万家和谐增长混合型证券投资基金

2012 第三季度 报告

2012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:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2012年10月24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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年10月23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2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家和谐增长混合	
基金主代码	519181	
交易代码	519181	519182
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年11月30日	
报告期末基金份额总额	3,282,131,583.76份	
投资目标	本基金通过有效配置股票、债券投资比例,平衡长期买入持有和事件驱动投资的优化选择策略,控制投资风险,谋取基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金最大特点是突出和谐增长,主要包含二层含义:一、资产配置的和谐,通过有效配置股票、债券资产比例,谋求基金资产在股票、债券投资中风险、收益的和谐平衡;二、长期买入持有和事件驱动投资的和谐,通过对不同行业、不同股票内在价值与市场价格的偏离程度和其市场价格向内在价值的回归速度的分析,谋求基金资产在不同行业和不同股票投资中长期投资和事件驱动投资的和谐平衡。	
业绩比较基准	沪深300指数×65%+中证全债指数×30%+同业存款利率×5%	
风险收益特征	本基金是混合型基金,其预期收益及风险水平介于股票型基金与债券型基金之间,属于中等风险收益水平基金。	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	

§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(2012年7月1日至2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-56,015,845.55
2.本期利润	-80,457,362.34
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0244
4.期末基金资产净值	1,536,523,030.78
5.期末基金份额净值	0.4681

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;

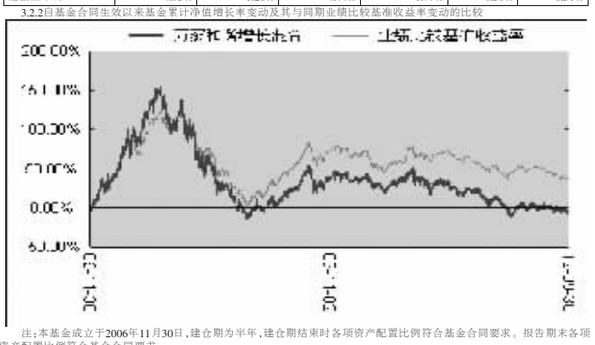
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 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	-4.95%	1.28%	-4.44%	0.77%	-0.51%	0.51%

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2006年11月30日,建仓期为半年,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合基金合同要求。

§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		
吕宜振	本基金基金经理,公司副总经理	2011年9月30日	-	11年	博士学位,曾任易方达基金管理有限公司研究主管、信诚基金管理有限公司研究总监、天弘基金管理有限公司投资总监等职,2011年5月起加入本公司,2011年8月起担任公司副总经理。
宁冬莉	本基金基金经理	2011年6月3日	-	6年	博士学位,曾任东方证券管理有限公司宏观与股票策略高级分析师。2008年4月加入万家基金管理有限公司,曾担任行业研究员、基金经理助理。

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

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。

本报告期内无下列情况: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%。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

2012年三季度,市场震荡下行,投资者情绪受到半年报总体不达预期以及对经济是否见底怀疑的背景下,情绪更加悲观,成交量萎缩。符合之前我们对市场的判断(二季度整体市场在经济下滑与中报业绩不及预期的影响下继续震荡,见三季度报告)。我们总体认为整体宏观背景还暂时不支持股市趋势性好转,但经济逐步探明底部可以对股市形成底部起到支撑作用,在行业表现上较为均衡,信息服务、采掘、医药、有色、电子等行业跌幅较小。

在组合配置上,以轻指数、重个股为角度,选择相对业绩确定、成长性更好的个股和子行业。三季度,经济指标继续下滑,但处于阶段性底部,本基金主要以精选个股为主,另外增加了配置的均衡性,主要超配医药、食品饮料、农业等大消费板块,并增加传媒以及化工,券商,消费电子等周期类行业。

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0.4681元,本报告期份额净值增长率-4.95%,同期业绩比较基准增长率为-4.44%.

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

四季度经济会温和反弹,短期已经出现一些改善的迹象。工业品价格9月份的企稳是一个正面的迹象,尤其是钢铁、水泥价格回升,意味着投资在四季度有可能回稳。三季度的情况是9 月经济增长可能有所企稳,但受到7-8月经济下行的压力,3 季度无论是GDP 增速还是工业企业利润可能仍将环比下滑。在逆周期政策维稳情况下,经济持续回暖,但是否从底部持续向上,目前仍需要数据验证。从中期来看经济复苏仍需依赖货币政策进一步放松;但考虑到地方财政收入不足,融资缺口依然较大。因此,明年经济能否走出复苏之路将取决于地方政府的融资情况。逆周期政策短期内可以促经济回暖,中国经济结构性失衡的现状无法改善,甚至会延缓经济结构再平衡的时点。中国经济存在内外结构失衡,投资消费结构失衡,产业结构失衡,收入分配结构失衡等深层次问题。在约束增长的制度改革之前,结构性失衡问题仍将长期存在,经济增速低水平(7%-8%)会是常态。

四季度是否真实经济见底是判断股市企稳的最重要依据,目前初步判断是阶段见底,未来仍需进一步验证,所以股市目前来看是有支撑的,下跌空间不大。根据已知信息来看总体判断,从景气度来看,周期类行业如建材行业已经在底部阶段回暖阶段,工程机械三季度最差,四季度可能环比趋好。上游有色金属行业仍在恶化,消费如服装,餐饮,旅游,零售,食品饮料继续放缓,但趋势在减弱,信息服务类行业继续放缓。

投资策略偏向均衡配置:首先,稳定成长股仍然是较好的穿越周期的品种。配置方向:(1)医药(中药,保健品),食品饮料,信息服务中业绩稳定增长前景稳定的个股仍值得重点把握;(2)农业养殖(3)传媒,(4)受益于金融改革的券商,保险(5)消费电子(6)节能环保,(7)化工。

§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	1,395,523,637.23	90.36
	其中:股票	1,395,523,637.23	90.36
2	固定收益投资	78,880,000.00	5.11
	其中:债券	78,880,000.00	5.11
	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	67,127,696.82	4.35
6	其他资产	2,819,808.28	0.18
7	合计	1,544,351,142.33	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	23,464,945.85	1.53
B	采掘业	25,532,998.50	1.66
C	制造业	900,163,215.96	58.58
C0	食品、饮料	184,615,819.99	12.02
C1	纺织、服装、皮毛	17,047,347.77	1.11
C2	木材、家具	14,129,990.58	0.92
C3	造纸、印刷	0.00	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	233,410,072.11	15.19
C5	电子	118,077,548.60	7.68
C6	金属、非金属	16,268,178.00	1.06
C7	机械、设备、仪表	167,831,084.91	10.92
C8	医药、生物制品	148,783,174.00	9.68
C99	其他制造业	0.00	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00
E	建筑业	78,752,721.24	5.13
F	交通运输、仓储业	0.00	0.00
G	信息技术业	113,768,457.20	7.40
H	批发和零售贸易	115,454,413.96	7.51
I	金融、保险业	57,373,408.88	3.73
J	房地产业	842,831.40	0.05
K	社会服务业	50,950,540.14	3.32
L	传播与文化产业	29,220,104.10	1.90
M	综合类	0.00	0.00
	合计	1,395,523,637.23	90.82

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	000407	胜利股份	19,000,000	109,250,000.00	7.11
2	002157	正邦科技	8,700,000	81,171,000.00	5.28
3	601886	江河幕墙	4,478,094	78,187,521.24	5.09
4	300170	汉得信息	4,200,000	69,804,000.00	4.54
5	300210	森远股份	4,420,800	65,118,384.00	4.24
6	000963	华东医药	1,699,908	58,646,826.00	3.82
7	002408	齐翔腾达	3,011,685	43,277,913.45	2.82
8	600280	南京中商	1,199,877	43,171,574.46	2.81
9	002456	欧菲光	1,052,782	37,973,846.74	2.47
10	300006	莱美药业	1,949,589	32,558,136.30	2.12

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	78,880,000.00	5.13
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	78,880,000.00	5.13

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	019211	12国债11	800,000	78,880,000.00	5.13

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

报告期末本基金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

报告期末本基金未持有权证。

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 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	558,247.22
5	应收申购款	11,561.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,819,808.28

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金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	3,312,015,744.34
报告期期间基金总申购份额	3,777,362.29
减:报告期期间基金总赎回份额	33,661,522.87
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	3,282,131,583.76

§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和谐增长混合型证券投资基金发行及募集的文件。
2、《万家和谐增长混合型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及其他临时公告。
5、万家和谐增长混合型证券投资基金2012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:<http://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
2012年10月24日

万家180指数证券投资基金

2012 第三季度 报告

2012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:2012年10月24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2012年10月22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2012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	10,071,688,739.64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(2012年7月1日至2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-269,900,379.14
2.本期利润	-360,598,851.53
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0341
4.期末基金资产净值	5,251,462,376.42
5.期末基金份额净值	0.5214

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。

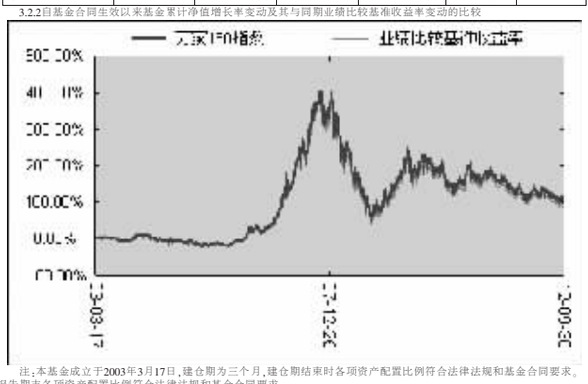
2、上表中本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-5.95%	1.09%	-6.20%	1.09%	0.25%	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	万家180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: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

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。

本报告期内无下列情况: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%。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内市场在经济疲弱的背景下连续下跌,接连创出年内低点,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,按照规定的投资决策程序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0.03%,符合基金合同规定的日拟合偏离度不超过0.5%的规定。跟踪误差主要是由于基金大额申购赎回、禁止投资成分股替代和成分股定期调整等因素造成。

本基金标的指数所代表的大中盘蓝筹股具有较大的估值优势,在经济逐步走稳、市场底部震荡的过程中有望取得较好的市场表现。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0.5214元,报告期基金份额净值增长率为-5.95%,业绩比较基准收益率-6.20%。

§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	4,976,124,764.06	94.58
	其中:股票	4,976,124,764.06	94.58
2	固定收益投资	222,232,092.50	4.22
	其中:债券	222,232,092.50	4.22
	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	57,472,322.52	1.09
6	其他资产	5,447,435.54	0.10
7	合计	5,261,276,614.62	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	30,549,946.96	0.58
B	采掘业	610,257,727.79	11.62
C	制造业	1,258,700,501.33	23.97
C0	食品、饮料	262,239,458.69	4.99
C1	纺织、服装、皮毛	18,702,846.87	0.36
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	62,605,134.70	1.19
C5	电子	56,598,316.84	1.08
C6	金属、非金属	305,130,766.73	5.81
C7	机械、设备、仪表	377,763,773.44	7.19
C8	医药、生物制品	175,660,204.06	3.34
C99	其他制造业	0.00	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	161,171,074.84	3.07
E	建筑业	170,563,640.07	3.25
F	交通运输、仓储业	153,577,162.69	2.92
G	信息技术业	137,008,793.94	2.61
H	批发和零售贸易	57,499,791.90	1.09
I	金融、保险业	2,060,172,533.55	39.23
J	房地产业	247,227,355.67	4.71
K	社会服务业	26,264,534.32	0.50
L	传播与文化产业	13,983,984.10	0.27
M	综合类	49,147,716.90	0.94
	合计	4,976,124,764.06	94.76

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	601318	中国平安	5,193,852	217,830,152.88	4.15
2	600016	民生银行	35,042,287	197,988,921.55	3.77
3	600036	招商银行	19,162,177	194,687,718.32	3.71
4	600519	贵州茅台	643,712	158,224,409.60	3.01
5	601328	交通银行	36,468,511	155,355,856.86	2.96
6	601166	兴业银行	11,700,038	140,517,456.38	2.68
7	600000	浦发银行	17,343,570	127,995,546.60	2.44
8	600030	中信证券	10,826,308	127,642,171.32	2.43
9	600837	海通证券	12,610,139	120,805,131.62	2.30
10	601088	中国神华	5,115,973	117,718,538.73	2.24

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	108,175,832.50	2.06
2	央行票据	48,335,000.00	0.92
3	金融债券	50,040,000.00	0.95
	其中:政策性金融债	50,040,000.00	0.95
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	15,681,260.00	0.30
8	其他	-	-
9	合计	222,232,092.50	4.23

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	020052	12贴债02	1,000,000	98,120,000.00	1.87
2	120305	12进出05	500,000	50,040,000.00	0.95
3	1101088	11央行票据88	500,000	48,335,000.00	0.92
4	113002	工行转债	155,260	15,681,260.00	0.30
5	019202	12国债02	100,210	10,046,052.50	0.19

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	0.00
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	1,661,837.65
4	应收利息	3,552,985.04
5	应收申购款	232,612.85
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
8	其他	0.00
9	合计	5,447,435.54

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	15,681,260.00	0.30

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	10,302,004,898.39
报告期期间基金总申购份额	1,096,187,342.10
减:报告期期间基金总赎回份额	1,326,503,500.85
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	10,071,688,739.64

§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2012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
2012年10月24日

万家公用事业行业股票型证券投资基金(LOF)

2012 第三季度 报告

2012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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2012年10月24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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年10月22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2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家公用事业行业股票(LOF)
基金主代码	161903
基金运作方式	契约型上市开放式基金(LOF)
基金合同生效日	2005年7月15日
报告期末基金份额总额	858,250,088.82份
投资目标	本基金主要运用增强型指数化投资方法,通过主要投资于国内与居民日常生活息息相关的公用事业上市公司所发行的股票,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用指数优化投资方法,基于巨潮公共服务指数成份股的盈利状况、分红水平、价值评估等方面作为研究因素,实施指数增强投资管理,寻找高质量的公用事业上市公司构造股票投资组合,力求实现较高的当期收益和稳健的资本增值。
业绩比较基准	80%×巨潮公共服务指数收益率+20%×同业存款利率
风险收益特征	本基金是一只指数增强股票型基金,主要投资于国内与居民日常生活息息相关的公用事业上市公司股票,长期平均的预期风险和收益高于混合型基金或债券型基金。
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§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(2012年7月1日至2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-17,064,541.22
2.本期利润	-27,690,019.59
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0321
4.期末基金资产净值	460,779,283.46
5.期末基金份额净值	0.5369

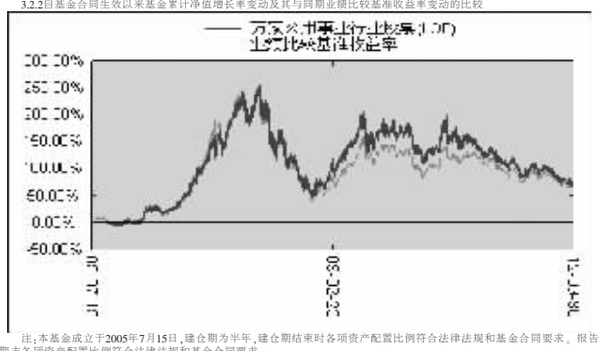
注:(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;(2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 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	-5.64%	1.04%	-4.59%	0.95%	-1.05%	0.09%

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2005年7月15日,建仓期为半年,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		
马云飞	本基金基金经理、万家精选基金基金经理	2012年2月4日	-	7年	硕士学位,曾就职于国投瑞银基金管理有限公司,齐鲁证券有限责任公司。2011年6月起加入万家基金管理有限公司。
朱颖	本基金基金经理、万家双引擎灵活配置基金基金经理	2011年11月11日	-	6年	硕士学位,2006年10月加入万家基金管理有限公司,曾担任行业分析师,基金经理助理。
吴印	本基金基金经理、万家双引擎基金基金经理、万家精选股票型基金基金经理	2011年6月8日	-	6年	硕士学位,2006年加入万家基金,曾担任研究发展部行业分析师、基金经理助理。

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