

万家 180 指数证券投资基金 2011 年第三季度报告

2011 年 9 月 30 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

报告送出日期：2011 年 10 月 25 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 2011 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	9,651,114,267.76 份
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
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2011年7月1日至2011年9月30日)
1. 本期已实现收益	-66,838,476.37
2. 本期利润	-959,428,958.34
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0998
4. 期末基金资产净值	5,426,721,130.47
5. 期末基金份额净值	0.5623

注:1、上述基金业绩指标不包括持有人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。

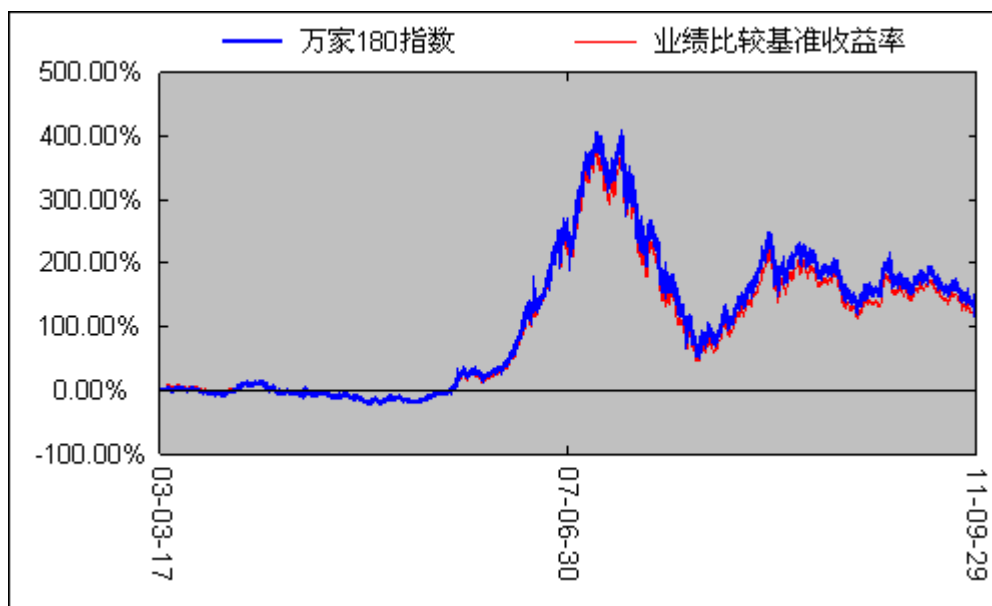
2、上表中本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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的比较

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 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-15.06%	1.28%	-14.93%	1.28%	-0.13%	0.00%

3.2.2 自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: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

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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、 权益投资 部副总监	2010 年 3 月 31 日	-	16 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、南方总部副总经理等职,2002 年至 2010 年 3 月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。
欧庆铃	本基金基金 经理、 万家精选 基金基金 经理、本 公司投资 管理部总 监	2007 年 5 月 31 日	2011 年 8 月 13 日	11 年	理学博士,曾任华南理工大学应用数学系副教授、广州证券有限责任公司任研究中心常务副总经理、金鹰基金管理有限公司研究副总监、万家公用事业基金、万家双引擎基金基金经理等职

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本公司严格遵循公平交易的原则,在投资管理活动中公平对待不同基金品种,无直接或间接在不同投资组合之间进行利益输送的行为,报告期内无异常交易。

公司根据中国证监会发布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,制订和完善了公平交易内部控制制度,通过制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时,公司通过对投资交易行为的监控、分析评估来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

在本报告期,我公司没有和本基金投资风格相似的其他投资组合品种。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内无异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内市场大幅下跌,本基金作为被动操作的指数基金,严格执行基金合同规定的投资策略,按照规定的投资策略和方法进行投资操作,努力拟合标的指数,减小跟踪误差。

本基金报告期内日跟踪误差为 0.01%,符合基金合同规定的日跟踪误差低于 0.5%的规定。跟踪误差主要是由于基金申购赎回、标的指数成分股调整等因素所造成。

本基金标的指数所代表的大中盘蓝筹股具有一定的估值优势,有望在今后一段时间内取得较稳定的市场表现。本基金管理人将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,为基金份额持有人谋求长期、稳定回报。

4.5 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 0.5623 元,本报告期份额净值增长率为-15.06%,业绩比较基准收益率-14.93%。

§ 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	5,150,821,393.04	94.77
	其中:股票	5,150,821,393.04	94.77
2	固定收益投资	119,310,585.00	2.20
	其中:债券	119,310,585.00	2.20
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	161,192,868.25	2.97
6	其他资产	3,489,065.81	0.06
7	合计	5,434,813,912.10	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	34,481,782.20	0.64
B	采掘业	757,947,777.92	13.97
C	制造业	1,319,310,997.95	24.31
C0	食品、饮料	221,224,963.13	4.08
C1	纺织、服装、皮毛	33,773,062.96	0.62
C2	木材、家具	0.00	0.00
C3	造纸、印刷	0.00	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	60,806,067.03	1.12
C5	电子	36,047,712.51	0.66
C6	金属、非金属	368,121,410.60	6.78
C7	机械、设备、仪表	444,274,559.70	8.19
C8	医药、生物制品	136,469,124.30	2.51
C99	其他制造业	18,594,097.72	0.34
D	电力、煤气及水的生产和供应业	123,353,661.94	2.27
E	建筑业	178,764,712.68	3.29
F	交通运输、仓储业	196,636,616.13	3.62
G	信息技术业	167,992,894.56	3.10
H	批发和零售贸易	63,973,991.19	1.18
I	金融、保险业	1,924,806,820.85	35.47
J	房地产业	244,856,614.16	4.51
K	社会服务业	31,622,044.38	0.58
L	传播与文化产业	8,650,749.06	0.16
M	综合类	98,422,730.02	1.81
	合计	5,150,821,393.04	94.92

5.3 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（%）
1	600036	招商银行	19,215,997	212,528,926.82	3.92
2	600016	民生银行	35,090,296	193,698,433.92	3.57
3	601318	中国平安	5,191,231	174,269,624.67	3.21
4	601328	交通银行	35,666,313	159,785,082.24	2.94
5	600000	浦发银行	17,405,885	148,646,257.90	2.74
6	601166	兴业银行	11,742,118	145,484,842.02	2.68
7	601088	中国神华	5,218,698	132,241,807.32	2.44
8	600519	贵州茅台	645,077	122,945,225.43	2.27
9	600030	中信证券	10,816,975	121,690,968.75	2.24
10	600837	海通证券	12,789,548	101,165,324.68	1.86

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	---------	--------------

1	国家债券	119,310,585.00	2.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	119,310,585.00	2.20

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010203	02 国债(3)	890,340	89,256,585.00	1.64
2	010112	21 国债(12)	300,000	30,054,000.00	0.55

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	71,849.12
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	847,742.17
4	应收利息	1,895,659.81
5	应收申购款	673,814.71
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
8	其他	0.00
9	合计	3,489,065.81

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	9,537,870,597.19
报告期期间基金总申购份额	295,036,737.93
报告期期间基金总赎回份额	181,793,067.36
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.00
报告期期末基金份额总额	9,651,114,267.76

§ 7 备查文件目录

7.1 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、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程
- 4、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、更新招募说明书及其他临时公告
- 5、万家 180 指数证券投资基金 2011 年第三季度报告原文
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议

7.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人网站：www.wjasset.com

7.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司

2011 年 10 月 25 日