万家180指数证券投资基金更新招募说明书摘要

（2014年第1号）

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

本基金根据2002年11月27日中国证券监督管理委员会《关于同意天同180指数证券投资基金设立的批复》(证监基金字[2002]88号)的核准,进行募集。本基金的基金合同于2003年3月17日正式生效。

【重要提示】

投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读本基金招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《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》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅本基金的基金合同。

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2014年3月17日,有关财务数据和净值表现截止日为2013年12月31日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:万家基金管理有限公司
住所:上海市浦东新区浦电路360号陆家嘴投资大厦9楼
办公地址:上海市浦东新区浦电路360号陆家嘴投资大厦9楼
法定代表人:毕玉国
总经理:吕宜振
成立日期:2002年8月23日
批准设立机关:中国证券监督管理委员会
批准设立文号:中国证监会证监基金字[2002]44号
组织形式:有限责任公司
注册资本:1亿元人民币
存续期间:持续经营
经营范围:基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。
联系人:兰剑
电话:021-38619810
传真:021-38619888
电子邮箱:lanj@wjasset.com

(二)主要人员情况

1.基金管理人董事会成员

董事长毕玉国先生,中共党员,硕士学历,高级会计师,注册企业风险管理师。历任莱钢股份公司炼铁厂财务科科长,莱钢股份公司财务处成本科科长,莱钢集团财务部副部长,莱钢驻日照钢铁有限公司财务总监,齐鲁证券计划财务部总经理,齐鲁证券副总经理兼财务负责人等职。现任齐鲁证券有限公司党委委员、总经理兼财务负责人。2011年3月起任本公司董事长,现兼任万家共赢资产管理有限公司董事长。

董事马永春先生,政治经济学硕士学位,曾任新疆自治区党委政策研究室科长,新疆通宝投资有限公司总经理,新疆对外经贸集团总经理,新疆天山股份有限公司董事,现任新疆国际实业股份有限公司副董事长兼总经理。

董事吕祥友先生,中共党员,大学本科,硕士学位,高级经济师,曾任莱芜钢铁集团有限公司财务处科长、鲁银投资集团股份有限公司办公室主任兼董事会秘书、天同证券风险处置工作小组托管组成员,现任齐鲁证券有限公司副总经理兼合规总监、董事会秘书、党委组织部部长、人力资源部总经理、鲁证期货有限公司董事。

董事吕宜振先生,中共党员,博士研究生。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,2011年5月起加入本公司,曾任公司副总经理,2012年12月起任公司总经理。

独立董事刘兴云先生,中共党员,管理学博士,教授,曾任山东财政学院会计系副主任、党总支书记、教务长、副院长,中央人民政府驻香港特别行政区联络办公室行政财务部副部长、巡视员兼副部长,现任山东财经大学党委书记兼校长,并从事企业财务管理方向的理论研究。

独立董事陈增敬先生,中国民主建国会成员,博士研究生,教授,曾任山东大学数学院讲师兼副教授,法国国家信息与自动化研究所博士后,加拿大西安大略大学保险系访问学者、兼职教授,山东大学金融研究院(现更名为山东大学齐鲁证券金融研究院)常务副院长兼教授,现任山东大学齐鲁证券金融研究院院长兼数学院副院长、教授。

独立董事骆玉鼎先生,中共党员,研究生,经济学博士,副教授,曾任上海财经大学金融学院银行系讲师,上海财经大学证券期货学院副教授、副院长,美国国际管理研究生院(雷鸟)访问研究员,上海财经大学证券期货学院副院长兼副教授,新疆财经大学金融系支教教师,上海财经大学金融学院副院长、常务副院长,上海财经大学金融学院副教授,现任上海财经大学商学院副院长。

2.基金管理人监事会成员

监事会主席李闽起先生,硕士学位,经济师。曾任宏源证券股份有限公司文艺路营业部客户主管、公司投行部项目经理,新疆国际实业股份有限公司证券事务代表,现任新疆国际实业股份有限公司董事会秘书兼副总经理。

监事崔明朋先生,中共党员,工商管理硕士,经济师,先后任职于山东智星计算机总公司、中创软件、山东山大华特科技股份有限公司,将军控股有限公司。现任山东省国有资产投资控股有限公司项目经理、副部长。

监事兰剑先生,法学硕士,律师、注册会计师,曾在江苏淮安知源律师事务所、上海和华利盛律师事务所从事律师工作,现为本公司信息披露负责人、合规稽核部总监。

监事李丽女士,中共党员,硕士,中级讲师,先后任职于中国工商银行济南分行、济南卓越外语学校、山东中医药大学。2008年3月起任万家基金管理有限公司,现任公司综合管理部总监。

监事蔡鹏鹏女士,本科,先后任职于北京幸福之光商贸有限公司、北方之星数码技术(北京)有限公司、路通资讯香港有限公司,2007年4月起任职于万家基金管理有限公司,现任公司机构理财部副总监。

3.基金管理人高级管理人员

董事长:毕玉国先生(简介请参见基金管理人董事会成员)
总经理:吕宜振先生(简介请参见基金管理人董事会成员)
副总经理:詹志令先生,大学本科,学士学位。1997年至2004年任职于国泰君安证券从事证券营销管理工作;2004年至2005年任职于中银国际证券,任营业部副总经理;2005年至2009年任职于信诚基金管理有限公司,直销部副总监等职;2009年至2011年任职于天弘基金管理有限公司,任机构理财部总经理兼上海分公司总经理;2011年加入本公司,任机构理财部总监、总经理助理。2013年4月起任本公司副总经理。
副总经理:李杰先生,硕士研究生。1994年至2003年任职于国泰君安证券、从事行政管理、机构客户开发等工作;2003年至2007年任职于兴安证券从事营销管理工作;2007年至2011年任职于齐鲁证券,任营业部高级经理、总经理等职;2011年加入本公司,任综合管理部总监、董事会秘书、总经理助理。2013年4月起任本公司副总经理。
督察长:李振伟先生,中共党员,大学本科,学士学位,高级经济师。1998年6月起从事证券监管工作,先后任证监会济南证管办党委办公室、上市处主任科员,证监会济南证管办上市处、机构处副处长,证监会山东证监局机构处副处长、处长,本公司总经理、监事会主席等职。2012年4月起任本公司督察长。

4.本基金基金经理

现任基金经理:

吴涛,男,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年起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。2010年3月起任本基金基金经理。现任量化投资部总监、兼任万家中证红利指数基金(LOF)基金经理、万家中证创业成长指数分级基金基金经理。

历任基金经理:
杨宇,本基金成立日起至2004年7月;
朱良,2004年7月至2005年5月;
肖侃宇,2005年5月至2006年2月;
潘江,2006年2月至2007年5月
欧庆铃,2007年5月至2011年8月

5.投资决策委员会成员

委员会主席:吕宜振
副主席:刘芳浩
委员:吴涛、华光磊、朱虹、吴印、孙驰、刘荆、高翰昆
吕宜振先生,万家基金管理有限公司总经理
刘芳浩先生,万家基金管理有限公司总经理助理、权益投资总监、权益投资部总监、研究部总监、万家和谐基金基金经理
吴涛先生,量化投资部总监、万家180基金基金经理、万家中证红利基金基金经理、万家中证创业成长基金基金经理
华光磊先生,权益投资部副总监、万家和谐基金基金经理、万家双引擎基金基金经理
朱虹女士,固定收益部总监、万家稳健增利债券基金基金经理、万家恒利债券基金基金经理、万家添利分级债券基金基金经理、万家岁得利定期开放债券基金基金经理、万家市政基金基金经理、万家城建债基金基金经理
吴印先生,权益投资部副总监,万家行业优选股票基金(LOF)基金经理、万家精选股票基金基金经理
孙驰先生,固定收益部副总监、万家货币基金基金经理、万家增强收益债券基金基金经理、万家强化收益定期开放债券基金基金经理、万家14天理财债券型证券投资基金基金经理
刘荆先生,研究部副总监
高翰昆先生,交易部副总监

6、上述人员之间不存在近亲属关系

二、基金托管人

（一）基本情况

名称:中国银行股份有限公司(简称"中国银行")
住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期:1983年10月31日
注册资本:人民币贰仟柒佰玖拾叁亿陆仟肆佰伍拾伍万贰仟肆佰叁拾柒元整
法定代表人:田国立
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24 号
托管业务部总经理:李爱华
托管部门信息披露联系人:王永民
客服电话:95566
传真:(010)66594942

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行于1998年设立基金托管部,为充分体现"以客户为中心"的服务理念,中国银行于2014年3月正式将托管及投资者服务部更名为托管业务部,现有员工120余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验,且具有海外工作、学习或培训经历,60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务,中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、基金(一对多、一对一)、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构银行间债券、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管产品体系。在国内,中国银行是首家开展绩效评估、风险管理等增值服务,为各类客户提供个性化的托管增值服务,是国内领先的大型中资托管银行。

（三）证券投资基金托管情况

截至2014年3月31日,中国银行已托管259只证券投资基金,其中境内基金234只,QDII基金25只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

三、相关服务机构

（一）销售机构

1、本基金直销机构为万家基金管理有限公司以及本公司的网上交易平台。
住所、办公地址:上海市浦东新区浦电路360号9层
法定代表人:毕玉国
联系人:刘怡君
电话:(021)38619982
传真:(021)38619998
客户服务热线:400-888-0800;95538转6
投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购、申购及赎回等业务,具体交易细则请参阅本公司网站公告。网上交易网址:
https://trade.wjasset.com/

2、代销机构:

（1）中国银行股份有限公司
客户服务统一咨询电话:95566
传真:(010)66594946
网址:www.boc.cn
（2）中国工商银行股份有限公司
电话:(010)66107900
传真:(010)66107914
客户服务电话:95588
网址:www.icbc.com.cn
（3）中国建设银行股份有限公司
客服电话:95533(或拨打各城市营业网点咨询电话)
公司网站:www.ccb.com
（4）中国农业银行股份有限公司
客户服务电话:95599
中国农业银行网站:www.abchina.com、www.95599.cn
（5）中国邮政储蓄银行股份有限公司
客服电话:95580
公司网站:www.psbc.com
(6)交通银行股份有限公司
电话:021-6888891,95559
网址:www.bankcomm.com
（7）招商银行股份有限公司
公司客服电话:95555(或拨打各城市营业网点咨询电话)
公司网站:www.cmbchina.com
（8）中信银行股份有限公司
电话:010-65541405
传真:010-65541281
（9）平安银行股份有限公司
客服电话:95511-3
公司网址:www.bank.pingan.com
（10）兴业银行股份有限公司
联系电话:(021)52629999
客户服务电话:95561
公司网址:www.cib.com.cn
（11）华夏银行股份有限公司
客服电话:95577(或拨打各城市营业网点咨询电话)
公司网站:www.hxb.com.cn
公司地址:北京市东城区建国门内大街22号
（12）民生银行股份有限公司
客户服务电话:95568
网址:www.cmbc.com.cn
(13)光大银行股份有限公司
客户服务电话:95595
网址:www.cebbank.com
（14）齐鲁证券有限公司
联系电话:0531-82024184、0531-82024147
传真电话:0531-82024197
网址:www.qlzq.com.cn
（15）中信建投证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
电话:010-65183888-86080
传真:010-65182261
（16）国泰君安证券股份有限公司
电话:021-62580818-213
传真:021-62569400
（17）中国银河证券股份有限公司
电话:010-66568888 66568587
传真:010-66568536
（18）海通证券股份有限公司
电话:021-53594566
传真:021-53858500
（19）国信证券有限责任公司
电话:0755-82130833-2181
传真:0755-82133302
（20）招商证券股份有限公司
电话:0755-82943511
传真:0755-82943237
（21）兴业证券股份有限公司
电话:021-68419974
传真:021-68419867
（22）湘财证券有限责任公司
电话:021-68634518-8631
传真:021-68865938
（23）东方证券股份有限公司
电话:021-50367888
传真:021-50366868
客户服务热线:021-962506
（24）广发证券股份有限公司
电话:020-87555888-875
传真:020-87557985
客户服务热线:020-87555888或拨打各城市营业网点咨询电话
公司网址:www.gf.com.cn
（25）民生证券有限责任公司
联系电话:010-85252605
传真电话:010-85252655
客服电话: 0371-67639999
公司网址: www.mszq.com
（26）华泰证券股份有限公司
客户服务电话:95597
网址:www.htsc.com.cn
（27）上海证券有限责任公司
客户服务电话:(021)962518
网址:www.962518.com.cn
（28）财富证券有限责任公司
客服电话:0731-4403319
网址:www.cfzq.com
（29）江海证券经纪有限责任公司
客服电话:400-666-2288
网址:www.jhzq.com.cn
（30）山西证券股份有限公司
客服热线:400-666-1618
网址:http://www.i618.com.cn/
（31）上海浦东发展银行股份有限公司
咨询电话:95528
公司网址:www.spdb.com.cn
（32）信达证券股份有限公司
客服热线: 400-800-8899
网址:www.cindasc.com
（33）广发华福证券有限责任公司
客服电话:96326(福建省外请先拨0591)
网址:www.gfhfzq.com.cn
（34）中航证券有限公司
客服电话: 400-8866-567
公司网址:http://www.avicsec.com
（35）天相投资顾问有限公司
客服电话:010-66045678
公司网址:www.txsec.com
（36）中信证券股份有限公司
统一客服电话:95558
公司网站地址:http://www.citics.com
（37）爱建证券有限责任公司
客服电话:021-63340678
网址:www.ajzq.com
（38）五矿证券有限责任公司
客服电话:40018-40028
网址:www.wkzq.com.cn
（39）华龙证券有限责任公司
客服电话:4006898888
网址: www.hlzqgs.com
（40）宏源证券股份有限公司
客服电话:4008-000-562
网址:www.hysec.com
（41）中国国际金融有限公司
电话:010-65051166
网址:www.cicc.com.cn
（42）光大证券股份有限公司
客服电话:4008888788
网址:www.ebscn.com
（43）中信万通证券有限责任公司
客服电话:96577
网址:www.zxwt.com.cn
（44）中银万国证券股份有限公司
客服电话:021-95523、4008-895523
网址:www.sywg.com
（45）东吴证券股份有限公司
客户服务电话:0512-96288
网址:www.dwjq.com.cn
（46）中信证券(浙江)有限责任公司(原中信金通证券)
客服电话:0571-96598
网址:www.bigsun.com.cn
（47）日信证券有限责任公司
客服电话:4006609839
网址: http://www.rxzq.com.cn
（48）中银国际证券有限责任公司
客服电话:4006208888
网址: http://www.bocichina.com
（49）杭州数米基金销售有限公司
客服电话:4000-766-123
网址:www.fund123.cn
（50）诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
客服电话:400-821-5399
网址:www.noah-fund.com
（51）上海长量基金销售投资顾问有限公司
客服电话:400-089-1289
网址:www.erichfund.com
（52）上海好买基金销售有限公司
客服电话:400-700-9665
网址:www. ehowbuy.com
(53) 深圳众禄基金销售有限公司
客服电话:4006-788-887
网址:www.zlfund.cn及www.jjmmw.com
(54) 北京展恒基金销售有限公司
客服电话:400-888-6661
网址:www.myfund.com
（55）上海天天基金销售有限公司
客服电话:400-1818-188
网址:www.1234567.com.cn
（56）华鑫证券有限责任公司
客服电话:021-32109999;029-68918888
网址:www.cfsc.com.cn
（57）和讯信息技术有限公司
客服电话:400-920-0022
公司网站:licaike.hexun.com
（58）中国中投证券有限责任公司
客户服务电话: 95532
公司网站:http://www.china-invs.cn/
(59) 金元证券股份有限公司
客户服务电话: 4008-888-228
公司网站: www.jyzq.cn
（60）万银财富基金销售有限公司
客服热线:400-808-0069
公司网站:www.wy-fund.com
（61）东海证券股份有限公司
400-8888-588
网址:www.longone.com.cn

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

（二） 基金注册与登记过户机构

名称: 中国证券登记结算有限责任公司
注册地址:北京西城区金融大街27号投资广场23层
电话:0755-82084015
传真:0755-82084010

（三）会计师事务所

名称:安永华明会计师事务所
住所:北京市东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层(邮编:100738)
办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心50楼(邮编:200120)
联系电话:(021)22288888
传真:(021)22280000
联系人:徐艳
经办注册会计师:徐艳,汤骏

（四）律师事务所

名称:北京市大成律师事务所上海分所
地址:上海市世纪大道100号上海环球金融中心24层
电话:(021)38722416
联系人:华涛

四、基金的名称

万家180指数证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式。

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资方向

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主要投资于国债、优质企业债、金融债以及债券回购。

八、基金的投资策略和投资组合

(一)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。

（二）基金的指数投资组合

指数投资组合包括上证180成份股票、预期选入上证180指数的股票、一级市场申购的新股以及现金。

1、指数投资组合的构建

本基金将采用指数复制法构造投资组合,当成份股发生新增、剔除或因公司行为导致指数权重发生变化时,指数投资组合将做出相应调整。

2、指数投资组合的跟踪误差的控制

本基金选择了两个评价跟踪误差的量化指标:一是拟合偏离度,这是一个日平均跟踪误差指标;另一个是指数投资相对收益率,这是相对累计收益率指标。

拟合偏离度的控制目标定为0.5%,指数投资相对收益率(年累计偏差)的控制目标定为2%。如果拟合偏离度或指数投资相对收益率超过了其控制目标,风险控制小组应将分析报告和调整方案上报给投资决策委员会审议,经审议批准后的组合调整方案交基金经理执行。

九、基金的业绩比较基准

本基金成立之日起至2005年12月31日的业绩比较基准为:75%×上证180指数+25%中信国债指数
自2006年元月1日起,业绩比较基准变更为:95%×上证180指数+5%×银行同业存款利率

十、基金的风险收益特征

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

十一、投资组合报告

万家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。

本基金的托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定,已于2014年4月10日复核了本投资组合报告的内容。

本投资组合报告所载数据截至2013年12月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

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	2,877,695,990.94	92.74
	其中:股票	2,877,695,990.94	92.74
2	固定收益投资	190,694,974.40	6.15
	其中:债券	190,694,974.40	6.15
	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	22,145,408.89	0.71
6	其他资产	12,327,012.96	0.40
7	合计	3,102,863,387.19	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末指数投资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	23,638,702.72	0.76
B	采矿业	181,039,300.74	5.85
C	制造业	763,168,059.93	24.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	87,721,231.49	2.83
E	建筑业	93,897,822.61	3.03
F	批发和零售业	40,400,411.44	1.31
G	交通运输、仓储和邮政业	85,550,982.42	2.76
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	89,765,327.71	2.90
J	金融业	1,297,872,356.32	41.94
K	房地产业	145,259,171.85	4.69
L	租赁和商务服务业	14,885,388.33	0.48
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	12,812,954.43	0.41
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	14,436,164.28	0.47
S	综合	27,248,116.67	0.88
	合计	2,877,695,990.94	92.98

2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票

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

3.1 报告期末指数投资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	3,922,146	163,671,152.58	5.29
2	600036	招商银行	13,552,314	147,584,699.46	4.77
3	600016	民生银行	18,511,963	142,912,354.36	4.62
4	601166	兴业银行	9,353,070	94,840,129.80	3.06
5	600000	浦发银行	9,167,834	86,452,674.62	2.79
6	600837	海通证券	6,976,076	78,969,180.32	2.55
7	600030	中信证券	5,911,739	75,374,672.25	2.44
8	601288	农业银行	21,265,720	52,738,985.60	1.70
9	601328	交通银行	12,693,029	48,741,231.36	1.57
10	601601	中国太保	2,574,180	47,699,555.40	1.54

3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	129,307,000.00	4.18
	其中:政策性金融债	129,307,000.00	4.18
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	61,387,974.40	1.98
8	其他	-	-
9	合计	190,694,974.40	6.16

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	130236	13国开36	1,000,000	99,310,000.00	3.21
2	130201	13国开01	300,000	29,997,000.00	0.97
3	113003	重工转债	177,810	20,720,199.30	0.67
4	110015	石化转债	213,810	20,388,921.60	0.66
5	113002	工行转债	191,070	19,364,944.50	0.63

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

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

8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据基金合同,本基金暂不能投资于股指期货

9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同,本基金暂不可投资国债期货

10 投资组合报告附注

10.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

10.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,248,016.24
2	应收证券清算款	7,236,456.90
3	应收股利	-
4	应收利息	2,722,448.07
5	应收申购款	120,091.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,327,012.96

10.4 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	113003	重工转债	20,720,199.30	0.67
2	110015	石化转债	20,388,921.60	0.66
3	113002	工行转债	19,364,944.50	0.63
4	110018	国电转债	913,909.00	0.03

10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

10.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

10.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2013年12月31日。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。

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

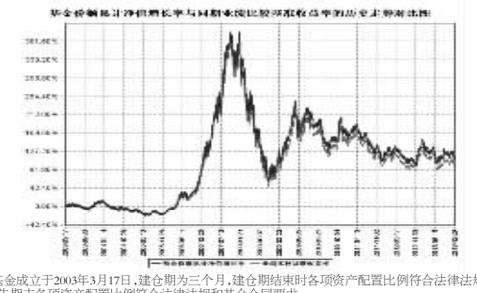
万家180指数基金历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较列表(截至2013年12月31日)

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)
2013年	-7.29%	1.35%	-8.61%	1.36%	1.32%	-0.01%
2012年	11.19%	1.18%	10.37%	1.19%	0.82%	-0.01%
2011年	-22.26%	1.23%	-22.02%	1.23%	-0.24%	0.00%
2010年	-15.65%	1.47%	-15.15%	1.48%	-0.50%	-0.01%
2009年	83.81%	1.91%	86.16%	1.96%	-2.35%	-0.05%
2008年	-63.32%	2.87%	-64.23%	2.91%	0.91%	-0.04%
2007年	142.57%	2.06%	141.09%	2.16%	1.48%	-0.10%
2006年	124.90%	1.30%	112.41%	1.32%	12.49%	-0.02%
2005年	-4.96%	1.00%	-2.75%	0.98%	-2.21%	0.02%
2004年	-9.25%	0.99%	-13.23%	1.00%	3.98%	-0.01%
2003年3月17日至12月31日	0.46%	0.71%	3.15%	0.81%	-2.69%	-0.10%
2003年3月17日至2013年12月31日	115.37%	1.60%	98.08%	1.63%	17.29%	-0.03%

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、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2013年12月31日)



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。

十三、基金费用概览

（一）与基金运作有关的费用种类

1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、基金信息披露费用;
4、基金份额持有人大会费用;
5、与基金相关的会计师费和律师费;
6、证券交易费和税收;
7、基金分红手续费;
8、注册登记费;
9、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

（二）基金运作费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

基金管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计算,主要用于支付管理人管理本基金的运作成本和向其他服务提供人支付的费用。计算方法如下:

H=E×1.0%÷当年天数;
H为每日应支付的基金管理费;
E为前一日基金资产净值

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。

2、基金托管人的托管费

基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计算。计算方法如下:

H=E×0.20%÷当年天数;
H为每日应计提的基金托管费;
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。

3、上述(一)中3至9项费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用。

(三)与基金销售有关的费用

1、本基金申购费率

申购金额M	申购费率
M<50万	1.5%
50万≤M<200万	1.2%
200万≤M<500万	1.0%
M≥500万	按笔收取,1000元/笔

2、本基金的赎回费率按实际持有期递减。具体为:

持有期限	赎回费率
D<1年	0.5%
1年≤D<3年	0.25%
D≥3年	0%

3、基金管理人可以在《基金合同》规定的范围内调整申购费率和赎回费率,调整后的申购费率和赎回费率在最新的公开说明书中列示。上述费率如发生变更,基金管理人还应最迟于新的费率实施前三个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

(四)不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

（五）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费和基金托管费,经中国证监会核准后公告,此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,对基金管理人于2013年10月30日刊登的本基金2013年第2号更新招募说明书进行了更新,并根据本基金管理人在本基金成立后对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新,主要更新内容如下:

1.在重要提示部分,明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。
2.在"三、基金管理人"部分,更新了基金管理人的有关内容。
3.在"四、基金托管人"部分,更新了有关基金托管人的有关内容。
4.在"五、相关服务机构"部分,增加了部分代销机构。
5. 在"七、基金份额的申购与赎回"部分,更新了开通定期定投的相关机构。
6.在"八、基金的投资"部分补充了本基金最近一期(2013年第四季度)投资组合报告内容。
7.在"九、基金的业绩"部分更新了基金成立以来的投资业绩。
8.在"二十一、其他应披露事项"部分更新了本基金最近一次招募说明书更新以来的公告事项。

万家基金管理有限公司
2014年4月30日

光大保德信基金管理有限公司关于参加上海天天基金销售有限公司周三申购费率优惠活动的公告

为更好地满足广大投资者的投资需求，投资者通过上海天天基金销售有限公司（以下简称"天天基金"）申购光大保德信基金管理有限公司（以下简称"本公司"）旗下部分基金在特定时间段（具体见下文"二、优惠活动期限及具体优惠费率"）享受申购费率优惠。详情如下：

一、适用的基金范围

基金名称	基金代码
光大保德信量化核心证券投资基金	360001
光大保德信红利股票型证券投资基金	360005
光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金	360011

二、优惠活动期限及具体优惠费率

2014年5月1日—2014年7月31日期间（截至当日法定交易时间），个人投资者每周二15:00:00至每周三14:59:59间通过天天基金申购上述开放式基金，其申购费率均享有2折优惠。优惠前收取固定费用的，则按原费率执行，不再享有费率折扣。

若遇节假日或基金管理人经公告暂停申购的情形，则该周三费率优惠活动不执行，顺延至下一个工作日的周三。

本次优惠活动仅限于上述基金的前端收费模式，且不适用于基金定投和转换业务。但投资者可根据本公司或天天基金其他有效优惠公告享受费率优惠。

三、重要提示

1、本公司承诺以诚实信用、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，也不保证最低收益。投资者投资于本公司基金时应认真阅读基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

2、上述基金费率优惠活动的解释权归天天基金所有。优惠活动期间，业务办理的业务规则和流程以天天基金的安排和规定为准。有关优惠活动的具体规定如有变化，以天天基金网（www.1234567.com.cn）的最新公布内容为准。

3、光大保德信基金管理有限公司网址：www.epf.com.cn

4、光大保德信管理有限公司客户服务信箱：epfservice@epf.com.cn

5、光大保德信基金管理有限公司客服电话：4008-202-888

6、上海天天基金销售有限公司客服电话：400-1818188，公司网站：www.1234567.com.cn

光大保德信基金管理有限公司
2014年4月30日

华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加上海浦东发展银行股份有限公司基金定期定额申购费率优惠活动的公告

为感谢广大投资者长期以来的信任与支持，经与上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称"浦发银行"）协商，华夏基金管理有限公司（以下简称"本公司"）旗下部分开放式基金决定参加浦发银行