

信息披露 Disclosure

万家180指数证券投资基金

2015 半年度报告摘要

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资产	本报告 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产：		
银行存款	161,769,168.85	215,066,837.63
结算备付金	4,420,710.09	1,033,468.87
存出保证金	3,706,362.14	1,481,102.80
应收利息	2,716,971,913.86	3,669,718,172.68
其他应收款项	2,716,971,913.86	3,669,718,172.68
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	12,077,378.68	-
预付款项	56,233.72	42,691.26
应收股利	-	-
应收申购款	1,874,530.01	4,447,668.42
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,890,946,903.03	3,892,679,656.06

负债和所有者权益	本报告 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
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	-	502.06
应付赎回款	30,344,263.40	22,263,774.18
应付管理人报酬	2,780,014.23	3,021,241.00
应付销售服务费	560,002.63	604,248.36
应付交易费	2,616,508.52	2,067,915.61
应付税费	-	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	205,311.04	497,547.49
负债合计	36,952,060.29	28,456,230.39
所有者权益：		
实收基金	2,890,946,903.03	4,522,565,129.20
未分配利润	86,299,407.89	-459,269,691.26
未分配利润合计	2,963,244,813.81	3,964,124,428.27
所有者权益合计	2,890,946,903.03	3,892,679,656.06

注：报告截止日2015年6月30日，基金份额净值1.0201元，基金份额总额2,890,956,406.33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：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

资产	本报告 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入	836,430,603.06	-140,963,669.60
1.利息收入	874,063.06	2,484,727.36
其中：存款利息收入	873,203.46	216,794.89
债券利息收入	1,790.39	2,237,387.24
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	3,956.23
2.公允价值变动收益	1,167,072,496.06	-134,867,617.76
其中：股票投资收益	1,142,704,143.07	-140,672,443.84
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,321,613.66	-2,346,879.26
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	22,766,740.03	27,161,706.26
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-533,060,184.19	-18,776,362.97
4.其他收入（损失以“-”号填列）	743,298.04	196,102.76
二、费用	21,359,247.43	20,156,728.20
1. 管理人报酬	18,728,621.66	14,349,381.16
2. 托管费	3,746,766.26	2,869,672.27
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	8,491,615.14	7,723,968.13
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	233,234.37	215,512.43
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	806,231,266.62	-161,122,407.99
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	806,231,266.62	-161,122,407.99

6.3 所有者权益（净亏损）变动表

会计主体：万家180指数证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	本报告 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、期初所有者权益（基金净值）	4,522,565,129.20	-658,389,631.38
二、本期投资运作产生的基金净值变动（本期利润）	-806,231,266.62	896,231,266.62
三、本期基金份额变动（基金净值变动以“-”号填列）	-1,715,941,714.32	-1,806,100,871.96
其中：1.基金申购款	1,033,338,509.88	13,044,696.57
2.基金赎回款	-2,748,888,314.30	-103,596,814.23
四、本期向基金持有人分配的基金净值变动（本期利润）	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
六、本期所有者权益（基金净值）	-1,631,618,226.17	-1,214,729,039.27
七、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
八、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
九、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
十、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
十一、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
十二、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
十三、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
十四、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
十五、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
十六、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
十七、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
十八、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
十九、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
二十、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
二十一、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
二十二、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
二十三、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
二十四、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
二十五、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
二十六、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
二十七、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
二十八、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
二十九、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
三十、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
三十一、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
三十二、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
三十三、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
三十四、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
三十五、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
三十六、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
三十七、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
三十八、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
三十九、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
四十、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
四十一、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
四十二、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
四十三、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
四十四、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
四十五、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
四十六、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
四十七、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
四十八、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
四十九、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
五十、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
五十一、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
五十二、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
五十三、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
五十四、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
五十五、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
五十六、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
五十七、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
五十八、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
五十九、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
六十、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
六十一、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
六十二、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
六十三、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
六十四、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
六十五、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
六十六、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
六十七、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
六十八、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
六十九、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
七十、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
七十一、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
七十二、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
七十三、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
七十四、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
七十五、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
七十六、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
七十七、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
七十八、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
七十九、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
八十、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
八十一、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
八十二、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
八十三、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
八十四、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
八十五、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
八十六、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
八十七、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
八十八、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
八十九、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
九十、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
九十一、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
九十二、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
九十三、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
九十四、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
九十五、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
九十六、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
九十七、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
九十八、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
九十九、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89
一百、本期所有者权益（基金净值）	2,890,946,903.03	56,299,407.89

本报告期为财务报表的组成部分。

报表经 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人 王亚平 主管会计工作负责人 李杰 会计机构负责人 陈广益

6.1 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》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，首次设立募集规模为1,929,789,525.05份基金份额。经中国证监会证监基金字[2006]13号《关于天同基金管理有限公司变更名称及修改基金合同事项的批复》，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（以下简称“中国证券登记结算公司”）。

6.2 基金的投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征

6.2.1 基金的投资目标

本基金为被动式指数基金，主要投资于上证180指数的成份股票，跟踪上证180指数的表现，追求基金净值增长率与业绩比较基准之间的差距最小化。

6.2.2 基金的投资策略

本基金采用被动式指数投资策略，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金主要投资于标的指数的成份股票，并根据标的指数的构成进行动态调整。

6.2.3 基金的风险收益特征

本基金为被动式指数基金，其风险收益特征与标的指数所代表的股票市场的风险收益特征相似。

6.2.4 基金的投资组合报告

6.2.4.1 基金资产组合情况

截至报告期末，本基金资产组合情况如下：

6.2.4.2 基金资产组合情况

截至报告期末，本基金资产组合情况如下：

6.2.4.3 基金资产组合情况

截至报告期末，本基金资产组合情况如下：

6.2.4.4 基金资产组合情况

截至报告期末，本基金资产组合情况如下：

6.2.4.5 基金资产组合情况

截至报告期末，本基金资产组合情况如下：

6.2.4.6 基金资产组合情况

截至报告期末，本基金资产组合情况如下：

6.2.4.7 基金资产组合情况

截至报告期末，本基金资产组合情况如下：

6.2.4.8 基金资产组合情况

截至报告期末，本基金资产组合情况如下：

6.2.4.9 基金资产组合情况

截至报告期末，本基金资产组合情况如下：

6.2.4.10 基金资产组合情况

截至报告期末，本基金资产组合情况如下：

6.2.4.11 基金资产组合情况

截至报告期末，本基金资产组合情况如下：

6.2.4.12 基金资产组合情况

截至报告期末，本基金资产组合情况如下：

6.2.4.13 基金资产组合情况

截至报告期末，本基金资产组合情况如下：

6.2.4.14 基金资产组合情况

截至报告期末，本基金资产组合情况如下：

6.2.4.15 基金资产组合情况

截至报告期末，本基金资产组合情况如下：

6.2.4.16 基金资产组合情况

截至报告期末，本基金资产组合情况如下：

6.2.4.17 基金资产组合情况

截至报告期末，本基金资产组合情况如下：

6.2.4.18 基金资产组合情况

截至报告期末，本基金资产组合情况如下：

6.2.4.19 基金资产组合情况