

## 万家180指数证券投资基金

## [2014] 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:中国银行股份有限公司

报告送出日期:2014年7月21日

## § 1 重要提示

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。投资人在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金报告期财务数据未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	万家180指数
基金代码	519180
交易代码	519180
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2000年3月17日
报告期末基金的份额	6154,227,887.60份
报告期末基金的净值	-0.839095573
投资目标	本基金通过投资于标的指数成份股，力求基金的跟踪组合收益和净值增长率与标的指数的收益和净值增长率相拟合，以实现对标的指数的跟踪。
投资策略	本基金通过投资于标的指数成份股，分散投资于标的指数所含的成份股，力求跟踪组合的收益和净值增长率与标的指数的收益和净值增长率相拟合。
业绩比较基准	95%×上证180指数收益+5%×银行存款利率
风险收益特征	本基金具有较高的系统性风险，长期内本基金稳健的回报产品具有较高的系统性风险。
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

## § 3 主要财务指标

单位:人民币元

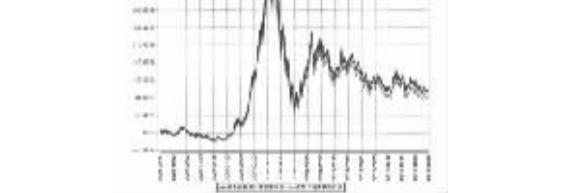
主要财务指标	报告期(2014年4月1日-2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-86,330,955.73
2.本期利润	49,074,668.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.0009
4.期末基金资产净值	3,144,297,388.47
5.期末基金份额净值	0.5108

注:1.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购、赎回费等),计入认购后实际收益水平将低于不计费用。

2.本期已实现收益指本期收入,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本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变动的比较



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。

## § 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介										
<table border="1"> <thead> <tr> <th>姓名</th> <th>职务</th> <th>任本基金的基金经理期限</th> <th>证券从业年限</th> <th>说明</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>吴涛</td> <td>本基金基金经理</td> <td>2010年3月31日</td> <td>-</td> <td>17年 硕士学历,曾任天同证券有限公司基金部副总监、公司基金部副总监、经理助理、万家基金有限公司基金部基金经理、基金投资部基金经理、基金经理助理、万家基金有限公司基金经理、基金经理助理、万家基金有限公司监察稽核部总监等。</td> </tr> </tbody> </table>	姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明	吴涛	本基金基金经理	2010年3月31日	-	17年 硕士学历,曾任天同证券有限公司基金部副总监、公司基金部副总监、经理助理、万家基金有限公司基金部基金经理、基金投资部基金经理、基金经理助理、万家基金有限公司基金经理、基金经理助理、万家基金有限公司监察稽核部总监等。
姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明						
吴涛	本基金基金经理	2010年3月31日	-	17年 硕士学历,曾任天同证券有限公司基金部副总监、公司基金部副总监、经理助理、万家基金有限公司基金部基金经理、基金投资部基金经理、基金经理助理、万家基金有限公司基金经理、基金经理助理、万家基金有限公司监察稽核部总监等。						

注:1.此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2.管理人对报告期内本基金运作合规的说明

本报告期内,本基金管理人遵守基金合同、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定,严格履行诚实信用、勤勉尽责、安全高效的管理原则和运用基金资产,在认真履行投资风险管理的基础上,为基金持有人谋取最大利益,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3.公平交易制度的执行情况

4.3.1.公平交易制度的执行情况

本基金制定了《公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》,对于交易行为中交易对手、对于交易对手的公平交易制度;对于一级市场申购、非一级市场发行股票申购等竞价行为,按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;对于二级市场交易,按照时间优先、价格优先的原则对公平公正的进行定价并完成交易,为保证公平交易原则的实现,通过制度安排、流程审批、系统监控参数设置等进行事前控制,通过对投资交易系统的实时监控在事中控制,通过对异常交易的监控和分析实现事后控制。

4.3.2.异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内未发现所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当年总成交量的5%。

4.4.报告期末基金的资产配置情况说明

报告本期内,本基金的资产配置情况符合基金合同的规定,不存在定期调整资产配置比例的情况。

4.5.报告期末基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.5108元,报告期基金份额净值增长率为1.67%,业绩比较基准收益

注:1.本基金报告期份额净值增长率为1.67%,符合基金合同规定的日均回报率不超过10%的规定。

本基金标的指数所代表的大盘蓝筹股具有较大的估值优势,在中长期市场有望获得较好表现。

本基金的管理人将遵守基金合同规定的投资目标与投资策略,一如既往地规范运作,为基金份额持有人实现长期、稳定的回报。

4.6.报告期末基金的资产配置情况说明

报告本期内,本基金的资产配置情况符合基金合同的规定,不存在定期调整资产配置比例的情况。

4.7.报告期末基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.5108元,报告期基金份额净值增长率为1.67%,业绩比较基准收益

注:1.本基金报告期份额净值增长率为1.67%,符合基金合同规定的日均回报率不超过10%的规定。

## § 5 投资组合报告

5.1 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	2,983,274,634.95	94.67
2	固定收益	2,983,274,634.95	94.67
3	货币市场基金	102,017,599.10	3.24
4	其他	-	-
5	现金类资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	61,749,631.88	1.96
7	其他资产	4,173,888.58	0.13
8	合计	3,151,215,754.51	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金报告期份额净值增长率为1.67%,符合基金合同规定的日均回报率不超过10%的规定。

本基金的管理人将遵守基金合同规定的投资目标与投资策略,一如既往地规范运作,为基金份额持有人实现长期、稳定的回报。

5.3 报告期内基金资产组合情况

5.3.1本报告期按行业分类的股票投资组合

注:本基金报告期份额净值增长率为1.67%,符合基金合同规定的日均回报率不超过10%的规定。

本基金的管理人将遵守基金合同规定的投资目标与投资策略,一如既往地规范运作,为基金份额持有人实现长期、稳定的回报。

5.3.2.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

注:1.本基金报告期份额净值增长率为1.67%,符合基金合同规定的日均回报率不超过10%的规定。

本基金的管理人将遵守基金合同规定的投资目标与投资策略,一如既往地规范运作,为基金份额持有人实现长期、稳定的回报。

5.4 报告期内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

5.4.1.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组合

注:本基金报告期份额净值增长率为1.67%,符合基金合同规定的日均回报率不超过10%的规定。

本基金的管理人将遵守基金合同规定的投资目标与投资策略,一如既往地规范运作,为基金份额持有人实现长期、稳定的回报。

5.4.2.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组合

注:本基金报告期份额净值增长率为1.67%,符合基金合同规定的日均回报率不超过10%的规定。

本基金的管理人将遵守基金合同规定的投资目标与投资策略,一如既往地规范运作,为基金份额持有人实现长期、稳定的回报。

5.4.3.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组合

注:本基金报告期份额净值增长率为1.67%,符合基金合同规定的日均回报率不超过10%的规定。

本基金的管理人将遵守基金合同规定的投资目标与投资策略,一如既往地规范运作,为基金份额持有人实现长期、稳定的回报。

5.4.4.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组合

注:本基金报告期份额净值增长率为1.67%,符合基金合同规定的日均回报率不超过10%的规定。

本基金的管理人将遵守基金合同规定的投资目标与投资策略,一如既往地规范运作,为基金份额持有人实现长期、稳定的回报。

5.4.5.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组合

注:本基金报告期份额净值增长率为1.67%,符合基金合同规定的日均回报率不超过10%的规定。

本基金的管理人将遵守基金合同规定的投资目标与投资策略,一如既往地规范运作,为基金份额持有人实现长期、稳定的回报。

5.4.6.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组合

注:本基金报告期份额净值增长率为1.67%,符合基金合同规定的日均回报率不超过10%的规定。

本基金的管理人将遵守基金合同规定的投资目标与投资策略,一如既往地规范运作,为基金份额持有人实现长期、稳定的回报。

5.4.7.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组合

注:本基金报告期份额净值增长率为1.67%,符合基金合同规定的日均回报率不超过10%的规定。

本基金的管理人将遵守基金合同规定的投资目标与投资策略,一如既往地规范运作,为基金份额持有人实现长期、稳定的回报。

5.4.8.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组合

注:本基金报告期份额净值增长率为1.67%,符合基金合同规定的日均回报率不超过10%的规定。

本基金的管理人将遵守基金合同规定的投资目标与投资策略,一如既往地规范运作,为基金份额持有人实现长期、稳定的回报。

5.4.9.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组合

注:本基金报告期份额净值增长率为1.67%,符合基金合同规定的日均回报率不超过10%的规定。

本基金的管理人将遵守基金合同规定的投资目标与投资策略,一如既往地规范运作,为基金份额持有人实现长期、稳定的回报。

5.4.10.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组合

注:本基金报告期份额净值增长率为1.67%,符合基金合同规定的日均回报率不超过10%的规定。

本基金的管理人将遵守基金合同规定的投资目标与投资策略,一如既往地规范运作,为基金份额持有人实现长期、稳定的回报。

5.4.11.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组合

注:本基金报告期份额净值增长率为1.67%,符合基金合同规定的日均回报率不超过10%的规定。

本基金的管理人将遵守基金合同规定的投资目标与投资策略,一如既往地规范运作,为基金份额持有人实现长期、稳定的回报。

5.4.12.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组合

注:本基金报告期份额净值增长率为1.67%,符合基金合同规定的日均回报率不超过10%的规定。

本基金的管理人将遵守基金合同规定的投资目标与投资策略,一如既往地规范运作,为基金份额持有人实现长期、稳定的回报。

5.4.13.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组合

注:本基金报告期份额净值增长率为1.67%,符合基金合同规定的日均回报率不超过10%的规定。

本基金的管理人将遵守基金合同规定的投资目标与投资策略,一如既往地规范运作,为基金份额持有人实现长期、稳定的回报。

5.4.14.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组合

注:本基金报告期份额净值增长率为1.67%,符合基金合同规定的日均回报率不超过10%的规定。

本基金的管理人将遵守基金合同规定的投资目标与投资策略,一如既往地规范运作,为基金份额持有人实现长期、稳定的回报。

5.4.15.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组合

注:本基金报告期份额净值增长率为1.67%,符合基金合同规定的日均回报率不超过10%的规定。

本基金的管理人将遵守基金合同规定的投资目标与投资策略,一如既往地规范运作,为基金份额持有人实现长期、稳定的回报。

5.4.16.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组合

注:本基金报告期