

Disclosure

万家公用事业行业股票型证券投资基金

2008年年度报告摘要

§1 重要提示

1.1 声明

基金管理人的董事及监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。本年度报告经三分之二以上的独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，保证基金持有人利益不受损害并负赔偿责任。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本公司管理的其他基金的过往业绩并不构成对本基金的业绩表现的保证。

本报告公告后基金将进行定期报告，敬请投资者注意阅读。

本报告出自 2008 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称 万家公用事业行业股票型证券投资基金

交易代码 161003

上市地或契约的开放式(LOF) 上市地或契约的开放式(LOF)

基金管理人方式 万家基金管理有限公司

基金合同生效日 2006年7月15日

基金托管人名称 交通银行股份有限公司

基金合同签署地点 上海市徐汇区宛平南路1号

基金托管费上的证券交易场所 深圳证券交易所

开始上市交易的日期 2006年8月15日

2.2 基金产品说明

本基金主要运用增强指数化投资方法，通过主要投资于国内与国际上同行业且具有良好信誉的上市公司所发行的股票，谋求基金资产的长期稳定增值。

本基金采取量化优化投资方法，基于行业分类和成份股的分布、水平、价值等各方面为研究基

础，实现对股票组合的优化配置，力求获得较基准的超额收益。

投资策略

本基金在综合分析宏观经济形势、政策环境、行业景气度、公司基本面的基础上，通过定量和定性相结合的分析，精选出具有投资价值的股票，构建股票投资组合。

业绩比较基准 80%×巨潮公用事业行业股票指数收益率+20%×同期一年期银行存款利率

风险收益特征 本基金是一只指数型股票基金，主要投资于行业内与日常生活息息相关的公用事业上市公司股票，长期平均预期风险和收益高于混合型基金但低于股票基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

名称 三箭 陈晓伟

信息披露负责人 联系电话 021-39619810 021-6888917

电子邮箱 lan@wjasset.com zhangy@hankou.com

客户服务电话 4008898000 95569

传真的 021-39619888 021-58408836

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告的法定报纸或互联网网址 <http://www.wjasset.com>

基金年度报告备置地点 基金管理人办公场所

报告截止日：2008年12月31日

单位：人民币元

资产 本期末 2008年12月31日 上年度末 2007年12月31日

资产总计 36,694,409.10 58,943,644.54

银行存款 57,358,189.08 17,872,247.40

结算备付金 351,282.06 361,202.06

保证金 182,274,260.48 390,317,373.40

其中：股票投资 182,274,260.48 390,317,373.40

债券投资 0.00 0.00

货币市场基金 0.00 0.00

应收证券清算款 0.00 0.00

应收利息 31,377.03 24,707.054

应收股利 0.00 0.00

应收申购款 36,449.32 3,078,602.33

其他资产 0.00 0.00

资产总计 278,149,616.77 469,629,824.15

负债和所有者权益 本期末 2008年12月31日 上年度末 2007年12月31日

负债： 0.00 0.00

短期借款 0.00 0.00

应付票据 0.00 0.00

应付账款 5,736,363.58 6,339,297.39

应付证券清算款 156,467.81 417,922.99

应付利息 49,598.96 64,291.39

应付股利 0.00 0.00

应付申购款 616,502.87 764,636.04

应付税款 0.00 0.00

应付利润 0.00 0.00

应付福利费 690,579.04 284,771.90

应付佣金 1,725,547.44 10,916,763.37

应付手续费 0.00 0.00

应付交易费用 0.00 0.00

应付利润 0.00 0.00

应付利息 69,941,377.44 40,899,366.91

所有者权益 278,149,616.77 469,629,824.15

注：(1)本期实现收入项目核算本报告期已确认收入，投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)

(2)本期相关费用项目不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列示的金额。

(3)本期未按公允价值计算而采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

(4)基金净值表现

2.5 基金份额净值增长率情况

注：基金业绩比较基准增长率为80%×巨潮公用事业行业股票指数收益率+20%×同期一年期银行存款利率

3.2 基金合同生效以来基金份额累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比

较

注：(1)本基金成立于2006年7月15日，建仓期为六个月，即期资产配置时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

(2)报告期内各季度资产配置比例符合法律法规和基金合同的要求。

3.3 本期的分红情况

3.4 期末可供分配利润

3.5 基金净值表现

3.6 基金份额净值增长率情况

注：(1)基金净值增长率=基金净值增长/(基金净值增长-同期银行存款利率)

3.2.2 基金合同生效以来基金份额累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比

较

注：(1)本基金成立后至2006年7月15日，建仓期为六个月，即期资产配置时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

(2)报告期内各季度资产配置比例符合法律法规和基金合同的要求。

3.2.3 本期合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：(1)基金净值增长率=基金净值增长/(基金净值增长-同期银行存款利率)

3.2.4 与同期业绩比较基准的偏离情况

注：(1)本基金成立后至2006年7月15日，建仓期为六个月，即期资产配置时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

(2)报告期内各季度资产配置比例符合法律法规和基金合同的要求。

3.2.5 与同期业绩比较基准的偏离情况

注：(1)本基金成立后至2006年7月15日，建仓期为六个月，即期资产配置时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

(2)报告期内各季度资产配置比例符合法律法规和基金合同的要求。

3.2.6 与同期业绩比较基准的偏离情况

注：(1)本基金成立后至2006年7月15日，建仓期为六个月，即期资产配置时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

(2)报告期内各季度资产配置比例符合法律法规和基金合同的要求。

3.2.7 与同期业绩比较基准的偏离情况

注：(1)本基金成立后至2006年7月15日，建仓期为六个月，即期资产配置时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

(2)报告期内各季度资产配置比例符合法律法规和基金合同的要求。

3.2.8 与同期业绩比较基准的偏离情况

注：(1)本基金成立后至2006年7月15日，建仓期为六个月，即期资产配置时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

(2)报告期内各季度资产配置比例符合法律法规和基金合同的要求。

3.2.9 与同期业绩比较基准的偏离情况

注：(1)本基金成立后至2006年7月15日，建仓期为六个月，即期资产配置时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

(2)报告期内各季度资产配置比例符合法律法规和基金合同的要求。

3.2.10 与同期业绩比较基准的偏离情况

注：(1)本基金成立后至2006年7月15日，建仓期为六个月，即期资产配置时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

(2)报告期内各季度资产配置比例符合法律法规和基金合同的要求。

3.2.11 与同期业绩比较基准的偏离情况

注：(1)本基金成立后至2006年7月15日，建仓期为六个月，即期资产配置时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

(2)报告期内各季度资产配置比例符合法律法规和基金合同的要求。

3.2.12 与同期业绩比较基准的偏离情况

注：(1)本基金成立后至2006年7月15日，建仓期为六个月，即期资产配置时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

(2)报告期内各季度资产配置比例符合法律法规和基金合同的要求。

3.2.13 与同期业绩比较基准的偏离情况

注：(1)本基金成立后至2006年7月15日，建仓期为六个月，即期资产配置时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

(2)报告期内各季度资产配置比例符合法律法规和基金合同的要求。

3.2.14 与同期业绩比较基准的偏离情况

注：(1)本基金成立后至2006年7月15日，建仓期为六个月，即期资产配置时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

(2)报告期内各季度资产配置比例符合法律法规和基金合同的要求。

3.2.15 与同期业绩比较基准的偏离情况

注：(1)本基金成立后至2006年7月15日，建仓期为六个月，即期资产配置时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

(2)报告期内各季度资产配置比例符合法律法规和基金合同的要求。

3.2.16 与同期业绩比较基准的偏离情况

注：(1)本基金成立后至2006年7月15日，建仓期为六个月，即期资产配置时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

(2)报告期内各季度资产配置比例符合法律法规和基金合同的要求。

3.2.17 与同期业绩比较基准的偏离情况

注：(1)本基金成立后至2006年7月15日，建仓期为六个月，即期资产配置时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

(2)报告期内各季度资产配置比例符合法律法规和基金合同的要求。

3.2.18 与同期业绩比较基准的偏离情况

注：(1)本基金成立后至2006年7月15日，建仓期为六个月，即期资产配置时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

(2)报告期内各季度资产配置比例符合法律法规和基金合同的要求。

3.2.19 与同期业绩比较基准的偏离情况

注：(1)本基金成立后至2006年7月15日，建仓期为六个月，即期资产配置时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

(2)报告期内各季度资产配置比例符合法律法规和基金合同的要求