

万家180指数证券投资基金更新招募说明书摘要

(2013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]388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。基金管理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2013年3月17日,有关财务数据和净值表现截止日为2012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: 华玉国
总经理: 吕宜振
成立日期: 2002年8月23日
批准设立机关: 中国证监会
批准设立文号: 中国证监会证监基金字[2002]344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
董事长华玉国先生,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,兼任万家共赢资产管理有限公司董事长,2011年3月起任本公司董事长。

董事马永春先生,政治经济学硕士学位,曾任新疆自治区党委政策研究室科长,新疆通宝投资有限公司总经理,新疆对外经贸集团总经理,新疆天山股份有限公司董事,现任新疆国际实业股份有限公司副董事长兼总经理。
董事吕祥友先生,中共党员,大学本科,硕士学位,高级经济师,曾任莱芜钢铁集团有限公司财务处科长、鲁银投资集团有限公司董事,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。

董事吕宜振先生,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5月起加入本公司,历任公司副总经理,现任公司总经理。

独立董事刘云先生,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、副校长、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。

独立董事陈敬敏先生,中国民主建国会成员,博士研究生,教授,曾任山东烟台十一中教师,山东大学数学讲师兼副教授,法国国家信息与自动化研究所博士后,加拿大西安大略大学保险系访问学者、兼职教授,山东大学金融研究院常务副院长兼教授,山东大学数学学院院长(兼)、教授,现任山东大学金融研究院院长(兼数学学院院长)、教授。

独立董事王鼎先生,中共党员,研究生,经济学博士,副教授,曾任上海财经大学金融学院银行系讲师,上海财经大学证券期货学院院长助理,美国国际管理研究生院(密西)访问研究员,上海财经大学证券期货学院院长兼副教授,新疆财经学院金融系主教授,上海财经大学金融学院副院长兼常务副院长,上海财经大学金融学院副教授,现任上海财经大学商学院副院长。

2、基金管理人监事会成员
监事会主席李渭起先生,硕士学位,经济师。1996年1月起,任宏源证券股份有限公司文艺路营业部客户主管、公司投行部经理,2012年3月起任新疆国际实业股份有限公司证券事务代表、董事会秘书,现任新疆国际实业股份有限公司董事会秘书兼副总经理。

监事崔刚明先生,中共党员,工商管理硕士,经济师,先后任职于山东智胜计算机总公司、中创软件、山东山大华特科技股份有限公司、将智控股有限公司。现任山东省国有资产控股有限公司项目经理、副部长。

监事李剑先生,法学硕士,律师、注册会计师,曾在江苏淮安知源律师事务所、上海和利华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。

监事李丽女士,中共党员,大学讲师,先后任职于中国工商银行济南分行、济南卓越外语学校、山东中医药大学。2008年3月起任万家基金管理有限公司,现任公司综合管理部副总监。

监事蔡鹏鹏女士,本科,先后任职于北京幸福之光商贸有限公司监事主管、北方之星数码技术(北京)有限公司高级客户经理、路通资讯香港有限公司北京代表处高级业务经理,2007年4月起任职于万家基金管理有限公司渠道客服部渠道经理、机构管理部总监助理。现任公司机构管理部副总监。

3、基金管理人高级管理人员
董事长: 华玉国先生(简介参见基金管理人董事会成员)
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,本公司副总经理等职。2012年12月起任本公司总经理。

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。现任量化投资部总监、兼任万家中证红利指数基金(LOF)基金经理、万家中证创业成长指数分级基金基金经理。
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;
肖仇宁,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: 刘芳洁、吴涛、陈靖、华光磊、朱虹
吕宜振先生,万家基金管理有限公司总经理
刘芳洁先生,万家基金管理有限公司总经理助理、权益投资总监、权益投资部总监(兼)
吴涛先生,量化投资部总监、万家180基金基金经理、万家中证红利基金基金经理、万家中证创业成长基金基金经理
陈靖先生,交易部副总监
华光磊先生,研究部总监、万家和谐基金基金经理

朱虹女士,固定收益部总监,万家信用恒利债券基金基金经理、万家添利分级债券型证券投资基金基金经理、万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理
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
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
电话: 010-66594942

(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,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、基金(一对多、一对一)、社保基金、保险基金、QFII、QDII、券商资产管理计划、信托计划、年金基金、理财产品、私募基金、资金托管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,托管资产规模居同业前列。

(三)证券投资基金托管情况

截至2012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LOF、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、海富通精选贰号混合、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、嘉实货币、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票、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、景顺长城鼎颐股票(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、华泰柏瑞量化成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化先行股票型、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、摩根士丹利华鑫收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券混合、易方达丰添利债券型、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证券投资基金联接、上证50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、易方达医疗大健康行业股票型、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、金鹰中证技术领先精选股票型、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、招商深圳电子信息技术产业(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、长盛同信增利债券型、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、上投摩根健康品质生活股票型、工银瑞信睿智中证500指数分级、招商优势企业灵活配置混合型、国泰中小盘300成长交易型开放式指数、国泰中小盘300成长交易型开放式指数证券投资基金联接、景顺长城优质增利债券型、诺德周期策略股票型、长盛电子信息产业股票型、诺安中证创业成长指数分级、信诚双盈分级债券型、嘉实沪深300交易型开放式指数、民生加银信用双利债券型、工银瑞信基本面量化策略股票型、信诚周期轮动股票型、富兰克林国海研究精选股票型、诺安汇鑫保本混合型、平安大华策略先锋混合型、华宝兴业中证短融50指数债券型、180等权重交易型开放式指数、华安双月薪短融债券型、大成景恒保本混合型、景顺长城上证180等权重交易型开放式指数证券投资基金联接、上投摩根分红添利债券型、嘉实优化红利股票型、长盛同鑫二号保本混合型、招商信用增强债券型、华宝兴业资源优选股票型、中证500沪市交易型开放式指数、大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接、博时医疗大健康行业股票型、诺德深证300指数分级、华夏安康信用优选债券型、汇添富多元收益债券型、广发双债添利债券型、长盛添利30天理财债券型、信诚理财7日盈债券型、长盛添利60天理财债券型发起式、平安大华添利债券型、大成理财21天债券型发起式、华泰柏瑞稳健收益债券型、信诚添金分级债券型、国泰现金管理货币市场、国投瑞银纯债债券型、银华中证中债50指数债券型、华安信用增强债券型、长盛同丰分级债券型、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)、富国大中中华精选股票型(QDII)、招商标普金砖四国指数(LOF-QDII)、华安兴业成熟市场动量优选(QDII)、大成标普500等权重(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)、上投摩根全球天然资源股票型、工银瑞信中国机会全球精选股票型(QDII)、易方达标普全球高端消费品指数增强型(QDII)、建信全球资源股票型(QDII)、恒生交易型开放式指数(QDII)、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接(QDII)、广发纳斯达克100指数(QDII)等189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: 姚薇
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
公司网站: www.abchina.com.cn
(5)中国邮政储蓄银行股份有限公司
客服电话: 95580

公司网站: www.psbc.com
(6)交通银行股份有限公司
公司网站: www.cmbchina.com
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)平安银行股份有限公司
客服电话: 95511-3
公司网站: www.bank.pingan.com
(10)兴业银行股份有限公司
联系电话: 021-52629999
客户服务电话: 95561
公司网站: 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.gdiz.com.cn
(15)中信建投证券股份有限公司
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: 010-66568886/6568587
传真: 010-66568536
(18)海通证券股份有限公司
电话: 021-53594566
传真: 021-53858500
(19)国信证券股份有限公司
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: 021-50366888
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
公司网站: www.gf.com.cn
(25)民生证券股份有限公司
联系电话: 010-85252605
传真电话: 010-85252655
客服电话: 0371-67639999
公司网站: www.mszy.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
(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
公司网站: 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)广发证券股份有限公司
客服电话: 96326 福建省外请先拨0591)
网址: www.gdiz.com.cn
(34)中航证券有限公司
客服电话: 400-8866-567
公司网站: http://www.avicsec.com
(35)天相投资顾问有限公司
客服电话: 010-66045678
公司网站: 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.citics.com
(37)爱建证券有限责任公司
客服电话: 021-63340678
网址: www.aijz.com.cn
(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: 4008888878
网址: www.ebscn.com
(43)中信万通证券股份有限公司
客服电话: 95577
网址: www.zxwt.com.cn
(44)申银万国证券股份有限公司
客服电话: 021-95523、4008-895523
网址: www.syyw.com
(45)东吴证券股份有限公司
客户服务电话: 0512-96288
公司网站: www.dwjz.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
(47)日信证券有限责任公司
客服电话: 4006609839
网址: http://www.rxzq.com.cn
(48)中银国际证券有限责任公司
客服电话: 4006208888
网址: http://www.bocicchina.com
(49)杭州数米基金销售有限公司
客服电话: 4000-766-123
网址: www.fund123.cn

(50)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
客服电话: 400-821-5399
网址: www.noah-fund.com
(51)上海长量基金销售投资顾问有限公司
客服电话: 400-089-1289
网址: www.erichfund.com
(52)上海好买基金销售有限公司
客服电话: 400-700-9665
网址: www.ehowbuy.com
(53)深圳众禄基金销售有限公司
客服电话: 4006-788-887
网址: www.zlfund.cn及www.jimwm.com
(54)北京展恒基金销售有限公司
客服电话: 400-888-6661
网址: www.myfund.com
(55)上海天天基金销售有限公司
客服电话: 400-1818-188
网址: www.1234567.com
(56)华鑫证券有限责任公司
客服电话: 021-32109999; 029-68918888
网址: www.cfsc.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
联系人: 徐艳
经办注册会计师: 徐艳、杨峻
(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5C
电话: 021-61682193
联系人: 华涛

四、基金的名

五、基金的类型

万家180指数证券投资基金
契约型开放式。
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。

六、基金的投资目标

本基金资产的股票指数化投资方法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、预期将要被调入上证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。

七、基金的投资方向

(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、预期调入上证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、剔除或因行为导致指数权重发生变化时,指数投资组合将相应进行调整。
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:一是拟合偏差,这是一个平均跟踪误差指标;另一个是指数投资相对收益率,这是相对累计收益率指标。

拟合偏差度的控制目标定为0.5%,指数投资相对收益率年累计偏差的控制目标定为2%。如果拟合偏差度或指数投资相对收益率超过了其控制目标,风险控制小组将对分析报告和调整方案上报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%*中国国债指数
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

万家基金管理有限公司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2013年4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2012年12月31日,本报告中列明财务数据已经审计。

序号	项目	金额(元)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	5,296,776,203.23	92.99
2	固定收益投资	5,296,776,203.23	92.99
3	衍生品投资	207,522,774.60	3.64
4	买入返售金融资产	-	-
5	应收利息	90,000,000.00	1.58
6	其他资产	88,863,453.07	1.56
7	其他负债	12,622,623.33	0.22
8	合计	5,495,785,036.13	100.00

序号	项目	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	股票、债券、货币	439,489,821.38	0.56
B	权证	687,676,072.99	0.89
C	固定收益	212,449,946.50	21.67
D	衍生品	287,123,555.40	4.06
E	买入返售	18,455,060.42	0.33
F	应收利息	0.00	0.00
G	其他资产	0.00	0.00
H	其他负债	0.00	0.00
I	公允价值	1,315,515,506.32	3.07
J	公允价值	203,580,588.12	3.64
K	公允价值	151,449,586.84	2.74
L	公允价值	124,355,493.57	2.22
M	公允价值	2,362,709,953.30	42.22
N	公允价值	305,505,131.18	5.46
O	公允价值	29,521,808.70	0.53
P	公允价值	11,203,451.46	0.20
Q	公允价值	16,128,691.32	0.30
R	公允价值	5,296,776,203.23	94.66

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	600016	民生银行	33,411,538	262,614,845.88	4.49
2	600036	招商银行	1,212,449,946.50	21,677,446.50	0.46
3	601318	中国平安	6,969,225	225,056,200.25	4.02
4	601106	华能国际	11,117,075	185,543,901.78	3.32
5	601328	交通银行	14,461,232	117,083,326.08	2.06
6	600000	浦发银行	16,472,969	163,411,852.48	2.92
7	600519	浦发银行	10,114,577	135,130,748.72	2.41
8	600519	浦发银行	10,114,577	135,130,748.72	2.41
9	601088	中国神华	1,849,023	122,922,733.06	2.20
10	600037	浦发银行	1,849,023	122,922,733.06	2.18

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(%)
600016	民生银行	33,411,558	262,614,845.88	4.49	
600036	招商银行	18,132,175	209,747,406.25	4.66	
601518	中国平安	4,969,225	225,056,200.25	4.02	
600166	中国石化	11,117,075	165,543,918.75	3.52	
601328	交通银行	36,472,232	163,883,226.08	3.06	
600000	浦发银行	16,472,969	163,141,852.48	2.92	
600030	中信证券	10,114,577	135,130,748.72	2.41	

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	000002	万科A	1,000,000	98,000,000.00	1.75
2	120005	浦发银行	30,000,000	30,000,000.00	0.54
3	019202	浦发银行	396,390	39,654,855.60	0.71
4	019201	浦发银行	19,847,130.00	19,847,130.00	0.35

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	000002	万科A	1,000,000	98,000,000.00	1.75
2	120005	浦发银行	30,000,000	30,000,000.00	0.54
3	019202	浦发银行	396,390	39,654,855.60	0.71
4	019201	浦发银行	19,847,130.00	19,847,130.00	0.35

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 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