

万家180 指数证券投资基金 2008年半年度报告摘要

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

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...

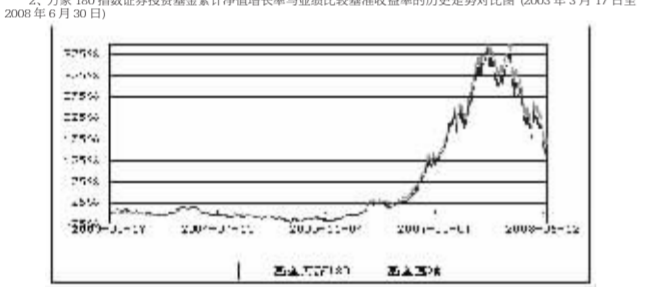
基金管理人: 万家基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司
基金名称: 万家180指数证券投资基金

投资目标: 本基金通过运用量化投资方法, 力求实现超越业绩比较基准的长期资本增值, 并力争在控制风险的前提下, 力争实现超越业绩比较基准的长期资本增值...

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
基金名称: 万家180指数证券投资基金

Table with 5 columns: 序号, 主要财务指标, 2008年1月1日至2008年6月30日, 2007年1月1日至2007年6月30日, 单位: 人民币元

Table with 5 columns: 序号, 主要财务指标, 2008年1月1日至2008年6月30日, 2007年1月1日至2007年6月30日, 单位: 人民币元



1. 本基金在报告期内净值下降比例超过10%。2. 本基金投资于股票资产的比例, 不低于基金资产净值的60%...

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
基金名称: 万家180指数证券投资基金

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
基金名称: 万家180指数证券投资基金

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
基金名称: 万家180指数证券投资基金

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
基金名称: 万家180指数证券投资基金

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
基金名称: 万家180指数证券投资基金

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
基金名称: 万家180指数证券投资基金

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
基金名称: 万家180指数证券投资基金

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
基金名称: 万家180指数证券投资基金

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
基金名称: 万家180指数证券投资基金

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
基金名称: 万家180指数证券投资基金

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
基金名称: 万家180指数证券投资基金

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
基金名称: 万家180指数证券投资基金

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
基金名称: 万家180指数证券投资基金

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
基金名称: 万家180指数证券投资基金

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
基金名称: 万家180指数证券投资基金

2. 利润表
单位: 人民币元
项目 附注 2008年1月1日至2008年6月30日 2007年1月1日至2007年6月30日

Table with 5 columns: 项目, 附注, 2008年1月1日至2008年6月30日, 2007年1月1日至2007年6月30日, 单位: 人民币元

3. 所有者权益(基金净值)变动表
单位: 人民币元
项目 2008年1月1日至2008年6月30日

Table with 5 columns: 项目, 2008年1月1日至2008年6月30日, 2007年1月1日至2007年6月30日, 单位: 人民币元

(一) 会计报表附注
1. 基金会计政策及会计估计
2. 基金估值程序

3. 关联方关系
关联方: 中国银行股份有限公司

4. 本报告期关联方关系发生变化的情况
5. 本报告期关联方关系发生变化的情况

6. 本报告期关联方关系发生变化的情况
7. 本报告期关联方关系发生变化的情况

8. 本报告期关联方关系发生变化的情况
9. 本报告期关联方关系发生变化的情况

10. 本报告期关联方关系发生变化的情况
11. 本报告期关联方关系发生变化的情况

12. 本报告期关联方关系发生变化的情况
13. 本报告期关联方关系发生变化的情况

14. 本报告期关联方关系发生变化的情况
15. 本报告期关联方关系发生变化的情况

16. 本报告期关联方关系发生变化的情况
17. 本报告期关联方关系发生变化的情况

18. 本报告期关联方关系发生变化的情况
19. 本报告期关联方关系发生变化的情况

20. 本报告期关联方关系发生变化的情况
21. 本报告期关联方关系发生变化的情况

22. 本报告期关联方关系发生变化的情况
23. 本报告期关联方关系发生变化的情况

24. 本报告期关联方关系发生变化的情况
25. 本报告期关联方关系发生变化的情况

26. 本报告期关联方关系发生变化的情况
27. 本报告期关联方关系发生变化的情况

28. 本报告期关联方关系发生变化的情况
29. 本报告期关联方关系发生变化的情况

30. 本报告期关联方关系发生变化的情况
31. 本报告期关联方关系发生变化的情况

32. 本报告期关联方关系发生变化的情况
33. 本报告期关联方关系发生变化的情况

34. 本报告期关联方关系发生变化的情况
35. 本报告期关联方关系发生变化的情况

36. 本报告期关联方关系发生变化的情况
37. 本报告期关联方关系发生变化的情况

38. 本报告期关联方关系发生变化的情况
39. 本报告期关联方关系发生变化的情况

截至报告期末2008年6月30日止, 本基金未持有在买入或卖出交易过程中收到的, 在对方法没有违约时就可以出售或用于质押的证券。

Table with 5 columns: 项目, 2008年6月30日, 2007年12月31日, 单位: 人民币元

截至报告期末2008年6月30日止, 本基金在报告期内未出现定期存款提前支取, 造成利息损失的情况。

Table with 5 columns: 项目, 2007年12月31日, 2007年12月31日, 2007年12月31日, 单位: 人民币元

7. 风险管理
(1) 风险管理政策和组织架构
(2) 信用风险管理

(3) 流动性风险管理
(4) 市场风险管理

(5) 利率风险管理
(6) 汇率风险管理

(7) 操作风险管理
(8) 合规风险管理

(9) 信息披露管理
(10) 投资者关系管理

(11) 基金估值程序
(12) 基金估值程序

(13) 基金估值程序
(14) 基金估值程序

(15) 基金估值程序
(16) 基金估值程序

(17) 基金估值程序
(18) 基金估值程序

(19) 基金估值程序
(20) 基金估值程序

(21) 基金估值程序
(22) 基金估值程序

(23) 基金估值程序
(24) 基金估值程序

(25) 基金估值程序
(26) 基金估值程序

(27) 基金估值程序
(28) 基金估值程序

(29) 基金估值程序
(30) 基金估值程序

(31) 基金估值程序
(32) 基金估值程序

(33) 基金估值程序
(34) 基金估值程序

(35) 基金估值程序
(36) 基金估值程序

(37) 基金估值程序
(38) 基金估值程序

(39) 基金估值程序
(40) 基金估值程序

(41) 基金估值程序
(42) 基金估值程序

(43) 基金估值程序
(44) 基金估值程序

(45) 基金估值程序
(46) 基金估值程序

(47) 基金估值程序
(48) 基金估值程序

1. 报告期内累计买入价值超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 累计买入金额(元), 占期末资产净值比例(%)

2. 报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 累计卖出金额(元), 占期末资产净值比例(%)

3. 报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 2 columns: 买入股票成本总额, 卖出股票收入总额

(五) 报告期末按种类分列的债券投资组合

Table with 2 columns: 债券种类, 公允价值

(六) 报告期末本基金权证投资组合

Table with 2 columns: 权证名称, 公允价值

(七) 报告期末资产支持证券投资组合

Table with 2 columns: 资产支持证券名称, 公允价值

(八) 投资组合报告附注

Table with 5 columns: 序号, 权证名称, 代码, 数量, 成本(元), 公允价值(元)

报告期末本基金前十名重仓股票

Table with 5 columns: 序号, 股票名称, 代码, 数量, 成本(元), 公允价值(元)

报告期末本基金前十名重仓债券

Table with 5 columns: 序号, 债券名称, 代码, 数量, 成本(元), 公允价值(元)

报告期末本基金前十名重仓权证

Table with 5 columns: 序号, 权证名称, 代码, 数量, 成本(元), 公允价值(元)