

## 万家 180 指数证券投资基金 2011 年半年度报告

2011 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2011 年 8 月 26 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2011 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、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,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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 2011 年 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 .....	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 .....	6
§ 4 管理人报告 .....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	8
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 .....	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	9
§ 5 托管人报告 .....	9
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	9
5.2 托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	9
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 .....	9
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计) .....	10
6.1 资产负债表 .....	10
6.2 利润表 .....	11
6.3 所有者权益(基金净值)变动表 .....	12
6.4 报表附注 .....	13
§ 7 投资组合报告 .....	27
7.1 期末基金资产组合情况 .....	27
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	28
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 .....	29
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	33
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	34
7.6 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 .....	35
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 .....	35
7.8 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 .....	35
7.9 投资组合报告附注 .....	35
§ 8 基金份额持有人信息 .....	36
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	36
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况 .....	36
§ 9 开放式基金份额变动 .....	36

§ 10 重大事件揭示 .....	36
10.1 基金份额持有人大会决议.....	36
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.....	36
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	37
10.4 基金投资策略的改变.....	37
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	37
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.....	37
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	37
10.8 其他重大事件 .....	38
§ 11 备查文件目录 .....	38
11.1 备查文件名称 .....	38
11.2 备查文件存放地点.....	38
11.3 备查文件查阅方式.....	38

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	万家 180 指数证券投资基金
基金简称	万家 180 指数
基金主代码	519180
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 3 月 17 日
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	9,537,870,597.19 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过运用指数化投资方法,力求基金的股票组合收益率拟合上证 180 指数的增长率。伴随中国经济增长和资本市场的发展,实现利用指数化投资方法谋求基金资产长期增值的目标。
投资策略	本基金以跟踪目标指数为原则,实现与市场同步成长为基本理念。指数化投资是一种充分考虑投资者利益的投资方法,采取拟合目标指数收益率的投资策略,分散投资于目标指数所包含的股票中,力求股票组合的收益率拟合目标指数所代表的资本市场的平均收益率。
业绩比较基准	95%×上证 180 指数收益率+5%×银行同业存款利率
风险收益特征	本基金追踪上证 180 指数,是一种风险适中、长期资本收益稳健的投资产品,并具有长期稳定的投资风格

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	唐州徽
	联系电话	021-38619810	010-66594855
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		4008880800	95566
传真		021-38619888	010-66594942
注册地址		上海市浦东新区福山路 450 号新天国际大厦 23 楼	北京西城区复兴门内大街 1 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	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200122	100818
法定代表人		毕玉国	肖钢

## 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
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(2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-350,688,578.01
本期利润	30,899,297.33
加权平均基金份额本期利润	0.0030
本期加权平均净值利润率	0.45%
本期基金份额净值增长率	-1.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-3,721,960,293.43
期末可供分配基金份额利润	-0.3902
期末基金资产净值	6,313,946,100.33
期末基金份额净值	0.6620
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	164.96%

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、所述基金业绩指标不包括持有人认购或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(为期末余额,不是当期发生数)。

### 3.2 基金净值表现

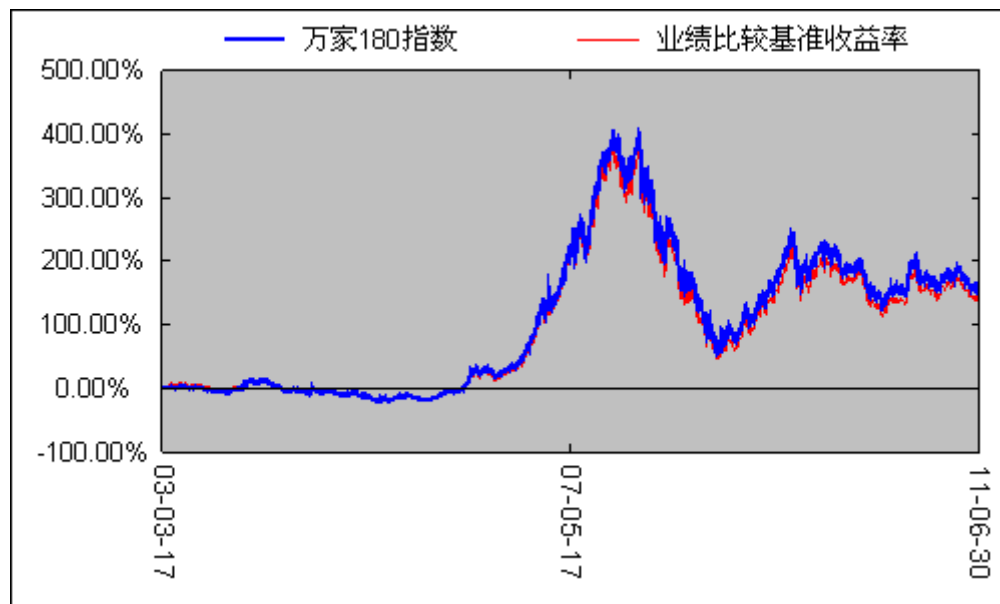
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.33%	1.09%	0.46%	1.11%	0.87%	-0.02%
过去三个月	-4.57%	1.03%	-5.34%	1.04%	0.77%	-0.01%
过去六个月	-1.41%	1.14%	-1.54%	1.15%	0.13%	-0.01%

过去一年	13.92%	1.30%	14.32%	1.31%	-0.40%	-0.01%
过去三年	1.02%	1.91%	3.01%	1.93%	-1.99%	-0.02%
自基金合同生效起至今	164.96%	1.69%	147.93%	1.72%	17.03%	-0.03%

注：基金业绩比较基准增长率=95%\*上证 180 指数增长率+5%\*银行同业存款利率

### 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



注：本基金成立于 2003 年 3 月 17 日，建仓期为三个月，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。报告期末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福山路 450 号，注册资本 1 亿元人民币。目前管理十只开放式基金，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、万家中证红利指数型证券投资基金 (LOF) 和万家添利分级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		
欧庆铃	本基金基金经理、万家精选基金基金经理、本公司投资管	2007 年 5 月 31 日		12 年	理学博士，曾任华南理工大学应用数学系副教授、广州证券有限责任公司任研究中心常务副总经理、金鹰基金管理

	理部总监				有限公司研究副总监、万家公用事业基金、万家双引擎基金基金经理等职
吴涛	本基金基金经理、权益投资部副总监	2010 年 3 月 31 日	-	16 年	硕士学位, 曾任天同证券有限责任公司上海营业部副总经理、天同证券有限责任公司深圳营业部总经理、南方总部副总经理等职, 2002 年至 2010 年 3 月任万家基金管理有限公司监察稽核部总监, 负责公司投资风险管理、监察稽核等工作。

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合规守信情况的说明

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。

#### 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

在本报告期, 我公司没有和本基金投资风格相似的其他投资组合品种。

##### 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

2011 年上半年, 通胀治理成为影响国内经济首要因素, 持续的货币紧缩措施的效果逐步显现, 证券市场整体表现为窄幅震荡, 但市场风格与去年相比发生明显变化, 价值类蓝筹股票受到市场更多关注。报告期本基金投资标的指数--上证 180 指数收益率为-1.68%。

本基金作为被动投资的指数基金, 其投资目标是通过跟踪、复制上证 180 指数, 为投资者获取股票市场长期的平均收益。报告期内我们严格按照基金合同规定, 采取了完全复制方法进行投资管理, 努力拟合标的指数, 减小跟踪误差。

报告期内, 本基金采用有效的量化跟踪技术, 将基金跟踪误差控制在较低范围内。跟踪误差主要是由于基金申购赎回、标的指数成分股调整等因素所造成。

##### 4.4.2 报告期内基金业绩表现

截至报告期末, 本基金份额净值为 0.6620 元, 报告期内基金份额净值增长率为 -1.41%, 同期业绩比



较基准收益率为 -1.54%，基金日跟踪误差为 0.04%，符合基金合同中跟踪误差低于 0.5% 的规定。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011 年下半年，我们认为随着通胀水平得到有效控制，通胀压力逐步缓解，我国经济将实现“软着陆”，上市公司业绩成长将得以延续，这将构成市场的长期投资基础，而国家财政政策重点倾斜行业、经济转型和结构调整受益产业等将呈现更多的投资机会。因此，我们看好国内股票市场的长期成长前景，并将在下半年密切关注市场风格的趋势变动。本基金标的指数——上证 180 指数作为沪市大中盘蓝筹股指数，估值优势明显、市场代表性强，具备较高的长期投资价值。

本基金将继续贯彻被动投资理念，恪守基金合同规定的投资目标和投资策略，一如既往地规范、勤勉运作，将本基金打造为稳定有效的指数投资工具，为基金份额持有人谋求长期、稳定回报。

#### 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

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

本基金管理人尚未就投资品种的定价服务签署任何协议。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金在报告期内未实施利润分配。

## § 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

本报告期内，中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对万家 180 指数证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本半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、投资组合报告等数据核对

无误。(注:财务会计报告中的“金融工具风险管理”部分未在托管人复核范围内。)

中国银行股份有限公司托管及投资者服务部  
2011 年 8 月 24 日

## § 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 180 指数证券投资基金

报告截止日: 2011 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	6.4.7.1	119,206,734.42	118,017,262.05
结算备付金		2,041,875.85	2,790,142.50
存出保证金		71,973.58	71,849.12
交易性金融资产	6.4.7.2	6,162,333,791.95	8,069,419,489.71
其中: 股票投资		5,962,693,791.95	7,764,213,781.71
基金投资		-	-
债券投资		199,640,000.00	305,205,708.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	20,000,000.00	-
应收证券清算款		2,739,073.97	14,287,998.59
应收利息	6.4.7.5	4,551,244.72	3,506,549.52
应收股利		12,604,173.36	-
应收申购款		130,188.38	30,493,650.79
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		6,323,679,056.23	8,238,586,942.28
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2011 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2010 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>			
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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,462,060.28	1,750,621.76
应付管理人报酬		4,814,226.87	7,107,317.00
应付托管费		962,845.38	1,421,463.41
应付销售服务费		0.00	0.00

应付交易费用	6.4.7.7	1,282,024.89	2,252,983.25
应交税费		31,717.80	31,717.80
应付利息		0.00	0.00
应付利润		0.00	0.00
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	180,080.68	411,533.09
负债合计		9,732,955.90	12,975,636.31
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	9,537,870,597.19	12,250,097,329.54
未分配利润	6.4.7.10	-3,223,924,496.86	-4,024,486,023.57
所有者权益合计		6,313,946,100.33	8,225,611,305.97
负债和所有者权益总计		6,323,679,056.23	8,238,586,942.28

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.6620，基金份额总额 9,537,870,597.19 份。

## 6.2 利润表

会计主体：万家 180 指数证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		81,089,762.34	-2,060,233,572.79
1. 利息收入		4,783,663.56	2,757,523.63
其中：存款利息收入	6.4.7.11	604,197.06	1,460,611.79
债券利息收入		3,995,229.80	1,256,024.27
资产支持证券利息收入		0.00	0.00
买入返售金融资产收入		184,236.70	40,887.57
其他利息收入		0.00	0.00
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-308,095,295.33	-141,938,274.35
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-370,996,571.84	-183,869,009.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,287,724.53	0.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	0.00
衍生工具收益	6.4.7.15	-	362,883.62

股利收益	6.4.7.16	61,613,551.98	41,567,851.42
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	381,587,875.34	-1,922,180,602.10
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	2,813,518.77	1,127,780.03
<b>减：二、费用</b>		50,190,465.01	44,516,538.95
1. 管理人报酬		34,200,159.85	33,548,448.79
2. 托管费		6,840,031.96	6,709,689.77
3. 销售服务费		0.00	0.00
4. 交易费用	6.4.7.19	8,462,857.96	4,040,996.62
5. 利息支出		496,216.44	37,788.25
其中：卖出回购金融资产支出		496,216.44	37,788.25
6. 其他费用	6.4.7.20	191,198.80	179,615.52
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		30,899,297.33	-2,104,750,111.74
减：所得税费用		0.00	0.00
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		30,899,297.33	-2,104,750,111.74

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家 180 指数证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 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）	12,250,097,329.54	-4,024,486,023.57	8,225,611,305.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	30,899,297.33	30,899,297.33
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）	-2,712,226,732.35	769,662,229.38	-1,942,564,502.97
其中：1. 基金申购款	1,290,169,721.60	-453,103,640.06	837,066,081.54
2. 基金赎回款	-4,002,396,453.95	1,222,765,869.44	-2,779,630,584.51
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)	9,537,870,597.19	-3,223,924,496.86	6,313,946,100.33
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010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)	9,505,971,970.74	-1,938,713,670.50	7,567,258,300.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,104,750,111.74	-2,104,750,111.74
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)	1,679,084,727.35	-641,946,599.77	1,037,138,127.58
其中:1.基金申购款	3,027,582,405.01	-996,577,552.01	2,031,004,853.00
2.基金赎回款	-1,348,497,677.66	354,630,952.24	-993,866,725.42
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)	-	0.00	0.00
五、期末所有者权益(基金净值)	11,185,056,698.09	-4,685,410,382.01	6,499,646,316.08

注: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                                  杨峰                                  陈广益  
 基金管理公司负责人          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 180 指数证券投资基金(以下简称“本基金”),原名天同 180 指数证券投资基金,系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2002]88 号文《关于同意天同 180 指数证券投资基金设立的批复》的核准,由天同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 2003 年 3 月 17 日正式生效,首次设立的募集规模为 1,929,789,525.65 份基金份额。经中国证监会证监基金字[2006]13 号文《关于同意天同基金管理有限公司变更名称及修改公司章程的批复》的核准,天同基金管理有限公司于 2006 年 2 月更名为万家基金管理有限公司;另经基金管理人董事会审议通过,基金托管人同意,中国证监会基金部核准,本基金于 2006 年 2 月更名为万家 180 指数证券投资基金。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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金资产的股票指数化投资部分主要投资于组成上证 180 指数的成份股票,包括:上证 180 指数包含的 180 只成份股、预期将要被选入上证 180 指数的股票、一级市场申购的新股;本基金资产的债券投资部分投资于国债、优质企业债、金融债以及债券回购;本基金亦可投资于经中国证监会批准允许投资的其他金融工具。本基金通过运用指数化投资方法,力求基金的股票组合收益率拟合上证 180 指数增长率。本基金的业绩比较基准为:95%×上证 180 指数+5%×银行同业存款利率。

### 6.4.2 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。

#### 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 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年上半度的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计(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一致。

本报告期无重大会计差错事项。

#### 6.4.5 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。

#### 6.4.6 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.6.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
活期存款	119,206,734.42
定期存款	0.00
其中: 存款期限 1-3 个月	0.00
其他存款	0.00
合计	119,206,734.42

##### 6.4.6.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目		本期末 2011 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		6,780,275,021.03	5,962,693,791.95	-817,581,229.08
债券	交易所市场	202,306,702.97	199,640,000.00	-2,666,702.97
	银行间市场	0.00	0.00	0.00
	合计	202,306,702.97	199,640,000.00	-2,666,702.97
资产支持证券		0.00	0.00	0.00
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		6,982,581,724.00	6,162,333,791.95	-820,247,932.05

##### 6.4.6.3 衍生金融资产/负债

无

##### 6.4.6.4 买入返售金融资产

###### 6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位: 人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中: 买断式逆回购
交易所市场	20,000,000.00	0.00
合计	20,000,000.00	0.00

###### 6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无

##### 6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	27,410.41
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	826.92
应收债券利息	4,509,863.02
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	13,115.30
其他	29.07
合计	4,551,244.72

6.4.6.6 其他资产

无

6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,282,024.89
银行间市场应付交易费用	0.00
合计	1,282,024.89

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,904.25
预提费用	177,176.43
合计	180,080.68

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,250,097,329.54	12,250,097,329.54
本期申购	1,290,169,721.60	1,290,169,721.60
本期赎回（以“-”号填列）	-4,002,396,453.95	-4,002,396,453.95
本期末	9,537,870,597.19	9,537,870,597.19

6.4.6.10 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	-4,376,743,093.99	352,257,070.42	-4,024,486,023.57
本期利润	-350,688,578.01	381,587,875.34	30,899,297.33
本期基金份额交易产生的变动数	1,005,471,378.57	-235,809,149.19	769,662,229.38
其中：基金申购款	-494,214,599.93	41,110,959.87	-453,103,640.06
基金赎回款	1,499,685,978.50	-276,920,109.06	1,222,765,869.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,721,960,293.43	498,035,796.57	-3,223,924,496.86

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	456,656.96
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	38,560.76
其他	108,979.34
合计	604,197.06

6.4.6.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	3,358,942,984.86
减：卖出股票成本总额	3,729,939,556.70
买卖股票差价收入	-370,996,571.84

6.4.6.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	186,757,751.37
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	181,897,769.33
减：应收利息总额	3,572,257.51

债券投资收益	1,287,724.53
--------	--------------

## 6.4.6.14 资产支持证券投资收益

无

## 6.4.6.15 衍生工具收益

## 6.4.6.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无

## 6.4.6.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	61,613,551.98
基金投资产生的股利收益	-
合计	61,613,551.98

## 6.4.6.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
1. 交易性金融资产	381,587,875.34
——股票投资	381,886,440.21
——债券投资	-298,564.87
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	381,587,875.34

## 6.4.6.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
基金赎回费收入	2,802,897.50
基金转换费收入	9,271.27
其他	1,350.00
合计	2,813,518.77

## 6.4.6.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
交易所市场交易费用	8,462,582.96

银行间市场交易费用	275.00
合计	8,462,857.96

6.4.6.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
审计费用	30,937.68
信息披露费	146,238.75
银行费用	5,022.37
银行间账户维护费	9,000.00
合计	191,198.80

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

本基金本报告期末不存在或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

本基金本报告期末不存在资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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
中国银行股份有限公司	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

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
齐鲁证券有限公司	742,166,273.82	15.23%	383,638,237.52	13.14%

6.4.9.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

本基金上一报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.9.1.3 债券交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

本基金上一报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.9.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
齐鲁证券有限公司	235,000,000.00	8.93%	175,000,000.00	33.98%

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
齐鲁证券有限公司	630,839.23	15.23%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
齐鲁证券有限公司	325,316.19	13.11%	127,518.89	9.19%

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的管理费	34,200,159.85
其中：支付销售机构的客户维护费	5,544,115.57	6,292,159.70

注：支付基金管理人万家基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日的基金资产净值 1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1% / 当年天数。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
----	--	---

当期发生的基金应支付的托管费	6,840,031.96	6,709,689.77
----------------	--------------	--------------

注：支付基金托管人中国银行股份有限公司的托管费按前一日的基金资产净值 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.2% / 当年天数

**6.4.9.3 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 2011 年 1 月 1 日至 2011 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
中国银行	-	52,169,206.16	-	-	-	-
上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 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
-	-	-	-	-	-	-

注：上一报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况**

**6.4.9.4.1 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 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
	基金合同生效日(2003 年 3 月 17 日)持有的基金份额	-
期初持有的基金份额	24,234,935.04	-
期间申购/买入总份额	0.00	-
期间因拆分变动份额	0.00	-
减：期间赎回/卖出总份额	0.00	-
期末持有的基金份额	24,234,935.04	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.25%	-

注：上一报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**6.4.9.4.2 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**

份额单位：份

关联方名称	本期末 2011 年 6 月 30 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例

				例
齐鲁证券有限公司	24,234,935.04	0.25%	0.00	0.00%

注：上年度末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金份额。

#### 6.4.9.5 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 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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
中国银行	119,206,734.42	456,656.96	232,015,396.74	1,438,925.40

#### 6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10 利润分配情况

本基金本期内未进行利润分配。

#### 6.4.11 期末（2011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

本基金期末未持有因认购新发/增发流通受限证券

##### 6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
600216	浙江医药	2011-06-27	重大事项	31.39	2011-07-04	32.60	432,365	11,626,545.84	13,571,937.35	
600369	西南证券	2011-03-01	重大事项	11.87	2011-08-16	12.49	965,412	15,599,686.01	11,459,440.44	

##### 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

本基金期末未持有因从事债券正回购交易形成的抵押债券。

###### 6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

本基金期末未持有交易所市场债券正回购。

#### 6.4.12 金融工具风险及管理

##### 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公司的证券,不得超过该证券的 10%。

本基金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。

#### 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、外汇风险和市场价格风险。

##### 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 2011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	119,206,734.42	-	-	-	-	-	119,206,734.42
结算备付金	2,041,875.85	-	-	-	-	-	2,041,875.85
存出保证金	71,973.58	-	-	-	-	-	71,973.58
交易性金融 资产	-	199,640,000.00	-	-	-	5,962,693,791.95	6,162,333,791.95
衍生金融资 产	-	-	-	-	-	0.00	0.00
买入返售金 融资产	20,000,000.00	-	-	-	-	-	20,000,000.00
应收证券清	-	-	-	-	-	2,739,073.97	2,739,073.97

算款							
应收利息	-	-	-	-	-	4,551,244.72	4,551,244.72
应收股利	-	-	-	-	-	12,604,173.36	12,604,173.36
应收申购款	-	-	-	-	-	130,188.38	130,188.38
其他资产	-	-	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	141,320,583.85	199,640,000.00	-	-	-	-5,982,718,472.38	6,323,679,056.23
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	-	-	-	-	-	2,462,060.28	2,462,060.28
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,814,226.87	4,814,226.87
应付托管费	-	-	-	-	-	962,845.38	962,845.38
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,282,024.89	1,282,024.89
应交税费	-	-	-	-	-	31,717.80	31,717.80
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	180,080.68	180,080.68
负债总计	-	-	-	-	-	9,732,955.90	9,732,955.90
利率敏感度缺口	141,320,583.85	199,640,000.00	-	-	-	-5,972,985,516.48	6,313,946,100.33

上年度末 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	118,017,262.05	-	-	-	-	-	118,017,262.05
结算备付金	2,790,142.50	-	-	-	-	-	2,790,142.50
存出保证金	71,849.12	-	-	-	-	-	71,849.12



交易性金融资产	-	-	305,205,708.00	-	-	7,764,213,781.71	8,069,419,489.71
衍生金融资产	-	-	-	-	-	0.00	0.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	14,287,998.59	14,287,998.59
应收利息	-	-	-	-	-	3,506,549.52	3,506,549.52
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	30,493,650.79	30,493,650.79
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	120,879,253.67	-	305,205,708.00	-	-	7,812,501,980.61	8,238,586,942.28
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	-	-	-	-	-	1,750,621.76	1,750,621.76
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	7,107,317.00	7,107,317.00
应付托管费	-	-	-	-	-	1,421,463.41	1,421,463.41
应付销售服务	-	-	-	-	-	-	-

费							
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,252,983.25	2,252,983.25
应交税费	-	-	-	-	-	31,717.80	31,717.80
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	411,533.09	411,533.09
负债总计	-	-	-	-	-	12,975,636.31	12,975,636.31
利率敏感度缺口	120,879,253.67	-	305,205,708.00	-	-	7,799,526,344.30	8,225,611,305.97

注：表统计了本基金资产和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者进行了分类。

#### 6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 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(2011年6月30日)	上年度末(2010年12月31日)
	1. 市场利率下降25个基点	118,000.00	510,500.00
2. 市场利率上升25个基点	-117,900.00	-508,700.00	

#### 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

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。

##### 6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		上年度末 2010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	5,962,693,791.95	94.44	7,764,213,781.71	94.39

交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	199,640,000.00	3.16	305,205,708.00	3.71
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	6,162,333,791.95	97.60	8,069,419,489.71	98.10

注：本基金投资于股票的比例，不得高于基金资产净值的 95%，其中投资于上证 180 指数成份股的比重不低于基金资产净值的 90%；本基金持有到期日在一年以内的政府债券或者现金比例不低于基金资产净值的 5%。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如表中数据。

#### 6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 若股票基准指数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（2011 年 6 月 30 日）	上年度末（2010 年 12 月 31 日）
	1. 股票基准指数下降 100 个基点	-57,895,700.00	-75,840,100.00
	2. 股票基准指数上升 100 个基点	57,895,700.00	75,840,100.00

注：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。表中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。

#### 6.4.12.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	1. 95%		
	2. 前推 244 个交易日		
分析	风险价值（单位：人民币元）	本期末（2011 年 6 月 30 日）	上年度末（2010 年 12 月 31 日）
	基金净资产	111,373,100.00	178,237,000.00
	合计	111,373,100.00	178,237,000.00

注：风险价值计算采用历史模拟方法。

## §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	5,962,693,791.95	94.29
	其中：股票	5,962,693,791.95	94.29
2	固定收益投资	199,640,000.00	3.16

	其中：债券	199,640,000.00	3.16
	资产支持证 券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	20,000,000.00	0.32
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备 付金合计	121,248,610.27	1.92
6	其他各项资产	20,096,654.01	0.32
7	合计	6,323,679,056.23	100.00

## 7.2 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	43,093,214.75	0.68
B	采掘业	833,091,516.87	13.19
C	制造业	1,570,027,467.88	24.87
C0	食品、饮料	213,652,511.10	3.38
C1	纺织、服装、皮毛	39,154,844.35	0.62
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	80,044,468.19	1.27
C5	电子	16,733,762.46	0.27
C6	金属、非金属	464,560,557.29	7.36
C7	机械、设备、仪表	573,367,881.74	9.08
C8	医药、生物制品	160,678,275.43	2.54
C99	其他制造业	21,835,167.32	0.35
D	电力、煤气及水的生产和供应 业	160,380,733.86	2.54
E	建筑业	237,338,307.27	3.76
F	交通运输、仓储业	231,392,580.24	3.66
G	信息技术业	145,870,322.78	2.31
H	批发和零售贸易	92,740,029.60	1.47
I	金融、保险业	2,194,466,735.73	34.76
J	房地产业	308,240,770.43	4.88
K	社会服务业	26,741,319.42	0.42
L	传播与文化产业	10,366,511.18	0.16
M	综合类	108,944,281.94	1.73
	合计	5,962,693,791.95	94.44

## 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

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	601318	中国平安	5,570,604	268,893,055.08	4.26
2	600036	招商银行	19,888,997	258,954,740.94	4.10
3	600016	民生银行	36,280,796	207,888,961.08	3.29
4	601328	交通银行	33,410,703	185,095,294.62	2.93
5	600000	浦发银行	17,954,243	176,669,751.12	2.80
6	601088	中国神华	5,431,000	163,690,340.00	2.59
7	601166	兴业银行	12,088,218	162,949,178.64	2.58
8	600030	中信证券	11,165,204	146,040,868.32	2.31
9	600519	贵州茅台	601,000	127,790,630.00	2.02
10	601601	中国太保	5,302,830	118,730,363.70	1.88
11	601939	建设银行	22,704,880	112,162,107.20	1.78
12	601398	工商银行	24,359,070	108,641,452.20	1.72
13	600585	海螺水泥	3,199,907	88,829,418.32	1.41
14	600031	三一重工	4,879,866	88,032,782.64	1.39
15	600111	包钢稀土	1,163,000	83,073,090.00	1.32
16	601006	大秦铁路	9,538,392	78,119,430.48	1.24
17	601668	中国建筑	19,180,227	77,296,314.81	1.22
18	600050	中国联通	13,571,881	71,252,375.25	1.13
19	600837	海通证券	7,848,909	70,797,159.18	1.12
20	601169	北京银行	6,998,606	69,776,101.82	1.11
21	600048	保利地产	6,219,760	68,355,162.40	1.08
22	601857	中国石油	6,018,768	65,544,383.52	1.04
23	601899	紫金矿业	8,439,772	61,103,949.28	0.97
24	601989	中国重工	4,410,173	60,816,285.67	0.96
25	600068	葛洲坝	4,784,529	57,366,502.71	0.91
26	600900	长江电力	7,857,424	56,652,027.04	0.90
27	600104	上海汽车	2,968,005	55,620,413.70	0.88
28	600089	特变电工	4,218,523	54,587,687.62	0.86
29	600028	中国石化	6,609,033	54,392,341.59	0.86
30	600547	山东黄金	1,130,500	50,691,620.00	0.80
31	600019	宝钢股份	8,390,078	50,592,170.34	0.80
32	601699	潞安环能	1,475,892	48,424,016.52	0.77
33	600383	金地集团	7,540,325	48,333,483.25	0.77
34	601288	农业银行	17,197,296	48,152,428.80	0.76
35	600015	华夏银行	4,394,316	47,766,214.92	0.76
36	600362	江西铜业	1,330,603	47,156,570.32	0.75
37	600348	国阳新能	1,919,951	46,347,617.14	0.73

38	600256	广汇股份	1,920,000	45,657,600.00	0.72
39	601766	中国南车	6,296,883	44,833,806.96	0.71
40	600795	国电电力	14,643,673	43,345,272.08	0.69
41	600887	伊利股份	2,568,496	42,765,458.40	0.68
42	600739	辽宁成大	1,453,384	40,404,075.20	0.64
43	600489	中金黄金	1,478,333	40,343,707.57	0.64
44	601168	西部矿业	2,664,123	39,482,302.86	0.63
45	600690	青岛海尔	1,280,013	35,776,363.35	0.57
46	601299	中国北车	5,295,378	35,479,032.60	0.56
47	600010	宝钢股份	4,130,000	34,485,500.00	0.55
48	601600	中国铝业	3,081,102	33,922,933.02	0.54
49	600188	兖州煤业	951,000	33,570,300.00	0.53
50	601390	中国中铁	8,209,020	32,753,989.80	0.52
51	600518	康美药业	2,467,886	32,477,379.76	0.51
52	600309	烟台万华	1,733,055	32,425,459.05	0.51
53	601628	中国人寿	1,661,456	31,152,300.00	0.49
54	601618	中国中冶	7,822,625	30,821,142.50	0.49
55	601919	中国远洋	3,659,583	30,337,943.07	0.48
56	601009	南京银行	3,345,947	30,013,144.59	0.48
57	601788	光大证券	2,174,666	29,901,657.50	0.47
58	601186	中国铁建	4,930,032	29,826,693.60	0.47
59	601958	金钼股份	1,536,763	29,582,687.75	0.47
60	601898	中煤能源	2,930,482	29,304,820.00	0.46
61	600875	东方电气	1,057,653	26,970,151.50	0.43
62	600415	小商品城	2,178,598	26,774,969.42	0.42
63	600132	重庆啤酒	464,768	26,677,683.20	0.42
64	600005	武钢股份	6,413,084	26,614,298.60	0.42
65	601666	平煤股份	1,896,235	26,566,252.35	0.42
66	600029	南方航空	3,357,770	26,324,916.80	0.42
67	601607	上海医药	1,540,157	25,874,637.60	0.41
68	601111	中国国航	2,650,865	25,421,795.35	0.40
69	600252	中恒集团	1,330,000	24,751,300.00	0.39
70	600058	五矿发展	688,492	23,601,505.76	0.37
71	600150	中国船舶	317,864	23,518,757.36	0.37
72	600100	同方股份	2,227,092	23,295,382.32	0.37
73	600660	福耀玻璃	2,244,750	23,255,610.00	0.37
74	600642	申能股份	4,550,928	23,073,204.96	0.37
75	600497	驰宏锌锗	1,046,046	23,065,314.30	0.37
76	600123	兰花科创	549,743	22,968,262.54	0.36
77	601688	华泰证券	1,776,221	21,936,329.35	0.35
78	601727	上海电气	3,155,371	21,835,167.32	0.35

79	600999	招商证券	1,149,561	21,128,931.18	0.33
80	600177	雅戈尔	2,113,353	20,858,794.11	0.33
81	601106	中国一重	4,150,512	20,129,983.20	0.32
82	600583	海油工程	3,116,541	20,008,193.22	0.32
83	600655	豫园商城	1,829,353	19,903,360.64	0.32
84	600832	东方明珠	2,558,606	19,829,196.50	0.31
85	600009	上海机场	1,542,778	19,747,558.40	0.31
86	600115	东方航空	3,734,645	19,420,154.00	0.31
87	600664	哈药股份	1,189,226	18,670,848.20	0.30
88	600320	振华重工	2,805,989	18,659,826.85	0.30
89	600741	华域汽车	1,650,000	18,364,500.00	0.29
90	600550	天威保变	1,010,112	18,192,117.12	0.29
91	601001	大同煤业	1,065,492	18,113,364.00	0.29
92	600549	厦门钨业	437,059	18,107,354.37	0.29
93	600271	航天信息	691,319	17,863,682.96	0.28
94	600166	福田汽车	2,032,290	17,640,277.20	0.28
95	601998	中信银行	3,710,450	17,624,637.50	0.28
96	600395	盘江股份	530,885	17,620,073.15	0.28
97	600196	复星医药	1,524,436	16,585,863.68	0.26
98	600376	首开股份	1,209,156	15,972,950.76	0.25
99	600598	北大荒	1,138,846	15,943,844.00	0.25
100	600997	开滦股份	994,027	15,864,670.92	0.25
101	600208	新湖中宝	2,465,622	15,360,825.06	0.24
102	600812	华北制药	1,312,325	15,117,984.00	0.24
103	600703	三安光电	917,888	15,053,363.20	0.24
104	600352	浙江龙盛	1,541,275	14,765,414.50	0.23
105	600219	南山铝业	1,548,517	14,571,544.97	0.23
106	600169	太原重工	1,367,791	13,883,078.65	0.22
107	600643	爱建股份	1,315,300	13,810,650.00	0.22
108	600418	江淮汽车	1,236,936	13,742,358.96	0.22
109	600085	同仁堂	382,174	13,628,324.84	0.22
110	601118	海南橡胶	1,105,700	13,622,224.00	0.22
111	600216	浙江医药	432,365	13,571,937.35	0.21
112	600649	城投控股	1,666,661	13,533,287.32	0.21
113	600108	亚盛集团	2,228,525	13,527,146.75	0.21
114	600221	海南航空	1,863,199	13,303,240.86	0.21
115	600331	宏达股份	991,550	13,197,530.50	0.21
116	601818	光大银行	3,935,618	13,184,320.30	0.21
117	601101	昊华能源	202,967	12,809,247.37	0.20
118	601179	中国西电	2,089,274	12,744,571.40	0.20
119	600118	中国卫星	566,835	12,702,772.35	0.20

120	601158	重庆水务	1,537,753	12,701,839.78	0.20
121	600879	航天电子	1,040,364	12,650,826.24	0.20
122	601866	中海集运	3,471,852	12,637,541.28	0.20
123	600635	大众公用	2,108,277	12,438,834.30	0.20
124	600595	中孚实业	1,208,315	12,131,482.60	0.19
125	600325	华发股份	1,045,625	11,731,912.50	0.19
126	600895	张江高科	1,222,048	11,536,133.12	0.18
127	600369	西南证券	965,412	11,459,440.44	0.18
128	600406	国电南瑞	313,845	11,392,573.50	0.18
129	600239	云南城投	883,031	11,355,778.66	0.18
130	601377	兴业证券	650,000	11,199,500.00	0.18
131	601117	中国化学	1,244,390	11,025,295.40	0.17
132	600675	中华企业	1,579,943	10,743,612.40	0.17
133	600432	吉恩镍业	480,736	10,710,798.08	0.17
134	600508	上海能源	426,067	10,383,252.79	0.16
135	600037	歌华有线	1,017,322	10,366,511.18	0.16
136	600266	北京城建	661,419	9,954,355.95	0.16
137	601888	中国国旅	412,004	9,735,654.52	0.15
138	600160	巨化股份	289,922	9,410,868.12	0.15
139	600804	鹏博士	1,186,760	9,363,536.40	0.15
140	600528	中铁二局	1,067,165	9,273,663.85	0.15
141	600600	青岛啤酒	260,000	8,876,400.00	0.14
142	601588	北辰实业	2,319,989	8,491,159.74	0.13
143	600096	云天化	421,788	8,389,363.32	0.13
144	600663	陆家嘴	573,511	8,017,683.78	0.13
145	600516	方大炭素	602,609	7,912,256.17	0.13
146	600674	川投能源	549,290	7,876,818.60	0.12
147	600773	西藏城投	330,000	7,788,000.00	0.12
148	600183	生益科技	836,784	7,681,677.12	0.12
149	600884	杉杉股份	420,360	7,679,977.20	0.12
150	600872	中炬高新	1,136,584	7,637,844.48	0.12
151	600737	中粮屯河	735,838	7,542,339.50	0.12
152	600823	世茂股份	501,446	7,336,154.98	0.12
153	600064	南京高科	520,729	7,212,096.65	0.11
154	600220	江苏阳光	1,382,951	6,970,073.04	0.11
155	600109	国金证券	445,135	6,476,714.25	0.10
156	600747	大连控股	800,000	6,472,000.00	0.10
157	600638	新黄浦	649,464	6,462,166.80	0.10
158	600322	天房发展	1,211,547	6,433,314.57	0.10
159	601018	宁波港	1,900,000	6,080,000.00	0.10
160	600158	中体产业	949,265	5,980,369.50	0.09



161	601717	郑煤机	160,000	5,833,600.00	0.09
162	600175	美都控股	1,366,649	5,671,593.35	0.09
163	600736	苏州高新	874,799	5,511,233.70	0.09
164	601268	二重重装	489,818	5,309,627.12	0.08
165	600641	万业企业	543,258	4,943,647.80	0.08
166	600246	万通地产	881,648	4,408,240.00	0.07
167	600748	上实发展	592,552	4,290,076.48	0.07
168	600622	嘉宝集团	506,087	4,205,582.97	0.07
169	600811	东方集团	595,471	4,096,840.48	0.06
170	601099	太平洋	431,150	4,061,433.00	0.06
171	600863	内蒙华电	450,000	3,987,000.00	0.06
172	600657	信达地产	576,318	3,671,145.66	0.06
173	600259	广晟有色	50,000	3,646,000.00	0.06
174	600151	航天机电	288,500	3,326,405.00	0.05
175	601718	际华集团	700,000	3,220,000.00	0.05
176	601808	中海油服	180,000	3,214,800.00	0.05
177	600584	长电科技	312,359	2,580,085.34	0.04
178	600173	卧龙地产	455,699	2,465,331.59	0.04
179	600759	正和股份	288,670	1,532,837.70	0.02
180	600631	百联股份	70,100	1,043,088.00	0.02

注：本报告期内，本基金的股票投资全部为指数化投资，无积极投资。

#### 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

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	601318	中国平安	82,738,914.94	1.01
2	600068	葛洲坝	60,686,892.50	0.74
3	600000	浦发银行	52,837,071.92	0.64
4	600585	海螺水泥	38,764,705.77	0.47
5	600016	民生银行	37,198,872.00	0.45
6	600036	招商银行	36,288,687.09	0.44
7	601601	中国太保	34,577,395.60	0.42
8	601179	中国西电	33,834,247.94	0.41
9	601186	中国铁建	31,905,395.63	0.39
10	601818	光大银行	31,759,833.94	0.39
11	601088	中国神华	30,582,178.40	0.37
12	600795	国电电力	28,886,000.00	0.35
13	600048	保利地产	27,126,195.78	0.33
14	601166	兴业银行	25,532,554.96	0.31
15	600252	中恒集团	24,186,203.19	0.29
16	601727	上海电气	23,976,081.69	0.29

17	600031	三一重工	23,890,638.88	0.29
18	601688	华泰证券	23,036,557.28	0.28
19	601989	中国重工	22,150,279.17	0.27
20	601788	光大证券	21,136,400.30	0.26

注：“买入金额”按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

#### 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

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	601318	中国平安	167,641,159.68	2.04
2	600036	招商银行	127,386,892.23	1.55
3	600016	民生银行	98,362,985.74	1.20
4	601166	兴业银行	88,582,554.12	1.08
5	601328	交通银行	81,365,368.85	0.99
6	600000	浦发银行	74,636,689.08	0.91
7	601088	中国神华	73,868,301.81	0.90
8	601601	中国太保	70,611,837.83	0.86
9	600030	中信证券	70,329,005.11	0.86
10	600068	葛洲坝	63,592,708.44	0.77
11	600900	长江电力	53,221,464.10	0.65
12	601939	建设银行	51,175,473.83	0.62
13	600031	三一重工	50,411,259.74	0.61
14	600519	贵州茅台	50,078,089.44	0.61
15	601398	工商银行	46,585,421.66	0.57
16	601186	中国铁建	44,263,966.30	0.54
17	600585	海螺水泥	42,929,024.56	0.52
18	601006	大秦铁路	38,856,939.21	0.47
19	601668	中国建筑	38,191,666.83	0.46
20	601179	中国西电	37,286,914.38	0.45

注：“卖出金额”按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 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	1,546,533,126.73
卖出股票收入(成交)总额	3,358,942,984.86

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

#### 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	199,640,000.00	3.16
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	199,640,000.00	3.16

#### 7.6 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

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	010110	21 国债(00)	2,000,000	199,640,000.00	3.16

#### 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 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

#### 7.9.3 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	71,973.58
2	应收证券清算款	2,739,073.97
3	应收股利	12,604,173.36
4	应收利息	4,551,244.72
5	应收申购款	130,188.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	0.00
9	合计	20,096,654.01

#### 7.9.4 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。

#### 7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 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
372,853	25,580.78	3,138,492,424.12	32.91%	6,399,378,173.07	67.09%

### 8.2 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	1,015,246.66	0.01%

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2003年3月17日)基金份额总额	1,929,789,525.65
本报告期期初基金份额总额	12,250,097,329.54
本报告期基金总申购份额	1,290,169,721.60
减:本报告期基金总赎回份额	4,002,396,453.95
本报告期基金拆分变动份额	0.00
本报告期末基金份额总额	9,537,870,597.19

## § 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

2011年1月29日基金管理人在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》发布“万家基金管理有限公司关于公司董事变更的公告”，选举毕玉国、杨峰、陈晓龙、魏颖晖、刘兴云、蔡荣生、邓辉为万家基金管理有限公司第三届董事会董事，其中刘兴云、蔡荣生、邓辉为第三届董事会独立董事。

2011年3月4日基金管理人在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》发布“万家基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告”，毕玉国先生担任公司董事长职务，孙国茂先生不再担任公司董事长职务；杨峰先生担任公司总经理职务，李振伟先生不再担任总经理职务。

本报告期内，根据证监会《关于核准中国银行股份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职资格的批复》，李爱华先生担任本基金托管人——中国银行托管及投资者服务部总经理；因工作调动，董杰先生不再担任中国银行托管及投资者服务部总经理。该人事变动已按相关规定备案并公告。

**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**

报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

**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	
东方证券	1	1,162,180,169.18	23.85%	987,851.99	23.85%	-
上海证券	1	1,046,557,199.73	21.48%	889,574.57	21.48%	-
齐鲁证券	3	742,166,273.82	15.23%	630,839.23	15.23%	-
东吴证券	1	408,177,391.37	8.38%	346,949.56	8.38%	-
民族证券	1	386,381,267.97	7.93%	328,423.60	7.93%	-
华宝证券	1	324,167,278.57	6.65%	275,542.76	6.65%	-
中航证券	1	289,314,963.11	5.94%	245,916.88	5.94%	-
银河证券	1	199,992,575.36	4.10%	169,990.69	4.10%	-
中信万通	1	187,476,807.26	3.85%	159,355.00	3.85%	-
湘财证券	1	125,688,170.98	2.58%	106,834.19	2.58%	-

注：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。

**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	
	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
东方证券	38,534,588.20	22.34%	604,000,000.00	22.96%
上海证券	223,008.00	0.13%	720,000,000.00	27.37%
齐鲁证券	-	-	235,000,000.00	8.93%
东吴证券	-	-	142,000,000.00	5.40%

民族证券	93,269,392.50	54.08%	60,000,000.00	2.28%
华宝证券	37,378,583.00	21.67%	150,000,000.00	5.70%
中航证券	3,048,995.20	1.77%	350,000,000.00	13.30%
银河证券	-	-	-	-
中信万通	-	-	200,000,000.00	7.60%
湘财证券	-	-	170,000,000.00	6.46%

### 10.8 其他重大事件

无

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件名称

- 1、中国证监会批准万家 180 指数证券投资基金发行及募集的文件。
- 2、《万家 180 指数证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家 180 指数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 180 指数证券投资基金 2011 年半年度报告原文。

### 11.2 备查文件存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人网站：[www.wjasset.com](http://www.wjasset.com)

### 11.3 备查文件查阅方式

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

2011 年 8 月 26 日