	10,001,250.00
期初持有的基金份额	10,001,250.00	10,001,250.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,001,250.00	10,001,250.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.68%	0.16%

注：基金管理人认购及申购本基金份额时所适用的费率与本基金公告的费率一致。期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

6.4.9.6.2 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本报告期末未投资本基金。

6.4.9.7 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2013 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	64,179.52	1,955,004.39	7,537,034.35	1,102,541.25

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有限责任公司,2014 年 1 月 1 日至 6 月 30 日获得的利息为人民币 52,757.17 元，（2013 年 1 月 1 日至 6 月 30 日获得的利息收入为人民币 36,893.28 元）;2014 年 6 月 30 日结算备付金余额为人民币 862,413.62 元（2013 年 6 月 30 日结算备付金余额为人民币 3,182,951.24 元）。

6.4.9.8 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10 利润分配情况

6.4.10.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		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	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2014 年 2 月 28 日	2014 年 2 月 28 日	2014 年 2 月 28 日	0.0180	11,484,791.31	-	11,484,791.31	
合计	-	-		0.0180	11,484,791.31	-	11,484,791.31	

6.4.11 期末（ 2014 年 6 月 30 日 ）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发、增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事银行间市场证券正回购形成的卖出回购证券款余额。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 6 月 30 日止,本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 18,771,961.1 元，其中 9,634,979.50 元于 2014 年 7 月 9 日到期，4,999,992.50 元于 2014 年 7 月 10 日到期，3,811,989.92 元于 2014 年 7 月 11 日到期，324,999.20 元于 2014 年 7 月 25 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.12 金融工具风险及管理

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。

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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。本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 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。

6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
A-1	-	1,929,808,000.00
A-1 以下	10,130,000.00	-
未评级	-	149,195,000.00
合计	10,130,000.00	2,079,003,000.00

注：未评级债券包括国债、中央银行票据、政策性金融债和超短期融资券。

6.4.12.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
AAA	14,047,200.00	593,753,802.00
AAA 以下	596,090,420.35	1,736,529,375.29
未评级	-	1,181,847,000.00
合计	610,137,620.35	3,512,130,177.29

注：未评级债券包括国债、中央银行票据、政策性金融债。

6.4.12.3 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,除在附注 6.4.12 中列示的本基金于本报告期末持有的流通受限证券外，本报告期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投资的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门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。

6.4.12.4 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、外汇风险和其他价格风险。

6.4.12.4.1 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。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2014年6月30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	64,179.52	-	-	-	-	-	64,179.52
结算备付金	862,413.62	-	-	-	-	-	862,413.62
存出保证金	360,962.26	-	-	-	-	-	360,962.26
交易性金融资产	-	10,130,000.00	134,242,463.40	465,901,156.95	9,994,000.00	-	620,267,620.35
应收利息	-	-	-	-	-	12,364,422.90	12,364,422.90
资产	1,287,555.40	10,130,000.00	134,242,463.40	465,901,156.95	9,994,000.00	12,364,422.90	633,919,598.65

总计							
负债							
卖出回购金融资产款	18,771,961.10	-	-	-	-	-	18,771,961.10
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	351,185.53	351,185.53
应付托管费	-	-	-	-	-	100,338.72	100,338.72
应付交易费用	-	-	-	-	-	30,005.21	30,005.21
应付利息	-	-	-	-	-	8,858.77	8,858.77
应交税费	-	-	-	-	-	1,702,947.10	1,702,947.10
其他负债	-	-	-	-	-	188,437.29	188,437.29
负债	18,771,961.10	-	-	-	-	2,381,772.62	21,153,733.72

总计							
利率敏感度缺口	-17,484,405.70	10,130,000.00	134,242,463.40	465,901,156.95	9,994,000.00	9,982,650.28	612,765,864.93
上年度末2013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	659,464,687.94	150,000,000.00	-	-	-	-	809,464,687.94
结算备付金	15,097,461.22	-	-	-	-	-	15,097,461.22
存出保证金	404,519.19	-	-	-	-	-	404,519.19
交易性金融资产	454,064,000.00	1,502,191,435.00	1,391,815,551.00	2,143,194,791.29	99,867,400.00	-	5,591,133,177.29
买入返	497,955,949.98	199,600,539.40	-	-	-	-	697,556,489.38

售金融资产							
应收证券清算款	-	-	-	-	-	716,286.87	716,286.87
应收利息	-	-	-	-	-	132,306,086.70	132,306,086.70
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,626,986,618.33	1,851,791,974.40	1,391,815,551.00	2,143,194,791.29	99,867,400.00	133,022,373.57	7,246,678,708.59
负债							
卖出回购金融资产款	833,498,072.95	-	-	-	-	-	833,498,072.95
应付证券清算款	-	-	-	-	-	56,210,414.88	56,210,414.88
应付管理人	-	-	-	-	-	3,776,292.24	3,776,292.24

报酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	1,078,940.61	1,078,940.61
应付交易费用	-	-	-	-	-	75,334.72	75,334.72
应付利息	-	-	-	-	-	428,942.64	428,942.64
应交税费	-	-	-	-	-	708,772.04	708,772.04
其他负债	-	-	-	-	-	320,000.00	320,000.00
负债总计	833,498,072.95	-	-	-	-	62,598,697.13	896,096,770.08
利率敏感度缺口	793,488,545.38	1,851,791,974.40	1,391,815,551.00	2,143,194,791.29	99,867,400.00	70,423,676.44	6,350,581,938.51

注：该表统计了本基金交易的利率风险敞口。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。

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	若市场利率发生变动而其他市场变量保持不变		
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：人民币元）	
		本期末（ 2014 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2013 年 12 月 31 日 ）

	市场利率下降 25 个基点	3,469,618.55	23,877,268.85
	市场利率上升 25 个基点	-3,437,489.72	-23,625,976.67

注：上表为利率风险的敏感性分析,反映了在其他变量不变的假设下,利率发生合理、可能的变动时,为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

6.4.12.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.12.4.3 其他价格风险

其他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。本基金主要投资于交易所及银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

§7 投资组合报告

7.1 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	620,267,620.35	97.85
	其中：债券	620,267,620.35	97.85
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	926,593.14	0.15
7	其他各项资产	12,725,385.16	2.01
8	合计	633,919,598.65	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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

本基金本报告期未投资股票。

7.4.2 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

本基金本报告期未投资股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期未投资股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	194,948,620.35	31.81
5	企业短期融资券	10,130,000.00	1.65
6	中期票据	415,189,000.00	67.76
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	620,267,620.35	101.22

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1080129	10 中钢债	1,000,000	98,560,000.00	16.08
2	1382133	13 天隆集 MTN1	1,000,000	97,930,000.00	15.98
3	1382136	13 乌兰煤 MTN1	600,000	58,446,000.00	9.54
4	1382130	13 通综投 MTN1	500,000	49,365,000.00	8.06
5	1282116	12 渝力帆	400,000	40,252,000.00	6.57

		MTN1			

7.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告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

本基金本报告期末未持有贵金属投资

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

本报告期内,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。

7.11.2

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。

7.11.3 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	360,962.26
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,364,422.90
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,725,385.16

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§8 基金份额持有人信息

8.1 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
2,767	215,418.88	468,060,263.43	78.53%	128,003,790.30	21.47%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	-	-

注：截至本报告期末,本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0,本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

8.3 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,250.00	1.68	10,001,250.00	1.68	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,250.00	1.68	10,001,250.00	1.68	-

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2013 年 3 月 6 日 ）基金份额总额	6,380,439,193.08
本报告期期初基金份额总额	6,380,439,191.18
本报告期基金总申购份额	191,642,913.00
减:本报告期基金总赎回份额	5,976,018,050.45
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
本报告期期末基金份额总额	596,064,053.73

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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：

2014 年 5 月 24 日本公司发布公告聘任孙驰为本基金基金经理。原基金经理朱虹因个人原因离职，不再担任本基金基金经理。

基金托管人：

报告期内本基金基金托管人无重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
华宝证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华宝证券	2,720,210,137.48	89.05%	2,472,400,000.00	95.14%	-	-
齐鲁证券	334,427,689.85	10.95%	126,366,000.00	4.86%	-	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基字[2007]48 号)的有关规定要求,我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后,向多家券商租用了基金专用交易席位。

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服务;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、基金专用交易席位的变更情况:

本基金本报告期内无交易席位的变更。

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。

2、《万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》。

3、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。

4、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、更新招募说明书及其他临时公告。

5、万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金 2014 年半年度报告原文。

6、万家基金管理有限公司董事会决议。

11.2 存放地点

基金管理人的办公场所，并登载于基金管理人网站：www.wjasset.com

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司
2014 年 8 月 27 日