万家180指数证券投资基金更新招募说明书摘要

（2012年第1号）

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

本基金根据2002年11月27日中国证券监督管理委员会《关于同意天同180指数证券投资基金设立的批复》（证监基金字［2002］88号）的核准，进行募集。本基金的基金合同于2003年3月17日正式生效。

【重要提示】

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本基金招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅本基金的基金合同。

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2012年3月17日，有关财务数据和净值表现截止日为2011年12月31日。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况
名称：万家基金管理有限公司
住所：上海市浦东新区浦电路360号陆家嘴投资大厦9楼
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
法定代表人：毕玉国
总经理：杨峰
成立日期：2002年8月23日
批准设立机关：中国证券监督管理委员会
批准设立文号：中国证监会证监基金字［2002］44号
组织形式：有限责任公司
注册资本：1亿元人民币
存续期间：持续经营
经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。
联系人：兰剑
电话：021-38619810
传真：021-38619888
电子邮箱：lanj@wjasset.com
（二）主要人员情况
1、基金管理人董事会成员
董事长毕玉国先生，中共党员，研究生，高级会计师，曾任莱钢集团莱钢股份公司炼铁厂财务科科长，莱钢集团莱钢股份公司财务处成本科科长，莱钢集团财务部副部长，莱钢驻日照钢铁有限公司财务总监，齐鲁证券经纪有限公司计划财务部总经理。现任齐鲁证券有限公司副总经理兼财务负责人，2011年3月起任本公司董事长。
董事罗国举先生，大学本科学历，硕士学位。曾任湘财证券有限责任公司营业部负责人、经纪总部总经理、公司副总裁、总裁。现任齐鲁证券有限公司副总经理。
董事陈晓龙先生，中共党员，研究生，硕士学位，经济师。曾任上海久事公司资产管理二部总经理助理、上海浦江镇投资发展有限公司副总经理等职，现任上海久事公司资产经营部经理。
董事涂冬仁先生，中共党员，大学专科，高级经济师，曾任农行江西省信托投资股份有限公司经理、江南证券有限责任公司经理、江南信托投资股份有限公司经理、总裁助理，现任江西江南投资有限责任公司副总经理。
独立董事刘兴云先生，中共党员，管理学博士，教授，曾任山东财政学院会计系副主任、党总支书记、教务长、副院长，中央人民政府驻香港特别行政区联络办公室行政财务部副部长、巡视员兼副部长，现任山东财经大学校长兼党委副书记并从事企业财务管理方向的理论研究。
独立董事蔡荣生先生，中共党员，经济学博士，教授，曾任职于长春一汽集团、中共中央台湾工作办公室、国务院台湾事务办公室，现任中国人民大学招生就业处处长、商学院教授。
独立董事邓辉先生，中国民主促进会会员，法学博士，教授，曾任江西财经大学法学院副院长，现任江西财经大学法学院院长，江西省立法研究会副会长、中国法学会证券法学研究会常务理事、中国法学会商法学研究会理事。
2、基金管理人监事会成员
监事会主席吕祥友先生，中共党员，大学本科学历，硕士学位，高级经济师。先后就职于莱芜钢铁集团有限公司、鲁银投资集团股份有限公司。现任齐鲁证券有限公司董事会秘书、党委组织部部长、人力资源部总经理、鲁证期货有限公司董事。
监事崔朋朋先生，中共预备党员，工商管理硕士，经济师，先后任职于山东智星计算机总公司、中创软件、山东山大华特科技股份有限公司、将军控股有限公司。现任山东省国有资产投资控股有限公司项目经理、副部长。
监事兰剑先生，法学硕士，律师、注册会计师，曾在江苏淮安知源律师事务所、上海和华利盛律师事务所从事律师工作，现为本公司信息披露负责人、合规稽核部总监。
3、基金管理人高级管理人员
董事长：毕玉国先生 简介请参见基金管理人董事会成员）
总经理：杨峰先生，中共党员，理学博士。历任山东大学助教、讲师、副教授等职，2000年7月至2002年北京大学博士后流动站、深圳证券交易所博士后工作站博士后，2002年3月至2004年3月在泰达荷银基金管理有限公司任组织与战略规划部总经理、公司职工监事等职，2004年3月至2005年9月在大成基金管理有限公司任规划发展部副总监（总监级）主持工作，2005年9月起任万家基金管理有限公司总经理助理，2008年4月起任公司副总经理，2011年3月起任本公司总经理。
副总经理：吕宜振先生，中共党员，博士研究生。曾任易方达基金管理有限公司研究主管，信诚基金管理有限公司研究总监，天弘基金管理有限公司投资总监，2011年8月起任本公司副总经理。
督察长：李振伟先生，中共党员，大学本科，学士学位，高级经济师。1998年6月起从事证券监管工作，先后任证监会济南证管办党委办公室、上市处主任科员，证监会济南证管办上市处、机构处副处长，证监会山东证监局机构处副处长、处长，本公司总经理、监事会主席等职。2012年4月起任本公司督察长。
4、本基金基金经理
现任基金经理：
吴涛，男，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年起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。2010年3月起任本基金基金经理。
历任基金经理：
杨宇，本基金成立日起至2004年7月；
朱良，2004年7月至2005年5月；
肖侃宁，2005年5月至2006年2月；
潘江，2006年2月至2007年5月
欧庆铃，2007年5月至2011年8月
5、投资决策委员会成员
委员会主任：吕宜振
委员：伏爱国、邹昱、吴涛、陈靖、华光磊
吕宜振先生，万家基金管理有限公司副总经理、万家和谐基金基金经理
伏爱国先生，万家基金管理有限公司总经理助理、投资管理部总监、专户投资部总监、权益投资部总监
邹昱先生，固定收益部总监、万家稳健增利基金基金经理、万家添利分级基金基金经理
吴涛先生，量化投资部总监兼万家180基金基金经理、万家中证红利基金基金经理
陈靖先生，交易部总监
华光磊先生，研究部总监
上述人员之间不存在近亲属关系

二、基金托管人

（一）基本情况
名称：中国银行股份有限公司（简称"中国银行"）
住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期：1983年10月31日
变更注册登记日期：2004年8月26日
注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整
法定代表人：肖 钢
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字［1998］24 号
托管及投资者服务部总经理：李爱华
托管部门信息披露联系人：唐州徽
电话：010）66594855
传真：010）66594942
发展概况：
1912 年2 月，经孙中山先生批准，中国银行正式成立。从1912 年至1949 年，中国银行先后履行中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行职能，坚持以服务社会民众、振兴民族金融为己任，稳健经营，锐意进取，各项业务取得了长足发展。新中国成立后，中国银行长期作为国家外汇专业银行，成为我国对外开放的重要窗口和对外筹资的主要渠道。1994 年，中国银行改为国有独资商业银行。2003 年，中国银行启动股份制改造。2004 年8 月，中国银行股份有限公司挂牌成立。2006 年6 月、7 月，先后在香港联交所和上海证券交易所成功挂牌上市，成为国内首家在境内外资本市场上发行上市的商业银行。
中国银行是中国国际化和多元化程度最高的银行，在中国内地、香港澳门台湾及31个国家和地区为客户提供全面的金融服务，主要经营商业银行业务，包括公司金融业务、个人金融业务和金融市场业务，并通过全资子公司中银国际开展投资银行业务，通过全资子公司中银集团保险及中银保险经营保险业务，通过全资子公司中银集团投资从事直接投资和投资管理业务，通过控股中银基金管理有限公司从事基金管理业务，通过中银航空租赁私人有限公司经营飞机租赁业务。
在近百年的发展历程中，中国银行始终秉承追求卓越的精神、稳健经营的理念、客户至上的宗旨、诚信为本的传统和严谨细致的作风，得到了业界和客户的广泛认可和赞誉，树立了卓越的品牌形象。2010年度，中国银行被Global Finance（《环球金融》）评为2010年度中国最佳公司贷款银行和最佳外汇交易银行，被Euromoney（《欧洲货币》）评为2010 年度房地产业"中国最佳商业银行"，被英国《金融时报》评为最佳私人银行奖，被The Asset（《财资》）评为中国最佳贸易融资银行，被Finance Asia（《金融亚洲》）评为中国最佳私人银行、中国最佳贸易融资银行，被《21世纪经济报道》评为亚洲最佳全球化服务银行、最佳企业公民、年度中资优秀私人银行品牌。面对新的历史机遇，中国银行将积极推进创新发展、转型发展、跨境发展，向着国际一流银行的战略目标不断迈进。
（二）基金托管部门及主要人员情况
中国银行于1998年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念，中国银行于2005年3月23日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，下设覆盖集合类产品、机构类产品、全球托管产品、投资分析及监督服务、风险管理与内控、核算估值、信息技术、资金和证券交收等各层面的多个团队，现有员工120余人。另外，中国银行在重点分行已开展托管业务。
目前，中国银行拥有证券投资基金、一对多专户、一对一专户、社保基金、保险资产、QFII资产、QDII资产、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、信托资产、年金资产、理财产品、海外人民币基金、私募基金等门类齐全的托管产品体系。在国内，中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管服务。2010年末中国银行在中国内地托管的资产突破万亿元，居同业前列。
（三）证券投资基金托管情况
截至2011年12月末，中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合（LOF）、大成2020生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深300指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选武号混合、海富通收益增长混合、海富通中证100指数（LOF）、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深300指数（LOF）、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证100ETF联接、万家180指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票（LOF）、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票（LOF）、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诸德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证180金融交易型开放式指数、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接、诺德优选30股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证200指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息传媒产业（TMT）50交易型开放式指数、招商深证TMT50交易型开放式指数证券投资基金联接、嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接、深证基本面120交易型开放式指数、上证180成长交易型开放式指数、华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接、易方达资源行业股票型、华安深证300指数、嘉实信用债券型、平安大华行业先锋股票型、华泰柏瑞信用增利债券型、泰信中小盘精选股票型、海富通国策导向股票型、中邮上证380指数增强型、泰达宏利中证500指数分级、长盛同禧信用增利债券型、银华中证内地资源主题指数分级、平安大华深证300指数增强型、嘉实安心货币市场、嘉实海外中国股票（QDII）、银华全球优选（QDII-FOF）、长盛环球景气行业大盘精选股票型（QDII）、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型（QDII）、信诚金砖四国积极配置（QDII）、海富通大中华精选股票型（QDII）、招商标普金砖四国指数（LOF-QDII）、华宝兴业成熟市场动量优选（QDII）、大成标普500等权重指数（QDII）、长信标普100等权重指数（QDII）、博时抗通胀增强回报（QDII）、华安大中华升级股票型（QDII）、信诚全球商品主题（QDII）、工银瑞信中国机会全球配置股票型（QDII）等137只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

三、相关服务机构

（一）销售机构
1、直销机构：万家基金管理有限公司
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
电话：021-38619999
客户服务电话：95538转6；400-888-0800；021-68644599
传真：021-38619968
联系人：姚燕
网址：www.wjasset.com
2、代销机构：
（1）中国银行股份有限公司
客户服务统一咨询电话：95566
传真：010）66594946
网址：www.boc.cn
（2）中国工商银行股份有限公司
电话：010）66107900
传真：010）66107914
客户服务电话：95588
网址：www.icbc.com.cn
（3）中国建设银行股份有限公司
客服电话：95533（或拨打各城市营业网点咨询电话）
公司网站：www.ccb.com
（4）中国农业银行股份有限公司
客户服务电话：95599
中国农业银行网站：www.abchina.com、www.95599.cn
（5）中国邮政储蓄银行有限责任公司
客服电话：11185（或拨打各城市营业网点咨询电话）
公司网站：www.cpsrb.com
（6）交通银行股份有限公司
电话：021-6888891，95559
网址：www.bankcomm.com
（7）招商银行股份有限公司
公司客服电话：95555（或拨打各城市营业网点咨询电话）
公司网站：www.cmbchina.com
（8）中信银行股份有限公司
电话：010-65541405
传真：010-65541281
（9）深圳发展银行股份有限公司
联系电话：0755）82088888
传真号码：0755-82080714
客服电话：0755-82080409
公司网址：http://www.sdb.com.cn
（10）兴业银行股份有限公司
联系电话：021）52629999
客户服务电话：95561
公司网址：www.cib.com.cn
（11）华夏银行股份有限公司
客服电话：95577（或拨打各城市营业网点咨询电话）
公司网站：www.hxb.com.cn
公司地址：北京市东城区建国门内大街22号
（12）民生银行股份有限公司
客户服务电话：95568
网址：www.cmbc.com.cn
（13）光大银行股份有限公司
客户服务电话：95595
网址：www.cebbank.com
（14）齐鲁证券有限公司
联系电话：0531-82024184、0531-82024147
传真电话：0531-82024197
网址：www.qlzq.com.cn
（15）中信建投证券有限责任公司
注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼
电话：010-65183888-86080
传真：010-65182261
（16）国泰君安证券股份有限公司
电话：021-62580818-213
传真：021-62569400
（17）中国银河证券股份有限公司
电话：010-66568888 66568587
传真：010-66568536
（18）海通证券股份有限公司
电话：021-53594566
传真：021-53858500
（19）国信证券有限责任公司
电话：0755-82130833-2181
传真：0755-82133302
（20）招商证券股份有限公司
电话：0755-82943511
传真：0755-82943237
（21）兴业证券股份有限公司
电话：021-68419974
传真：021-68419867
（22）湘财证券有限责任公司
电话：021-68634518-8631
传真：021-68865938
（23）东方证券股份有限公司
电话：021-50367888
传真：021-50366868
客户服务热线：021-962506
（24）广发证券股份有限公司
电话：020-87555888-875
传真：020-87557985
客户服务热线：020-87555888或拨打各城市营业网点咨询电话
公司网址：www.gf.com.cn
（25）民生证券有限责任公司
联系电话：010-85252605
传真电话：010-85252655
客服电话：0371-67639999
公司网址：www.mszq.com
（26）华泰证券股份有限公司
客户服务电话：95597
网址：www.htsc.com.cn
（27）上海证券有限责任公司
客户服务电话：021）962518
网址：www.962518.com.cn
（28）财富证券有限责任公司
客服电话：0731-4403319
网址：www.cfzq.com
（29）江海证券经纪有限责任公司
客服电话：400-666-2288
网址：www.jhzq.com.cn
（30）山西证券股份有限公司
客服热线：400-666-1618
网址：http://www.i618.com.cn/
（31）上海浦东发展银行股份有限公司
咨询电话：95528
公司网址：www.spdb.com.cn
（32）信达证券股份有限公司
客服热线：400-800-8899
网址：www.cindasc.com
（33）广发华福证券有限责任公司
客服电话：96326（福建省外请先拨0591）
网址：www.gfhfzq.com.cn
（34）中航证券有限公司
客服电话：400-8866-567
公司网址：http://www.avicsec.com
（35）天相投资顾问有限公司
客服电话：010-66045678
公司网址：www.txsec.com
（36）中信证券股份有限公司
统一客服电话：95558
公司网站地址：http://www.cities.com
（37）爱建证券有限责任公司
客服电话：021-63340678
网址：www.ajzq.com
（38）五矿证券有限责任公司
客服电话：40018-40028
网址：www.wkzq.com.cn
（39）华龙证券有限责任公司
客服电话：4006898888
网址：www.hlzqgs.com
（40）宏源证券股份有限公司
客服电话：4008-000-562
网址：www.hysec.com
（41）中国国际金融有限公司
电话：010-65051166
网址：www.cicc.com.cn
（42）光大证券股份有限公司
客服电话：4008888788
网址：www.ebscn.com
（43）中信万通证券有限责任公司
客服电话：96577
网址：www.zxwt.com.cn
（44）中银万国证券股份有限公司
客服电话：021-95523、4008-895523
网址：www.sywg.com
（45）东吴证券股份有限公司
客户服务电话：0512-96288
网址：www.dwjq.com.cn
（46）中信证券（浙江）有限责任公司（原中信金通证券）
客服电话：0571-96598
网址：www.bigsun.com.cn
基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。
（二）基金注册与登记过户机构
名称：中国证券登记结算有限责任公司
注册地址：北京西城区金融大街27号投资广场23层
电话：0755-82084015
传真：0755-82084010
（三）会计师事务所
名称：安永华明会计师事务所
住所：北京市东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层（邮编：100738）
办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心50楼（邮编：200120）
联系电话：（021）22288888
传真：（021）22280000
联系人：徐艳
经办注册会计师：徐艳，汤骏
（四）律师事务所
名称：上海华涛律师事务所
地址：上海浦东向城路58号东方国际科技大厦5G
电话：（021）61682193
联系人：华涛

四、基金的名称

万家180指数证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式。

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资方向

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主要投资于国债、优质企业债、金融债以及债券回购。

八、基金的投资策略和投资组合

（一）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。
（二）基金的指数投资组合
指数投资组合包括上证180成份股票、预期选入上证180指数的股票、一级市场申购的新股以及现金。
1、指数投资组合的构建
本基金将采用指数复制法构造投资组合，当成份股发生新增、剔除或因公司行为导致指数权重发生变化时，指数投资组合将做出相应调整。
2、指数投资组合的跟踪误差的控制
本基金选择了两个评价跟踪误差的量化指标：一是拟合偏离度，这是一个日平均跟踪误差指标；另一个是指数投资相对收益率，这是相对累计收益率指标。
拟合偏离度的控制目标定为0.5%，指数投资相对收益率（年累计偏差）的控制目标定为2%。如果拟合偏离度或指数投资相对收益率超过了其控制目标，风险控制小组应将分析报告和调整方案上报给投资决策委员会审议，经审议批准后的组合调整方案交基金经理执行。

九、基金的业绩比较基准

本基金成立之日起至2005年12月31日的业绩比较基准为：75%×上证180指数+25%中信国债指数
自2006年元月1日起，业绩比较基准变更为：95%×上证180指数+5%×银行同业存款利率

十、基金的风险收益特征

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

十一、投资组合报告

万家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。
本基金的托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2011年10月10日复核了本投资组合报告的内容。
本投资组合报告所载数据截至2011年12月31日，本报告中所列财务数据已经审计。
1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,813,769,053.25	94.67
	其中：股票	4,813,769,053.25	94.67
2	固定收益投资	201,361,042.00	3.96
	其中：债券	201,361,042.00	3.96
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	8,000,000.00	0.16
	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	53,961,818.22	1.06
6	其他资产	7,810,315.23	0.15
7	合计	5,084,902,228.70	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	29,183,595.42	0.57
B	采掘业	620,476,984.08	12.22
C	制造业	1,188,781,040.34	23.41
C0	食品、饮料	233,883,837.89	4.61
C1	纺织、服装、皮毛	31,565,081.55	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	42,171,303.43	0.83
C5	电子	23,606,007.28	0.46
C6	金属、非金属	305,133,809.42	6.01
C7	机械、设备、仪表	399,497,705.30	7.87
C8	医药、生物制品	145,033,090.57	2.86
C99	其他制造业	7,890,204.90	0.16
D	电力、煤气及水的生产和供应业	141,769,116.92	2.79
E	建筑业	152,789,254.33	3.01
F	交通运输、仓储业	191,455,012.96	3.77
G	信息技术业	168,877,629.04	3.33
H	批发和零售贸易	56,535,901.32	1.11
I	金融、保险业	1,933,650,871.22	38.08
J	房地产业	219,401,832.73	4.32
K	社会服务业	30,582,816.59	0.60
L	传播与文化产业	0.00	0.00
M	综合类	80,264,998.30	1.58
	合计	4,813,769,053.25	94.80

3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	19,388,013	230,135,714.31	4.53
2	600016	民生银行	35,457,549	208,844,963.61	4.11
3	601318	中国平安	5,262,774	181,249,936.56	3.57
4	601328	交通银行	35,948,608	161,049,763.84	3.17
5	600000	浦发银行	17,557,493	149,063,115.57	2.94
6	601166	兴业银行	11,855,495	148,430,797.40	2.92
7	601088	中国神华	5,173,975	131,056,786.75	2.58
8	600519	贵州茅台	657,024	127,002,739.20	2.50
9	600030	中信证券	10,827,485	105,134,879.35	2.07
10	600837	海通证券	12,899,039	95,581,878.99	1.88

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	102,181,042.00	2.01
2	央行票据	99,180,000.00	1.95
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	201,361,042.00	3.97

5. 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010203	02国债(3)	1,020,280	102,181,042.00	2.01
2	1101087	11央行票据87	1,000,000	99,180,000.00	1.95

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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. 报告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。
8. 投资组合报告附注
8.1 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。
8.2 基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	71,849.12
2	应收证券清算款	5,188,916.65
3	应收股利	0.00
4	应收利息	2,282,268.22
5	应收申购款	267,281.24
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
8	其他	0.00
9	合计	7,810,315.23

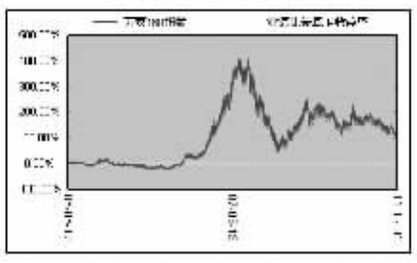
8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2011年12月31日。
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。
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
万家180指数基金历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较列表（截至2011年12月31日）

阶段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)	业绩比较基准收益率(3)	业绩比较基准标准差(4)	(1)-(3)	(2)-(4)
2011年	-22.26%	1.23%	-22.02%	1.23%	-0.24%	0.00%
2010年	-15.65%	1.47%	-15.15%	1.48%	-0.50%	-0.01%
2009年	83.81%	1.91%	86.16%	1.96%	-2.35%	-0.05%
2008年	-63.32%	2.87%	-64.23%	2.91%	0.91%	-0.04%
2007年	142.57%	2.06%	141.09%	2.16%	1.48%	-0.10%
2006年	124.90%	1.30%	112.41%	1.32%	12.49%	-0.02%
2005年	-4.96%	1.00%	-2.75%	0.98%	-2.21%	0.02%
2004年	-9.25%	0.99%	-13.23%	1.00%	3.98%	-0.01%
2003年3月17日至12月31日	0.46%	0.71%	3.15%	0.81%	-2.69%	-0.10%
成立至今	108.93%	1.67%	96.37%	1.70%	12.56%	-0.03%

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
2、万家180指数基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
（2003年3月17日至2011年12月31日）



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。

十三、基金费用概览

（一）与基金运作有关的费用种类
1、基金管理人的管理费；
2、基金托管人的托管费；
3、基金信息披露费用；
4、基金份额持有人大会费用；
5、与基金相关的会计师费和律师费；
6、证券交易费和税收；
7、基金分红手续费；
8、注册登记费；
9、按照国家有关规定可以列入的其他费用。
（二）基金运作费用计提方法、计提标准和支付方式
1、基金管理人的管理费
基金管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计算，主要用于支付管理人管理本基金的运作成本和向其他服务提供人支付的费用。计算方法如下：
H=E×1.0%÷当年天数；
H为每日应支付的基金管理费；
E为前一日基金资产净值
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人；若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。
2、基金托管人的托管费
基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计算。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。
3、上述（一）中3至9项费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。
（三）与基金销售有关的费用
1、本基金申购费率

申购金额M	申购费率
M<50万	1.5%
50万≤M<200万	1.2%
200万≤M<500万	1.0%
M≥500万	按笔收取，1000元/笔

2、本基金的赎回费率按实际持有期递减。具体为：

持有期限	赎回费率
D<1年	0.5%
1年≤D<3	0.25%
D≥3年	0%

3、基金管理人可以在《基金合同》规定的范围内调整申购费率和赎回费率，调整后的申购费率和赎回费率在最新的公开说明书中列示。上述费率如发生变更，基金管理人还应最迟于新的费率实施前三个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。
（四）不列入基金费用的项目
基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。
（五）基金管理费和基金托管费的调整
基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费和基金托管费，经中国证监会核准后公告，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，对基金管理人于2011年10月31日刊登的本基金2011年第2号更新招募说明书进行了更新，并根据本基金管理人在本基金成立后对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要更新内容如下：
1.在重要提示部分，明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。
2、在"三、基金管理人"部分，更新了基金管理人的有关内容。
3.在"四、基金托管人"部分，更新了有关基金托管人的有关内容。
4.在"五、相关服务机构"部分，增加了部分代销机构。
5. 在"七、基金份额的申购与赎回"部分，更新了开通定期定投的相关机构。
6.在"八、基金的投资"部分补充了本基金最近一期（2011年第四季度）投资组合报告内容。
7.在"九、基金的业绩"部分更新了基金成立以来的投资业绩。
8.在"二十一、其他应披露事项"部分更新了本基金最近一次招募说明书更新以来的公告事项。

万家基金管理有限公司
2012年4月28日

证券代码：600467 证券简称：好当家 公告编号：临2012-019

山东好当家海洋发展股份有限公司第七届董事会第十七次会议决议公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

山东好当家海洋发展股份有限公司董事会于2012年4月26日在山东好当家海洋发展股份有限公司会议室召开了公司第七届董事会第十七次会议。董事唐传勤、张术森、李俊峰、宋荣超、宋俊芳、李波、孙慧玲、程仲言、余明阳参加了此次会议，应到董事9人，实到董事9人。公司监事列席了会议，会议由公司董事长唐传勤主持，会议符合《公司法》和《公司章程》等关于召开董事会的规定。

与会董事经过充分研究和讨论，形成如下决议：

审议通过了关于对外投资收购股权的议案

详细内容见《山东好当家海洋发展股份有限公司关于对外投资收购股权的公告》（公告编号：2012-020）。

与会董事9人，9票同意、0票反对、0票弃权。

特此公告。

山东好当家海洋发展股份有限公司
董 事 会
2012年4月28日

证券代码：600467 证券简称：好当家 公告编号：临2012-020

山东好当家海洋发展股份有限公司关于对外投资收购股权的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大