

重要提示
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，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本年度报告已经三分之一以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2006年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、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、重大遗漏。

基金管理人以诚实信用、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代表其未来表现。投资有风险，投资人在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

在基金存续期间，基金管理人对基金财务资料已经审计，上海公证华证会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本年度报告摘要摘自年度报告全文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

第一章 基金简介

1.基金名称：万家180指数证券投资基金

2.基金简称：万家180

3.基金交易代码：519190

4.基金运作方式：契约型开放式

5.基金合同生效日：2003年3月17日

6.报告期末基金份额总额：6,364,412,216.33份

7.基金合同存续期：不定期

8.基金上市交易的证券交易所：无

9.上证日期：无

10.报告期天数：365天

(二)基金产品说明

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赶上上证180指数的增长率。伴随着中国经济增长和资本市场的健康发展，实现运用指数化投资方式谋求基金资产长期稳定的回报。

本基金以跟踪指数为原则，实现与市场同步成长的基本理念，同时精选个股，力争在控制风险的前提下，获得超越指数的收益。

本基金的投资风格是一种风险适中、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。

(三)基金管理人

1.名称：万家基金管理有限公司

2.注册地址：上海市浦东新区陆家嘴450号新国际大厦23楼

3.办公地址：上海市浦东新区陆家嘴450号新国际大厦23楼

4.邮政编码：200122

5.国际互联网站：<http://www.wjasset.com>

6.法定代表人：柳亚明

7.总经理：李振伟

8.信息披露负责人：吴涛

9.联系电话：021-38919899

10.传真：021-38919888

11.电子邮件：wu@wjasset.com

(四)基金托管人

1.名称：中国银行股份有限公司

2.注册地址：北京市复兴门内大街1号

3.办公地址：北京市复兴门内大街1号

4.邮政编码：100011

5.国际互联网站：<http://www.bocom>

6.法定代表人：肖钢

7.信息披露负责人：宁敬

8.联系电话：010-66949707

9.传真：010-66949442

10.电子邮件：tgxpx@bank-of-china.com

(五)信息披露

信息披露名称：《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》

登载年度报告的管理人互联网网址：<http://www.wjasset.com>

基金年度报告备置地点：上海市浦东新区陆家嘴450号基金公司办公场所

第二章 主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况

本基金的业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

一、主要财务指标

单位：人民币元

序号 主要财务指标 2007年 2006年

1 本期利润 270,728,421.61 310,248,387.05

2 累计利润扣减本期公允价值变动 466,673,095.34 156,956,971.97

3 固定期平均份额本期利润 0.1800 0.0934

4 固定期平均利润 -0.0098 0.0583

5 基金总资产值 7,839,366,215.33 199,628,065.99

6 基金总份额值 1.2308 1.0269

7 固定期平均份额时间间隔率 139.4% 80.6%

8 固定期平均份额增长率 142.5% 124.9%

9 固定期平均份额增长长率 -0.96% -0.4%

10 固定期平均净值增长率 37.23% 94.85%

11.增加“本期利润扣减本期公允价值变动后的利润”

12.原“本期收益”名称调整为“本期利润扣减本期公允价值变动后的利润”

13.原“加权平均基金份额本期净收益”名称调整为“加权平均基金份额本期利润”，计算方法在原

基础上增加“按单个账户分母不同进行重新计算”的基础。

“加权平均基金份额本期净收益”公式： $(\frac{A}{B} + \frac{C}{D}) / E$ 的基础上，将 P 作为本期利润。

二、基金净值表现

1.万万家180指数基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差额率表

阶段 净增长百分比 准差(2%) 收益率(3%) (1)-(3) (2)-(4)

过去3个月 -1.13% 1.61% -2.93% 1.92% 182% -0.31%

过去6个月 42.47% 18.00% 41.57% 1.97% 0.90% -0.17%

过去一年 142.5% 20.06% 141.00% 2.16% -0.10%

过去三年 416.46% 15.0% 306.01% 1.58% -0.06%

自基金成立以来 372.97% 1.33% 345.72% 1.38% 26.65% -0.05%

2.万万家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图对比如图(2003年3月17日至2007年12月31日)

3.过去三年每年的净值增长率，与同期业绩比较基准收益率的对比如图

4.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

5.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

6.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

7.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

8.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

9.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

10.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

11.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

12.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

13.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

14.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

15.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

16.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

17.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

18.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

19.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

20.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

21.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

22.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

23.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

24.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

25.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

26.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

27.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

28.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

29.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

30.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

31.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

32.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

33.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

34.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

35.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

36.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

37.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

38.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

39.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

40.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

41.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

42.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

43.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

44.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

45.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

46.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

47.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

48.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

49.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

50.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

51.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

52.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

53.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

54.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

55.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

56.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

57.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

58.本基金在2003年3月17日开始担任本期管理人，从那时起担任本期管理人至今。

59.本基金在2003年3