

万家180 指数证券投资基金 2007年第四季度报告

一、重要提示
基金管理人及基金托管人承诺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。
基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2008年1月17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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。投资者在投资前应认真阅读本基金招募说明书。
本报告期内基金不存在关联交易事项。报告期内，基金管理人及基金托管人不存在任何违法违规及违反基金合同约定的行为。
本报告期于2007年10月1日起至2007年12月31日止。本报告中的财务资料未经审计。

二、基金基本情况

1.基金名称	万家180
2.基金运作方式	契约型开放式
3.基金合同生效日	2003年03月17日
4.报告期末基金份额总额	6,364,412,214.33份
5.基金管理人	万家基金管理有限公司
6.基金托管人	中信银行股份有限公司
7.基金合同生效以来基金投资运作情况的简要说明	本基金自成立以来的基金投资运作情况，请参见本报告中的基金管理人报告。

三、主要财务指标和基金净值表现

1.本期利润	-172,466,304.62
2.本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	287,139,622.40
3.加权平均基金份额本期利润	-0.027289
4.期末基金份额净值	1.0385
5.期末基金资产净值	6,651,878,516.61
6.期末基金份额净值	1.2308

(3) 本基金投资于上述180指数成份股的比例不低于基金资产净值的90%，并尽量提高基金净值的90%基金资产投资于股票。投资于跟踪标的指数的成份股的比例不低于基金资产净值的90%。本基金的各项投资比例符合法律法规及基金合同中的相关规定。
四、管理人报告
报告期内，基金经理曾仕军先生担任本基金的基金经理。曾仕军先生曾任中国工商银行总行资产管理部副经理，负责管理总行资产管理部管理的证券投资基金。曾仕军先生具有多年基金管理经验，具备良好的职业道德和风险控制意识。
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》等法律法规及中国证监会的有关规定，勤勉尽责，为基金份额持有人谋求利益。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》等法律法规及中国证监会的有关规定，勤勉尽责，为基金份额持有人谋求利益。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》等法律法规及中国证监会的有关规定，勤勉尽责，为基金份额持有人谋求利益。
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》等法律法规及中国证监会的有关规定，勤勉尽责，为基金份额持有人谋求利益。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》等法律法规及中国证监会的有关规定，勤勉尽责，为基金份额持有人谋求利益。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》等法律法规及中国证监会的有关规定，勤勉尽责，为基金份额持有人谋求利益。

(一) 基金资产净值及基金份额

C3 电子、非金属	64,712,249.62	0.70%
C0 金融、非金属	746,677,481.03	9.53%
C7 机械、设备、仪表	460,972,026.73	5.75%
C2 医药、生物制品	98,533,630.26	1.26%
C9 其他制造业	31,120,880.78	0.40%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	534,114,103.60	6.82%
K 房地产业	28,008,272.14	0.35%
F 交通运输、仓储业	746,376,568.71	9.37%
G 信息技术业	203,602,894.21	2.57%
H 批发和零售业	100,773,918.93	1.26%
L 金融、保险业	1,979,941,100.50	25.00%
I 制造业	286,412,738.18	3.60%
K 房地产业	28,008,272.14	0.35%
L 金融、保险业	93,903,001.28	1.18%
M 传播与文化产业	40,273,877.31	0.51%
N 综合类	181,156,946.34	2.28%
合计	723,034,727.27	93.89%

报告期内基金管理人承诺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。如有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，中国证监会将依法对基金管理人进行处罚。

3. 基金的投资组合构成

序号	其他资产	金额(元)
1	应收保证金	321,849.12
2	应收证券清算款	73,076,982.60
3	应收利息	184,433.91
4	应收申购款	19,737,326.07
5	其他应收款	---
6	待摊费用	0.00
7	其他	0.00
合计	合计	93,326,692.70

五、投资组合报告

(一) 报告期末基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金资产净值比例
股票	7,331,034,727.27	90.50%
债券	2,166,924.00	0.03%
权证	987,143.13	0.01%
资产支持证券	0.00	0.00%
银行存款和备付金合计	672,304,872.40	8.23%
其他资产	93,326,990.70	1.13%
其他	8,100,479,851.30	100.00%

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	市值(元)	占基金资产净值比例
A 农林牧渔	60,227,401.20	0.64%
B 采矿业	1,033,113,762.51	13.19%
C 制造业	1,876,210,267.88	23.96%
C0 食品、饮料	260,354,872.40	3.31%
C1 纺织服装、皮毛	79,197,552.72	1.01%
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	154,561,568.22	1.97%

(二) 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为：上证180指数收益率×50%+银行同业存款利率×50%。
本基金管理人认为，本基金业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的投资目标和风险水平。本基金管理人认为，本基金业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的投资目标和风险水平。本基金管理人认为，本基金业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的投资目标和风险水平。

(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	600028	中国石化	18,900,362	442,836,247.36	5.61%
2	600030	中信证券	4,877,006	431,807,550.92	5.51%
3	600016	民生银行	21,623,544	320,460,922.00	4.09%
4	600000	浦发银行	5,804,879	306,407,611.20	3.91%
5	600008	招商银行	7,289,680	288,728,763.17	3.69%
6	600019	宝钢股份	11,403,906	198,188,672.80	2.54%
7	600060	中国铁建	14,962,972	179,544,701.76	2.29%
8	600090	长江电力	9,075,776	176,880,874.24	2.28%
9	600018	华鲁恒升	760,380	172,761,000.00	2.23%
10	601318	中国平安	1,522,536	161,141,000.00	2.06%

(四) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	国债	0.00	0.00%
2	金融债	0.00	0.00%
3	企业债	1,363,130.00	0.02%
4	可转债	2,166,924.00	0.03%
5	其他	0.00	0.00%
合计	合计	2,166,924.00	0.03%

(五) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券

序号	资产支持证券名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(六) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

序号	权证名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(七) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券

序号	资产支持证券名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(八) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

序号	权证名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(九) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

序号	权证名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(十) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

序号	权证名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(十一) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

序号	权证名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(十二) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

序号	权证名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(十三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

序号	权证名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(十四) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

序号	权证名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(十五) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

序号	权证名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(十六) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

序号	权证名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(十七) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

序号	权证名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(十八) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

序号	权证名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(十九) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

序号	权证名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(二十) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

序号	权证名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(二十一) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

序号	权证名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(二十二) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

序号	权证名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(二十三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

序号	权证名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(二十四) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

序号	权证名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(二十五) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

序号	权证名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(二十六) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

序号	权证名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(二十七) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

序号	权证名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(二十八) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

序号	权证名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(二十九) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

序号	权证名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(三十) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

序号	权证名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(三十一) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

序号	权证名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(三十二) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

序号	权证名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(三十三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

序号	权证名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(三十四) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

序号	权证名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(三十五) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

序号	权证名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(三十六) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

序号	权证名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(三十七) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证

序号	权证名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	07上汽CWB11	1,068,648	0.01%
2	其他	987,143.13	0.01%
合计	合计	2,055,791.13	0.02%

(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	600028	中国石化	18,900,362	442,836,247.36	5.61%
2	600030	中信证券	4,877,006	431,807,550.92	5.51%
3	600016	民生银行	21,623,544	320,460,922.00	4.09%
4	600000	浦发银行	5,804,879	306,407,611.20	3.91%
5	600019	宝钢股份	11,403,906	198,188,672.80	2.54%
6	600060	中国铁建	14,962,972	179,544,701.76	2.29%
7	600090	长江电力	9,075,776	176,880,874.24	2.28%
8	600018	华鲁恒升	760,380	172,761,000.00	2.23%
9	601318	中国平安	1,522,536	161,141,000.00	2.06%

(四) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券

序号	债券名称	市值(元)	占基金资产净值比例
1	国债	0.0	