万家180指数证券投资基金2014年年度报告

2014年12月31日

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

送出日期：2015年3月27日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二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规定，于 2015 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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代表其未来表现。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及其更新。

本报告财务资料已经审计。安永华明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。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 2014 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
3.3 其他指标 **错误!未定义书签。**
3.4 过去三年基金的利润分配情况 8
§4 管理人报告 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 13
§5 托管人报告 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 13
§6 审计报告 13
6.1 审计报告基本信息 13
6.2 审计报告的基本内容 14
§7 年度财务报表 14
7.1 资产负债表 14
7.2 利润表 16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 17
7.4 报表附注 18
§8 投资组合报告 41
8.1 期末基金资产组合情况 41
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 42
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 43
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 48
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 49
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 49

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 49
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 49
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 49
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 50
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 50
8.12 投资组合报告附注 50
§9 基金份额持有人信息 51
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 51
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 51
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 51
§10 开放式基金份额变动 51
§11 重大事件揭示 52
11.1 基金份额持有人大会决议 52
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 52
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 52
11.4 基金投资策略的改变 52
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 52
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 52
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 53
11.8 其他重大事件 ..... **错误!未定义书签。**
§12 影响投资者决策的其他重要信息 55
§13 备查文件目录 55
13.1 备查文件目录 55
13.2 存放地点 55
13.3 查阅方式 55

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家 180 指数证券投资基金
基金简称	万家 180 指数
基金主代码	519180
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 3 月 17 日
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
报告期末基金份额总额	4,522,505,120.65 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	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拟合上证 180 指数的增长率。伴随中国经济增长和资本市场的发展,实现利用指数化投资方法谋求基金资产长期增值的目标。
投资策略	本基金以跟踪目标指数为原则,实现与市场同步成长为基本理念。指数化投资是一种充分考虑投资者利益的投资方法,采取拟合目标指数收益率的投资策略,分散投资于目标指数所包含的股票中,力求股票组合的收益率拟合目标指数所代表的资本市场的平均收益率。
业绩比较基准	95%×上证 180 指数收益率+5%×银行同业存款利率
风险收益特征	本基金追踪上证 180 指数,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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		万家基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	王永民
	联系电话	021-38909626	010-66594896
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95538 转 6、4008880800	95566
传真		021-38909627	010-66594942
注册地址		上海市浦东新区浦电路 360 号陆家嘴投资大厦 9 楼	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		上海市浦东新区浦电路 360 号陆家嘴投资大厦 9 楼	北京西城区复兴门内大街 1 号

邮政编码	200122	100818
法定代表人	毕玉国	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.wjasset.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014 年	2013 年	2012 年
本期已实现收益	32,108,749.15	-324,731,438.01	-723,979,133.73
本期利润	1,561,363,998.84	-110,800,811.41	513,259,715.92
加权平均基金份额本期利润	0.2767	-0.0175	0.0501
本期加权平均净值利润率	49.99%	-3.12%	9.18%
本期基金份额净值增长率	58.78%	-7.29%	11.19%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
期末可供分配利润	-2,373,122,469.59	-3,086,985,974.84	-4,720,850,670.62
期末可供分配基金份额利润	-0.5247	-0.5367	-0.4897
期末基金资产净值	3,864,124,429.27	3,094,952,290.07	5,595,848,391.16
期末基金份额净值	0.8544	0.5381	0.5804
3.1.3 累计期末指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
基金份额累计净值增长率	241.97%	115.37%	132.30%

注：(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

(2)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

(3)期末可供分配利润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。

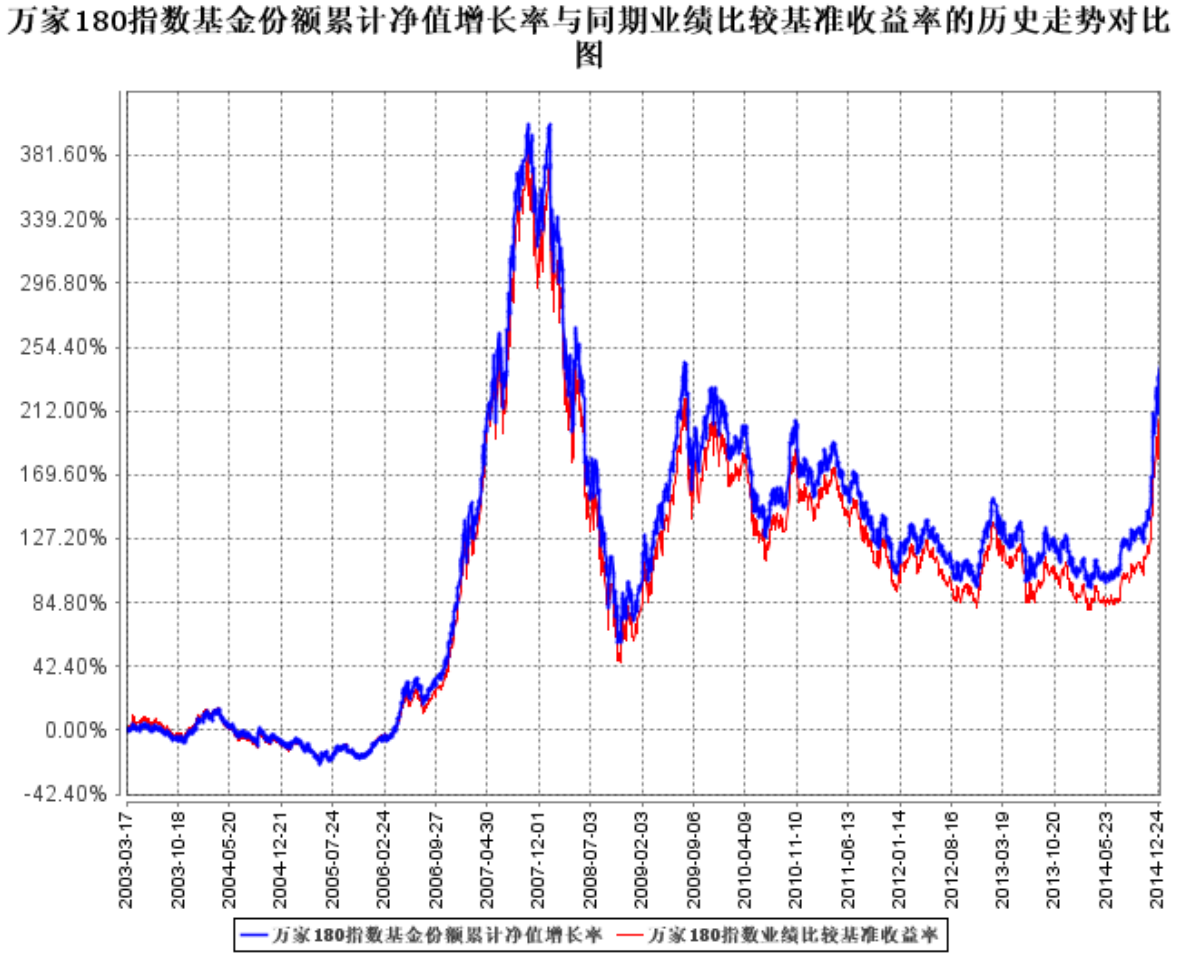
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	47.36%	1.70%	47.64%	1.69%	-0.28%	0.01%
过去六个月	67.27%	1.34%	65.78%	1.35%	1.49%	-0.01%
过去一年	58.78%	1.20%	56.12%	1.20%	2.66%	0.00%
过去三年	63.68%	1.25%	57.48%	1.26%	6.20%	-0.01%
过去五年	7.32%	1.29%	4.19%	1.30%	3.13%	-0.01%
自基金合同生效起至今	241.97%	1.57%	209.24%	1.60%	32.73%	-0.03%

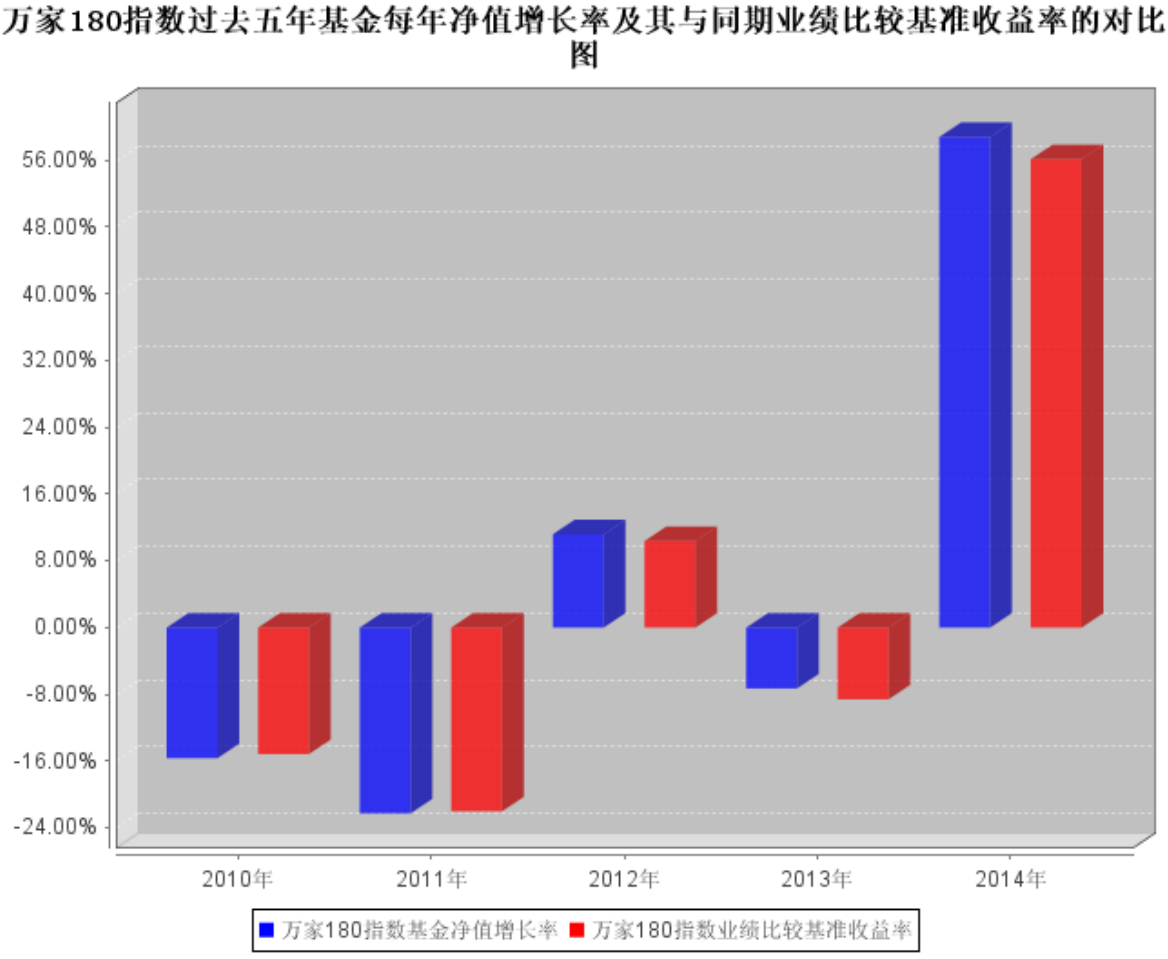
注:基金业绩比较基准增长率=95%*上证 180 指数增长率+5%*银行同业存款利率

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金成立于 2003 年 3 月 17 日,建仓期为三个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

3.2.3 过去五年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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金在过去三年未实施利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44 号文批准设立。公司现股东为齐鲁证券有限公司、新疆国际实业股份有限公司和山东省国有资产投资控股有限公司,住所地及办公地点均为上海市浦东新区浦电路 360 号 9 楼,注册资本 1 亿元人民币。目前管理十八只基金,分别为万家 180 指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选股票型证券投资

基金、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家精选股票型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数型证券投资基金、万家添利分级债券型证券投资基金、万家中证创业成长指数分级证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家上证 380 交易型开放式指数证券投资基金、万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金和万家现金宝货币市场证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴涛	本基金基金经理、万家中证红利基金基金经理、万家中证创业成长指数分级基金基金经理、万家上证 380ETF 基金基金经理、量化投资部总监	2010 年 3 月 31 日	-	21 年	硕士学位，曾任天同证券有限责任公司上海营业部副总经理、天同证券有限责任公司深圳营业部总经理、南方总部副总经理、万家基金管理有限公司监察稽核部总监等职。

注:1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律、法规和监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金持有人谋取最大利益,没有损害基金

持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《万家基金管理有限公司公平交易管理办法》，涵盖了研究、授权、投资决策和交易执行等投资管理活动的各个环节，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送，确保公平对待不同投资组合。

在投资决策上：（1）公司对不同类别的投资组合分别设定独立的投资部门，公募基金经理和特定客户资产管理投资经理不得互相兼任。（2）公司投资管理实行分层次决策，投资决策委员会下设的公募基金投资决策小组和专户投资决策小组分别根据公募基金和专户投资组合的规模、风格特征等因素合理确定各投资组合经理的投资权限，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需经过严格的逐级审批程序。（3）公司接受的外部研究报告、研究员撰写的研究报告等均通过统一的投研管理平台发布，确保各投资组合经理在获得投资信息、投资建议和实施决策方面享有公平的机会。

在交易执行上：（1）公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度；（2）对于交易公开竞价交易，所有指令必须通过系统下达，公司执行交易系统中的公平交易程序；（3）对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；（4）对于银行间交易，交易部按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。

在行为监控上，公司定期对不同投资组合的同向交易价差、反向交易，场外交易对手议价的价格公允性及其他异常交易情况进行监控及分析，基金经理对异常交易情况进行合理性解释并留存记录，并定期编制公平交易分析报告，由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司定期进行同向交易价差分析，即采集公司旗下管理的所有组合，连续四个季度期间内，不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的同向交易样本，对两两组合之间的同向交易价差均值进行原假设为 0，95%的置信水平下的 t 检验，并对结论进行跟踪分析，分析结果显示在样本数量大于 30 的前提下，组合之间在同向交易方面不存在违反公平交易行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易次数为 1 次，为指数型基金因被动跟踪标的指数与其他组合发生同日反向交易，不存在不公平交易和利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金作为被动投资的指数基金，其投资目标是通过跟踪、复制上证 180 指数，为投资者获取市场长期的平均收益。报告期内我们严格按照基金合同规定，原则上采取完全复制的方法进行投资管理，努力拟合标的指数，减小跟踪误差，将基金跟踪误差控制在较低范围之内。同时，本基金采用有效的量化跟踪技术，降低管理成本。导致跟踪误差的主要原因是基金申购赎回、禁止投资成分股替代和标的指数成分股调整等因素。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.8544 元，报告期内基金份额净值增长率为 58.78%，同期业绩比较基准收益率为 56.12%，基金日跟踪误差为 0.0518%，符合基金合同规定的日拟合偏离度不超过 0.5%的规定。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为国内经济增长 2015 年将保持平稳的下行态势，进入经济增速回落和增长质量提高的新常态，积极的财政政策和稳健偏松的货币政策将对冲房地产投资的下滑，有力保证经济增长的稳定性。随着经济结构调整的不断深化和诸多改革措施的落实，深刻的结构变化和动力机制变化将继续推进，特别是一些领域的改革攻坚将会为经济中长期发展注入持久的活力和动力，上市公司盈利状况将会稳步提高，证券市场的长期投资基础将会有效改善。因此，我们看好中国经济和国内股票市场中长期发展前景，看好今年符合国家经济发展指向和产业发展趋势的国企改革、“一带一路” 等主题投资机会的市场前景。本基金所跟踪的上证 180 指数作为沪市大中盘蓝筹股的基准指数，估值优势明显、市场代表性强，具备较高的长期投资价值。

本基金将继续贯彻被动投资理念,恪守基金合同规定的投资目标和投资策略,一如既往地规范、勤勉运作,将本基金打造为稳定有效的指数投资工具,为基金份额持有人谋求长期、稳定回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内,基金管理人为防范和化解经营风险,确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完

整,主要做了以下工作:

(一)加强风控文化建设

不断梳理和优化制度流程、防范操作风险、加强对员工的合规培训和加深员工对合规风控工作的理解，确保公司各项业务合法合规。

（二）制度流程建设

为加强内控管理，保证公司各项制度流程的有效性、及时性、完备性，本年度对投资、销售相关的制度流程及后台部门相关制度进行了修订;本年度还制订了多项 ETF 相关管理制度和流程。

(三)定期和临时稽核工作

报告期内，监察稽核部门按计划完成了各项定期稽核和专项稽核，检查内容覆盖公司各业务部门和业务环节，检查完成后出具监察稽核报告和建议书，并对整改情况进行跟踪。

(四)绩效评估和风险管理工作

报告期内,优化并形成了较为完善的每日风险监控；改进基金业绩评价工作，辅助基金经理投资决策；针对专户量化投资产品、股指期货产品等新业务进行合规、风险分析和系统测试，提供风险评估意见等；针对由于市场流动性紧张的情况，加大了对货币基金的风险管理，防范资金交收风险。

(五) 员工行为管理与防控内幕交易

报告期内, 公司进一步完善防控内幕交易制度和从业人员投资申报等制度，强化员工行为管理工作，防范内幕交易和利益输送。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了估值委员会,定期评价现行估值政策和程序,在发生了影响估值政策和程序有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。估值委员会由督察长、基金运营部负责人、合规稽核部负责人、权益投资部负责人、固定收益部负责人等组成。估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关从业资格,精通各自领域的理论知识,熟悉政策法规,并具有丰富的实践经验。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不介入基金日常估值业务。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金在报告期内未实施利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未发生连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万的情况。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在万家 180 指数证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2015）审字第 60778298_B02 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	万家 180 指数证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的万家 180 指数证券投资基金财务报表，包括 2014 年 12 月 31 日的资产负债表、2014 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人万家基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了万家 180 指数证券投资基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	汤骏	浦未娜
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	中国　北京	
审计报告日期	2015 年 3 月 20 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：万家 180 指数证券投资基金

报告截止日： 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	215,956,637.63	17,039,158.42
结算备付金		1,933,458.67	5,106,250.47
存出保证金		1,481,102.98	2,248,016.24
交易性金融资产	7.4.7.2	3,668,718,172.68	3,068,390,965.34
其中：股票投资		3,668,718,172.68	2,877,695,990.94
基金投资		-	-
债券投资		-	190,694,974.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	7,236,456.90
应收利息	7.4.7.5	42,619.28	2,722,448.07
应收股利		-	-
应收申购款		4,447,668.42	120,091.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,892,579,659.66	3,102,863,387.19
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2014 年 12 月 31 日**	**上年度末 2013 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		502.95	-
应付赎回款		22,263,774.18	2,582,466.18
应付管理人报酬		3,021,241.90	2,678,058.88
应付托管费		604,248.36	535,611.74
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,067,915.51	1,610,285.53
应交税费		-	31,717.80
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	497,547.49	472,956.99
负债合计		28,455,230.39	7,911,097.12
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	4,522,505,120.65	5,751,313,814.96

未分配利润	7.4.7.10	-658,380,691.38	-2,656,361,524.89
所有者权益合计		3,864,124,429.27	3,094,952,290.07
负债和所有者权益总计		3,892,579,659.66	3,102,863,387.19

注:报告截止日 2014 年 12 月 31 日,基金份额净值 0.8544 元,基金份额总额 4,522,505,120.65 份。

7.2 利润表

会计主体：万家 180 指数证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
一、收入		1,610,761,360.13	-54,352,988.06
1.利息收入		4,041,077.17	5,751,956.89
其中：存款利息收入	7.4.7.11	901,449.38	593,673.04
债券利息收入		3,103,513.04	4,543,422.45
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		36,114.75	614,861.40
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		75,800,357.05	-276,255,756.10
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-4,452,005.81	-364,638,332.22
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	8,397,384.37	9,189,680.87
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	71,854,978.49	79,192,895.25
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,529,255,249.69	213,930,626.60
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,664,676.22	2,220,184.55
减：二、费用		49,397,361.29	56,447,823.35
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	31,187,335.72	35,743,898.83
2. 托管费	7.4.10.2.2	6,237,467.13	7,148,779.77
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	11,540,894.30	13,105,154.70
5. 利息支出		-	9,986.96
其中：卖出回购金融资产支出		-	9,986.96
6. 其他费用	7.4.7.20	431,664.14	440,003.09
三、利润总额（亏损总额以“-”		1,561,363,998.84	-110,800,811.41

号填列）			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,561,363,998.84	-110,800,811.41

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家 180 指数证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	5,751,313,814.96	-2,656,361,524.89	3,094,952,290.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,561,363,998.84	1,561,363,998.84
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,228,808,694.31	436,616,834.67	-792,191,859.64
其中：1.基金申购款	2,241,557,239.00	-1,004,644,352.36	1,236,912,886.64
2.基金赎回款	-3,470,365,933.31	1,441,261,187.03	-2,029,104,746.28
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	4,522,505,120.65	-658,380,691.38	3,864,124,429.27
项目	**上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日**		
	实收基金	**未分配利润**	**所有者权益合计**
一、期初所有者权益（基金净值）	9,641,123,815.79	-4,045,275,424.63	5,595,848,391.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-110,800,811.41	-110,800,811.41
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-3,889,810,000.83	1,499,714,711.15	-2,390,095,289.68

（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	756,616,907.19	-318,205,917.16	438,410,990.03
2.基金赎回款	-4,646,426,908.02	1,817,920,628.31	-2,828,506,279.71
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	5,751,313,814.96	-2,656,361,524.89	3,094,952,290.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

毕玉国	李杰	陈广益
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

万家 180 指数证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2002]88 号文《关于同意天同 180 指数证券投资基金设立的批复》的核准，由基金管理人万家基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2003 年 3 月 17 日正式生效，首次设立募集规模为 1,929,789,525.65 基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为万家基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金资产的股票指数化投资部分主要投资于组成上证 180 指数的成份股票，包括：上证 180 指数包含的 180 只成份股、预期将要被选入上证 180 指数的股票、一级市场申购的新股；本基金资产的债券投资部分投资于国债、优质企业债、金融债以及债券回购；本基金亦可投资于经中国证监会批准允许投资的其他金融工具。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拟合上证 180 指数增长率。本基金的业绩比较基准为：95%×上证 180 指数收益率＋5%×银行同业存款利率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会

计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

采用若干修订后/新会计准则

2014 年 1 至 3 月，财政部制定了《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》和《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》；修订了《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》和《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》；上述 7 项会计准则均自 2014 年 7 月 1 日起施行。2014 年 6 月，财政部修订了《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，在 2014 年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本基金的财务报表无重大影响。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权

益工具的合同。

(1)金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资；

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2)债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3)权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4)分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5)回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

(1)存在活跃市场的金融工具

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(2)不存在活跃市场的金融工具

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5)股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6)债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7)资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8)衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9)股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(10)公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(11)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1)基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00%的年费率逐日计提；

(2)基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率逐日计提；

(3)卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4)其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)基金收益分配采用现金方式，投资者可选择获取现金红利或者将现金红利按红利权益登记日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；如果投资者没有明示选择，则视为选择现金发放方式；

(2)每一基金份额享有同等分配权；

(3)基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

(4)如果基金投资当期出现亏损，则可不进行收益分配；

(5)基金收益分配比例按照有关规定执行；

(6)在满足分配条件下，每年至少分配一次，分配比例不低于基金净收益的 90%；成立不满 3 个月，收益可不分配；期中分配由基金管理人另行公告，年度分配在基金会计年度结束后 4 个月内完成；

(7)法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

会计政策变更的说明可参见 7.4.2 会计报表的编制基础。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.6.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

7.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
活期存款	215,956,637.63	17,039,158.42
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	215,956,637.63	17,039,158.42

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2014 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		2,596,129,634.31	3,668,718,172.68	1,072,588,538.37
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,596,129,634.31	3,668,718,172.68	1,072,588,538.37
项目		上年度末 2013 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		3,333,557,210.09	2,877,695,990.94	-455,861,219.15
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	61,663,116.57	61,387,974.40	-275,142.17
	银行间市场	129,837,350.00	129,307,000.00	-530,350.00
	合计	191,500,466.57	190,694,974.40	-805,492.17
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,525,057,676.66	3,068,390,965.34	-456,666,711.32

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有返售金融资产余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	41,068.16	4,512.71
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	870.03	2,297.80
应收债券利息	-	2,714,625.86
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	14.59	0.10
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	666.50	1,011.60
合计	42,619.28	2,722,448.07

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	2,067,915.51	1,610,285.53
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	2,067,915.51	1,610,285.53

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	25,133.41	542.91
预提费用	410,000.00	410,000.00
应付其他	62,414.08	62,414.08
合计	497,547.49	472,956.99

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,751,313,814.96	5,751,313,814.96
本期申购	2,241,557,239.00	2,241,557,239.00
本期赎回(以"-"号填列)	-3,470,365,933.31	-3,470,365,933.31
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以"-"号填列)	-	-
本期末	4,522,505,120.65	4,522,505,120.65

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,086,985,974.84	430,624,449.95	-2,656,361,524.89
本期利润	32,108,749.15	1,529,255,249.69	1,561,363,998.84
本期基金份额交易产生的变动数	681,754,756.10	-245,137,921.43	436,616,834.67
其中：基金申购款	-1,247,737,667.75	243,093,315.39	-1,004,644,352.36
基金赎回款	1,929,492,423.85	-488,231,236.82	1,441,261,187.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,373,122,469.59	1,714,741,778.21	-658,380,691.38

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

活期存款利息收入	827,842.14	486,518.17
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	44,796.29	64,177.22
其他	28,810.95	42,977.65
合计	901,449.38	593,673.04

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	4,400,406,383.99	5,529,599,485.98
减：卖出股票成本总额	4,404,858,389.80	5,894,237,818.20
买卖股票差价收入	-4,452,005.81	-364,638,332.22

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	8,397,384.37	9,189,680.87
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	8,397,384.37	9,189,680.87

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
卖出债券（债转股及债券到	1,680,307,755.38	1,997,430,526.44

期兑付）成交总额		
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,662,203,708.26	1,974,077,431.66
减：应收利息总额	9,706,662.75	14,163,413.91
买卖债券差价收入	8,397,384.37	9,189,680.87

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内未持有资产支持证券。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内未持有贵金属。

7.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内未持有权证。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	71,854,978.49	79,192,895.25
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	71,854,978.49	79,192,895.25

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	1,529,255,249.69	213,930,626.60
——股票投资	1,528,449,757.52	214,803,190.60
——债券投资	805,492.17	-872,564.00
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	1,529,255,249.69	213,930,626.60

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	1,657,681.22	1,912,016.89
转换费收入	6,995.00	306,054.51
其他	-	2,113.15
合计	1,664,676.22	2,220,184.55

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	11,540,894.30	13,103,979.70
银行间市场交易费用	-	1,175.00
合计	11,540,894.30	13,105,154.70

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
审计费用	110,000.00	110,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
其他	400.00	400.00
银行间帐户维护费	13,500.00	22,500.00
银行费用	7,764.14	7,103.09
合计	431,664.14	440,003.09

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
齐鲁证券有限公司(“齐鲁证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
新疆国际实业股份有限公司	基金管理人股东
山东省国有资产投资控股有限公司	基金管理人股东
万家共赢资产管理有限公司	基金管理人子公司
上海承方投资管理有限公司	基金管理人控制的公司

注：1.报告期内，上海承方投资管理有限公司于 2014 年 12 月由万家共赢资产管理有限公司全资设立，受基金管理人间接控制。

2.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
齐鲁证券	3,963,836,729.96	57.33%	3,283,579,629.63	45.31%

债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
齐鲁证券	1,068,799,081.50	57.24%	1,188,541,181.80	65.31%

债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日

	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
齐鲁证券	131,000,000.00	99.09%	1,412,700,000.00	35.47%

7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
齐鲁证券	3,608,675.09	58.05%	1,062,063.79	51.36%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
齐鲁证券	2,989,356.66	45.31%	1,010,512.34	62.75%

注:上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	31,187,335.72	35,743,898.83
其中：支付销售机构的客户维护费	6,929,204.86	7,957,360.16

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1%÷当年天数

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每个月月末,按月支付,由基金托管人复核后于次月的前两个工作日内,根据基金管理人向基金托管人发送的划付指令,从基金资产中支付给基金管理人以及服务提供人;若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	6,237,467.13	7,148,779.77

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.20%÷当年天数

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每个月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月的前两个工作日内从基金资产中支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	0.00	0.00	0.00	0.00	19,600,000.00	9,263.01

注：本基金本报告期未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	215,956,637.63	827,842.14	17,039,158.42	486,518.17

注：本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2014 年度获得的利息收入为人民币 44,796.29 元(2013 年度:人民币 64,177.22 元)，2014 年末结算备付金余额为人民币 1,933,458.67 元(2013 年末:人民币 5,106,250.47 元)。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2014 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600332	白云山	2014 年 12 月 3 日	重大事项	27.11	2015 年 1 月 13 日	29.82	343,866	10,115,876.12	9,322,207.26	-
600649	城投控股	2014 年 11 月 3 日	重大事项	7.23	-	-	1,031,636	7,193,674.88	7,458,728.28	-

600759	洲际油气	2014 年 12 月 24 日	重大事项	9.90	-	-	590,546	4,901,465.32	5,846,405.40	-
600490	鹏欣资源	2014 年 12 月 24 日	重大事项	10.79	2015 年 1 月 12 日	11.87	540,941	7,086,272.29	5,836,753.39	-
601216	内蒙君正	2014 年 12 月 1 日	重大事项	10.44	2015 年 1 月 7 日	11.10	419,812	3,085,192.32	4,382,837.28	-
600240	华业地产	2014 年 10 月 16 日	重大事项	7.19	2015 年 1 月 22 日	7.91	592,302	2,759,811.57	4,258,651.38	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险,并设定适当的风险限额及内部控制流程,通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理融入各业务层面,建立了三道防线:以各岗位目标责任制为基础,形成第一道防线;通过相关部门、相关岗位之间相互监督制衡,形成第二道防线;由监察稽核部门、督察长对各岗位、各部门、各机构、各项业务实施监督反馈,形成第三道防线。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构

进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持证券全部在证券交易所上市，因此，除在附注 7.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和市场价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及部分应收申购款等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	215,956,637.63	-	-	-	-	-	215,956,637.63
结算备付金	1,933,458.67	-	-	-	-	-	1,933,458.67
存出保证金	1,481,102.98	-	-	-	-	-	1,481,102.98
交易性金融资产	-	-	-	-	-	3,668,718,172.68	3,668,718,172.68
应收利息	-	-	-	-	-	42,619.28	42,619.28

应收申购款	-	-	-	-	-	4,447,668.42	4,447,668.42
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	219,371,199.28	-	-	-	-	3,673,208,460.38	3,892,579,659.66
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	502.95	502.95
应付赎回款	-	-	-	-	-	22,263,774.18	22,263,774.18
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,021,241.90	3,021,241.90
应付托管费	-	-	-	-	-	604,248.36	604,248.36
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,067,915.51	2,067,915.51
其他负债	-	-	-	-	-	497,547.49	497,547.49
负债总计	-	-	-	-	-	28,455,230.39	28,455,230.39
利率敏感度缺口	219,371,199.28	-	-	-	-	3,644,753,229.99	3,864,124,429.27
上年度末 2013 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	17,039,158.42	-	-	-	-	-	17,039,158.42
结算备付金	5,106,250.47	-	-	-	-	-	5,106,250.47
存出保证金	2,248,016.24	-	-	-	-	-	2,248,016.24
交易性金融资产	29,997,000.00	-	99,310,000.00	61,387,974.40	-	2,877,695,990.94	3,068,390,965.34
应收证券清算款	-	-	-	-	-	7,236,456.90	7,236,456.90
应收利息	-	-	-	-	-	2,722,448.07	2,722,448.07
应收申购款	397.62	-	-	-	-	119,694.13	120,091.75
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	54,390,822.75	-	99,310,000.00	61,387,974.40	-	2,887,774,590.04	3,102,863,387.19
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,582,466.18	2,582,466.18
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,678,058.88	2,678,058.88
应付托管费	-	-	-	-	-	535,611.74	535,611.74

应付交易费用		-	-	-	-	-	1,610,285.53	1,610,285.53
应交税费		-	-	-	-	-	31,717.80	31,717.80
其他负债		-	-	-	-	-	472,956.99	472,956.99
负债总计		-	-	-	-	-	7,911,097.12	7,911,097.12
利率敏感度缺口	54,390,822.75		-99,310,000.00	61,387,974.40		-2,879,863,492.92	3,094,952,290.07

注：该表统计了本基金资产和负债的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值,并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；		
	2.该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；		
	3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；		
	4.银行存款、结算备付金、存出保证金、部分应收申购款以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2014 年 12 月 31 日 ）	上年度末（ 2013 年 12 月 31 日 ）
	基准利率上升 25 个基点	0.00	-664,704.18
	基准利率下降 25 个基点	0.00	671,113.30

注：该表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	3,668,718,172.68	94.94	2,877,695,990.94	92.98
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	190,694,974.40	6.16
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,668,718,172.68	94.94	3,068,390,965.34	99.14

注：本基金投资于股票的比例,不得高于基金资产净值的 95%,其中投资于上证 180 指数成份股的比重不低于基金资产净值的 90%;本基金持有到期日在一年以内的政府债券或者现金比例不低于基金资产净值的 5%。于资产负债表日,本基金面临的整体市场价格风险列示如表中数据。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	2.以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2014 年 12 月 31 日 ）	上年度末（ 2013 年 12 月 31 日 ）
	1. 上证 180 指数上涨 1%	37,684,979.93	28,978,938.81
	2. 上证 180 指数下跌 1%	-37,684,979.93	-28,978,938.81

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2014 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层级的余额为人民币 3,611,050,020.09 元，属于第二层级的余额为人民币 57,668,152.59 元，无第三层级余额。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

2014 年度，对于以公允价值计量的金融工具，由第一层次转入第二层次的投资的金额为人民币 45,659,257.68 元，由第二层次转入第一层次的投资的金额为人民币 26,152,322.10 元。

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期及上年度可比期间未发生第三层次公允价值转入转出情况。

7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大承诺事项。

7.4.14.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,668,718,172.68	94.25
	其中：股票	3,668,718,172.68	94.25
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-

5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	217,890,096.30	5.60
7	其他各项资产	5,971,390.68	0.15
8	合计	3,892,579,659.66	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	14,988,309.62	0.39
B	采矿业	178,458,994.87	4.62
C	制造业	793,131,408.02	20.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	105,619,505.59	2.73
E	建筑业	191,769,611.12	4.96
F	批发和零售业	61,768,226.59	1.60
G	交通运输、仓储和邮政业	110,059,139.51	2.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	121,541,451.53	3.15
J	金融业	1,825,627,064.96	47.25
K	房地产业	182,040,578.65	4.71
L	租赁和商务服务业	12,496,042.00	0.32
M	科学研究和技术服务业	6,877,504.23	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	13,389,286.56	0.35
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	26,746,809.23	0.69
S	综合	24,204,240.20	0.63
	合计	3,668,718,172.68	94.94

8.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本报告期内,本基金的股票投资全部为指数化投资,无积极投资。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	2,883,312	215,412,239.52	5.57
2	600016	民生银行	18,258,736	198,655,047.68	5.14
3	600030	中信证券	4,930,502	167,144,017.80	4.33
4	600036	招商银行	10,014,746	166,144,636.14	4.30
5	600837	海通证券	4,679,103	112,579,218.18	2.91
6	600000	浦发银行	6,789,984	106,534,848.96	2.76
7	601166	兴业银行	5,747,848	94,839,492.00	2.45
8	601398	工商银行	13,846,156	67,430,779.72	1.75
9	601668	中国建筑	9,097,414	66,229,173.92	1.71
10	601328	交通银行	9,527,277	64,785,483.60	1.68
11	601601	中国太保	1,907,076	61,598,554.80	1.59
12	601818	光大银行	12,082,432	58,962,268.16	1.53
13	601288	农业银行	15,753,514	58,445,536.94	1.51
14	600887	伊利股份	1,859,135	53,227,035.05	1.38
15	600519	贵州茅台	277,257	52,573,472.34	1.36
16	600104	上汽集团	2,007,464	43,100,252.08	1.12
17	600048	保利地产	3,906,042	42,263,374.44	1.09
18	601169	北京银行	3,845,485	42,031,151.05	1.09
19	601688	华泰证券	1,699,241	41,580,427.27	1.08
20	601989	中国重工	4,488,922	41,342,971.62	1.07
21	601088	中国神华	2,001,837	40,617,272.73	1.05
22	600999	招商证券	1,410,264	39,868,163.28	1.03
23	601939	建设银行	5,822,586	39,186,003.78	1.01
24	601390	中国中铁	4,146,523	38,562,663.90	1.00
25	601006	大秦铁路	3,608,460	38,466,183.60	1.00
26	600015	华夏银行	2,702,673	36,377,978.58	0.94
27	601901	方正证券	2,497,152	35,184,871.68	0.91
28	601377	兴业证券	2,208,869	33,398,099.28	0.86
29	600900	长江电力	3,004,636	32,059,466.12	0.83
30	601628	中国人寿	910,795	31,103,649.25	0.80

31	600383	金地集团	2,724,216	31,083,304.56	0.80
32	601186	中国铁建	1,867,069	28,491,472.94	0.74
33	600585	海螺水泥	1,226,427	27,079,508.16	0.70
34	601857	中国石油	2,359,493	25,506,119.33	0.66
35	600050	中国联通	5,143,030	25,457,998.50	0.66
36	601336	新华保险	506,480	25,101,148.80	0.65
37	600886	国投电力	2,057,858	23,541,895.52	0.61
38	600111	包钢稀土	881,765	22,820,078.20	0.59
39	600011	华能国际	2,550,260	22,518,795.80	0.58
40	600028	中国石化	3,433,150	22,281,143.50	0.58
41	601099	太平洋	1,500,221	21,333,142.62	0.55
42	600019	宝钢股份	2,998,973	21,022,800.73	0.54
43	601766	中国南车	3,254,947	20,766,561.86	0.54
44	601299	中国北车	2,801,440	20,562,569.60	0.53
45	600010	包钢股份	4,856,058	19,812,716.64	0.51
46	600089	特变电工	1,572,781	19,471,028.78	0.50
47	600739	辽宁成大	866,852	18,628,649.48	0.48
48	600031	三一重工	1,849,604	18,459,047.92	0.48
49	601555	东吴证券	818,532	18,351,487.44	0.47
50	600018	上港集团	2,763,093	17,739,057.06	0.46
51	601800	中国交建	1,263,052	17,543,792.28	0.45
52	600690	青岛海尔	924,458	17,157,940.48	0.44
53	600276	恒瑞医药	456,216	17,098,975.68	0.44
54	600570	恒生电子	299,566	16,404,234.16	0.42
55	601899	紫金矿业	4,789,445	16,188,324.10	0.42
56	600705	中航资本	904,374	16,179,250.86	0.42
57	600256	广汇能源	1,902,864	15,907,943.04	0.41
58	601009	南京银行	1,081,766	15,847,871.90	0.41
59	600340	华夏幸福	363,344	15,841,798.40	0.41
60	600109	国金证券	790,735	15,648,645.65	0.40
61	600535	天士力	376,091	15,457,340.10	0.40
62	600150	中国船舶	417,992	15,407,185.12	0.40
63	600637	百视通	405,920	15,376,249.60	0.40
64	600369	西南证券	684,802	15,264,236.58	0.40
65	601618	中国中冶	2,956,267	14,929,148.35	0.39
66	601669	中国电建	1,745,846	14,717,481.78	0.38
67	600518	康美药业	933,625	14,676,585.00	0.38
68	601998	中信银行	1,801,990	14,668,198.60	0.38
69	600196	复星医药	694,666	14,657,452.60	0.38

70	600352	浙江龙盛	743,082	14,623,853.76	0.38
71	601600	中国铝业	2,324,019	14,525,118.75	0.38
72	600309	万华化学	655,608	14,279,142.24	0.37
73	600674	川投能源	671,881	13,928,093.13	0.36
74	600832	东方明珠	967,434	13,389,286.56	0.35
75	600406	国电南瑞	885,061	12,877,637.55	0.33
76	600100	同方股份	1,066,811	12,460,352.48	0.32
77	600221	海南航空	3,578,941	12,239,978.22	0.32
78	600804	鹏博士	674,638	12,129,991.24	0.31
79	600066	宇通客车	538,993	12,035,713.69	0.31
80	600009	上海机场	583,839	11,454,921.18	0.30
81	601117	中国化学	1,195,331	11,295,877.95	0.29
82	600583	海油工程	1,072,424	11,292,624.72	0.29
83	600315	上海家化	326,013	11,188,766.16	0.29
84	600177	雅戈尔	944,741	10,873,968.91	0.28
85	600208	新湖中宝	1,461,044	10,694,842.08	0.28
86	601018	宁波港	2,296,956	10,565,997.60	0.27
87	601888	中国国旅	236,649	10,507,215.60	0.27
88	600839	四川长虹	2,241,367	10,444,770.22	0.27
89	600703	三安光电	725,962	10,323,179.64	0.27
90	601933	永辉超市	1,183,533	10,308,572.43	0.27
91	600271	航天信息	336,440	10,264,784.40	0.27
92	600893	航空动力	354,362	10,262,323.52	0.27
93	600118	中国卫星	358,782	10,218,111.36	0.26
94	601633	长城汽车	243,928	10,135,208.40	0.26
95	600741	华域汽车	626,420	9,696,981.60	0.25
96	601607	上海医药	583,675	9,630,637.50	0.25
97	600489	中金黄金	892,375	9,477,022.50	0.25
98	600332	白云山	343,866	9,322,207.26	0.24
99	600663	陆家嘴	247,670	9,287,625.00	0.24
100	600362	江西铜业	503,047	9,276,186.68	0.24
101	600252	中恒集团	562,855	9,208,307.80	0.24
102	600027	华电国际	1,298,420	9,088,940.00	0.24
103	600266	北京城建	379,972	8,990,137.52	0.23
104	600085	同仁堂	397,064	8,906,145.52	0.23
105	600372	中航电子	320,742	8,881,345.98	0.23
106	600108	亚盛集团	946,807	8,843,177.38	0.23
107	600600	青岛啤酒	211,307	8,828,406.46	0.23
108	600547	山东黄金	431,934	8,573,889.90	0.22

109	600717	天津港	499,277	8,552,615.01	0.22
110	600827	百联股份	468,539	8,382,162.71	0.22
111	600875	东方电气	403,874	8,335,959.36	0.22
112	600588	用友软件	353,160	8,295,728.40	0.21
113	600718	东软集团	520,290	8,225,784.90	0.21
114	600079	人福医药	320,226	8,213,796.90	0.21
115	600879	航天电子	503,761	7,858,671.60	0.20
116	600649	城投控股	1,031,636	7,458,728.28	0.19
117	601808	中海油服	357,154	7,418,088.58	0.19
118	600158	中体产业	409,474	7,251,784.54	0.19
119	601098	中南传媒	435,624	7,231,358.40	0.19
120	603000	人民网	167,964	7,044,410.16	0.18
121	600497	驰宏锌锗	606,217	7,038,179.37	0.18
122	600316	洪都航空	247,645	6,926,630.65	0.18
123	600645	中源协和	169,773	6,877,504.23	0.18
124	601992	金隅股份	657,939	6,671,501.46	0.17
125	600549	厦门钨业	201,779	6,654,671.42	0.17
126	600418	江淮汽车	546,011	6,595,812.88	0.17
127	600597	光明乳业	370,604	6,470,745.84	0.17
128	600348	阳泉煤业	729,062	6,466,779.94	0.17
129	600643	爱建股份	470,733	6,458,456.76	0.17
130	600633	浙报传媒	351,896	6,400,988.24	0.17
131	600499	科达洁能	338,014	6,239,738.44	0.16
132	600895	张江高科	467,724	6,230,083.68	0.16
133	601699	潞安环能	534,434	6,167,368.36	0.16
134	601118	海南橡胶	704,717	6,145,132.24	0.16
135	601929	吉视传媒	534,603	6,137,242.44	0.16
136	600516	方大炭素	625,062	6,106,855.74	0.16
137	600433	冠豪高新	499,285	5,891,563.00	0.15
138	600759	洲际油气	590,546	5,846,405.40	0.15
139	600490	鹏欣资源	540,941	5,836,753.39	0.15
140	600157	永泰能源	1,288,670	5,618,601.20	0.15
141	600317	营口港	1,181,128	5,610,358.00	0.15
142	600522	中天科技	359,485	5,532,474.15	0.14
143	600435	北方导航	225,892	5,527,577.24	0.14
144	600816	安信信托	187,616	5,512,158.08	0.14
145	600648	外高桥	170,201	5,509,406.37	0.14
146	601958	金钼股份	587,666	5,506,430.42	0.14
147	600376	首开股份	546,065	5,504,335.20	0.14

148	600037	歌华有线	379,472	5,498,549.28	0.14
149	600060	海信电器	477,007	5,452,190.01	0.14
150	600675	中华企业	794,034	5,447,073.24	0.14
151	600787	中储股份	563,281	5,430,028.84	0.14
152	600765	中航重机	283,677	5,404,046.85	0.14
153	601928	凤凰传媒	463,010	4,981,987.60	0.13
154	600267	海正药业	293,738	4,958,297.44	0.13
155	600325	华发股份	396,997	4,898,942.98	0.13
156	600259	广晟有色	79,324	4,408,827.92	0.11
157	601216	内蒙君正	419,812	4,382,837.28	0.11
158	600880	博瑞传播	399,029	4,289,561.75	0.11
159	600240	华业地产	592,302	4,258,651.38	0.11
160	600067	冠城大通	506,627	4,103,678.70	0.11
161	600747	大连控股	622,378	4,101,471.02	0.11
162	600770	综艺股份	472,705	4,093,625.30	0.11
163	600638	新黄浦	238,263	3,876,539.01	0.10
164	600373	中文传媒	288,507	3,842,913.24	0.10
165	600639	浦东金桥	159,033	3,783,395.07	0.10
166	600809	山西汾酒	157,019	3,594,164.91	0.09
167	600998	九州通	191,610	3,462,392.70	0.09
168	600023	浙能电力	477,890	3,426,471.30	0.09
169	600748	上实发展	263,495	3,349,021.45	0.09
170	603288	海天味业	83,376	3,330,871.20	0.09
171	600503	华丽家族	583,605	3,314,876.40	0.09
172	600823	世茂股份	213,791	3,144,865.61	0.08
173	600432	吉恩镍业	189,589	2,697,851.47	0.07
174	600773	西藏城投	176,439	2,136,676.29	0.06
175	600620	天宸股份	221,222	2,066,213.48	0.05
176	600640	号百控股	128,810	1,988,826.40	0.05
177	601225	陕西煤业	285,462	1,898,322.30	0.05
178	600658	电子城	106,609	1,249,457.48	0.03
179	600795	国电电力	228,044	1,055,843.72	0.03

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本报告期内,本基金的股票投资全部为指数化投资,无积极投资。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601398	工商银行	432,297,630.45	13.97
2	601989	中国重工	425,180,803.33	13.74
3	601318	中国平安	391,224,619.96	12.64
4	600028	中国石化	230,810,185.14	7.46
5	600795	国电电力	194,497,335.56	6.28
6	600109	国金证券	127,865,253.02	4.13
7	600016	民生银行	111,285,631.59	3.60
8	600674	川投能源	92,350,921.48	2.98
9	601288	农业银行	90,618,621.95	2.93
10	600104	上汽集团	67,342,947.90	2.18
11	600036	招商银行	64,309,200.20	2.08
12	600000	浦发银行	64,235,933.00	2.08
13	600030	中信证券	57,064,289.00	1.84
14	601166	兴业银行	52,948,649.30	1.71
15	601328	交通银行	48,103,723.17	1.55
16	600383	金地集团	38,913,347.00	1.26
17	600048	保利地产	34,681,687.20	1.12
18	600837	海通证券	33,117,597.27	1.07
19	600887	伊利股份	30,857,931.94	1.00
20	600886	国投电力	24,749,544.14	0.80

注：“买入金额”按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	434,469,606.83	14.04
2	601398	工商银行	431,192,038.20	13.93
3	601989	中国重工	411,258,634.00	13.29
4	600795	国电电力	218,439,053.95	7.06
5	600028	中国石化	217,030,631.32	7.01

6	600016	民生银行	137,145,113.50	4.43
7	600109	国金证券	130,704,106.62	4.22
8	601288	农业银行	108,248,364.94	3.50
9	600036	招商银行	104,594,558.06	3.38
10	600674	川投能源	94,836,246.77	3.06
11	601166	兴业银行	94,771,076.31	3.06
12	600000	浦发银行	90,621,069.09	2.93
13	600104	上汽集团	83,649,492.49	2.70
14	600030	中信证券	75,449,116.10	2.44
15	600837	海通证券	64,404,028.31	2.08
16	601328	交通银行	64,389,479.30	2.08
17	600383	金地集团	47,164,268.64	1.52
18	600048	保利地产	45,374,464.59	1.47
19	600519	贵州茅台	36,972,497.67	1.19
20	601088	中国神华	35,279,117.01	1.14

注:“卖出金额”按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,667,430,814.02
卖出股票收入（成交）总额	4,400,406,383.99

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据基金合同,本基金暂不能投资于股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同,本基金暂不能投资于国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的,在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2

本基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,481,102.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	42,619.28
5	应收申购款	4,447,668.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,971,390.68

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
259,428	17,432.60	84,510,297.27	1.87%	4,437,994,823.38	98.13%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	565,310.22	0.01%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0，本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2003 年 3 月 17 日）基金份额总额	1,929,789,525.65
本报告期期初基金份额总额	5,751,313,814.96
本报告期基金总申购份额	2,241,557,239.00
减:本报告期基金总赎回份额	3,470,365,933.31
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
本报告期期末基金份额总额	4,522,505,120.65

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

2014 年 10 月 25 日本公司发布公告，原总经理吕宜振因个人原因离职，不再担任本公司总经理。由副总经理李杰代为履行总经理职务。

2014 年 10 月 25 日本公司发布公告，原督察长李振伟因个人原因离职，不再担任本公司督察长。由副总经理詹志令代为履行督察长职务。

基金托管人：

2014 年 2 月 14 日中国银行股份有限公司公告，自 2014 年 2 月 13 日起，陈四清先生担任本行行长。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自 2009 年 4 月起,本基金聘请安永华明会计师事务所为本基金提供审计服务。本报告期未改聘会计师事务所。

本基金 2014 年度需向安永华明会计师事务所支付审计费 110,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
齐鲁证券	2	1,984,840,339.50	28.71%	1,806,996.96	29.07%	-
山东齐鲁证券	1	1,978,996,390.46	28.62%	1,801,678.13	28.98%	-
广发证券	1	1,083,115,046.86	15.67%	961,154.92	15.46%	-
兴业证券	1	875,616,833.00	12.66%	744,272.80	11.97%	-
长江证券	1	604,930,316.91	8.75%	550,728.97	8.86%	-
上海证券	1	144,687,401.61	2.09%	131,723.22	2.12%	-
民族证券	1	131,882,869.30	1.91%	120,066.16	1.93%	-
申银万国	1	109,847,435.54	1.59%	100,004.17	1.61%	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
远东证券	1	-	-	-	-	-
华夏证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
江南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
中信万通	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-

注:1、基金专用交易席位的选择标准如下:

(1)经营行为稳健规范,内控制度健全,在业内有良好的声誉;

(2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施满足基金进行证券交易的需要;

(3)具有较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于:有较好的研究能力和行业分析能力,能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务;能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告,具有开发量化投资组合模型的能力;能积极为公司投资业务的开展,投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下:
(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构;
(2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。
3、报告期内基金租用证券公司交易单元的变更情况：
增加兴业证券一个席位。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
齐鲁证券	702,791,521.90	37.64%	110,000,000.00	83.21%	-	-
山东齐鲁证券	366,007,559.60	19.60%	21,000,000.00	15.89%	-	-
广发证券	91,310,750.80	4.89%	-	-	-	-
兴业证券	384,433,980.10	20.59%	-	-	-	-
长江证券	217,119,442.90	11.63%	-	-	-	-
上海证券	80,707,262.20	4.32%	-	-	-	-
民族证券	24,941,924.30	1.34%	1,200,000.00	0.91%	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
远东证券	-	-	-	-	-	-
华夏证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
江南证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中信万通	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金托管人中国银行的专门基金托管部门的名称由托管及投资者服务部更名为托管业务部。

§13 备查文件目录

13.1 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 180 指数证券投资基金托管协议》。

4、万家基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。

5、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、季度报告、更新招募说明书及其他临时公告。

6、万家 180 指数证券投资基金 2014 年年度报告原文。

13.2 存放地点

基金管理人的办公场所和基金托管人住所，并登载于基金管理人网站：www.wjasset.com。

13.3 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
2015 年 3 月 27 日