

万家 180 指数证券投资基金 2012 年半年度报告

2012 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：2012 年 8 月 24 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 2012 年 8 月 22 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 2012 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	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	8
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投资运作合规守信、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	28
7.1 期末基金资产组合情况	28
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	35
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	37
10.1 基金份额持有人大会决议.....	37
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.....	37
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
§ 11 备查文件目录	39
11.1 备查文件名称	39
11.2 备查文件存放地点.....	39
11.3 备查文件查阅方式.....	39

§ 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	10,302,004,898.39 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	$95\% \times \text{上证 180 指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$
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		95538 转 6、4008880800	95566
传真		021-38619888	010-66594942
注册地址		上海市浦东新区浦电路 360 号 9 楼	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		上海市浦东新区浦电路 360 号 9 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(2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-195,295,137.21
本期利润	293,067,751.20
加权平均基金份额本期利润	0.0283
本期加权平均净值利润率	4.99%
本期基金份额净值增长率	6.21%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-4,590,974,119.08
期末可供分配基金份额利润	-0.4456
期末基金资产净值	5,711,030,779.31
期末基金份额净值	0.5544
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	121.90%

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

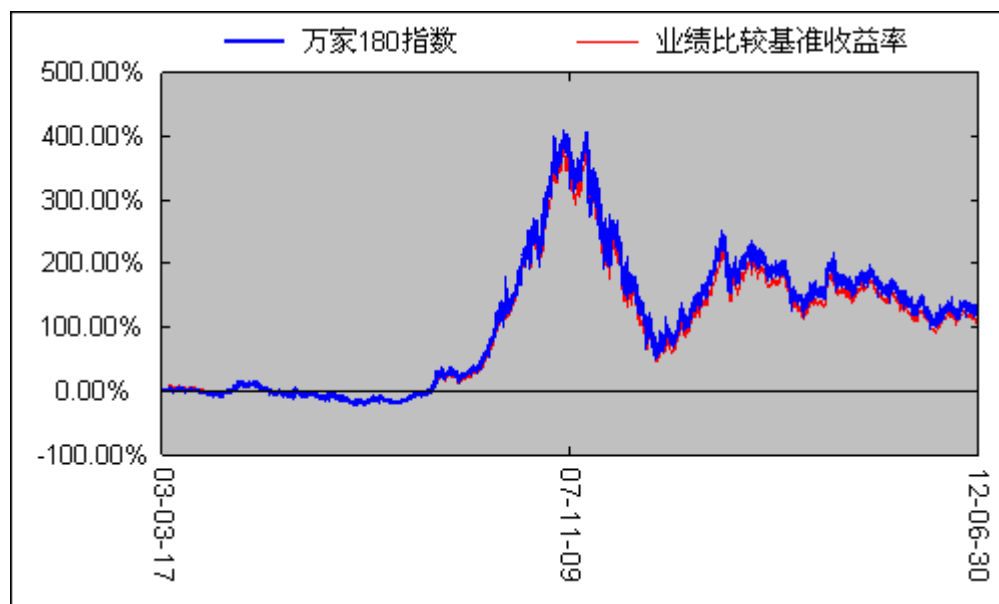
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-4.89%	1.04%	-5.94%	1.04%	1.05%	0.00%
过去三个月	1.54%	1.03%	0.34%	1.04%	1.20%	-0.01%
过去六个月	6.21%	1.22%	5.19%	1.22%	1.02%	0.00%
过去一年	-16.25%	1.26%	-16.68%	1.27%	0.43%	-0.01%

过去三年	-24.62%	1.46%	-23.85%	1.48%	-0.77%	-0.02%
自基金合同生效起至今	121.90%	1.65%	106.57%	1.68%	15.33%	-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浦电路 360 号陆家嘴投资大厦 9 楼，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、万家中证红利指数型证券投资基金、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		
吴涛	万家 180 基金基金经理、万家中证红利基金基金经理、量化投资部总监	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

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,执行交易系统内的公平交易程序;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。

本报告期内无下列情况: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%。

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

2012 年上半年,为应对国内经济增速下滑,国家在财政、货币政策方面逐步转为积极和宽松,但政策刺激效应尚需累积,经济增速和通胀水平持续回落。期间证券市场整体表现为震荡走势,政策放松和经济改善预期推动前期市场反弹,实际数据压迫市场快速下滑。报告期本基金投资标的指数—上证 180 指数收益率为 5.4%。

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、禁止投资成分股替代和标的指数成分股定期调整等因素所造成。

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 0.5544 元,报告期内基金份额净值增长率为 6.21%,同期业绩比较基准收益率为 5.19%,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

2012 年下半年,我们认为经济增速水平已经处于底部区域,较低的通胀压力将拓宽政策的调控空间。随着流动性的持续改善,经济增长活力的逐步修复,我国经济将实现“软着陆”,上市公司业绩也将得到改善,而经济转型和结构调整受益产业以及具有成长确定性的行业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。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

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

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, 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真实、准确和完整发表意见

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(注: 财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

中国银行股份有限公司及投资者服务部
2012 年 8 月 22 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：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	42,789,059.26	51,711,568.18
结算备付金		3,911,701.15	2,250,250.04
存出保证金		0.00	71,849.12
交易性金融资产	6.4.7.2	5,669,609,366.57	5,015,130,095.25
其中：股票投资		5,409,947,349.58	4,813,769,053.25
基金投资		-	-
债券投资		259,662,016.99	201,361,042.00
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	0.00	8,000,000.00
应收证券清算款		0.00	5,188,916.65
应收利息	6.4.7.5	2,265,910.47	2,282,268.22
应收股利		14,519,324.71	0.00
应收申购款		177,171.85	267,281.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,733,272,534.01	5,084,902,228.70
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 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	6.4.7.3	0.00	0.00
卖出回购金融资产款		0.00	0.00
应付证券清算款		14,180,598.74	0.00
应付赎回款		980,742.74	747,435.63
应付管理人报酬		4,872,135.16	4,459,816.58
应付托管费		974,427.04	891,963.32
应付销售服务费		-	0.00
应付交易费用	6.4.7.7	1,052,657.76	705,668.80
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	149,475.46	410,648.51
负债合计		22,241,754.70	7,247,250.64
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	10,302,004,898.39	9,726,736,581.11
未分配利润	6.4.7.10	-4,590,974,119.08	-4,649,081,603.05
所有者权益合计		5,711,030,779.31	5,077,654,978.06
负债和所有者权益总计		5,733,272,534.01	5,084,902,228.70

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.5544 元，基金份额总额 10,302,004,898.39 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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
一、收入		331,499,037.40	81,089,762.34
1. 利息收入		3,829,376.58	4,783,663.56
其中：存款利息收入	6.4.7.11	300,034.75	604,197.06
债券利息收入		3,416,012.11	3,995,229.80
资产支持证 券利息收入		-	0.00
买入返售金 融资产收入		113,329.72	184,236.70
其他利息收 入		-	0.00
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		-161,152,302.26	-308,095,295.33
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-241,772,757.47	-370,996,571.84
基金投资收 益		-	-
债券投资收 益	6.4.7.13	1,271,663.69	1,287,724.53
资产支持证 券投资收益	6.4.7.14	0.00	0.00
衍生工具收 益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	79,348,791.52	61,613,551.98
3. 公允价值变动收 益（损失以“-”号 填列）	6.4.7.17	488,362,888.41	381,587,875.34
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	459, 074. 67	2, 813, 518. 77
减：二、费用		38, 431, 286. 20	50, 190, 465. 01
1. 管理人报酬		29, 099, 677. 22	34, 200, 159. 85
2. 托管费		5, 819, 935. 40	6, 840, 031. 96
3. 销售服务费		0. 00	0. 00
4. 交易费用	6. 4. 7. 19	3, 256, 135. 48	8, 462, 857. 96
5. 利息支出		93, 754. 13	496, 216. 44
其中：卖出回购金融资产支出		93, 754. 13	496, 216. 44
6. 其他费用	6. 4. 7. 20	161, 783. 97	191, 198. 80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		293, 067, 751. 20	30, 899, 297. 33
减：所得税费用		0. 00	0. 00
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		293, 067, 751. 20	30, 899, 297. 33

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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 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, 726, 736, 581. 11	-4, 649, 081, 603. 05	5, 077, 654, 978. 06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	293, 067, 751. 20	293, 067, 751. 20
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）	575, 268, 317. 28	-234, 960, 267. 23	340, 308, 050. 05
其中：1. 基金申购款	1, 410, 515, 766. 90	-599, 939, 027. 39	810, 576, 739. 51
2. 基金赎回款	-835, 247, 449. 62	364, 978, 760. 16	-470, 268, 689. 46
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）	10, 302, 004, 898. 39	-4, 590, 974, 119. 08	5, 711, 030, 779. 31
项目	上年度可比期间 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

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,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 3 号《半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 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年上半年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)

本半年度报告所采用的会计政策、会计估计与上年度报告相一致。

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》,对基金取得的股票的股息、红利及债券的利息等收入,由上市公司、债券发行企业等在向基金派发时代扣代缴 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

6.4.7 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 2012 年 6 月 30 日
活期存款	42,789,059.26
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	42,789,059.26

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2012 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		6,830,185,614.53	5,409,947,349.58	-1,420,238,264.95
债券	交易所市场	110,666,151.20	110,757,016.99	90,865.79
	银行间市场	148,230,900.00	148,905,000.00	674,100.00
	合计	258,897,051.20	259,662,016.99	764,965.79
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		7,089,082,665.73	5,669,609,366.57	-1,419,473,299.16

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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	7,235.40
应收定期存款利息	0.00
应收其他存款利息	0.00
应收结算备付金利息	1,584.27
应收债券利息	2,254,938.82
应收买入返售证券利息	0.00
应收申购款利息	2,151.98

其他	0.00
合计	2,265,910.47

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	-
合计	-

无

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,050,047.36
银行间市场应付交易费用	2,610.40
合计	1,052,657.76

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	0.00
应付赎回费	297.34
预提费用	149,178.12
合计	149,475.46

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,726,736,581.11	9,726,736,581.11
本期申购	1,410,515,766.90	1,410,515,766.90
本期赎回（以“-”号填列）	-835,247,449.62	-835,247,449.62
本期末	10,302,004,898.39	10,302,004,898.39

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	-4,067,292,389.14	-581,789,213.91	-4,649,081,603.05
本期利润	-195,295,137.21	488,362,888.41	293,067,751.20

本期基金份额交易产生的变动数	-242,109,779.00	7,149,511.77	-234,960,267.23
其中：基金申购款	-602,721,389.56	2,782,362.17	-599,939,027.39
基金赎回款	360,611,610.56	4,367,149.60	364,978,760.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,504,697,305.35	-86,276,813.73	-4,590,974,119.08

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	259,729.61
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	23,924.88
其他	16,380.26
合计	300,034.75

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

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	935,407,622.87
减：卖出股票成本总额	1,177,180,380.34
买卖股票差价收入	-241,772,757.47

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	86,510,453.92
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	84,678,466.24
减：应收利息总额	560,323.99
债券投资收益	1,271,663.69

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

无

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	79,348,791.52
基金投资产生的股利收益	-
合计	79,348,791.52

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	488,362,888.41
——股票投资	487,789,969.92
——债券投资	572,918.49
——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	488,362,888.41

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	420,092.18
基金转换费收入	38,982.49
合计	459,074.67

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	3,255,460.48
银行间市场交易费用	675.00
合计	3,256,135.48

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
审计费用	0.00
信息披露费	149,178.12
银行费用	3,605.85
银行间账户维护费	9,000.00
合计	161,783.97

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

本基金本报告期末不存在或有事项。

6.4.8.2 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。

6.4.9 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
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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 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	503,075,754.66	23.00%	742,166,273.82	15.23%

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额	成交金额	占当期债券成交总额

		额的比例		额的比例
齐鲁证券有限公司	52,467,569.10	29.71%	0.00	0.00%

注：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。

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 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	135,000,000.00	11.74%	235,000,000.00	8.93%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 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	434,218.42	23.11%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 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%

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	29,099,677.22	34,200,159.85
其中：支付销售机构的客户维护费	4,327,466.15	5,544,115.57

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金托管人复核后于次月的前两个工作

日内, 根据基金管理人向基金托管人发送的划付指令, 从基金资产中支付给基金管理人以及服务提供者; 若遇法定节假日、休息日等, 支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,819,935.40	6,840,031.96

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:

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算, 逐日累计至每个月月末, 按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令, 基金托管人复核后于次月的前两个工作日内从基金资产中支付给基金托管人, 若遇法定节假日、休息日等, 支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

无

6.4.10.3 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 2012 年 1 月 1 日至 2012 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	97,588,603.28	49,165,161.75	-	-	295,000,000.00	73,265.07
上年度可比期间 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	-	-	-	-

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 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	0.00	24,234,935.34
期间申购/买入总份额	0.00	0.00

期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
期末持有的基金份额	0.00	24,234,935.34
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.25%

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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本报告期末未投资本基金。

6.4.10.5 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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 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	42,789,059.26	259,729.61	119,206,734.42	456,656.96

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，2012 年上半年度获得的利息收入为人民币 23,925.14 元（2011 年度：人民币 69,770.6 元），2012 上半年末结算备付金余额为人民币 3,911,701.15 元（2011 年末：人民币 2,250,250.04 元）。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无

6.4.11 利润分配情况

本基金本期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2012 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金期末未持有因新发/增发而流通受限证券

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金期末未持暂时停牌等流通受限证券

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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公司的证券,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。

6.4.13.3 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2012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	42,789,059.26	-	-	-	-	-	42,789,059.26
结算备付金	3,911,701.15	-	-	-	-	-	3,911,701.15
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	110,757,016.99	-	148,905,000.00	-	-	5,409,947,349.58	5,669,609,366.57
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	-	-	-	-	-	2,265,910.47	2,265,910.47

应收股利	-	-	-	-	-	14,519,324.71	14,519,324.71
应 收 申 购 款	-	-	-	-	-	177,171.85	177,171.85
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	157,457,777.40	-	148,905,000.00	-	-	5,426,909,756.61	5,733,272,534.01
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	-	-	-	-	-	14,180,598.74	14,180,598.74
应 付 赎 回 款	-	-	-	-	-	980,742.74	980,742.74
应 付 管 理 人报酬	-	-	-	-	-	4,872,135.16	4,872,135.16
应 付 托 管 费	-	-	-	-	-	974,427.04	974,427.04
应 付 销 售 服务费	-	-	-	-	-	-	-
应 付 交 易 费用	-	-	-	-	-	1,052,657.76	1,052,657.76
应交税费	-	-	-	-	-	31,717.80	31,717.80
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	149,475.46	149,475.46
负债总计	-	-	-	-	-	22,241,754.70	22,241,754.70
利 率 敏 感 度缺口	157,457,777.40	-	148,905,000.00	-	-	5,404,668,001.91	5,711,030,779.31

上年 度末 2011 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	51,711,568.18	-	-	-	-	-	51,711,568.18

存款							
结算 备付 金	2,250,250.04	-	-	-	-	-	2,250,250.04
存出 保证 金	71,849.12	-	-	-	-	-	71,849.12
交易 性金 融资 产	-	99,180,000.00	102,181,042.00	-	-	4,813,769,053.25	5,015,130,095.25
衍生 金融 资产	-	-	-	-	-	0.00	0.00
买入 返售 金融 资产	8,000,000.00	-	-	-	-	-	8,000,000.00
应收 证券 清算 款	-	-	-	-	-	5,188,916.65	5,188,916.65
应收 利息	-	-	-	-	-	2,282,268.22	2,282,268.22
应收 股利	-	-	-	-	-	267,281.24	267,281.24
应收 申购 款	-	-	-	-	-	0.00	0.00
其他 资产	-	-	-	-	-	-	-
资产 总计	62,033,667.34	99,180,000.00	102,181,042.00	-	-	4,821,507,519.36	5,084,902,228.70
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	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	747,435.63	747,435.63
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	4,459,816.58	4,459,816.58
应付 托管 费	-	-	-	-	-	891,963.32	891,963.32
应付 销售 服务 费	-	-	-	-	-	-	-
应付 交易 费用	-	-	-	-	-	705,668.80	705,668.80
应交 税费	-	-	-	-	-	31,717.80	31,717.80
应付 利息	-	-	-	-	-	-	-
应付 利润	-	-	-	-	-	-	-
其他 负债	-	-	-	-	-	410,648.51	410,648.51
负债 总计	-	-	-	-	-	7,247,250.64	7,247,250.64
利率 敏感 度缺 口	62,033,667.34	99,180,000.00	102,181,042.00	-	-	4,814,260,268.72	5,077,654,978.06

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。

6.4.13.4.1.2 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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	变动	本期末(2012 年 6 月 30 日)	上年度末(2011 年 12 月 31 日)
	1. 市场利率下降 25 个基点	434,200.00	105,000.00
	2. 市场利率上升 25 个基点	-432,200.00	-104,700.00

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价,因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 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	5,409,947,349.58	94.73	4,813,769,053.25	94.80
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	259,662,016.99	4.55	201,361,042.00	3.97
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	5,669,609,366.57	99.27	5,015,130,095.25	98.77

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 指数成份股的比例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。

6.4.13.4.3.2 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(2012 年 6 月 30 日)	上年度末(2011 年 12 月 31 日)
	1. 股票基准指数下降 100 个基点	-54,130,300.00	-47,466,000.00
	2. 股票基准指数上升 100 个基点	54,130,300.00	47,466,000.00

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。上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。

§ 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	5,409,947,349.58	94.36
	其中：股票	5,409,947,349.58	94.36
2	固定收益投资	259,662,016.99	4.53
	其中：债券	259,662,016.99	4.53
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	—	—
4	买入返售金融资产	0.00	—
	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	46,700,760.41	0.81
6	其他各项资产	16,962,407.03	0.30
7	合计	5,733,272,534.01	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	27,812,197.13	0.49
B	采掘业	622,713,605.45	10.90
C	制造业	1,336,645,586.17	23.40
C0	食品、饮料	269,922,902.45	4.73
C1	纺织、服装、皮毛	21,751,590.26	0.38
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	63,526,474.02	1.11
C5	电子	58,346,547.33	1.02
C6	金属、非金属	328,614,724.82	5.75
C7	机械、设备、仪表	436,290,296.64	7.64
C8	医药、生物制品	158,193,050.65	2.77
C99	其他制造业	0.00	0.00

D	电力、煤气及水的生产和供应业	178,900,811.37	3.13
E	建筑业	196,131,895.10	3.43
F	交通运输、仓储业	173,689,938.15	3.04
G	信息技术业	146,614,881.50	2.57
H	批发和零售贸易	63,607,661.27	1.11
I	金融、保险业	2,275,510,209.30	39.84
J	房地产业	288,691,800.83	5.05
K	社会服务业	26,496,653.31	0.46
L	传播与文化产业	13,202,293.12	0.23
M	综合类	59,929,816.88	1.05
	合计	5,409,947,349.58	94.73

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	5,390,426	246,558,085.24	4.32
2	600016	民生银行	35,730,836	214,027,707.64	3.75
3	600036	招商银行	19,494,007	212,874,556.44	3.73
4	601328	交通银行	35,973,760	163,320,870.40	2.86
5	600519	贵州茅台	666,315	159,349,232.25	2.79
6	601166	兴业银行	11,947,791	155,082,327.18	2.72
7	600000	浦发银行	17,912,444	145,628,169.72	2.55
8	600030	中信证券	11,085,642	140,011,658.46	2.45
9	600837	海通证券	13,033,592	125,513,490.96	2.20
10	601088	中国神华	5,309,348	119,354,143.04	2.09
11	601601	中国太保	4,951,363	109,821,231.34	1.92
12	601398	工商银行	27,501,871	108,632,390.45	1.90
13	601288	农业银行	39,391,693	102,024,484.87	1.79
14	600111	包钢稀土	2,299,430	90,735,507.80	1.59
15	600048	保利地产	7,617,255	86,379,671.70	1.51
16	601939	建设银行	18,842,231	79,137,370.20	1.39
17	601668	中国建筑	23,610,330	78,858,502.20	1.38
18	601169	北京银行	6,924,621	67,653,547.17	1.18
19	601006	大秦铁路	9,500,291	66,787,045.73	1.17
20	600031	三一重工	4,787,186	66,637,629.12	1.17
21	601818	光大银行	19,191,374	54,503,502.16	0.95
22	600900	长江电力	7,875,302	53,552,053.60	0.94
23	600887	伊利股份	2,556,013	52,602,747.54	0.92
24	600015	华夏银行	5,417,566	51,304,350.02	0.90

25	600050	中国联通	13,347,381	49,652,257.32	0.87
26	601857	中国石油	5,482,560	49,617,168.00	0.87
27	600104	上汽集团	3,470,834	49,598,217.86	0.87
28	601899	紫金矿业	12,450,021	48,306,081.48	0.85
29	600585	海螺水泥	3,205,050	47,498,841.00	0.83
30	600256	广汇能源	3,307,893	44,557,318.71	0.78
31	601628	中国人寿	2,403,548	43,984,928.40	0.77
32	600999	招商证券	3,729,616	43,300,841.76	0.76
33	600028	中国石化	6,671,806	42,032,377.80	0.74
34	600383	金地集团	6,249,970	40,499,805.60	0.71
35	600518	康美药业	2,445,526	37,710,010.92	0.66
36	600547	山东黄金	1,138,641	37,392,970.44	0.65
37	601989	中国重工	7,042,780	36,552,028.20	0.64
38	600019	宝钢股份	8,259,653	35,681,700.96	0.62
39	600739	辽宁成大	2,183,127	34,056,781.20	0.60
40	600489	中金黄金	1,572,083	33,831,226.16	0.59
41	600795	国电电力	12,111,949	32,702,262.30	0.57
42	600011	华能国际	4,940,022	31,863,141.90	0.56
43	600362	江西铜业	1,330,400	31,809,864.00	0.56
44	601699	潞安环能	1,476,112	30,614,562.88	0.54
45	600690	青岛海尔	2,578,589	30,221,063.08	0.53
46	600348	阳泉煤业	1,924,816	29,449,684.80	0.52
47	601009	南京银行	3,335,606	28,419,363.12	0.50
48	601600	中国铝业	4,598,378	28,371,992.26	0.50
49	601688	华泰证券	2,699,785	28,347,742.50	0.50
50	601788	光大证券	2,152,097	28,343,117.49	0.50
51	600406	国电南瑞	1,512,665	28,271,708.85	0.50
52	600089	特变电工	4,150,227	28,097,036.79	0.49
53	600276	恒瑞医药	974,379	27,974,421.09	0.49
54	601299	中国北车	6,603,925	26,481,739.25	0.46
55	601669	中国水电	6,021,311	26,313,129.07	0.46
56	601766	中国南车	5,649,659	25,762,445.04	0.45
57	601168	西部矿业	2,995,764	25,643,739.84	0.45
58	601377	兴业证券	2,418,581	25,346,728.88	0.44
59	600309	烟台万华	1,730,034	23,095,953.90	0.40
60	601898	中煤能源	2,928,032	22,662,967.68	0.40
61	600068	葛洲坝	3,351,886	21,887,815.58	0.38
62	601186	中国铁建	4,843,596	21,554,002.20	0.38
63	600100	同方股份	2,501,752	21,064,751.84	0.37
64	600600	青岛啤酒	548,424	20,944,312.56	0.37
65	601390	中国中铁	8,083,503	20,774,602.71	0.36

66	600369	西南证券	1, 829, 292	20, 689, 292. 52	0. 36
67	600642	申能股份	4, 465, 201	20, 584, 576. 61	0. 36
68	600010	包钢股份	4, 126, 052	20, 135, 133. 76	0. 35
69	600150	中国船舶	868, 694	19, 953, 901. 18	0. 35
70	600123	兰花科创	1, 098, 405	19, 837, 194. 30	0. 35
71	601958	金钼股份	1, 547, 636	19, 608, 548. 12	0. 34
72	600009	上海机场	1, 518, 085	19, 340, 402. 90	0. 34
73	600549	厦门钨业	436, 831	19, 181, 249. 21	0. 34
74	601666	平煤股份	1, 887, 176	19, 098, 221. 12	0. 33
75	600875	东方电气	1, 063, 982	19, 066, 557. 44	0. 33
76	601618	中国中冶	7, 666, 207	19, 012, 193. 36	0. 33
77	600583	海油工程	3, 056, 952	18, 616, 837. 68	0. 33
78	600196	复星医药	1, 799, 918	18, 557, 154. 58	0. 32
79	601117	中国化学	3, 157, 617	18, 219, 450. 09	0. 32
80	600085	同仁堂	1, 042, 636	18, 193, 998. 20	0. 32
81	600188	兖州煤业	947, 419	17, 982, 012. 62	0. 31
82	600177	雅戈尔	2, 097, 030	17, 803, 784. 70	0. 31
83	601111	中国国航	2, 824, 501	17, 370, 681. 15	0. 30
84	601998	中信银行	4, 335, 827	17, 343, 308. 00	0. 30
85	601919	中国远洋	3, 670, 282	17, 030, 108. 48	0. 30
86	600005	武钢股份	6, 295, 498	16, 934, 889. 62	0. 30
87	600271	航天信息	888, 140	16, 794, 727. 40	0. 29
88	600415	小商品城	2, 137, 419	16, 671, 868. 20	0. 29
89	600029	南方航空	3, 558, 725	16, 405, 722. 25	0. 29
90	601607	上海医药	1, 505, 613	16, 064, 890. 71	0. 28
91	600376	首开股份	1, 197, 780	15, 858, 607. 20	0. 28
92	600166	福田汽车	2, 211, 711	15, 813, 733. 65	0. 28
93	601808	中海油服	946, 870	15, 632, 823. 70	0. 27
94	600809	山西汾酒	409, 282	15, 425, 838. 58	0. 27
95	600115	东方航空	3, 675, 202	15, 362, 344. 36	0. 27
96	600058	五矿发展	685, 995	15, 318, 268. 35	0. 27
97	600252	中恒集团	1, 377, 891	15, 101, 685. 36	0. 26
98	600741	华域汽车	1, 655, 376	14, 848, 722. 72	0. 26
99	600143	金发科技	2, 460, 366	14, 688, 385. 02	0. 26
100	601901	方正证券	2, 885, 425	14, 657, 959. 00	0. 26
101	600497	驰宏锌锗	1, 030, 865	14, 504, 270. 55	0. 25
102	600655	豫园商城	1, 806, 169	14, 232, 611. 72	0. 25
103	600395	盘江股份	528, 649	14, 210, 085. 12	0. 25
104	601717	郑煤机	1, 149, 422	13, 333, 295. 20	0. 23
105	600060	海信电器	792, 360	13, 319, 571. 60	0. 23
106	600259	广晟有色	200, 896	13, 245, 073. 28	0. 23

107	600649	城投控股	1,809,880	13,067,333.60	0.23
108	601106	中国一重	4,120,281	13,020,087.96	0.23
109	600703	三安光电	946,204	12,877,836.44	0.23
110	600804	鹏博士	2,108,393	12,523,854.42	0.22
111	600208	新潮中宝	3,006,237	12,415,758.81	0.22
112	600839	四川长虹	5,816,883	12,273,623.13	0.21
113	600219	南山铝业	1,827,082	12,241,449.40	0.21
114	600125	铁龙物流	1,439,641	12,208,155.68	0.21
115	600366	宁波韵升	580,084	12,042,543.84	0.21
116	601001	大同煤业	1,070,156	11,718,208.20	0.21
117	600811	东方集团	2,099,620	11,505,917.60	0.20
118	600893	航空动力	856,833	11,147,397.33	0.20
119	601101	昊华能源	642,372	10,997,408.64	0.19
120	601179	中国西电	2,745,261	10,926,138.78	0.19
121	601633	长城汽车	610,000	10,858,000.00	0.19
122	600266	北京城建	712,707	10,826,019.33	0.19
123	600674	川投能源	1,552,689	10,744,607.88	0.19
124	600895	张江高科	1,249,056	10,704,409.92	0.19
125	600216	浙江医药	425,621	10,704,368.15	0.19
126	600108	亚盛集团	2,145,377	10,576,708.61	0.19
127	600331	宏达股份	1,294,296	10,406,139.84	0.18
128	601928	凤凰传媒	1,200,008	10,320,068.80	0.18
129	600643	爱建股份	1,226,989	10,122,659.25	0.18
130	600664	哈药股份	1,510,264	9,952,639.76	0.17
131	600340	华夏幸福	541,800	9,801,162.00	0.17
132	600863	内蒙华电	1,219,622	9,635,013.80	0.17
133	600132	重庆啤酒	443,503	9,575,229.77	0.17
134	600550	天威保变	1,080,672	9,434,266.56	0.17
135	600352	浙江龙盛	1,618,165	9,272,085.45	0.16
136	600498	烽火通信	347,936	9,223,783.36	0.16
137	600221	海南航空	1,882,270	9,185,477.60	0.16
138	600160	巨化股份	899,814	9,088,121.40	0.16
139	600118	中国卫星	721,509	9,083,798.31	0.16
140	600325	华发股份	1,055,080	8,989,281.60	0.16
141	600316	洪都航空	685,708	8,934,775.24	0.16
142	601118	海南橡胶	1,295,216	8,898,133.92	0.16
143	601158	重庆水务	1,509,850	8,893,016.50	0.16
144	600516	方大炭素	1,032,108	8,814,202.32	0.15
145	601336	新华保险	250,000	8,560,000.00	0.15
146	600816	安信信托	513,768	8,538,824.16	0.15
147	600169	太原重工	2,391,576	8,394,431.76	0.15

148	600971	恒源煤电	600,000	8,358,000.00	0.15
149	600598	北大荒	1,119,108	8,337,354.60	0.15
150	600158	中体产业	1,079,166	8,277,203.22	0.14
151	601555	东吴证券	928,865	8,211,166.60	0.14
152	600675	中华企业	1,738,218	8,134,860.24	0.14
153	600072	中船股份	450,000	7,992,000.00	0.14
154	600770	综艺股份	695,147	7,980,287.56	0.14
155	600663	陆家嘴	641,619	7,872,665.13	0.14
156	600747	大连控股	1,677,296	7,832,972.32	0.14
157	600239	云南城投	919,746	7,808,643.54	0.14
158	600970	中材国际	669,987	7,731,649.98	0.14
159	600418	江淮汽车	1,420,588	7,685,381.08	0.13
160	600636	三爱富	381,495	7,381,928.25	0.13
161	600109	国金证券	491,183	7,068,123.37	0.12
162	601992	金隅股份	1,023,121	6,803,754.65	0.12
163	601099	太平洋	939,480	6,482,412.00	0.11
164	601002	晋亿实业	591,148	6,325,283.60	0.11
165	600823	世茂股份	558,764	6,135,228.72	0.11
166	600873	梅花集团	893,621	6,031,941.75	0.11
167	600251	冠农股份	320,000	5,993,600.00	0.10
168	600736	苏州高新	1,027,656	5,816,532.96	0.10
169	600614	鼎立股份	351,678	5,243,518.98	0.09
170	600151	航天机电	766,210	4,957,378.70	0.09
171	600773	西藏城投	371,396	4,694,445.44	0.08
172	600503	华丽家族	881,300	4,053,980.00	0.07
173	601233	桐昆股份	451,694	3,947,805.56	0.07
174	600535	天士力	89,979	3,933,881.88	0.07
175	600759	正和股份	606,059	3,357,566.86	0.06
176	600657	信达地产	731,015	3,238,396.45	0.06
177	600641	万业企业	645,566	3,008,337.56	0.05
178	600373	中文传媒	200,712	2,882,224.32	0.05
179	601311	骆驼股份	126,472	1,174,924.88	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	601398	工商银行	66,649,663.06	1.31
2	600999	招商证券	56,416,311.97	1.11
3	601288	农业银行	50,366,521.32	0.99
4	601818	光大银行	42,154,035.68	0.83

5	600011	华能国际	40,286,000.00	0.79
6	600036	招商银行	31,343,744.48	0.62
7	601669	中国水电	27,850,462.15	0.55
8	601328	交通银行	27,070,302.42	0.53
9	601318	中国平安	26,848,354.78	0.53
10	600256	广汇能源	25,374,970.27	0.50
11	601939	建设银行	25,127,447.05	0.49
12	600837	海通证券	24,772,007.41	0.49
13	600030	中信证券	24,592,212.79	0.48
14	600016	民生银行	23,916,529.63	0.47
15	600369	西南证券	23,867,905.25	0.47
16	601166	兴业银行	23,825,236.73	0.47
17	601009	南京银行	23,441,596.89	0.46
18	600000	浦发银行	19,688,457.76	0.39
19	600048	保利地产	19,486,367.21	0.38
20	601377	兴业证券	18,801,056.43	0.37

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	600999	招商证券	56,542,957.15	1.11
2	601398	工商银行	40,714,580.49	0.80
3	600256	广汇能源	28,320,175.44	0.56
4	600036	招商银行	27,839,655.59	0.55
5	601328	交通银行	25,769,713.30	0.51
6	600837	海通证券	24,113,626.46	0.47
7	600660	福耀玻璃	23,166,836.69	0.46
8	601009	南京银行	21,738,796.66	0.43
9	600030	中信证券	21,567,435.03	0.42
10	601166	兴业银行	21,475,151.61	0.42
11	601318	中国平安	21,328,389.78	0.42
12	600016	民生银行	20,778,870.02	0.41
13	600832	东方明珠	15,338,669.58	0.30
14	600000	浦发银行	15,336,304.58	0.30
15	600383	金地集团	14,947,324.30	0.29
16	600369	西南证券	12,562,736.56	0.25
17	601888	中国国旅	12,545,847.25	0.25
18	600111	包钢稀土	12,265,959.41	0.24
19	601088	中国神华	11,821,743.18	0.23
20	600519	贵州茅台	11,570,713.37	0.23

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	1,285,568,706.75
卖出股票收入（成交）总额	935,407,622.87

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	108,048,615.49	1.89
2	央行票据	48,455,000.00	0.85
3	金融债券	100,450,000.00	1.76
	其中：政策性金融债	100,450,000.00	1.76
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	2,708,401.50	0.05
8	其他	—	—
9	合计	259,662,016.99	4.55

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	120305	12 进出 05	1,000,000	100,450,000.00	1.76
2	020052	12 贴债 02	1,000,000	97,937,505.49	1.71
3	1101088	11 央行票据 88	500,000	48,455,000.00	0.85
4	019202	12 国债 02	100,110	10,111,110.00	0.18
5	113002	工行转债	24,850	2,708,401.50	0.05

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权证。

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	0.00

2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	14,519,324.71
4	应收利息	2,265,910.47
5	应收申购款	177,171.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	0.00
9	合计	16,962,407.03

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113002	工行转债	2,708,401.50	0.05

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
353,788	29,119.15	4,155,387,756.75	40.34%	6,146,617,141.64	59.66%

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	855,657.50	0.01%

注：1、截止本报告期末，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均为 0；

2、截止本报告期末，本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

§ 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	9,726,736,581.11

本报告期基金总申购份额	1,410,515,766.90
减:本报告期基金总赎回份额	835,247,449.62
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	10,302,004,898.39

§ 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

2012 年 4 月 21 日,基金管理人发布了“万家基金管理有限公司关于公司督察长变更的公告”,公司原督察长甘世雄因个人原因离职,经中国证监会批准(证监许可【2012】512 号),李振伟担任本公司督察长。

2012 年 6 月 2 日,基金管理人发布了“万家基金管理有限公司关于公司高级管理人员变更的公告”,公司原总经理杨峰因个人原因离职,经公司董事会决定,并经中国证监会批准(基金部函【2012】441 号),暂由公司董事长毕玉国代为履行总经理职务。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

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

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	
齐鲁证券	2	503,075,754.66	23.00%	434,218.42	23.11%	-
上海证券	1	387,016,759.78	17.70%	328,962.94	17.51%	-
银河证券	1	352,439,124.79	16.12%	305,495.30	16.26%	-
东方证券	1	293,098,868.19	13.40%	254,239.34	13.54%	-
五矿证券	1	255,800,342.83	11.70%	217,430.02	11.58%	-
东吴证券	1	223,971,115.29	10.24%	190,376.32	10.14%	-
华宝证券	1	107,628,751.01	4.92%	92,200.30	4.91%	-
湘财证券	1	48,343,456.99	2.21%	42,204.73	2.25%	-
长江证券	1	15,552,256.43	0.71%	13,219.21	0.70%	-
国泰君安	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-

海通证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	—
华夏证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	—
招商证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	—
平安证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	—
江南证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	—
中金公司	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	—
远东证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	—
民族证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	—
中信万通	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	—

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:

无

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
齐鲁证券	52,467,569.10	29.71%	135,000,000.00	11.74%
东吴证券	33,054,217.00	18.72%	229,000,000.00	19.92%
上海证券	27,284,806.10	15.45%	206,000,000.00	17.92%
东方证券	24,261,411.40	13.74%	283,000,000.00	24.62%
湘财证券	22,029,001.00	12.47%	9,000,000.00	0.78%
五矿证券	9,993,443.60	5.66%	215,000,000.00	18.70%
银河证券	5,000,510.60	2.83%	56,000,000.00	4.87%
华宝证券	2,498,953.50	1.42%	0.00	0.00%
长江证券	0.00	0.00%	16,500,000.00	1.44%
国泰君安	0.00	0.00%	0.00	0.00%
海通证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
华夏证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
招商证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
平安证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
江南证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
中金公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%
远东证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%

民族证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
中信万通	0.00	0.00%	0.00	0.00%

§ 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 2012 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

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

2012 年 8 月 24 日