万家180指数证券投资基金

【2014】半年度报告摘要

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
送出日期:2014年8月27日

§1 重要提示

1.1 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。本报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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8月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	万家180指数
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	6,156,227,887.63份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。
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。
业绩比较基准	95%×上证180指数收益率+5%×银行同业存款利率
风险收益特征	本基金追踪上证180指数,是一种风险适中、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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		万家基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	王永民
	联系电话	021-38619810	010-66594896
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95538转6,4008880800	95566
传真		021-38619888	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.wjasset.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	-142,346,425.02
本期利润	-161,122,407.99
加权平均基金份额本期利润	-0.0284
本期基金份额净值增长率	-5.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.5627
期末基金资产净值	3,144,297,358.47
期末基金份额净值	0.5108

注:1、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。

2、所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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

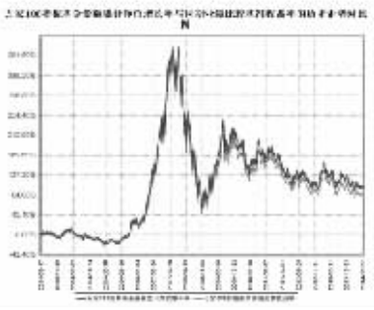
3.2 基金净值表现

3.2.1 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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.29%	0.70%	0.36%	0.72%	0.93%	-0.02%
过去三个月	1.67%	0.84%	0.73%	0.85%	0.94%	-0.01%
过去六个月	-5.07%	0.97%	-5.83%	0.98%	0.76%	-0.01%
过去一年	0.31%	1.12%	-1.07%	1.13%	1.38%	-0.01%
过去三年	-22.84%	1.23%	-24.76%	1.24%	1.92%	-0.01%
过去五年	-30.55%	1.37%	-31.24%	1.38%	0.69%	-0.01%
自基金合同生效起至今	104.45%	1.58%	86.54%	1.61%	17.91%	-0.03%

注: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

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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: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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44号文批准设立。公司现股东为齐鲁证券有限公司、新疆国际实业股份有限公司和山东省国有资产投资控股有限公司,住所地及办公地点均为上海市浦东新区浦电路360号9楼,注册资本1亿元人民币。目前管理十八只开放式基金,分别为万家180指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选股票型证券投资基金、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家精选股票型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数型证券投资基金、万家添利债券型证券投资基金、万家中证创业成长指数分级证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家上证380交易型开放式指数证券投资基金、万家市政纯债定期开放债券型证券投资基金和万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴涛	本基金基金经理、万家中证红利基金基金经理、万家中证创业成长指数分级基金基金经理、量化投资部总监	2010年3月31日	-	17年	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、万家基金管理有限公司监察稽核部总监等职。

注: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遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律、法规和监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理办法》和《异常交易监控及报告管理办法》等规章制度,涵盖了研究、授权、投资决策和交易执行等投资管理活动的各个环节,确保公平对待不同投资组合,防范导致不公平交易以及利益输送的异常交易发生。

公司制订了明确的投资授权制度,并建立了统一的投资管理平台,确保不同投资组合获得公平的投资决策机会。实行集中交易制度,对于交易所公开竞价交易,执行交易系统中的公平交易程序;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易,按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;对于银行间交易,按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。为保证公平交易原则的实现,通过制度规范、流程审批、系统风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进行事中控制,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有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内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日成交量的5%的交易次数为1次,为指数型基金因被动跟踪标的指数与其他组合发生同日反向交易,不存在不公平交易和利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年上半年,我国经济运行总体保持平稳,1、2季度GDP增长分别为7.4%和7.5%,景气度逐步回升,经济结构调整稳步推进,转型升级势头良好,另一方面,房地产投资增速减缓,产业结构调整等因素对经济增长构成一定的下行压力。在双方共同影响下,A股市场在上半年表现为区间震荡整理走势,成交略减,上半年成长和价值风格分化较为显著,小盘成长风格表现较好。报告期本基金投资标的指数---上证180指数收益率为-6.17%。

本基金作为被动投资的指数基金,其投资目标是通过跟踪、复制上证180指数,为投资者获取股票市场长期的平均收益。报告期内我们严格按照基金合同规定,采取了完全复制方法进行投资管理,努力拟合标的指数,减小跟踪误差。

报告期内,本基金采用有效的量化跟踪技术,将基金跟踪误差控制在较低范围内,跟踪误差主要是由于基金申购赎回、禁止投资成分股替代和标的指数成分股定期调整等因素所造成。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.5108元,报告期内基金份额净值增长率为-5.07%,同期业绩比较基准收益率为-5.83%,基金日跟踪误差为0.0348%,符合基金合同规定中日拟合偏离度不超过0.5%的规定。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年下半年,我们认为“调结构,稳增长”政策指导下,各项改革措施将进一步落实,财政、货币政策支持实体经济的力度将继续加大,定向宽松和定向刺激措施的作用将逐步显现,经济稳步增长确定,并将引导投资者调整市场预期。因此,我们看好国内股票市场的下半年表现。本基金标的指数---上证180指数作为沪市大中盘蓝筹股指数,估值优势明显、市场代表性强,在目前国企改革加速推进的过程中,其成分股将最为受益,具有较高的投资价值。

本基金将继续贯彻被动投资理念,恪守基金合同规定的投资目标和投资策略,一如既往地规范、勤勉运作,将本基金打造为稳定有效的指数投资工具,为基金份额持有人谋求长期、稳定回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了估值委员会,定期评价现行估值政策和程序,在发生了影响估值政策和程序有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。估值委员会由督察长、基金运营部负责人、合规稽核部负责人、权益投资部负责人、固定收益部负责人等组成。估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关从业资格,精通各自领域的理论知识,熟悉政策法规,并具有丰富的实践经验。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不介入基金日常估值业务。

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重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金在报告期内未实施利润分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)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,本托管人根据《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规定,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地复核,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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:万家180指数证券投资基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产:		
银行存款	61,477,886.11	17,039,158.42
结算备付金	271,745.77	5,106,250.47
存出保证金	363,463.25	2,248,016.24
交易性金融资产	3,085,292,234.05	3,068,390,965.34
其中:股票投资	2,983,274,634.95	2,877,695,990.94
基金投资	-	-
债券投资	102,017,599.10	190,694,974.40
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	-	-
应收证券清算款	-	7,236,456.90
应收股利	-	-
应收申购款	53,779.66	120,091.75
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,151,215,754.51	3,102,863,387.19
负债和所有者权益	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	954.16	-
应付赎回款	2,562,986.30	2,582,466.18
应付管理人报酬	2,344,467.70	2,678,058.88
应付托管费	468,893.53	535,611.74
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,274,715.14	1,610,285.53
应交税费	-	31,717.80
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	266,379.21	472,956.99
负债合计	6,918,396.04	7,911,097.12
所有者权益:		
实收基金	6,156,227,887.63	5,751,313,814.96
未分配利润	-3,011,930,529.16	-2,656,361,524.89
所有者权益合计	3,144,297,358.47	3,094,952,290.07
负债和所有者权益总计	3,151,215,754.51	3,102,863,387.19

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值0.5108元,基金份额总额6,156,227,887.63份。

6.2 利润表

会计主体:万家180指数证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	-140,963,669.60	-249,115,950.84
1.利息收入	2,494,727.36	3,050,035.54
其中:存款利息收入	216,784.89	404,079.68
债券利息收入	2,273,987.24	2,163,470.87
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,955.23	482,484.99
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-124,867,617.75	-180,814,226.15
其中:股票投资收益	-149,672,443.84	-224,584,817.42
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-2,346,879.26	105,159.47
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	27,151,705.35	43,665,431.80
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-18,775,982.97	-73,544,744.71
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	185,203.76	2,192,984.48
减:二、费用	20,158,738.39	31,462,971.66
1.管理人报酬	14,349,381.56	19,896,635.16
2.托管费	2,869,876.27	3,979,327.04
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	2,723,968.13	7,356,743.57
5.利息支出	-	9,412.41
其中:卖出回购金融资产支出	-	9,412.41
6.其他费用	215,512.43	220,853.48
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-161,122,407.99	-280,578,922.50
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-161,122,407.99	-280,578,922.50

6.3 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:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	5,751,313,814.96	-2,656,361,524.89	3,094,952,290.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-161,122,407.99	-161,122,407.99
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	404,914,072.67	-194,446,596.28	210,467,476.39
其中:1.基金申购款	1,037,310,868.48	-506,829,775.55	530,481,092.93
2.基金赎回款	-632,396,795.81	312,383,179.27	-320,013,616.54
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	6,156,227,887.63	-3,011,930,529.16	3,144,297,358.47
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	9,641,123,815.79	-4,045,275,424.63	5,595,848,391.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-280,578,922.50	-280,578,922.50
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-3,716,873,146.06	1,418,113,776.65	-2,298,759,369.41
其中:1.基金申购款	527,478,374.90	-218,651,490.95	308,826,883.95
2.基金赎回款	-4,244,351,520.96	1,636,765,267.60	-2,607,586,253.36
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	5,924,250,669.73	-2,907,740,570.48	3,016,510,099.25

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

_____毕玉国_____ _____李杰_____ _____陈广益_____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

万家180指数证券投资基金(以下简称“本基金”),原名天同180指数证券投资基金,系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2002]88号文《关于同意天同180指数证券投资基金设立的批复》的核准,由天同基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集,基金合同于2003年3月17日正式生效,首次设立的募集规模为1,929,789,525.65份基金份额。经中国证监会证监基金字[2006]13号文《关于同意天同基金管理有限公司变更名称及修改公司章程的批复》的核准,天同基金管理有限公司于2006年2月更名为万家基金管理有限公司;另经基金管理人董事会审议通过,基金托管人同意,中国证监会基金部核准,本基金于2006年2月更名为万家180指数证券投资基金。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为万家基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

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投资于国债、优质企业债、金融债以及债券回购;本基金亦可投资于经中国证监会批准允许投资的其他金融工具。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指数增长率。本基金的业绩比较基准为:95%×上证180指数收益率+5%×银行同业存款利率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》,中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则 第2号 《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则 》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2014年6月30日的财务状况以及2014年上半年度的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错。

6.4.6 税项

1.印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

2.营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

3.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入,储蓄存款利息收入,由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内关联方关系未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
齐鲁证券有限公司(“齐鲁证券”)	基金管理人主要股东、基金代销机构

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
齐鲁证券	1,035,692,383.48	56.52%	1,531,161,989.77	37.72%

债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
齐鲁证券	90,355,122.60	43.54%	76,725,623.20	35.96%

债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
齐鲁证券	10,000,000.00	89.29%	1,254,700,000.00	36.82%

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内和上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
齐鲁证券	942,893.35	56.69%	674,648.66	52.93%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
齐鲁证券	1,393,966.50	37.72%	196,073.44	21.88%

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	14,349,381.56	19,896,635.16
其中:支付销售机构的客户维护费	3,312,164.88	4,173,023.63

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.00%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.00%÷当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,869,876.27	3,979,327.04

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.20%÷当年天数

H为每日应支付的基金托管费

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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期 2014年1月1日至2014年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	19,600,000.00	9,263.01

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金.

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	61,477,886.11	193,364.03	11,987,318.83	339,863.56

注:本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司,2014年1月1日至2013年6月30日获得的利息收入为人民币10,294.57元(2013年1月1日至6月30日:人民币41,075.74元),2014年6月30日结算备付金余额为人民币271,745.77元(2013年6月30日:人民币2,378,398.61元)。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.9 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金期末未持有因新发/增发而流通受限证券

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600637	百视通	2014年5月29日	重大事项	32.03	-	-	521,516	10,834,365.53	16,704,157.48	-
600832	东方明珠	2014年5月29日	重大事项	10.98	-	-	1,211,472	12,740,685.08	13,301,962.56	-
601669	中国电建	2014年5月13日	重大事项	2.79	-	-	2,991,443	12,382,527.44	8,346,125.97	-
600418	江淮汽车	2014年4月14日	重大事项	10.20	2014年7月11日	11.22	718,072	5,202,640.63	7,324,334.40	-
600516	方大炭素	2014年6月30日	临时停牌	9.59	2014年7月2日	9.05	738,257	7,431,999.69	7,079,884.63	-
600498	烽火通信	2014年6月30日	重大事项	11.91	2014年7月7日	12.10	419,070	6,839,131.31	4,991,123.70	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金期末未持有银行间市场债券正回购。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金期末未持有交易所市场债券正回购。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,983,274,634.95	94.67
	其中:股票	2,983,274,634.95	94.67
2	固定收益投资	102,017,599.10	3.24
	其中:债券	102,017,599.10	3.24
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	61,749,631.88	1.96
7	其他各项资产	4,173,888.58	0.13
8	合计	3,151,215,754.51	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.9 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

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	13,665,820.91	0.43
B	采矿业	195,271,723.23	6.21
C	制造业	791,702,055.55	25.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	97,091,825.21	3.09
E	建筑业	92,377,637.22	2.94
F	批发和零售业	53,643,593.52	1.71
G	交通运输、仓储和邮政业	74,046,495.17	2.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	103,301,149.80	3.29
J	金融业	1,323,863,456.13	42.10
K	房地产业	155,614,105.15	4.95
L	租赁和商务服务业	14,248,716.12	0.45
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	13,301,962.56	0.42
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	29,721,698.02	0.95
S	综合	25