

万家180指数证券投资基金

2012年第二季度报告

基金管理人:万家基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2012年7月19日

重要提示

基金管理人的董事、监事、经理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。

基金托管人和基金管理人根据有关法规规定，于2012年7月16日对复核了本报告中的财务指标、净值表现和资产组合报告等信息，保证本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

本报告期财务资料未经审计。

本报告期自2012年4月1日起至6月30日止。

5.2 基金产品概况

基金简称	万家180指数						
基金代码	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						
报告期末基金份额总额	10,302,004,898.39份						
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指数的收益率，实现利用指数化投资方法谋求基金长期增值的目标。							
本基金以跟踪目标指数为原则，实现与市场同步增长为基本理念。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的投資策略，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%×银行同期同业存款利率							
风险收益特征 本基金追踪上证180指数，是一种风险适中、中长期资本收益稳健的投资产品，属于风险适中的投资风格。							
基金管理人 万家基金管理有限公司							
基金托管人 中国工商银行股份有限公司							
5.3 主要财务指标和基金净值表现							
3.1 主要财务指标							
单位:人民币元							
主要财务指标	报告期(2012年4月1日至2012年6月30日)						
1.本期已实现收益	-81,308,263.93						
2.本期利润	83,251,665.97						
3.加权平均基金份额本期利润	0.0079						
4.期末基金份额净值	5,711,030.7791						
5.期末基金份额净值	0.5544						
注:1.上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数据。 2.上表中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。							
3.2 基金净值表现							
3.2.1 报告期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	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	准收益率差④	①-③	②-④	
过去三个月	1.54%	0.34%	1.04%	1.20%	-0.01%		
3.2.2 基金合同生效以来基金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							
序号	债券代码	债券名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)		
1	601138	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	0.1012		
3	600036	招商银行	19,494,007	212,874,556.44	3.73		
4	601328	交通银行	35,973,760	163,380,704.40	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	13,053,592	125,513,490.96	2.20		
10	601088	中国神华	5,309,348	119,354,143.04	2.09		
5.3 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	601138	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	0.1012		
3	600036	招商银行	19,494,007	212,874,556.44	3.73		
4	601328	交通银行	35,973,760	163,380,704.40	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	13,053,592	125,513,490.96	2.20		
10	601088	中国神华	5,309,348	119,354,143.04	2.09		
5.4 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	国债	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				
4	企业债券	100,450,000.00	1.76				
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	259,662,166.99	4.55				
5.5 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	120305	12债券05	1,000,000	100,450,000.00	1.76		
2	200205	12贴息02	1,000,000	97,937,505.49	1.71		
3	111018	11央行票据88	300,000	48,455,000.00	0.85		
4	019202	12国债02	100,110	10,111,110.00	0.18		
5	113002	11银行转债	24,850	2,708,401.50	0.05		
5.6 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货币市场基金投资明细							
序号	基金名称	基金代码	基金名称	基金代码	份额(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	本基金	519180	万家180指数	519180	1,000,000	100,450,000.00	1.76
2	易方达货币	000016	货币A	000016	1,000,000	97,937,505.49	1.71
3	汇添富货币	519210	货币A	519210	1,000,000	48,455,000.00	0.85
4	工银瑞信货币	100003	货币A	100003	1,000,000	10,111,110.00	0.18
5	华夏现金	000001	货币A	000001	1,000,000	2,708,401.50	0.05
6	嘉实货币	000003	货币A	000003	1,000,000	2,708,401.50	0.05
7	南方现金	000007	货币A	000007	1,000,000	2,708,401.50	0.05
8	鹏华现金	000008	货币A	000008	1,000,000	2,708,401.50	0.05
9	华安现金	000009	货币A	000009	1,000,000	2,708,401.50	0.05
10	广发现金	000010	货币A	000010	1,000,000	2,708,401.50	0.05
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细							
序号	权证代码	权证名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)		
1	000001	中行权证	1,000,000	100,450,000.00	1.76		
2	000002	中行权证	1,000,000	97,937,505.49	1.71		
3	000003	中行权证	1,000,000	48,455,000.00	0.85		
4	000004	中行权证	1,000,000	10,111,110.00	0.18		
5	000005	中行权证	1,000,000	2,708,401.50	0.05		
6	000006	中行权证	1,000,000	2,708,401.50	0.05		
7	000007	中行权证	1,000,000	2,708,401.50	0.05		
8	000008	中行权证	1,000,000	2,708,401.50	0.05		
9	000009	中行权证	1,000,000	2,708,401.50	0.05		
10	000010	中行权证	1,000,000	2,708,401.50	0.05		
5.8 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股票投资明细							
序号	股票代码	股票名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)		
1	601138	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	0.1012		
3	600036	招商银行	19,494,007	212,874,556.44	3.73		
4	601328	交通银行	35,973,760	163,380,704.40	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	13,053,592	125,513,490.96	2.20		
10	601088	中国神华	5,309,348	119,354,143.04	2.09		
5.9 报告期末按行业分类的股票投资组合							
序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)				
1	农、林、牧、渔业	27,812,197.13	0.49				
2	采掘业	622,713,605.45	10.90				
3	制造业	1,336,645,586.17	23.40				
4	食品、饮料	269,922,902.45	4.73				
5	纺织、服装、皮毛	21,751,590.26	0.38				
6	木材、家具	0.00	0.00				
7	造纸、印刷	0.00	0.00				
8	石油、化学、塑胶、塑料	63,526,474.02	1.11				
9	电子	58,346,547.33	1.02				
10	金属、非金属	328,614,724.82	5.75				
11	机械、设备、仪表	436,290,296.64	7.64				
12	医药	193,093,060.65	2.77				
13							