

# 万家180指数证券投资基金

## 二〇〇六年半年度报告

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

送出日期： 2006年8月26日

## 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。本半年度报告已经全体独立董事签字同意，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2006年8月21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。

报告期为2006年1月1日起至2006年6月30日止，本报告财务资料未经审计。

## 目 录

一、基金简介	4
二、主要财务指标和基金净值表现	5
三、基金管理人报告	6
四、基金托管人报告	8
五、财务会计报告	9
(一) 基金会计报表	9
(二) 年度会计报表附注	12
六、投资组合报告	19
七、基金份额持有人情况	27
八、开放式基金份额变动情况	28
九、重大事项揭示	28
十、备查文件	30

## 一、基金简介

### (一) 基金基本资料

- |                 |                  |
|-----------------|------------------|
| 1、基金名称:         | 万家 180 指数证券投资基金  |
| 2、基金简称:         | 万家 180           |
| 3、交易代码:         | 519180           |
| 4、基金运作方式:       | 契约型开放式           |
| 5、基金合同生效日:      | 2003 年 3 月 17 日  |
| 6、报告期末基金份额总额:   | 360, 579, 873.81 |
| 7、基金合同存续期:      | 不定期              |
| 8、基金份额上市的证券交易所: | 无                |
| 9、上市日期:         | 无                |

### (二) 基金产品说明

- |           |   |
|-----------|---|
| 1、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。                                 |
| 2、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。 |
| 3、业绩比较基准: | $95\% \times \text{上证 180 指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$  |
| 4、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   |

### (三) 基金管理人

- |            |               |
|------------|---------------|
| 1、名称:      | 万家基金管理有限公司    |
| 2、注册地址:    | 上海浦东源深路 273 号 |
| 3、办公地址:    | 上海浦东源深路 273 号 |
| 4、邮政编码:    | 200135        |
| 5、法定代表人:   | 柳亚男           |
| 6、信息披露负责人: | 吴涛            |

- 7、联系电话：021-68644577 转 276  
 8、传真：021-68531888  
 9、电子邮箱：[wut@wjasset.com](mailto:wut@wjasset.com)

**(四) 基金托管人**

- 1、名称：中国银行股份有限公司  
 2、注册地址：北京西城区复兴门内大街1号  
 3、办公地址：北京西城区复兴门内大街1号  
 4、邮政编码：100818  
 5、法定代表人：肖钢  
 6、信息披露负责人：宁敏  
 7、联系电话：010-66594977  
 8、传真：010-66594942  
 9、电子邮箱：[tgxxpl@bank-of-china.com](mailto:tgxxpl@bank-of-china.com)

**(五) 信息披露**

- 1、信息披露报纸名称：《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》  
 2、登载半年度报告正文的管理人互联网网址：<http://www.wjasset.com>  
 3、基金半年度报告置备地点：上海市源深路 273 号基金管理人办公场所

**(六) 其他有关资料**

- 1、基金注册登记机构名称：中国证券登记结算有限责任公司  
 2、办公地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

**二、主要财务指标和基金净值表现**

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。

**(一) 主要会计数据和财务指标**

序号	主要会计数据和财务指标	
1	基金本期净收益	46,062,209.01 元
2	基金份额本期净收益	0.0899 元
3	期末可供分配基金收益	21,125,283.45 元
4	期末可供分配基金份额收益	0.0586 元
5	期末基金资产净值	452,646,975.65 元
6	期末基金份额净值	1.2553 元
7	基金加权平均净值收益率	9.1190%
8	本期基金份额净值增长率	52.1023%
9	基金份额累计净值增长率	31.72%

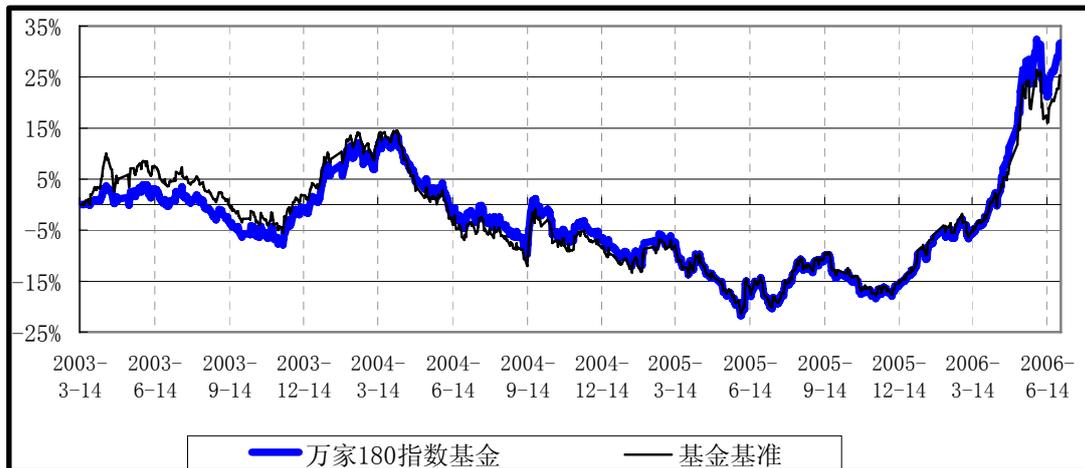
**(二) 基金净值表现**

1、万家 180 指数基金历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较列表

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)	业绩比较基准标准差 (4)	(1)-(3)	(2)-(4)
过去 1 个月	2.01%	1.61%	1.66%	1.64%	0.35%	-0.03%
过去 3 个月	35.02%	1.55%	28.56%	1.60%	6.46%	-0.05%
过去 6 个月	52.10%	1.26%	43.97%	1.30%	8.13%	-0.04%
过去一年	58.00%	1.05%	50.25%	1.07%	7.75%	-0.02%
自基金合同生效起至今	31.72%	0.99%	25.31%	1.01%	6.41%	-0.02%

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

2、基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较  
 万家 180 指数基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
 (2003 年 3 月 17 日至 2006 年 6 月 30 日)



注： 1、本基金在基金合同中有以下投资比例限制：(1) 本基金投资于股票的比例，不得高于基金资产净值的 95%；(2) 本基金持有到期日在一年以内的政府债券或者现金比例不低于基金资产净值的 5%；(3) 本基金投资于上证 180 指数成份股的比重不低于基金资产净值的 90%，并尽量用基金净值的 95% 资金进行标准指数化投资，追求与被跟踪的目标指数的最大拟合程度。

本基金本报告期内遵守法律、法规和上述比例限制进行证券投资。

2、2006 年 2 月，本基金基金经理由肖侃宁变更为潘江，潘江简历见下面基金经理简介。

三、管理人报告

(一) 基金管理人及基金经理情况

1、基金管理人及其管理基金的情况

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。公司股东为天同证券有限责任公司、上海久事公司、湖南湘泉集团有限公司，注册地为上海，注册资本为1亿元人民币。目前管理四只开放式基金，分别为万家180指数证券投资基金、万家保本增值证券投资基金、万家公用事业行业股票型证券投资基金和万家货币市场证券投资基金。

## 2、基金经理简介

潘江,男,1967年5月生,美国耶鲁大学管理学院MBA学位,CFA,曾任国泰基金管理公司研究部经理,2002年6月加入万家基金管理有限公司,历任研究部总监、金融工程部总监和研究部总经理等职,2006年2月起担任本基金基金经理。

### (二) 报告期内基金运作的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。

### (三) 报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释

#### (1) 2006年上半年度证券市场回顾

2006年上半年度股票市场呈现单边稳步上涨势头,上证180指数涨幅达到46.63%。截止到2006年6月30日,股改公司市值占两市总市值的比例达到78.46%,我们认为股权分置改革催生的投资机会以及A股投资价值长期被低估是吸引资金不断进入市场的主要原因,目前投资者对A股市场信心已经恢复。从市场热点来看,资金主要集中在含权板块,有色金属板块,消费类板块,军工板块等。宏观经济方面,一季度GDP同比增长10.2%,全社会固定资产投资同比增长27.7%,消费品零售总额同比增长12.8%,同时物价水平温和上涨,经济发展状况良好,另外企业经营效率有所提高,产销匹配情况良好。

#### (2) 2006年上半年基金运作情况和业绩

万家180作为一只指数基金,其投资目标是通过跟踪目标指数——上证180指数,为投资者获得长期收益。截至报告期末,本基金份额净值为1.2553元,从2006年1月1日到2006年6月30日,万家180基金净值增长率为52.10%,同期上证180指数和银行同业拆借利率构成的复合指数收益率(业绩比较基准)为43.97%,基金相对于业绩衡量基准的相对收益为+8.13%,评价期间基金指数投资组合的日拟合偏离度为0.020%,远低于基金合同中0.5%的规定。

#### (四) 宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计 2006 年下半年中国经济将继续保持强劲增长,在“十一五”规划指引下,国内经济增长方式和行业发展结构将逐渐优化,固定资产投资增速将保持在合理水平,社会消费总额将进一步增长,企业产销匹配良好,购销两旺,整体经济发展呈现结构调整和优化的特征。

目前 A 股市场已经呈现牛市特征,下半年,我们认为金融创新和并购题材概念板块和个股将有较大投资机会,另外,行业方面,我们继续看好银行、地产、资源、零售、机械制造、电子元器件和电力设备等行业。

从今年开始,万家 180 指数基金已按照新的业绩衡量基准进行操作,由原来业绩衡量基准“75%×上证 180 指数+25%×中信国债指数”调整为“95%×上证 180 指数收益率+5%×银行同业存款利率”,股票投资比例有大幅度的提升。我们将继续努力提高跟踪指数技术和现金管理水平,使万家 180 指数基金成为广大投资者良好的投资工具,并为投资者带来相应的投资回报。

#### 四、托管人报告

本托管人依据《万家180指数证券投资基金基金合同》与《万家180指数证券投资基金托管协议基金托管协议》,自2003年3月17日起托管万家180指数证券投资基金(以下称“万家180基金”或“本基金”)的全部资产。现根据《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》、《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3号<半年度报告的内容与格式>》及其他相关规定,出具本托管人报告。

1、本托管人在托管本基金期间,严格遵守《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》和本基金合同以及托管协议的规定,诚信地履行了基金托管人的职责,不存在损害本基金持有人利益的行为。

(1) 本托管人履行安全保管基金资产的全部资产的职责,保证基金资产与自有资产等非基金资产严格分开,维护基金的独立账户,与本托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行了严格的分账管理。

(2) 本托管人严格根据《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》和本基金合同以及托管协议的规定执行基金管理人的投资指令,及时、准确地完成了本基金的各项资金清算交割。本托管人对于本基金的任何资产的运用、处分和分配,均具备正当依据。

(3) 本托管人对与本基金资产相关的重大合同原件、因履行基金托管人职责而生成或收悉的记录基金业务活动的原始凭证、记账凭证、基金账册、交易记录等有妥善的保管。

2、本托管人在2006年上半年度依照《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》、《万家180指数证券投资基金基金合同》及《万家180指数证券投资基金托管协议》



资产合计:		458,817,698.01	582,880,734.52
负债:			
应付证券清算款		3,031,608.62	13,502,491.46
应付赎回款		1,846,641.09	143,424.11
应付赎回费		444.33	237.48
应付管理人报酬		360,540.17	475,697.90
应付托管费		72,108.03	95,139.62
应付佣金		531,456.15	181,079.73
应付利息			
应付收益			
未交税金		28,335.40	28,335.40
其他应付款		250,000.00	250,000.00
卖出回购证券款			
短期借款			
预提费用		49,588.57	100,000.00
其他负债			
负债合计		6,170,722.36	14,776,405.70
持有人权益:			
实收基金		360,579,873.81	688,385,366.49
未实现利得		70,941,818.39	-66,674,491.47
未分配收益		21,125,283.45	-53,606,546.20
持有人权益合计		452,646,975.65	568,104,328.82
负债与持有人权益总计		458,817,698.01	582,880,734.52

2、经营业绩表及收益分配表（本报告期及上年度可比期间的比较式经营业绩表及收益分配表）

(1) 经营业绩表

单位：元

序号	项目	附注	2006年1月1日至6月30日	2005年1月1日至6月30日
1	一、收入		49,347,037.90	-29,088,706.48
2	1、股票差价收入		28,552,275.80	-40,092,066.40
3	2、债券差价收入		-134,988.40	-56,823.53
4	3、债券利息收入		308,143.44	2,558,510.68
5	4、存款利息收入		62,756.46	82,878.83
6	5、股利收入		7,066,105.51	8,080,586.10
7	6、买入返售证券收入		800	71,890.00
8	7、权证差价收入		13,280,456.72	
9	8、其他收入		211,488.37	266,317.84
10	二、费用		3,284,828.89	4,771,996.58
11	1、基金管理人报酬		2,520,763.65	3,699,852.48
12	2、基金托管费		504,152.73	739,970.54

13	3、卖出回购证券支出			35,345.20
14	4、利息支出			
15	5、其他费用		259,912.51	296,828.36
16	其中：			
17	信息披露费		198,640.26	233,066.46
18	审计费用		49,588.57	49,588.57
19	上市年费			
20				
21				
22				
23	三、基金净收益		46,062,209.01	-33,860,703.06
24	加：未实现利得		168,678,733.51	-25,314,047.42
25	四、基金经营业绩		214,740,942.52	-59,174,750.48

(2) 收益分配表

单位：元

项目	附注	2006年1月1日至6月30日	2005年1月1日至6月30日
<b>本期基金净收益</b>		<b>46,062,209.01</b>	-33,860,703.06
加：期初基金净收益		-53,606,546.20	-5,474,911.94
加：本期损益平准金		28,669,620.64	3,628,425.64
<b>可供分配基金净收益</b>		<b>21,125,283.45</b>	-35,707,189.36
减：本期已分配基金净收益			
<b>期末基金净收益</b>		<b>21,125,283.45</b>	-35,707,189.36

3、基金净值变动表（本报告期及上年度可比期间的比较式基金净值变动表）

项目	附注	2006年1月1日至6月30日	2005年1月1日至6月30日
一、期初基金净值		568,104,328.82	845,337,413.64
二、本期经营活动			
基金净收益		46,062,209.01	-33,860,703.06
未实现利得		168,678,733.51	-25,314,047.42
经营活动产生的净值变动数		214,740,942.52	-59,174,750.48
三、本期基金单位交易			
基金申购款		40,756,018.75	72,504,464.84



	163,915,571.92	18.10%	0	0%	0	0%	134,410.35	18.11%
--	----------------	--------	---	----	---	----	------------	--------

2005年1月1日至6月30日通过关联方席位进行的交易

关联方	买卖股票成交量		买卖债券成交量		回购成交量		佣金	
	成交量 人民币元	占本年成交 量的比例	成交量 人民币元	占本年成交 量的比例	成交量 人民币元	占本年成交 量的比例	佣金 人民币元	占本年佣金 总量的比例
天同证券	151,899,513.14	27.25%	10,130,100.00	3.77%	58,000,000.00	4.10%	123,967.87	28.133%

### (3) 关联方报酬

#### a、基金管理人报酬：

支付基金管理人万家基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日的基金资产净值1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1% / 当年天数。

本基金在2006年1月1日至2006年6月30日需支付基金管理费2,520,763.65元。已支付2,160,223.48元。

本基金在2005年1月1日至2005年6月30日需支付基金管理费3,699,852.48元。

#### b、基金托管费：

支付基金托管人中国银行股份有限公司的托管费按前一日的基金资产净值0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.2% / 当年天数。

本基金在2006年1月1日至2006年6月30日需支付基金托管费504,152.73元。已支付432,044.70元。

本基金在2005年1月1日至2005年6月30日需支付基金托管费739,970.54元。

#### C、与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

2006年与基金托管人通过银行间同业市场进行的交易

单位：人民币元

关联方	债券成交金额	回购成交金额	回购利息收入	回购利息支出
中国银行	0.00	0.00	0.00	0.00

2005年与基金托管人通过银行间同业市场进行的交易

单位：人民币元

关联方	债券成交金额	回购成交金额	回购利息收入	回购利息支出
中国银行	41,170,082.19	60,000,000.00	0.00	14,479.45

(4) 基金各关联方投资本基金的情况

a、本报告期末基金管理公司未持有本基金份额

b、本报告期末基金管理公司主要股东及其控制的机构未持有本基金份额

(5) 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，并按银行间同业利率计息。

基金托管人 2006 年 6 月 30 日保管的银行存款余额及本会计期间产生的利息收入如下：

单位：人民币元

项目	金额	利息收入
银行存款	12,434,317.67	56,740.33
清算备付金	493,354.23	5,430.92
席位交易保证金	321,849.12	585.21

4、基金会计报表重要项目说明

(1) 按银行存款利息、清算备付金利息、债券利息、买入返售证券利息等分项列示应收利息的金额。

单位：人民币元

项 目	2006 年 6 月 30 日
应收银行存款利息	4,468.67
应收清算备付金利息	199.80
应收债券利息	8,416.44
应收权证保证金利息	29.07
应收利息合计	13,113.98

(2) 按注册登记费、信息披露费、审计费用、律师费用等分项列示待摊费用的期末结存余额。

单位：人民币元

项 目	2006 年 6 月 30 日
信息披露费	201,934.44
待摊费合计	201,934.44

(3) 按所估资产的种类分别列示投资估值增值的金额。

单位：人民币元

项目	2006年6月30日
股票投资估值增值	107,764,418.57
债券投资估值增值	0
投资估值增值合计	107,764,418.57

(4) 按证券经营机构分别列示应付佣金的金额。

单位：人民币元

项目	2006年6月30日
国泰君安	0.00
海通证券	0.00
华夏证券	19,838.63
天同证券	134,410.35
银河证券	89,761.42
齐鲁证券	223,891.18
东吴证券	0.00
东方证券	63,554.57
应付佣金合计	531,456.15

(5) 分项列示其他应付款的金额。

单位：人民币元

项目	2006年6月30日
券商垫付的交易保证金	250,000.00
其他应付款合计	250,000.00

(6) 按注册登记费、信息披露费、审计费用、律师费用等分项列示预提费用的期末结存余额。

单位：人民币元

项目	2006年6月30日
----	------------

审计费用	49,588.57
预提费用合计	49,588.57

(7) 开放式基金应按期初数、本期因申购的增加数、本期因赎回的减少数、期末数分项列示实收基金的金额。

单位：人民币元

项目	2006年6月30日
实收基金期初数	688,385,366.49
本期因申购的增加数	37,084,482.26
本期因赎回的减少数	364,889,974.94
实收基金期末数	360,579,873.81

(8) 开放式基金应按投资估值增值、本期申购的未实现利得平准金、本期赎回的未实现利得平准金等分项列示未实现利得的金额。

单位：人民币元

项目	2006年6月30日
期初未实现利得合计	-66,674,491.47
本期投资估值增值	168,678,733.51
本期申购的未实现利得平准金	4,886,725.07
本期赎回的未实现利得平准金	-35,949,148.72
期末未实现利得合计	7,0941,818.39

(9) 按卖出股票成交总额、成本总额等列示股票差价收入。

单位：人民币元

项目	本期数
卖出股票成交总额	602,040,920.85
卖出股票成本总额	572975505.67
佣金	512,370.78
股票差价收入	28,552,275.80

(10) 按卖出债券成交总额或收到的全部价款、成本总额、应收利息总额等列示债券差价收入。

单位：人民币元

项 目	本期数
卖出债券成交总额	43,584,057.66
卖出债券成本总额	42,387,049.34
应收利息	1,331,996.72
债券差价收入	-134,988.4

(11) 按开放式基金赎回费扣除有关手续费后的余额、配股手续费返还等分项列示其他收入的金额。

单位：人民币元

项 目	本期数
赎回费收入	211,360.31
配股手续费返还收入	128.06
新股手续费返还收入	0.00
国债手续费返还收入	0.00
基金认购利息收入	0.00
合 计	211,488.37

(12) 按注册登记费、上市年费、信息披露费、审计费用、律师费用、其他（应明示费用项目）等分项列示其他费用的金额。

单位：人民币元

项 目	本期数
银行费用	1,114.92
信息披露费	198,640.26
会计师费	49,588.57
回购交易费用	18.76
银行间账户维护费	10,550.00
分红手续费	0.00
其他	0.00
合 计	259,912.51

(13) 按各次收益分配金额、累计收益分配金额等披露本期已分配基金净收益。

单位：人民币元

项目	本期数
----	-----

累计分红金额	0.00
--------	------

(14) 按活期存款披露最近两个年度末银行存款项目的构成

单位：人民币元

项目	2006年6月30日	2005年12月31日
上海中行分行营业部	12,434,317.67	18,417,394.84

本报告期末投资定期存款

(15) 现金对价对报告期内股票投资成本的累积影响金额

单位：人民币元

项目	本年数
现金对价对股票投资成本的累积影响金额	1,743,451.07

#### 5、报告期末流通转让受到限制的基金资产的说明

股票代码	股票名称	数量	停牌日期	复牌日期	复牌开盘单价(元)	报告期末估值单价(元)	类型	报告期末估值总额(元)
600027	G华电电	310,650	2006-6-30	2006-8-1	2.46	0.38	股权分置	117,851.18
600033	G闽高速	145,327	2006-6-29	2006-7-14	6.15	1.40	股权分置	203,233.07
600035	楚天高速	315,140	2006-6-26	2006-7-11	5.38	1.15	股权分置	363,088.98
600088	G中视	68,117	2006-6-9	2006-7-4	13.2	4.68	股权分置	318,922.94
600110	G英华	101,200	2006-6-9	2006-7-27	7.35	-1.62	股权分置	-163,962.59
600176	中国玻纤	300,000	2006-6-26	2006-7-10	7.83	0.48	股权分置	143,590.73
600186	莲花味精	27,848	2006-4-24	2006-7-18	3.19	-3.85	股权分置	-107,125.22
600236	G桂冠	359,956	2006-6-13	2006-7-6	5.5	1.32	股权分置	475,798.97
600266	G城建	63,781	2006-6-30	2006-7-3	5.6	-0.10	股权分置	-6,638.17
600345	长江通信	44,180	2006-6-26	2006-7-11	9.44	0.57	股权分置	25,321.13
600383	金地	518,766	2006-3-		9.43	2.83	股权分	1,470,394.1

	集团		27	2006-7-11			置	4
600674	G 川投	130,000	2006-6-23	2006-7-14	4.15	-0.17	股权分置	-22,600.15
600786	东方锅炉	194,150	2006-6-19	2006-7-4	27	11.20	股权分置	2,173,902.99
600811	东方集团	489,028	2006-6-26	2006-7-6	6.73	2.72	股权分置	1,330,439.43
600823	世茂股份	160,202	2006-6-16	尚未复牌		0.21	股权分置	34,223.19
600835	上海机电	263,824	2006-6-26	2006-7-10	8.69	1.27	股权分置	333,997.04
600854	G 春兰	141,328	2006-6-9	2006-7-17	3.88	0.37	股权分置	52,180.91
600970	G 中材	63,877	2006-6-16	2006-7-6	23.8	11.70	股权分置	747,639.19

## 六、投资组合报告

### (一) 报告期末基金资产组合情况

资产类别	金额(元)	占基金总资产的比例
股票投资	415,355,404.94	90.53%
债券投资	9,995,000	2.18%
银行存款及清算备付金合计	12,927,671.9	2.82%
权证投资	0.00	0.00%
其他资产	20,539,621.17	4.47%
合计	458,817,698.01	100.00%

### (二) 报告期末按行业分类的股票投资组合.

行业	市值(元)	占基金资产净值的比例
A 农、林、牧、渔业	1,302,755.52	0.2900%
B 采掘业	29,576,729.19	6.5300%
C 制造业	169,851,112.29	37.5200%
C0 食品、饮料	27,506,245.58	6.0800%
C1 纺织、服装、皮毛	4,942,984.01	1.0900%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	22,003,455.64	4.8600%
C5 电子	6,602,870.56	1.4600%
C6 金属、非金属	44,938,736.23	9.9300%
C7 机械、设备、仪表	51,079,184.96	11.2800%

C8 医药、生物制品	11,706,495.20	2.5900%
C99 其他制造业	1,071,140.11	0.2400%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	34,582,342.30	7.6400%
E 建筑业	2,077,372.57	0.4600%
F 交通运输、仓储业	35,126,456.63	7.7600%
G 信息技术业	20,153,690.09	4.4500%
H 批发和零售贸易	19,620,399.06	4.3300%
I 金融、保险业	65,860,826.04	14.5500%
J 房地产业	11,407,891.18	2.5200%
K 社会服务业	7,412,223.25	1.6400%
L 传播与文化产业	7,735,832.22	1.7100%
M 综合类	10,647,774.60	2.3500%

(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细

	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	600036	G 招行	3,494,140	26,939,819.40	5.95%
2	600016	G 民生	3,795,311	16,585,509.07	3.66%
3	600900	G 长电	1,981,112	13,570,617.20	3.00%
4	600019	G 宝钢	3,090,762	13,475,722.32	2.98%
5	600519	G 茅台	252,489	11,978,078.16	2.65%
6	600050	G 联通	4,628,097	11,199,994.74	2.47%
7	600028	中国石化	1,750,611	10,941,318.75	2.42%
8	600009	G 沪机场	726,952	10,475,378.32	2.31%
9	600320	G 振华	447,920	8,841,940.80	1.95%
10	600000	G 浦发	802,946	7,957,194.86	1.76%
11	600030	G 中信	496,697	7,867,680.48	1.74%
12	600795	国电电力	962,842	7,808,648.62	1.73%
13	600694	大商股份	175,324	7,249,647.40	1.60%
14	600309	G 万华	495,691	7,187,519.50	1.59%
15	600887	G 伊利	276,760	6,307,360.40	1.39%
16	600104	G 上汽	1,020,971	5,982,890.06	1.32%
17	600717	G 天津港	673,088	5,653,939.20	1.25%
18	600005	G 武钢	1,746,913	4,961,232.92	1.10%
19	600015	G 华夏	1,085,985	4,897,792.35	1.08%
20	600786	东方锅炉	194,150	4,849,867.00	1.07%
21	600832	G 明珠	462,376	4,739,354.00	1.05%
22	600583	G 海油	204,388	4,680,485.20	1.03%
23	600177	G 雅戈尔	724,377	4,570,818.87	1.01%
24	600037	G 歌华	309,367	4,560,069.58	1.01%
25	600383	金地集团	518,766	4,445,824.62	0.98%
26	600001	G 邯钢	1,062,579	4,175,935.47	0.92%

27	600642	G 申能	656,434	4,030,504.76	0.89%
28	600597	光明乳业	497,062	3,951,642.90	0.87%
29	600879	G 火箭	262,754	3,544,551.46	0.78%
30	600811	G 东方	489,028	3,472,098.80	0.77%
31	600089	G 特变	264,482	3,409,172.98	0.75%
32	600010	G 包钢	1,198,279	3,055,611.45	0.68%
33	600183	G 生益	276,176	3,026,888.96	0.67%
34	600271	G 航信	97,438	2,924,114.38	0.65%
35	600188	G 兖煤	398,311	2,907,670.30	0.64%
36	600660	G 福耀	341,745	2,774,969.40	0.61%
37	600649	G 原水	489,061	2,768,085.26	0.61%
38	600085	G 同仁堂	156,749	2,565,981.13	0.57%
39	600011	G 华能	507,772	2,554,093.16	0.56%
40	600350	G 鲁高速	690,342	2,519,748.30	0.56%
41	600688	上海石化	399,012	2,481,854.64	0.55%
42	600269	G 赣粤	248,472	2,439,995.04	0.54%
43	600631	G 百联	303,248	2,435,081.44	0.54%
44	600316	洪都航空	70,000	2431100	0.54%
45	600497	G 驰宏	68,243	2,381,680.70	0.53%
46	600875	G 东方	138,628	2,366,379.96	0.52%
47	600205	山东铝业	128,468	2,343,256.32	0.52%
48	600026	G 中海	363,012	2,316,016.56	0.51%
49	600596	G 新安	207,429	2,304,536.19	0.51%
50	600361	G 综超	123,505	2,230,500.30	0.49%
51	600418	G 江汽	447,221	2,218,216.16	0.49%
52	600176	中国玻纤	300,000	2,217,000.00	0.49%
53	600348	G 国阳	165,644	2,208,034.52	0.49%
54	600236	G 桂冠	359,956	2,174,134.24	0.48%
55	600096	G 云天化	225,348	2,156,580.36	0.48%
56	600360	G 华微	182,000	2143960	0.47%
57	600831	G 广电	128,592	2,097,335.52	0.46%
58	600835	上海机电	263,824	2,086,847.84	0.46%
59	600600	青岛啤酒	163,449	2,023,498.62	0.45%
60	600550	G 天威	91,725	2,006,943.00	0.44%
61	600270	外运发展	183,964	2,005,207.60	0.44%
62	600018	G 上港	115,585	1,982,282.75	0.44%
63	600331	G 宏达	116,828	1,976,729.76	0.44%
64	600456	G 宝钛	41,000	1,955,290.00	0.43%
65	600006	东风汽车	494,522	1,928,635.80	0.43%
66	600031	G 三一	132,320	1,904,084.80	0.42%
67	600296	兰州铝业	217,589	1,901,727.86	0.42%
68	600004	G 穗机场	273,647	1,879,954.89	0.42%
69	600123	G 兰花	140,000	1,820,000.00	0.40%

70	600895	G 张江	400,047	1,796,211.03	0.40%
71	600585	G 海螺	129,725	1,788,907.75	0.40%
72	600132	重庆啤酒	70,000	1,738,100.00	0.38%
73	600970	G 中材	63,877	1,714,458.68	0.38%
74	600627	上电股份	101,300	1,700,827.00	0.38%
75	600521	G 华海	150,000	1,684,500	0.37%
76	600362	G 江铜	145,214	1,648,178.90	0.36%
77	600161	G 天坛	113,013	1,644,339.15	0.36%
78	600489	G 中黄金	86,464	1,629,846.40	0.36%
79	600058	G 五矿	185,728	1,619,548.16	0.36%
80	600643	爱建股份	245,484	1,612,829.88	0.36%
81	600739	G 成大	134,912	1,602,754.56	0.35%
82	600808	G 马钢	544,181	1,561,799.47	0.35%
83	600035	楚天高速	315,140	1,550,488.80	0.34%
84	600138	G 中青旅	200,240	1,531,836.00	0.34%
85	600426	G 恒升	164,747	1,500,845.17	0.33%
86	600428	G 中远	206,361	1,425,954.51	0.32%
87	600779	G 全兴	194,636	1,422,789.16	0.31%
88	600601	方正科技	355,608	1,422,432.00	0.31%
89	600500	G 中化	241,660	1,367,795.60	0.30%
90	600718	G 东软	112,467	1,346,229.99	0.30%
91	600598	G 北大荒	287,584	1,302,755.52	0.29%
92	600675	G 中企	265,106	1,301,670.46	0.29%
93	600012	G 皖通	237,405	1,281,987.00	0.28%
94	600535	G 天士力	76,264	1,280,472.56	0.28%
95	600022	G 济钢	301,524	1,275,446.52	0.28%
96	600663	G 陆家嘴	175,267	1,263,675.07	0.28%
97	600267	G 海正	192,972	1,250,458.56	0.28%
98	600475	G 华光	132,443	1,217,151.17	0.27%
99	600151	G 航天	85,323	1,210,733.37	0.27%
100	600997	G 开滦	162,247	1,207,117.68	0.27%
101	600812	华北制药	377,167	1,199,391.06	0.27%
102	600008	G 首创	242,639	1,186,504.71	0.26%
103	600033	G 闽高速	145,327	1,180,055.24	0.26%
104	600460	G 士兰微	119,976	1179364.08	0.26%
105	600584	G 苏长电	144,159	1,174,895.85	0.26%
106	600508	G 上能	165,124	1,174,031.64	0.26%
107	600824	G 益民	190,000	1,170,400.00	0.26%
108	600639	G 金桥	162,886	1,154,861.74	0.26%
109	600060	G 海信	181,122	1,153,747.14	0.25%
110	600282	南钢股份	290,540	1,112,768.20	0.25%
111	600027	G 华电电	310,650	1,099,701.00	0.24%
112	600256	G 广汇	197,224	1,096,565.44	0.24%

113	600029	南方航空	392,508	1,075,471.92	0.24%
114	600062	G 双鹤	155,264	1,023,189.76	0.23%
115	600825	华联超市	90,400	996,208.00	0.22%
116	600289	G 信通	85,604	990,438.28	0.22%
117	600088	G 中视	68,117	987,696.50	0.22%
118	600886	G 华靖	153,504	925,629.12	0.20%
119	600322	G 天房	180,000	885,600.00	0.20%
120	600823	世茂股份	160,202	820,234.24	0.18%
121	600110	G 英华	101,200	819,720.00	0.18%
122	600317	G 营口港	100,199	819,627.82	0.18%
123	600533	G 栖霞	72,800	812,448.00	0.18%
124	600498	G 烽火	105,149	806,492.83	0.18%
125	600231	G 凌钢	206,494	764,027.80	0.17%
126	600748	G 实发展	120,284	737,340.92	0.16%
127	600854	G 春兰	141,328	723,599.36	0.16%
128	600797	G 网新	200,496	717,775.68	0.16%
129	600674	G 川投	130,000	715,000.00	0.16%
130	600436	G 片仔癀	37,910	694,132.10	0.15%
131	600780	G 通宝	215,462	667,932.20	0.15%
132	600635	G 大众	180,620	635,782.40	0.14%
133	600971	G 恒 源	65,952	626,544.00	0.14%
134	600690	G 海尔	129,749	607,225.32	0.13%
135	600171	G 贝岭	100,180	551,991.80	0.12%
136	600581	G 八一	173,434	516,833.32	0.11%
137	600352	G 龙盛	119,310	514,226.10	0.11%
138	600399	G 抚钢	143,069	492,157.36	0.11%
139	600169	G 太重	80,146	474,464.32	0.10%
140	600135	乐凯胶片	97,367	463,466.92	0.10%
141	600325	G 华发	60,033	447,245.85	0.10%
142	600020	G 中原	105,506	437,849.90	0.10%
143	600408	G 安泰	85,774	431,443.22	0.10%
144	600469	G 风神	80,000	420,800.00	0.09%
145	600961	G 株冶	47,045	397,530.25	0.09%
146	600548	G 深高速	100,132	395,521.40	0.09%
147	600482	G 风帆	54,900	380,457.00	0.08%
148	600345	G 长江	44,180	379,064.40	0.08%
149	600220	G 苏阳光	64,241	366,816.11	0.08%
150	600266	G 城建	63,781	362,913.89	0.08%
151	600196	G 复星	54,102	359,237.28	0.08%
152	600756	G 鲁浪潮	48,060	343,629.00	0.08%
153	600339	G 天利	81,700	333,336.00	0.07%
154	600210	G 紫江	95,597	251,420.11	0.06%
155	600602	G 电子	66,771	232,363.08	0.05%

156	600333	长春燃气	34,204	207,960.32	0.05%
157	600166	G 福田	64,311	167,208.60	0.04%
158	600839	G 长虹	45,541	164,403.01	0.04%
159	600863	G 蒙电	47,407	139,850.65	0.03%
160	600153	G 建发	25,234	127,179.36	0.03%
161	600115	东方航空	40,393	115,927.91	0.03%
162	600591	G 上航	30,989	90,797.77	0.02%
163	600880	G 博瑞	6,073	90,730.62	0.02%
164	600186	莲花味精	27,848	80,759.20	0.02%
165	600578	G 京能	12,885	61,848.00	0.01%
166	600021	G 上电	6,501	29,969.61	0.01%
167	600100	G 同方	2,234	20,441.10	0.00%
168	600328	G 兰太	2,558	15,117.78	0.00%
169	600129	G 太极	856	4,793.60	0.00%
170	600398	G 凯诺	951	4,783.53	0.00%
171	600770	G 综艺	459	4,328.37	0.00%
172	600073	G 梅林	569	4,017.14	0.00%
173	600130	G 波导	571	3,077.69	0.00%
174	600098	G 广控	544	2,502.40	0.00%
175	600637	G 上广电	480	2,145.60	0.00%
176	600247	G 物华	300	1,050.00	0.00%
177	600851	G 海欣	145	565.5	0.00%
		股票投资合计		415,355,404.94	91.7614%

(四) 报告期内股票投资组合的重大变动

1、报告期内累计买入价值超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计买入金额	占期初净值比 (%)
1	600795	国电电力	9,980,394.32	1.76%
2	600011	华能国际	8,543,701.70	1.50%
3	600309	G 万华	7,705,393.64	1.36%
4	600005	G 武钢	6,425,022.58	1.13%
5	600362	G 江铜	5,897,091.85	1.04%
6	600010	G 包钢	5,803,165.42	1.02%
7	600028	中国石化	5,768,781.67	1.02%
8	600739	G 成大	5,724,517.13	1.01%
9	600688	上海石化	5,575,628.02	0.98%
10	600348	G 国阳	5,559,877.06	0.98%
11	600600	青岛啤酒	5,070,196.67	0.89%
12	600001	G 邯钢	4,733,045.86	0.83%
13	600036	G 招行	4,378,694.21	0.77%

14	600205	山东铝业	4,170,144.74	0.73%
15	600675	中华企业	3,993,428.57	0.70%
16	600027	G 华电电	3,991,379.71	0.70%
17	600649	G 原水	3,735,964.68	0.66%
18	600596	G 新安	3,684,238.50	0.65%
19	600008	首创股份	3,599,087.70	0.63%
20	600009	G 沪机场	3,587,593.43	0.63%

## 2、报告期内累计卖出价值超期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计卖出金额	占期初净值比(%)
1	600050	G 联通	22,357,039.01	3.94%
2	600028	中国石化	16,321,296.09	2.87%
3	600019	G 宝钢	14,818,619.62	2.61%
4	600900	G 长电	14,172,060.21	2.49%
5	600362	G 江铜	11,757,867.86	2.07%
6	600688	上海石化	10,350,851.89	1.82%
7	600309	G 万华	10,276,941.66	1.81%
8	600795	国电电力	9,829,399.02	1.73%
9	600011	G 华能	9,821,992.13	1.73%
10	600000	G 浦发	9,554,139.12	1.68%
11	600018	G 上港	9,550,675.51	1.68%
12	600016	G 民生	9,343,569.07	1.64%
13	600036	G 招行	9,148,778.55	1.61%
14	600008	G 首创	9,101,755.75	1.60%
15	600005	G 武钢	9,091,067.86	1.60%
16	600519	G 茅台	8,416,708.84	1.48%
17	600009	G 沪机场	7,539,866.11	1.33%
18	600030	G 中信	7,511,327.69	1.32%
19	600015	G 华夏	7,382,981.76	1.30%
20	600205	山东铝业	7,090,115.48	1.25%

## 3 报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：元

买入股票成本总额	卖出股票收入总额
303,101,094.07	602,040,920.85

## (五) 报告期末按券种分类的债券投资组合

	债券类别	债券市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	国家债券投资	9,995,000.00	2.2081
2	央行票据投资	0.00	0.00%
3	企业债券投资	0.00	0.00%

4	金融债券投资	0.00	0.00%
5	可转换债投资	0.00	0.00%
合计		9,995,000.00	2.2081%

(六) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券名称	市 值	市值占基金资产净值比例
1	06 国债 08	9,995,000.00	2.2081%

(七) 投资组合报告附注

- 1、 本报告期内, 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, 在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。
- 2、 本基金投资的前十名股票中, 不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
- 3、 按照股权分置改革被动持有和主动投资两种类别
  - (1) 报告期末所有权证明细  
无
  - (2) 报告期内获得权证明细

序号	名称	权证代码	数量	市 值	市值占基金净值 比例%	获取方式
1	原 水 CTP1	580994	405,353	-	-	被动
2	万 华 HXP1	580993	202,062	-	-	被动
3	雅 戈 QCP1	580992	950,164	-	-	被动
4	海 尔 JTP1	580991	613,431	-	-	被动
5	茅 台 JCP1	580990	546,413	-	-	被动
6	邯 钢 JTB1	580003	905,632	-	-	被动
7	长 电 CWB1	580007	400,667	-	-	被动
8	首 创 JTB1	580004	60,126	-	-	被动

9	包 钢 JTB1	580002	866,358	-	-	被动
10	雅 戈 QCB1	580006	135,738	-	-	被动
11	万 华 HXB1	580005	134,708	-	-	被动
12	包 钢 JTP1	580995	866,358	-	-	被动
13	沪 场 JTP1	580996	609,424	-	-	被动
14	招 行 CMP1	580997	2,246,437	-	-	被动

本报告期内，本基金未对权证进行主动投资。

#### 4、基金其他资产的构成

其他资产	金额（元）
保证金	321,849.12
应收股利	283,023.63
应收利息	13,113.98
应收申购款	19,719,700.00
买入返售证券	0.00
待摊费用	201,934.44
合计	20,539,621.17

#### 5、本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无

#### 6、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券明细

无

#### 7、本报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无

### 七、基金份额持有人情况

#### （一）报告期末基金份额持有人户数

报告期末基金份额持有人户数：	9,014
报告期末平均每户持有的基金份额：	40,002.20

#### （二）报告期末基金份额持有人结构

项目	数量	占总份额的比例
基金份额总额:	360,579,873.81	100%
其中:机构投资者持有的基金份额	213,998,912.30	59.35%
个人投资者持有的基金份额	146,580,961.51	40.65%

## 八、开放式基金份额变动情况

本基金份额变动情况如下:

单位:份

基金合同生效日的基金份额总额	1,929,789,525.65
本报告期期初基金份额总额	688,385,366.49
本报告期期间总申购份额	37,084,482.26
本报告期期间总赎回份额	364,889,974.94
本报告期期末基金份额总额	360,579,873.81

## 九、重大事件揭示

1、本报告期内没有召开基金份额持有人大会。

2、经中国证券监督管理委员会证监基金字〔2006〕13号文批准,基金管理人名称由“天同基金管理有限公司”变更为“万家基金管理有限公司”;另经中国证券监督管理委员会基金部批准,本基金名称由原“天同180指数证券投资基金”更名为“万家180指数证券投资基金”。

上述更名事项,基金管理人于2006年2月20日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》发布了公告。

3、基金管理人董事变动:

经万家基金管理有限公司2006年第一次临时股东会审议批准,公司股东会同意马志刚先生、张建伟先生辞去董事职务,同意王晓冬女士、李方先生辞去独立董事职务;选举鲁国锋先生为公司董事,选举吴育华先生为公司独立董事。该项董事变动事宜,我公司已向中国证监会上海监管局备案。

4、基金经理变动:

经万家基金管理有限公司第一届第二十七次董事会审议批准,自2006年2月起由潘江先生担任本基金基金经理,免去肖侃宁先生本基金基金经理职务。上述事项,我公司已向中国证券

监督管理委员会上海监管局备案，并于 2006 年 4 月 29 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》发布了公告。

5、本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

6、本报告期内基金的投资组合策略的变动情况：

经基金管理人与基金托管人商定，按照本基金基金合同的规定，从 2006 年 1 月 1 日起调整本基金的投资比例限制，具体为：

(1) 本基金投资于股票的比例，不得高于基金资产净值的 95%；

(2) 本基金持有到期日在一年以内的政府债券或者现金比例不低于基金资产净值的 5%。

(3) 本基金投资于上证 180 指数成份股的比重不低于基金资产净值的 90%，并尽量用基金净值的 95%资金进行标准指数化投资，追求与被跟踪的目标指数的最大拟合程度。

同时本基金的业绩比较基准变更为 95% 的上证 180 指数收益率加 5% 的银行同业存款利率。

7、本报告期内未进行收益分配。

8、本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

9、本基金的基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员未有受到监管部门稽查或处罚的情形。

10、基金租用证券公司专用交易席位的有关情况：

本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字[1998]29 号）的有关规定要求及本基金管理人选择券商的标准（通过比较多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平），本基金管理人择定从以下证券经营机构租用基金交易专用席位：国泰君安证券、中国银河证券、招商证券、天同证券、华夏证券、海通证券、东方证券、平安证券、东吴证券、齐鲁证券。

本报告期内，各席位券商股票、国债及回购交易和佣金情况如下：

(1) 股票交易情况与佣金情况：

序号	券商名称	股票交易量（元）	占交易量比例	佣金（元）	占佣金总量比例
1	国泰君安	154,009,371.44	17.01%	126,287.74	17.02%

2	海通证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
3	华夏证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
4	天同证券	163,915,571.92	18.10%	134,410.35	18.11%
5	银河证券	238,500,913.12	26.34%	195,536.59	26.35%
6	东方证券	149,347,555.41	16.49%	122,291.87	16.48%
7	东吴证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
8	山东齐鲁证券	199,666,665.44	22.05%	163,546.46	22.04%
9	招商证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
10	平安证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
	合计	905,440,077.33	100.00%	742,073.01	100.00%

(2) 债券及回购交易情况:

序号	券商名称	债券交易量 (元)	占交易量比例	回购交易量 (元)	占交易量比例
1	国泰君安	0.00	0.00%	0.00	0.00%
2	海通证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
3	华夏证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
4	天同证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
5	银河证券	3,352,995.4	14.37%	0.00	0.00%
6	东方证券	2,100,200	9.00%	15,000,000	100.00%
7	东吴证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
8	山东齐鲁证券	17,880,246	76.63%	0.00	0.00%
9	招商证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
10	平安证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
	合计	23,333,441.4	100.00%	15,000,000	100.00%

(3) 权证交易情况:

序号	券商名称	权证交易量	占交易量比例		
1	国泰君安	2,261,984.21	17.03%		

2	天同证券	3,988,856.72	30.03%		
3	银河证券	2,438,626.25	18.36%		
4	山东齐鲁证券	4,592,018.96	34.57%		
	合计	13,281,486.14	100.00%		

## 十、备查文件

### (一) 备查文件目录

- 1、中国证监会批准万家 180 指数证券投资基金发行及募集的文件。
- 2、《万家 180 指数证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家 180 指数证券投资基金托管协议》。
- 4、万家基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金净值、季度报告、更新招募说明书及其他临时公告。
- 6、万家 180 指数证券投资基金 2006 年半年度报告原文。

### (二) 存放地点

上海市源深路273号

### (三) 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人万家基金管理有限公司

客户服务中心电话：68644599

网址：www.wjasset.com

万家基金管理有限公司

2006年8月26日