

信息披露 disclosure

万家180指数证券投资基金

2013 年 度 报 告 摘 要

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任何重大利益冲突。
4.已签订的与估值相关的任何定价服务的性质与范围
本基金管理人与中国国际实业股份有限公司签署了《中国收益率曲线中债估值服务最终用户服务协议》。
4.7 管理人对本报告期内基金利润分配情况的说明
本基金在本报告期内未实施利润分配。
5 托管人报告
报告期内本基金托管人遵规守信情况报告
本报告期内,中国国际银行股份有限公司(以下称“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,基金管理人根据《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约定,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 托管人对本年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见
本报告中的财务指标、净值表现、投资收益分配情况、财务会计报告、基金合同中的“金融工具风险及管理”部分未托管人复核范围,收益分配报告数据真实、准确和完整。
5.4 审计机构
本基金2013年年度报告财务会计报告已经安永华明会计师事务所审计,注册会计师签字出具安永华明(2014)审字第6078228、B04号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。
5.7 年度财务报表

7.1资产估值表
会计主体:万家180指数证券投资基金
报告截止日:2013年12月31日
单位:人民币元

资产	本报告 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
银行存款	17,039,158.42	87,766,734.63
结算备付金	5,106,250.47	1,006,700.44
存出保证金	2,248,016.24	-
交易性金融资产	3,068,390,963.34	5,504,208,977.83
其中:股票投资	2,877,059,908.04	5,296,75,203.33
债券投资	196,094,074.49	207,522,774.60
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	90,000,000.00
应收利息	7,236,026.06	7,739,319.87
应收股利	2,722,440.07	4,564,827.67
应收证券清算款	-	-
其他应收款	120,091.75	31,149.99
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,082,863,387.91	6,095,795,036.13

负债和所有者权益	本报告 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
负债:		
短期借款	-	-
应付短期融资款	-	-
应付票据	-	-
应付账款	-	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
应付证券清算款	-	-
其他应付款	-	-
其他负债	-	-
负债合计	7,911,097.12	99,594,644.97
所有者权益:		
实收基金	5,751,313,814.96	9,641,123,815.79
留存收益	-2,556,361,824.09	-4,065,275,424.63
所有者权益合计	3,194,951,990.87	5,575,838,391.16
所有者权益总计	3,194,951,990.87	5,575,838,391.16

注:本报告截止日2013年12月31日,基金份额净值0.6381元,基金份额总额7,751,313,814.96份。
7.2 利润表
会计主体:万家180指数证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日
单位:人民币元

项目	本报告 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入	-54,352,808.96	589,466,600.96
1.利息收入	5,751,956.89	7,813,551.41
其中:存款利息收入	303,673.04	579,591.28
债券利息收入	4,342,422.48	6,996,338.89
资产支持证券投资收入	-	-
公允价值变动收益	61,481.40	248,281.48
其他业务收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-276,255,356.10	-467,336,250.54
其中:股票投资收益	-86,648,006.02	-775,430,079.40
债券投资收益	9,969,680.87	1,077,675.93
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具损益	-	-
公允价值变动损益	79,192,895.25	115,016,151.55
3.公允价值变动收益(损失以“-”填列)	213,939,628.49	1,237,238,849.63
4.其他业务收入(损失以“-”填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”填列)	2,229,184.55	1,750,490.24
减:二、费用	56,447,822.35	76,206,885.04
1.管理人报酬	35,743,898.83	55,900,471.78
2.托管费	7,146,779.37	11,390,174.32
3.销售服务费	-	-
4.其他费用	13,556,154.15	8,918,005.74
5.其他支出	9,986.76	236,431.57
其中:卖出回购金融资产支出	9,986.76	236,431.57
6.其他费用	440,003.09	430,241.63
三、利润总额(亏损总额以“-”填列)	-110,800,811.41	513,259,715.92
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”填列)	-110,800,811.41	513,259,715.92

7.3 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:2013年1月1日至2013年12月31日
单位:人民币元

项目	本报告 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、实收基金	5,751,313,814.96	5,751,313,814.96
二、未分配利润	-2,556,361,824.09	-4,065,275,424.63
三、未分配利润	-2,556,361,824.09	-4,065,275,424.63
四、所有者权益合计	3,194,951,990.87	5,575,838,391.16
五、所有者权益合计	3,194,951,990.87	5,575,838,391.16

注:本报告截止日2013年12月31日,基金份额净值0.6381元,基金份额总额7,751,313,814.96份。
7.2 利润表
会计主体:万家180指数证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日
单位:人民币元

项目	本报告 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入	-54,352,808.96	589,466,600.96
1.利息收入	5,751,956.89	7,813,551.41
其中:存款利息收入	303,673.04	579,591.28
债券利息收入	4,342,422.48	6,996,338.89
资产支持证券投资收入	-	-
公允价值变动收益	61,481.40	248,281.48
其他业务收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-276,255,356.10	-467,336,250.54
其中:股票投资收益	-86,648,006.02	-775,430,079.40
债券投资收益	9,969,680.87	1,077,675.93
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具损益	-	-
公允价值变动损益	79,192,895.25	115,016,151.55
3.公允价值变动收益(损失以“-”填列)	213,939,628.49	1,237,238,849.63
4.其他业务收入(损失以“-”填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”填列)	2,229,184.55	1,750,490.24
减:二、费用	56,447,822.35	76,206,885.04
1.管理人报酬	35,743,898.83	55,900,471.78
2.托管费	7,146,779.37	11,390,174.32
3.销售服务费	-	-
4.其他费用	13,556,154.15	8,918,005.74
5.其他支出	9,986.76	236,431.57
其中:卖出回购金融资产支出	9,986.76	236,431.57
6.其他费用	440,003.09	430,241.63
三、利润总额(亏损总额以“-”填列)	-110,800,811.41	513,259,715.92
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”填列)	-110,800,811.41	513,259,715.92

7.3 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:2013年1月1日至2013年12月31日
单位:人民币元

项目	本报告 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、实收基金	5,751,313,814.96	5,751,313,814.96
二、未分配利润	-2,556,361,824.09	-4,065,275,424.63
三、未分配利润	-2,556,361,824.09	-4,065,275,424.63
四、所有者权益合计	3,194,951,990.87	5,575,838,391.16
五、所有者权益合计	3,194,951,990.87	5,575,838,391.16

注:本报告截止日2013年12月31日,基金份额净值0.6381元,基金份额总额7,751,313,814.96份。
7.2 利润表
会计主体:万家180指数证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日
单位:人民币元

项目	本报告 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入	-54,352,808.96	589,466,600.96
1.利息收入	5,751,956.89	7,813,551.41
其中:存款利息收入	303,673.04	579,591.28
债券利息收入	4,342,422.48	6,996,338.89
资产支持证券投资收入	-	-
公允价值变动收益	61,481.40	248,281.48
其他业务收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-276,255,356.10	-467,336,250.54
其中:股票投资收益	-86,648,006.02	-775,430,079.40
债券投资收益	9,969,680.87	1,077,675.93
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具损益	-	-
公允价值变动损益	79,192,895.25	115,016,151.55
3.公允价值变动收益(损失以“-”填列)	213,939,628.49	1,237,238,849.63
4.其他业务收入(损失以“-”填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”填列)	2,229,184.55	1,750,490.24
减:二、费用	56,447,822.35	76,206,885.04
1.管理人报酬	35,743,898.83	55,900,471.78
2.托管费	7,146,779.37	11,390,174.32
3.销售服务费	-	-
4.其他费用	13,556,154.15	8,918,005.74
5.其他支出	9,986.76	236,431.57
其中:卖出回购金融资产支出	9,986.76	236,431.57
6.其他费用	440,003.09	430,241.63
三、利润总额(亏损总额以“-”填列)	-110,800,811.41	513,259,715.92
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”填列)	-110,800,811.41	513,259,715.92

7.3 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:2013年1月1日至2013年12月31日
单位:人民币元

项目	本报告 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、实收基金	5,751,313,814.96	5,751,313,814.96
二、未分配利润	-2,556,361,824.09	-4,065,275,424.63
三、未分配利润	-2,556,361,824.09	-4,065,275,424.63
四、所有者权益合计	3,194,951,990.87	5,575,838,391.16
五、所有者权益合计	3,194,951,990.87	5,575,838,391.16

注:本报告截止日2013年12月31日,基金份额净值0.6381元,基金份额总额7,751,313,814.96份。
7.2 利润表
会计主体:万家180指数证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日
单位:人民币元

项目	本报告 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入	-54,352,808.96	589,466,600.96
1.利息收入	5,751,956.89	7,813,551.41
其中:存款利息收入	303,673.04	579,591.28
债券利息收入	4,342,422.48	6,996,338.89
资产支持证券投资收入	-	-
公允价值变动收益	61,481.40	248,281.48
其他业务收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-276,255,356.10	-467,336,250.54
其中:股票投资收益	-86,648,006.02	-775,430,079.40
债券投资收益	9,969,680.87	1,077,675.93
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具损益	-	-
公允价值变动损益	79,192,895.25	115,016,151.55
3.公允价值变动收益(损失以“-”填列)	213,939,628.49	1,237,238,849.63
4.其他业务收入(损失以“-”填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”填列)	2,229,184.55	1,750,490.24
减:二、费用	56,447,822.35	76,206,885.04
1.管理人报酬	35,743,898.83	55,900,471.78
2.托管费	7,146,779.37	11,390,174.32
3.销售服务费	-	-
4.其他费用	13,556,154.15	8,918,005.74
5.其他支出	9,986.76	236,431.57
其中:卖出回购金融资产支出	9,986.76	236,431.57
6.其他费用	440,003.09	430,241.63
三、利润总额(亏损总额以“-”填列)	-110,800,811.41	513,259,715.92
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”填列)	-110,800,811.41	513,259,715.92

7.3 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:2013年1月1日至2013年12月31日
单位:人民币元

项目	本报告 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、实收基金	5,751,313,814.96	5,751,313,814.96
二、未分配利润	-2,556,361,824.09	-4,065,275,424.63
三、未分配利润	-2,556,361,824.09	-4,065,275,424.63
四、所有者权益合计	3,194,951,990.87	5,575,838,391.16
五、所有者权益合计	3,194,951,990.87	5,575,838,391.16

注:本报告截止日2013年12月31日,基金份额净值0.6381元,基金份额总额7,751,313,814.96份。
7.2 利润表
会计主体:万家180指数证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日
单位:人民币元

项目	本报告 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入	-54,352,808.96	589,466,600.96
1.利息收入	5,751,956.89	7,813,551.41
其中:存款利息收入	303,673.04	579,591.28
债券利息收入	4,342,422.48	6,996,338.89
资产支持证券投资收入	-	-
公允价值变动收益	61,481.40	248,281.48
其他业务收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-276,255,356.10	-467,336,250.54
其中:股票投资收益	-86,648,006.02	-775,430,079.40
债券投资收益	9,969,680.87	1,077,675.93
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具损益	-	-
公允价值变动损益	79,192,895.25	115,016,151.55
3.公允价值变动收益(损失以“-”填列)	213,939,628.49	1,237,238,849.63
4.其他业务收入(损失以“-”填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”填列)	2,229,184.55	1,750,490.24
减:二、费用	56,447,822.35	76,206,885.04
1.管理人报酬	35,743,898.83	55,900,471.78
2.托管费	7,146,779.37	11,390,174.32
3.销售服务费	-	-
4.其他费用	13,556,154.15	8,918,005.74
5.其他支出	9,986.76	236,431.57
其中:卖出回购金融资产支出	9,986.76	236,431.57
6.其他费用	440,003.09	430,241.63
三、利润总额(亏损总额以“-”填列)	-110,800,811.41	513,259,715.92
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”填列)	-110,800,811.41	513,259,715.92

7.3 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:2013年1月1日至2013年12月31日
单位:人民币元

项目	本报告 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、实收基金	5,751,313,814.96	5,751,313,814.96
二、未分配利润	-2,556,361,824.09	-4,065,275,424.63
三、未分配利润	-2,556,361,824.09	-4,065,275,424.63
四、所有者权益合计	3,194,951,990.87	5,575,838,391.16
五、所有者权益合计	3,194,951,990.87	5,575,838,391.16

注:本报告截止日2013年12月31日,基金份额净值0.6381元,基金份额总额7,751,313,814.96份。
7.2 利润表
会计主体:万家180指数证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日
单位:人民币元

项目	本报告 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入	-54,352,808.96	589,466,600.96
1.利息收入	5,751,956.89	7,813,551.41
其中:存款利息收入	303,673.04	579,591.28
债券利息收入	4,342,422.48	6,996,338.89
资产支持证券投资收入	-	-
公允价值变动收益	61,481.40	248,281.48
其他业务收入	-	-