

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: 2011年8月26日

重要提示

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。

基金管理人中国银行股份有限公司根据基金合同规定,于2011年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或保证最低收益。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。
本报告期财务资料未经审计。

本报告自2011年1月1日起至2011年6月30日止。

基金简介

Table with 2 columns: 基金名称, 基金简称, 基金代码, etc. Details for 万家180指数证券投资基金.

Table with 2 columns: 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征. Details about the fund's investment strategy and performance benchmarks.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

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

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

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

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

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

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

万家180指数证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

2011年8月24日 半年度财务会计报告 (未经审计)

6.1 资产负债表
基金主体: 万家180指数证券投资基金
报告截止日: 2011年6月30日

单位: 人民币元
资产: 银行存款 119,206,734.42 118,017,262.05
结算备付金 2,041,875.85 2,790,142.50

负债: 应付债券 199,640,000.00 305,265,708.00
应付赎回款 2,462,060.28 1,750,621.76

所有者权益: 实收基金 9,537,870,597.19 12,250,097,329.54
未分配利润 -3,223,924,496.86 -4,024,486,023.57

注: 报告截止日2011年6月30日, 基金份额净值0.6620, 基金份额总额9,537,870,597.19份。

6.2 利润表
基金主体: 万家180指数证券投资基金
报告截止日: 2011年1月1日至2011年6月30日

单位: 人民币元
一、收入 81,089,762.34 -2,060,233,572.79
1. 利息收入 4,783,663.56 2,757,523.63

2. 公允价值变动收益(损失) 381,587,875.34 -1,922,180,602.10

3. 其他收入(损失) 2,813,518.77 1,127,780.03

减: 公允价值变动收益(损失) 30,190,465.01 44,516,538.95

二、费用 54,200,159.85 33,548,448.79

三、净利润 26,899,297.33 30,899,297.33

注: 1. 本报告期未发生与关联方进行相同同业市场的债券 回购交易。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
基金主体: 万家180指数证券投资基金
报告截止日: 2011年1月1日至2011年6月30日

单位: 人民币元
项目 实收基金 未分配利润 所有者权益合计

2010年12月31日 9,537,870,597.19 -3,223,924,496.86 6,313,946,100.33

2011年6月30日 12,250,097,329.54 -4,024,486,023.57 8,225,611,305.97

注: 1. 本报告期未发生与关联方进行相同同业市场的债券 回购交易。

6.4 关联方关系及其交易
基金主体: 万家180指数证券投资基金
报告截止日: 2011年1月1日至2011年6月30日

单位: 人民币元
关联方名称 本期 上期

中国银行股份有限公司 119,206,734.42 118,017,262.05

注: 1. 本报告期未发生与关联方进行相同同业市场的债券 回购交易。

6.4.2 关联方关系及其交易
基金主体: 万家180指数证券投资基金
报告截止日: 2011年1月1日至2011年6月30日

单位: 人民币元
关联方名称 本期 上期

中国银行股份有限公司 119,206,734.42 118,017,262.05

注: 1. 本报告期未发生与关联方进行相同同业市场的债券 回购交易。

6.4.3 关联方关系及其交易
基金主体: 万家180指数证券投资基金
报告截止日: 2011年1月1日至2011年6月30日

单位: 人民币元
关联方名称 本期 上期

中国银行股份有限公司 119,206,734.42 118,017,262.05

注: 1. 本报告期未发生与关联方进行相同同业市场的债券 回购交易。

6.4.4 关联方关系及其交易
基金主体: 万家180指数证券投资基金
报告截止日: 2011年1月1日至2011年6月30日

单位: 人民币元
关联方名称 本期 上期

中国银行股份有限公司 119,206,734.42 118,017,262.05

注: 1. 本报告期未发生与关联方进行相同同业市场的债券 回购交易。

6.4.5 关联方关系及其交易
基金主体: 万家180指数证券投资基金
报告截止日: 2011年1月1日至2011年6月30日

单位: 人民币元
关联方名称 本期 上期

中国银行股份有限公司 119,206,734.42 118,017,262.05

注: 1. 本报告期未发生与关联方进行相同同业市场的债券 回购交易。

6.4.6 关联方关系及其交易
基金主体: 万家180指数证券投资基金
报告截止日: 2011年1月1日至2011年6月30日

单位: 人民币元
关联方名称 本期 上期

中国银行股份有限公司 119,206,734.42 118,017,262.05

注: 1. 本报告期未发生与关联方进行相同同业市场的债券 回购交易。

6.4.7 关联方关系及其交易
基金主体: 万家180指数证券投资基金
报告截止日: 2011年1月1日至2011年6月30日

单位: 人民币元
关联方名称 本期 上期

中国银行股份有限公司 119,206,734.42 118,017,262.05

注: 1. 本报告期未发生与关联方进行相同同业市场的债券 回购交易。

6.4.8 关联方关系及其交易
基金主体: 万家180指数证券投资基金
报告截止日: 2011年1月1日至2011年6月30日

单位: 人民币元
关联方名称 本期 上期

中国银行股份有限公司 119,206,734.42 118,017,262.05

注: 1. 本报告期未发生与关联方进行相同同业市场的债券 回购交易。

6.4.9 关联方关系及其交易
基金主体: 万家180指数证券投资基金
报告截止日: 2011年1月1日至2011年6月30日

单位: 人民币元
关联方名称 本期 上期

中国银行股份有限公司 119,206,734.42 118,017,262.05

注: 1. 本报告期未发生与关联方进行相同同业市场的债券 回购交易。

6.4.10 关联方关系及其交易
基金主体: 万家180指数证券投资基金
报告截止日: 2011年1月1日至2011年6月30日

单位: 人民币元
关联方名称 本期 上期

中国银行股份有限公司 119,206,734.42 118,017,262.05

注: 1. 本报告期未发生与关联方进行相同同业市场的债券 回购交易。

6.4.11 关联方关系及其交易
基金主体: 万家180指数证券投资基金
报告截止日: 2011年1月1日至2011年6月30日

单位: 人民币元
关联方名称 本期 上期

中国银行股份有限公司 119,206,734.42 118,017,262.05

注: 1. 本报告期未发生与关联方进行相同同业市场的债券 回购交易。

6.4.12 关联方关系及其交易
基金主体: 万家180指数证券投资基金
报告截止日: 2011年1月1日至2011年6月30日

单位: 人民币元
关联方名称 本期 上期

中国银行股份有限公司 119,206,734.42 118,017,262.05

注: 1. 本报告期未发生与关联方进行相同同业市场的债券 回购交易。

金额单位: 人民币元

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

注: 1. 本报告期, 本基金的投资资产全部为指数化投资, 无股权投资。

投资者欲了解本报告期内基金投资组合的所有股票持仓, 应查阅本基金的半年度报告。

7.4 报告期内大额股票买卖的重大变动
7.4.1 累计买入金额超期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 1. 买入金额"按买卖成交金额(成交金额)孰低"原则, 不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 1. 买入金额"按买卖成交金额(成交金额)孰低"原则, 不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 1. 买入金额"按买卖成交金额(成交金额)孰低"原则, 不考虑相关交易费用。

7.4.4 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 1. 买入金额"按买卖成交金额(成交金额)孰低"原则, 不考虑相关交易费用。

7.4.5 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 1. 买入金额"按买卖成交金额(成交金额)孰低"原则, 不考虑相关交易费用。

7.4.6 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 1. 买入金额"按买卖成交金额(成交金额)孰低"原则, 不考虑相关交易费用。

7.4.7 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 1. 买入金额"按买卖成交金额(成交金额)孰低"原则, 不考虑相关交易费用。

7.4.8 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 1. 买入金额"按买卖成交金额(成交金额)孰低"原则, 不考虑相关交易费用。

7.4.9 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 1. 买入金额"按买卖成交金额(成交金额)孰低"原则, 不考虑相关交易费用。

7.4.10 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 1. 买入金额"按买卖成交金额(成交金额)孰低"原则, 不考虑相关交易费用。

7.4.11 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 1. 买入金额"按买卖成交金额(成交金额)孰低"原则, 不考虑相关交易费用。

7.4.12 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 1. 买入金额"按买卖成交金额(成交金额)孰低"原则, 不考虑相关交易费用。

7.4.13 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 1. 买入金额"按买卖成交金额(成交金额)孰低"原则, 不考虑相关交易费用。

7.4.14 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 1. 买入金额"按买卖成交金额(成交金额)孰低"原则, 不考虑相关交易费用。

7.4.15 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 1. 买入金额"按买卖成交金额(成交金额)孰低"原则, 不考虑相关交易费用。

7.4.16 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 1. 买入金额"按买卖成交金额(成交金额)孰低"原则, 不考虑相关交易费用。

7.4.17 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 1. 买入金额"按买卖成交金额(成交金额)孰低"原则, 不考虑相关交易费用。

7.4.18 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 1. 买入金额"按买卖成交金额(成交金额)孰低"原则, 不考虑相关交易费用。

7.4.19 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 1. 买入金额"按买卖成交金额(成交金额)孰低"原则, 不考虑相关交易费用。

7.4.20 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 1. 买入金额"按买卖成交金额(成交金额)孰低"原则, 不考虑相关交易费用。

7.4.21 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 1. 买入金额"按买卖成交金额(成交金额)孰低"原则, 不考虑相关交易费用。

7.4.22 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

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: 2011年8月26日