

万家货币市场证券投资基金 2006年第三季度报告

一、重要提示
基金管理人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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2006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预示其未来表现。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。

本报告期为2006年7月1日起至9月30日止。本报告中的财务资料未经审计。

Table with 2 columns: 基金名称, 万家货币; 基金运作方式, 契约型开放式基金; 基金合同生效日, 2006年5月24日; 报告期末基金份额总额, 740,302,400.39份

投资策略: 本基金通过运用指数化投资方法,力求基金的投资组合收益水平超越业绩比较基准。

业绩比较基准: 本基金业绩比较基准收益率为: 1年期银行定期存款税后收益率。

基金管理人: 万家基金管理有限公司; 基金托管人: 华夏银行股份有限公司

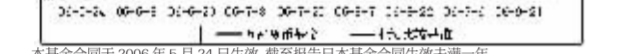
三、主要财务数据和基金净值表现
(一)主要财务指标
基金本期净收益 2,287,383.30
期末基金资产净值 740,302,400.39

注:1.本基金收益分配按月结转份额; 2.万家货币市场基金本报告期投资收益及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 6 columns: 阶段, 净增长率, 净值增长率, 业绩比较基准收益(1), 业绩比较基准收益(2), (1)-(3), (2)-(4)

基金业绩比较基准收益率为: 1年期银行定期存款税后收益率

万家货币市场基金自基金合同生效以来基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图(2006年5月24日至2006年9月30日)



本基金合同于2006年5月24日生效,截至报告日本基金合同生效满一年。

按基金合同约定,本基金自基金合同生效起3个月内为建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已符合基金合同约定的投资比例要求。

基金管理人: 万家基金管理有限公司; 基金托管人: 华夏银行股份有限公司

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预示其未来表现。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。

本报告期为2006年7月1日起至9月30日止。本报告中的财务资料未经审计。

投资策略: 本基金通过运用指数化投资方法,力求基金的投资组合收益水平超越业绩比较基准。

业绩比较基准: 本基金业绩比较基准收益率为: 1年期银行定期存款税后收益率。

基金管理人: 万家基金管理有限公司; 基金托管人: 华夏银行股份有限公司

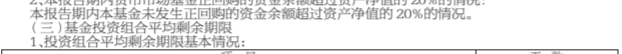
三、主要财务数据和基金净值表现
(一)主要财务指标
基金本期净收益 2,287,383.30
期末基金资产净值 740,302,400.39

注:1.本基金收益分配按月结转份额; 2.万家货币市场基金本报告期投资收益及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 6 columns: 阶段, 净增长率, 净值增长率, 业绩比较基准收益(1), 业绩比较基准收益(2), (1)-(3), (2)-(4)

基金业绩比较基准收益率为: 1年期银行定期存款税后收益率

万家货币市场基金自基金合同生效以来基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图(2006年5月24日至2006年9月30日)



本基金合同于2006年5月24日生效,截至报告日本基金合同生效满一年。

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天的说明: 本期发生单日基金份额达基金净值50%的巨额申购和赎回:8月17日,发生巨额申购,应申购款计入基金资产并不计算在平均剩余期限内,导致当日投资组合平均剩余期限超过180天;8月29日,发生巨额赎回,基金无延期支付,优先卖出剩余期限短、流动性好的债券,导致单日投资组合平均剩余期限超过180天。

Table with 4 columns: 序号, 发生日期, 巨额申购, 巨额赎回

2. 报告期内基金投资组合平均剩余期限分布比例:

Table with 4 columns: 序号, 平均剩余期限, 各期限资产占基金资产净值比例, 各期限基金份额占基金资产净值比例

(四) 报告期末债券投资组合
1. 报告期末债券投资组合构成

Table with 4 columns: 序号, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例

注:上表中,“债券名称”中的“有价证券”和“封闭式国债”指所有的债券投资和通过债券回购方式回购的券类资产

2. 基金投资前十名债券明细

Table with 6 columns: 序号, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例

注:上表中,“债券名称”中的“有价证券”和“封闭式国债”指所有的债券投资和通过债券回购方式回购的券类资产

(五) “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

Table with 2 columns: 项目, 偏离情况

1. 影子定价与摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

2. 报告期末,本基金持有的剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况

3. 报告期末,本基金持有的剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况

4. 其他情况的说明

六、开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目, 金额(元)

七、备查文件目录

1. 中国证监会批准万家货币市场证券投资基金发行及募集的文件。

2. 《万家货币市场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. 万家货币市场证券投资基金2006年第三季度报告原文。

6. 万家基金管理有限公司董事会议决议。

7. 上述文件的存放地点及查阅方式如下: 存放地点: 基金管理人/或基金托管人的办公场所,并登录于基金管理人网站: http://www.wjasset.com

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 二〇〇六年十月二十五日

万家公用事业行业股票型证券投资基金 2006年第三季度报告

一、重要提示
基金管理人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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2006年10月20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预示其未来表现。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。

本报告期为2006年7月1日至2006年9月30日止。本报告中的财务资料未经审计。

Table with 2 columns: 基金名称, 万家公用; 基金运作方式, 契约型开放式基金; 基金合同生效日, 2006年7月16日; 报告期末基金份额总额, 57,703,410.63份

投资策略: 本基金采用指数化投资方法,基于沪深两市行业指数成份股的加权平均,分析行业、个股估值等方面作为研究依据,实施跟踪投资策略,寻找高质量的公用事业上市公司构建股票投资组合,力求实现跟踪目标收益和超越基准的投资目标。

业绩比较基准: 本基金业绩比较基准收益率为: 沪深两市行业指数收益率+20%×同业存款利率。

基金管理人: 万家基金管理有限公司; 基金托管人: 华夏银行股份有限公司

三、主要财务数据和基金净值表现
(一)主要财务指标
基金本期净收益 5,492,933.58
期末基金资产净值 1,017,761.76元

注:1.本基金收益分配按月结转份额; 2.万家公用事业行业股票型证券投资基金本报告期投资收益及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 6 columns: 阶段, 净增长率, 净值增长率, 业绩比较基准收益(1), 业绩比较基准收益(2), (1)-(3), (2)-(4)

基金业绩比较基准收益率为: 80%×沪深两市行业指数收益率+20%×同业存款利率

万家公用事业行业股票型证券投资基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2006.7.15至2006.9.30)



本基金合同于2006年7月15日生效,截至报告日本基金合同生效满一年。

按基金合同约定,本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期,建仓期结束后应达到基金合同约定的投资比例限制:1)基金财产中投资于上市公司的股票,其市值不得超过基金资产净值的10%;2)本基金投资于其他基金的比例不得超过基金资产净值的10%;3)基金财产参与发行证券的金额不得超过基金总资产的5%;4)本基金持有的股票市值不得超过基金总资产的5%;5)本基金投资于同一原始权益人的资产,其市值不得超过基金资产净值的5%。

基金管理人: 万家基金管理有限公司; 基金托管人: 华夏银行股份有限公司

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预示其未来表现。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。

本报告期为2006年7月1日至2006年9月30日止。本报告中的财务资料未经审计。

投资策略: 本基金采用指数化投资方法,基于沪深两市行业指数成份股的加权平均,分析行业、个股估值等方面作为研究依据,实施跟踪投资策略,寻找高质量的公用事业上市公司构建股票投资组合,力求实现跟踪目标收益和超越基准的投资目标。

业绩比较基准: 本基金业绩比较基准收益率为: 沪深两市行业指数收益率+20%×同业存款利率。

基金管理人: 万家基金管理有限公司; 基金托管人: 华夏银行股份有限公司

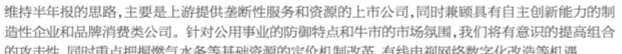
三、主要财务数据和基金净值表现
(一)主要财务指标
基金本期净收益 5,492,933.58
期末基金资产净值 1,017,761.76元

注:1.本基金收益分配按月结转份额; 2.万家公用事业行业股票型证券投资基金本报告期投资收益及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 6 columns: 阶段, 净增长率, 净值增长率, 业绩比较基准收益(1), 业绩比较基准收益(2), (1)-(3), (2)-(4)

基金业绩比较基准收益率为: 80%×沪深两市行业指数收益率+20%×同业存款利率

万家公用事业行业股票型证券投资基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2006.7.15至2006.9.30)



本基金合同于2006年7月15日生效,截至报告日本基金合同生效满一年。

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天的说明: 本期发生单日基金份额达基金净值50%的巨额申购和赎回:8月17日,发生巨额申购,应申购款计入基金资产并不计算在平均剩余期限内,导致当日投资组合平均剩余期限超过180天;8月29日,发生巨额赎回,基金无延期支付,优先卖出剩余期限短、流动性好的债券,导致单日投资组合平均剩余期限超过180天。

Table with 4 columns: 序号, 发生日期, 巨额申购, 巨额赎回

2. 报告期内基金投资组合平均剩余期限分布比例:

Table with 4 columns: 序号, 平均剩余期限, 各期限资产占基金资产净值比例, 各期限基金份额占基金资产净值比例

(四) 报告期末债券投资组合
1. 报告期末债券投资组合构成

Table with 4 columns: 序号, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例

注:上表中,“债券名称”中的“有价证券”和“封闭式国债”指所有的债券投资和通过债券回购方式回购的券类资产

2. 基金投资前十名债券明细

Table with 6 columns: 序号, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例

注:上表中,“债券名称”中的“有价证券”和“封闭式国债”指所有的债券投资和通过债券回购方式回购的券类资产

(五) “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

Table with 2 columns: 项目, 偏离情况

1. 影子定价与摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

2. 报告期末,本基金持有的剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况

3. 报告期末,本基金持有的剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况

4. 其他情况的说明

六、开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目, 金额(元)

七、备查文件目录

1. 中国证监会批准万家公用事业行业股票型证券投资基金发行及募集的文件。

2. 《万家公用事业行业股票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. 万家公用事业行业股票型证券投资基金2006年第三季度报告原文。

6. 万家基金管理有限公司董事会议决议。

7. 上述文件的存放地点及查阅方式如下: 存放地点: 基金管理人/或基金托管人的办公场所,并登录于基金管理人网站: http://www.wjasset.com

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 二〇〇六年十月二十五日

万家180指数证券投资基金 2006年第三季度报告

一、重要提示
基金管理人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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2006年10月18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预示其未来表现。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。

本报告期为2006年7月1日起至9月30日止。本报告中的财务资料未经审计。

Table with 2 columns: 基金名称, 万家180; 基金运作方式, 契约型开放式基金; 基金合同生效日, 2003年3月17日; 报告期末基金份额总额, 210,267,362.02份

投资策略: 本基金通过运用指数化投资方法,力求基金的投资组合收益水平超越业绩比较基准。

业绩比较基准: 本基金业绩比较基准收益率为: 沪深两市行业指数收益率+20%×同业存款利率。

基金管理人: 万家基金管理有限公司; 基金托管人: 华夏银行股份有限公司

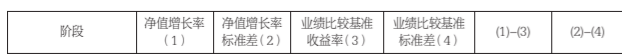
三、主要财务数据和基金净值表现
(一)主要财务指标
基金本期净收益 53,366,717.79元
期末基金资产净值 210,267,362.02份

注:1.本基金收益分配按月结转份额; 2.万家180指数证券投资基金本报告期投资收益及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 6 columns: 阶段, 净增长率, 净值增长率, 业绩比较基准收益(1), 业绩比较基准收益(2), (1)-(3), (2)-(4)

基金业绩比较基准收益率为: 80%×沪深两市行业指数收益率+20%×同业存款利率

万家180指数证券投资基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2006.7.15至2006.9.30)



本基金合同于2006年7月15日生效,截至报告日本基金合同生效满一年。

按基金合同约定,本基金自基金合同生效起3个月内为建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已符合基金合同约定的投资比例要求。

基金管理人: 万家基金管理有限公司; 基金托管人: 华夏银行股份有限公司

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预示其未来表现。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。

本报告期为2006年7月1日起至9月30日止。本报告中的财务资料未经审计。

投资策略: 本基金通过运用指数化投资方法,力求基金的投资组合收益水平超越业绩比较基准。

业绩比较基准: 本基金业绩比较基准收益率为: 沪深两市行业指数收益率+20%×同业存款利率。

基金管理人: 万家基金管理有限公司; 基金托管人: 华夏银行股份有限公司

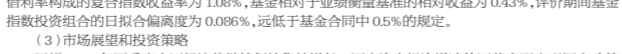
三、主要财务数据和基金净值表现
(一)主要财务指标
基金本期净收益 53,366,717.79元
期末基金资产净值 210,267,362.02份

注:1.本基金收益分配按月结转份额; 2.万家180指数证券投资基金本报告期投资收益及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 6 columns: 阶段, 净增长率, 净值增长率, 业绩比较基准收益(1), 业绩比较基准收益(2), (1)-(3), (2)-(4)

基金业绩比较基准收益率为: 80%×沪深两市行业指数收益率+20%×同业存款利率

万家180指数证券投资基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2006.7.15至2006.9.30)



本基金合同于2006年7月15日生效,截至报告日本基金合同生效满一年。

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天的说明: 本期发生单日基金份额达基金净值50%的巨额申购和赎回:8月17日,发生巨额申购,应申购款计入基金资产并不计算在平均剩余期限内,导致当日投资组合平均剩余期限超过180天;8月29日,发生巨额赎回,基金无延期支付,优先卖出剩余期限短、流动性好的债券,导致单日投资组合平均剩余期限超过180天。

Table with 4 columns: 序号, 发生日期, 巨额申购, 巨额赎回

2. 报告期内基金投资组合平均剩余期限分布比例:

Table with 4 columns: 序号, 平均剩余期限, 各期限资产占基金资产净值比例, 各期限基金份额占基金资产净值比例

(四) 报告期末债券投资组合
1. 报告期末债券投资组合构成

Table with 4 columns: 序号, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例

注:上表中,“债券名称”中的“有价证券”和“封闭式国债”指所有的债券投资和通过债券回购方式回购的券类资产

2. 基金投资前十名债券明细

Table with 6 columns: 序号, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例

注:上表中,“债券名称”中的“有价证券”和“封闭式国债”指所有的债券投资和通过债券回购方式回购的券类资产

(五) “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

Table with 2 columns: 项目, 偏离情况

1. 影子定价与摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

2. 报告期末,本基金持有的剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况

3. 报告期末,本基金持有的剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况

4. 其他情况的说明

六、开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目, 金额(元)

七、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2006年第三季度报告原文。

6. 万家基金管理有限公司董事会议决议。

7. 上述文件的存放地点及查阅方式如下: 存放地点: 基金管理人/或基金托管人的办公场所,并登录于基金管理人网站: http://www.wjasset.com

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 二〇〇六年十月二十五日