万家180指数证券投资基金更新招募说明书摘要

（2015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2015年3月17日，有关财务数据和净值表现截止日为2014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：方一天

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：021-38909626

传真：021-38909627

(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，博士研究生学历，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。2011年3月起任本公司董事长。

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。

董事方一天先生，大学本科，学士学位，先后在上海财政证券公司、中国证监会系统、上证所信息网络有限公司任职，2014年10月加入万家基金管理有限公司，2014年12月起任公司董事，2015年2月起任公司总经理。

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。

独立董事黄磊先生，中国民主建国会成员，经济学博士，教授，曾任贵州财经学院财政金融系教师、山东财经大学金融学院院长、山东省政协常委，现任山东财经大学资本市场研究中心主任、山东金融产业优化与区域管理协同创新中心副主任、山东省人大常委、山东省人大财经委员会委员、教育部高校金融类专业教学指导委员会委员。

2、基金管理人监事会成员

监事会主席李润起先生，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。

监事张浩先生，中共党员，现任山东省国有资产投资控股有限公司综合部（党委办公室）部长（主任）。

监事陈广益先生，硕士学位，先后任职于苏州对外贸易公司、兴业全球管理有限公司。2005年3月加入本公司，现任公司基金运营部总监。

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：方一天先生（简介请参见基金管理人董事会成员）

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，曾任综合管理部总监、董事会秘书、总经理助理，2013年4月起任公司副总经理，2014年10月至2015年2月代任公司总经理。

督察长：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，2005年10月起进入万家基金管理有限公司从事合规风控工作，先后担任职工监事、信息披露负责人、合规稽核部副总监、总监等职。2015年4月起任公司督察长。

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和万家上证380ETF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；

肖佩宁，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：李杰

委员：吴涛、华光磊、孙驰、刘荆、白宇

李杰先生，万家基金管理有限公司副总经理

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和万家上证380ETF交易型开放式指数证券投资基金基金经理

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、万家精选股票型证券投资基金基金经理

孙驰先生，固定收益部总监，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、万家日日薪货币市场证券投资基金基金经理、万家岁得利基金基金经理和万家现金宝货币市场证券投资基金基金经理。

刘荆先生，公司研究部副总监

白宇先生，公司交易部总监。

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

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110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2015年3月31日，中国银行已托管328只证券投资基金，其中境内基金303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：李亿莎

电话：(021)38909771

传真：(021)38909798

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）申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。

根据中基协发[2015]4号文“关于发布《基金参与融资融券及转融通证券出借业务指引》的通知”规定，本基金可以参与转融通证券出借交易。

（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2015年1月19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2014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	3,668,718,172.68	94.25
	其中：股票	3,668,718,172.68	94.25
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	217,890,096.30	5.60
7	其他资产	5,971,390.68	0.15
8	合计	3,892,579,659.66	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	14,988,309.62	0.39
B	采矿业	178,458,994.87	4.62
C	制造业	793,131,408.02	20.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	105,619,505.59	2.73
E	建筑业	191,769,611.12	4.96
F	批发和零售业	61,768,226.59	1.60
G	交通运输、仓储和邮政业	110,059,139.51	2.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	121,541,451.53	3.15
J	金融业	1,825,627,064.96	47.25
K	房地产业	182,040,578.65	4.71
L	租赁和商务服务业	12,496,042.00	0.32
M	科学研究和技术服务业	6,877,504.23	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	13,389,286.56	0.35
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	26,746,809.23	0.69
S	综合	24,204,240.20	0.63
	合计	3,668,718,172.68	94.94

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）
1	601318	中国平安	2,883,312	215,412,239.52
2	600016	民生银行	18,258,736	198,655,047.68
3	600030	中信证券	4,930,502	167,144,017.80
4	600036	招商银行	10,014,746	166,144,636.14
5	600837	海通证券	4,679,103	112,579,218.18
6	600000	浦发银行	6,789,984	106,534,848.96
7	601166	兴业银行	5,747,848	94,839,492.00
8	601398	工商银行	13,846,156	67,430,779.72
9	601668	中国建筑	9,097,414	66,229,173.92
10	601328	交通银行	9,527,277	64,785,483.60

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属

8 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

9 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

10 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

11 投资组合报告附注

11.1

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。

11.2

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。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,481,102.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	42,619.28
5	应收申购款	4,447,668.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,971,390.68

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期内未持有处于转换期的可转换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

11.5.1 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。

11.5.2 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2014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2014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)
2014	58.78%	1.20%	56.12%	1.20%	2.66%	0.00%
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2014年12月31日	241.97%	1.57%	209.24%	1.60%	32.73%	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2014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≤D3<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2014年10月30日刊登的本基金2014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、在释义部分，更新了两处释义内容。

3、在“三、基金管理人”部分，更新了基金管理人的有关内容。

4、在“四、基金托管人”部分，更新了基金托管人的有关内容。

5、在“五、相关服务机构”部分，更新了本基金的相关服务机构。

6、在“九、基金的投资”部分，补充了本基金最近一期（2014年第四季度）投资组合报告内容。

7、在“十、基金的业绩”部分，更新了基金成立以来的投资业绩。

8、增加了“二十三、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

2015年4月30日

河北建投能源投资股份有限公司

2015 第一季度报告

证券代码：000600　证券简称：建投能源　公告编号：2015-17

第一节　重要提示

公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证季度报告内容的真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并承担个别和连带的法律责任。

所有董事均已出席了审议本次季报的董事会会议。

公司负责人米大斌、主管会计工作负责人蔡树文及会计机构负责人（会计主管人员）曹芸声明：保证季度报告中财务报表的真实、准确、完整。

第二节　主要财务数据及股东变化

一、主要财务数据

公司是否因会计政策变更及会计差错更正等追溯调整或重述以前年度会计数据

□ 是 √ 否

	本报告期	上年同期	本报告期比上年同期增减
营业收入（元）	2,463,349,504.61	2,642,699,318.88	-6.79%
归属于上市公司股东的净利润（元）	543,681,108.71	488,279,827.37	11.35%
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润（元）	539,946,195.79	488,279,827.37	10.58%
经营活动产生的现金流量净额（元）	431,328,782.01	710,583,547.20	-39.30%
基本每股收益（元/股）	0.303	0.395	-23.29%
稀释每股收益（元/股）	0.303	0.395	-23.29%
加权平均净资产收益率	5.87%	9.51%	降低3.64个百分点
	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年度末增减
总资产（元）	24,506,799,865.69	25,266,317,212.50	-3.01%
归属于上市公司股东的净资产（元）	9,531,518,640.11	8,987,347,023.94	6.05%

非经常性损益项目和金额

√ 适用 □ 不适用

单位：元

项目	年初至报告期期末金额
计入当期损益的政府补助（与企业业务密切相关，按照国家统一标准定额或定量享受的政府补助除外）	3,085,846.65
对外委托贷款取得的损益	333,630.49
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	2,988,435.17
减：所得税影响额	980,156.84
少数股东权益影响额（税后）	1,692,842.55
合计	3,734,912.92

对公司根据《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第1号——非经常性损益》定义界定的非经常性损益项目，以及把《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第1号——非经常性损益》中列举的非经常性损益项目界定为经常性损益的项目，应说明原因。

□ 适用 √ 不适用

公司报告期不存在将根据《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第1号——非经常性损益》定义、列举的非经常性损益项目界定为经常性损益的项目的情形。

二、报告期末股东总数及前十名股东持股情况表

1.报告期末普通股股东总数及前十名普通股股东持股情况表

单位：股

报告期末普通股股东总数	58,135					
前10名普通股股东持股情况						
股东名称	股东性质	持股比例	持股数量	持有有限售条件股份数量	质押或冻结情况	
					股份状态	数量
河北建设投资集团有限责任公司	国有法人	67.21%	1,204,085,950	701,495,667		
华能国际电力开发公司	国有法人	4.06%	72,755,000			
银华财富-工商银行-银华资本分级三号专项资产管理计划	境内非国有法人	2.01%	36,000,000	36,000,000		
宝盈基金-光大银行-宝盈方德定增2号特定多客户资产管理计划	境内非国有法人	1.09%	19,520,000	19,520,000		
兴业证券-光大银行-兴业证券鑫享定增9号集合资产管理计划	境内非国有法人	1.05%	18,800,000	18,800,000		
财通基金-平安银行-平安信托-平安财富*创赢二期1号集合资金信托计划	境内非国有法人	1.00%	18,000,000	18,000,000		
全国社保基金五零二组合	境内非国有法人	0.95%	17,000,000	17,000,000		
北信瑞丰基金-宁波银行-北信瑞丰基金丰庆2号资产管理计划	境内非国有法人	0.95%	17,000,000	17,000,000		
江苏国泰紫金科技发展有限公司	国有法人	0.81%	14,470,588	14,470,588		
宝盈基金-民生银行-宝盈方德定增3号特定多客户资产管理计划	境内非国有法人	0.58%	10,480,000	10,480,000		

前10名无限售条件普通股股东持股情况			
股东名称	持有无限售条件普通股股份数量	股份种类	
		股份种类	数量
河北建设投资集团有限责任公司	502,590,283	人民币普通股	502,590,283
华能国际电力开发公司	72,755,000	人民币普通股	72,755,000
中国建设银行股份有限公司-博时裕富沪深300指数证券投资基金	5,590,502	人民币普通股	5,590,502
全国社保基金四零二组合	3,024,981	人民币普通股	3,024,981
海关总署机关服务中心（海关总署机关服务局）	2,052,677	人民币普通股	2,052,677
中国建设银行股份有限公司-景顺长城量化精选股票型证券投资基金	1,618,700	人民币普通股	1,618,700
中国银行-华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金	1,611,924	人民币普通股	1,611,924
广东粤财信托有限公司-菁英汇旺业资本8号证券投资集合资金信托计划	1,608,113	人民币普通股	1,608,113
中国对外经济贸易信托有限公司-安进13期壹心1号证券投资集合资金信托计划	1,429,700	人民币普通股	1,429,700
中国建设银行股份有限公司-华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金	1,376,828	人民币普通股	1,376,828
上述股东关联关系或一致行动的说明	上述股东之间不存在关联关系，且不属于《上市公司收购管理办法》规定的一致行动人。		

公司前10名普通股股东、前10名无限售条件普通股股东在报告期内是否进行约定购回交易

□ 是 √ 否

公司前10名普通股股东、前10名无限售条件普通股股东在报告期内未进行约定购回交易。

2.报告期末优先股股东总数及前十名优先股股东持股情况表

□ 适用 √ 不适用

第三节　重要事项

一、报告期主要会计报表项目、财务指标发生重大变动的情况及原因

1.资产负债项目大幅变动情况

单位：元

变动项目	期末金额	期初金额	变动金额	变动比例	变动原因
应收票据	11,068,000.00	2,700,000.00	8,368,000.00	309.93%	子公司应收票据增加所致
应收账款	929,926,669.22	664,830,716.64	265,095,952.58	39.87%	期末应收售电款增加所致
预付款项	347,386,353.83	1,186,402,925.06	-839,016,571.23	-70.72%	因收购股权交割完成，预付建投集团股权收购款减少所致
应收利息	0.00	46,454.88	-46,454.88	-100.00%	本期收回所致
应收股利	0.00	54,479,000.00	-54,479,000.00	-100.00%	本期收回所致
长期股权投资	4,660,705,527.64	3,407,773,763.93	1,252,931,763.71	36.77%	因实施重大资产购买，本期增加对王滩发电、龙山发电、承德热电和龙新热力投资所致
工程物资	22,994,476.21	50,955,981.82	-27,961,505.61	-54.87%	为基建子公司工程用物资减少所致
预收款项	81,085,103.44	365,869,236.18	-284,784,132.74	-77.84%	主要是由于子公司期初预收的供热款项本期已结算所致
应交税费	123,228,262.00	184,334,147.97	-61,105,885.97	-33.15%	主要是应交增值税和所得税减少所致
应付利息	66,517,953.60	39,553,107.99	26,964,845.61	68.17%	未到付息日，应付保险债、公司债、短期融资券利息增加所致

2.利润表项目大幅变动情况

单位：元

变动项目	本期金额	上期金额	变动金额	变动比例	变动原因
营业外收入	6,117,284.58	11,891,523.73	-5,774,239.15	-48.56%	主要是政府补助同比减少所致
营业外支出	43,002.76	5,400.00	37,602.76	696.35%	主要是赔偿金同比增加所致
所得税费用	148,586,647.22	66,215,557.83	82,371,089.39	124.40%	主要是子公司经营状况较好，应纳税所得额同比增长所致

3.现金流量表项目大幅变动情况

单位：元

变动项目	本期金额	上期金额	变动金额	变动比例	变动原因
经营活动产生的现金流量净额	431,328,782.01	710,583,547.20	-279,254,765.19	-39.30%	主要为售电收款同比减少所致
投资活动产生的现金流量净额	-565,204,290.90	-60,841,269.24	-504,363,021.66	-828.98%	主要是子公司基建资金支出同比增加所致
筹资活动产生的现金流量净额	-376,293,159.42	-652,552,588.79	276,259,429.37	42.34%	主要是对外借款支净额同比增加所致

二、重要事项进展情况及其影响和解决方案的分析说明

1. 2014年12月12日，公司第七届董事会第七次临时会议决议购买公司控股股东建投集团持有的王滩发电30%股权、龙山发电29.43%股权、承德热电35%股权、龙新热力35%股权，并将公司持有的国融公司90%股权转让予建投集团。12月26日，公司与建投集团签署了《股权转让协议》。12月29日，本次资产购买、出售事项获公司2014年第三次临时股东大会审议批准。上述五家标的资产的交割过户手续分别于2015年1月26日、3月12日、3月4日、3月16日和2月2日完成。

2. 2014年8月25日，公司第七届董事会第三次会议审议通过了《关于向河北建设投资集团财务有限责任公司增资的议案》，公司拟向参股公司财务公司增资0.50亿元人民币。2015年1月8日，公司与财务公司其他股东方共同签订了《河北建投集团财务有限公司增资扩股协议》。根据该协议，公司于2015年4月24日办理了有关出资手续。公司本次向财务公司增资0.50亿元人民币后，财务公司注册资本增至10.00亿元人民币，本公司出资总额1.00亿人民币，出资比例为10%。

重要事项概述	披露日期	临时报告披露网站查询索引
购买、出售资产事项	2014年08月04日	http://www.cninfo.com.cn/finalpage/2014-08-04/1200095877.PDF
	2014年12月13日	http://www.cninfo.com.cn/finalpage/2014-12-13/1200463151.PDF
	2014年12月20日	http://www.cninfo.com.cn/finalpage/2014-12-20/1200479843.PDF
	2014年12月27日	http://www.cninfo.com.cn/finalpage/2014-12-27/1200500218.PDF
	2014年12月30日	http://www.cninfo.com.cn/finalpage/2014-12-30/1200504362.PDF
	2015年04月15日	http://www.cninfo.com.cn/finalpage/2015-04-15/1200834274.PDF
财务公司增资事项	2014年08月30日	http://www.cninfo.com.cn/finalpage/2014-08-30/1200189711.PDF
	2015年01月09日	http://www.cninfo.com.cn/finalpage/2015-01-09/1200530475.PDF

三、公司或持股5%以上股东在报告期内发生或以前期间发生但持续到报告期内的承诺事项

承诺事项	承诺方	承诺内容	承诺时间	承诺期限	履行情况
资产重组时所作承诺	建投集团	1.建投集团出具避免同业竞争的承诺和具体措施，承诺将全力支持建投能源在火力发电领域的发展，未来在境内的新建火电项目及火电业务相关的资产运作、并购等机会优先提供给建投能源；对于盈利较好但暂不具备注入条件的火电资产，建投集团力争在本次交易完成后三年内使之符合上市条件并注入建投能源；对于盈利能力较差且短期内难以改善的火电资产，建投集团后续将通过整改，力争在本次交易完成后五年内使之符合上市条件并注入建投能源	2013年11月01日	资产重组完成后三年和五年内	根据上述承诺，经与公司协商，建投集团将其持有的业绩状况良好且符合注入条件的河北大唐国际王滩发电有限责任公司30%股权、国电河北龙山发电有限责任公司29.43%股权、国电承德热电有限公司35%股权、承德龙新热力有限责任公司35%股权转让予本公司。该交易事项已经公司2014年12月29日召开的2014年第三次临时股东大会审议通过，双方已签署有关股权转让协议，四家标的资产的交割过户手续分别于2015年1月26日、3月12日、3月4日、3月16日完成。
		2.建投集团出具减少和规范关联交易的承诺，承诺将尽力减少与本公司的关联交易。对于无法避免的业务往来或交易均按照公平、公允和等价有偿的原则进行	2013年11月01日	长期	该承诺正在严格履行中。
		3.建投集团出具关于财务公司与建投能源业务往来的承诺，承诺保证建投能源与财务公司业务往来的独立性与公允性。	2013年11月01日	长期	该承诺正在严格履行中。
		4.建投集团承诺在本次发行股份购买资产中所取得的建投能源股票自新增股份上市之日起三十六个月不进行转让。	2013年09月25日	自2014年4月23日起三十六个月内	该承诺正在严格履行中。
		5.建投集团承诺本次重大重组标的公司沧东发电在盈利补偿期间（2014年、2015年和2016年）实现的扣除非经常性损益后的净利润中归属于建投能源的累积数，不低于资产评估报告中所预测的沧东发电净利润中归属于建投能源的累积数。否则，建投集团同意就差额部分给予本公司补偿。	2013年09月25日	2014年、2015年和2016年	该承诺正在严格履行中。沧东发电2014年度经审计的净利润为106,781.36万元，扣除非经常性损益后的净利润为106,773.85万元，实现数高于盈利预测数46,286.22万元。因此，2014年沧东发电扣除非经常性损益后的净利润中归属于建投能源的累积数已达到盈利预测水平，建投集团不需给予公司补偿。
		6.建投集团承诺本次发行股份购买资产完成后，将按照相关法律法规的要求，使公司在业务、资产、财务、人员、机构等方面保持独立性。	2013年11月01日	长期	该承诺正在严格履行中。
		7.建投集团出具关于标的公司土地房屋情况的承诺，承诺将促使宣化热电在2013年12月31日前解决并完善相应土地权属瑕疵问题，如因土地所有权属瑕疵问题导致建投能源或宣化热电受到损失，建投集团将进行全额现金补偿；对于沧东发电以及三河发电的土地、房产的权属瑕疵问题，如因此问题导致建投能源或相关标的公司受到损失，将对建投能源或相关标的公司进行补偿。	2013年11月01日	长期	截至2013年12月31日，宣化热电未办理完成相关瑕疵土地的权属证明，建投集团已履行承诺，向宣化热电支付土地补偿金共计1,812.25万元。
承诺是否及时履行	是				

四、对2015年1-6月经营业绩的预计

预测年初至下一报告期期末的累计净利润可能为亏损或者与上年同期相比发生大幅度变动的警示及原因说明

□ 适用 √ 不适用

五、证券投资情况

□ 适用 √ 不适用

公司报告期不存在证券投资。

六、持有其他上市公司股权情况的说明

√ 适用 □ 不适用

公司名称	公司类别	最初投资成本（元）	期初持股数量（股）	期初持股比例	期末持股数量（股）	期末持股比例	期末账面值（元）	报告期损益（元）	会计核算科目	股份来源
交通银行股份有限公司	商业银行	1,087,819.00	726,805	0.00098%	726,805	0.00098%	4,644,283.95	0.00	可供出售金融资产	购买
合计		1,087,819.00	726,805	--	726,805	--	4,644,283.95	0.00	--	--

七、衍生品投资情况

公司报告期不存在衍生品投资。

八、报告期内接待调研、沟通、采访等活动登记表

公司报告期内未发生接待调研、沟通、采访等活动。

河北建投能源投资股份有限公司

法定代表人：米大斌

2015年4月29日