

万家中证红利指数证券投资基金(LOF)2012 年年度报告摘要

2012 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2013 年 3 月 30 日

§ 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2013 年 3 月 28 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

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 2012 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	万家中证红利指数(LOF)
基金主代码	161907
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2011 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	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,083,086,804.69 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011 年 6 月 15 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式指数化投资方法,通过严格的投资纪律约束和数量化风险控制手段,在正常市场情况下,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪偏离度不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 4%,实现对中证红利指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为指数型基金,原则上采用完全复制法,按照成份股在中证红利指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金管理人会对实际投资组合进行适当调整,以便实现对跟踪误差的有效控制。
业绩比较基准	$95\% \times \text{中证红利指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,预期风险高于货币市场基金、债券型基金及混合型基金,属于较高风险,较高预期收益的证券投资基金品种。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	田青
	联系电话	021-38619810	010-67595096
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008880800	010-67595096
传真		021-38619888	010-66275853

2.4 信息披露方式

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	上海市浦东新区浦电路 360 号陆家嘴投资大厦 9 楼 基金管理人办公场所
------------	--

§ 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	2012 年	2011 年 03 月 17 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-75,670,256.57	9,095,720.17
本期利润	56,489,625.17	-68,218,892.25
加权平均基金份额本期利润	0.0660	-0.0986
本期基金份额净值增长率	6.93%	-18.51%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	2011 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1286	-0.1851
期末基金资产净值	943,791,726.93	608,734,970.07
期末基金份额净值	0.8714	0.8149

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、上述基金业绩指标不包括持有人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。

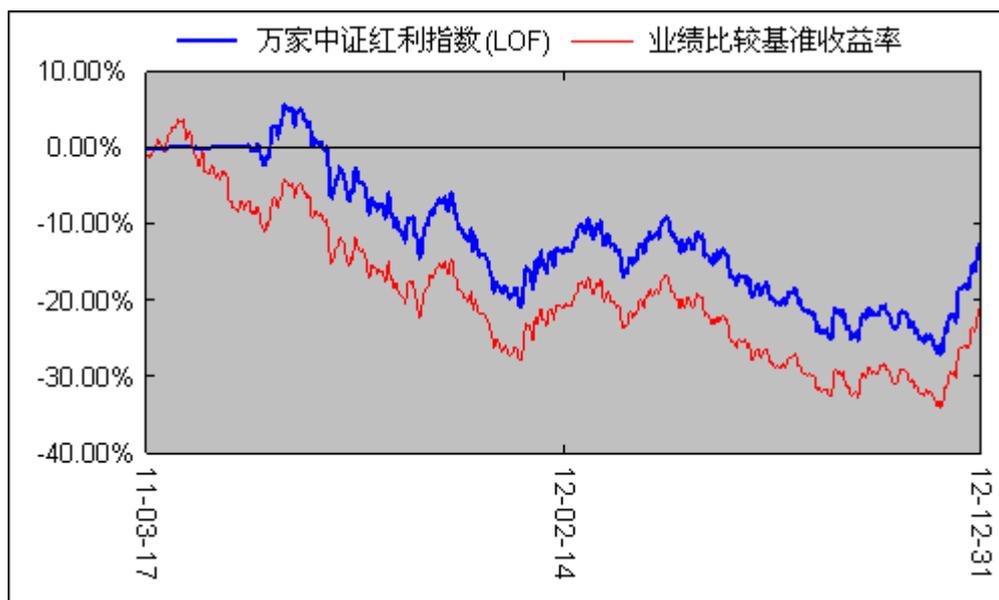
3.2 基金净值表现

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 3 个月	11.47%	1.18%	12.18%	1.20%	-0.71%	-0.02%
过去 6 个月	4.71%	1.13%	5.47%	1.14%	-0.76%	-0.01%
过去 1 年	6.93%	1.15%	6.82%	1.15%	0.11%	0.00%
自基金合同生效起至今	-12.86%	1.09%	-21.12%	1.15%	8.26%	-0.06%

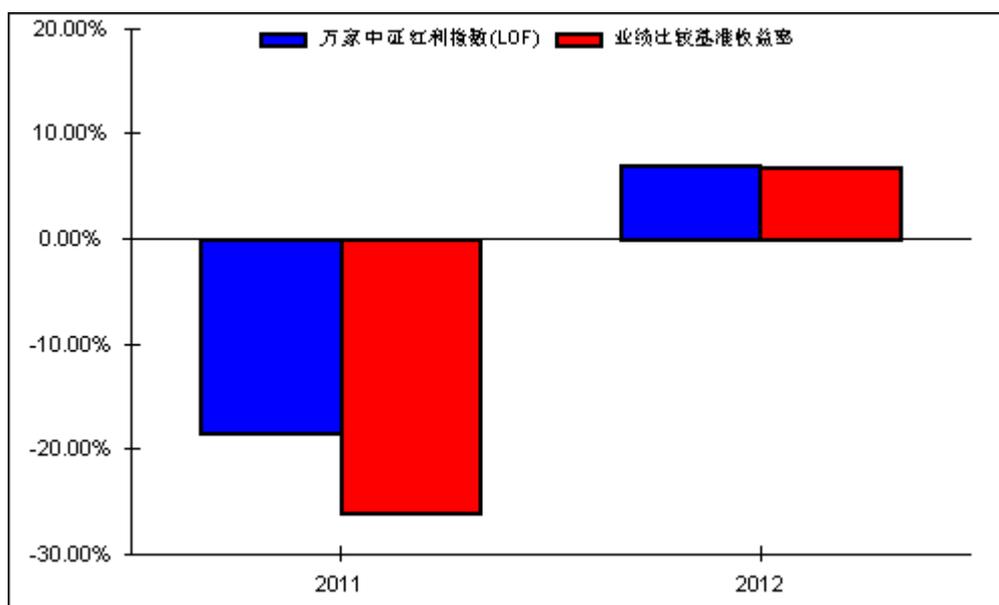
注:基金业绩比较基准=95%×中证红利指数收益率 + 5%×银行同业存款利率

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 2011 年 3 月 17 日,建仓期为六个月,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。截至本报告期末本基金成立满一年,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 自基金合同生效以来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



注:本基金于 2011 年 3 月 17 日成立,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自 2011 年 3 月 17 日(基金成立日)至本报告期内未发生利润分配。

§ 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。目前管理十四只开放式基金, 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、万家公用事业行业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 14 天理财债券型证券投资基金和万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金。

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 180 基金经理、万家中证创业成长指数分级基金经理、量化投资部总监	2012 年 2 月 4 日	-	17 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。
张鹏	本基金基金经理、量化投资部副总监	2012 年 7 月 5 日	-	4 年	复旦大学经济学硕士, FRM, 长期从事金融工程研究和量化投资工作, 曾任上海银行风险管理部主管、信诚基金量化投资部副总监等职, 2012 年 5 月 14 日加入万家基金管理有限公司任量化投资部副总监。
朱颖	本基金基金经理, 万家公用基金基金经理	2011 年 3 月 17 日	2012 年 7 月 5 日	5 年	男, 1978 年生, 硕士学位, 毕业于中国科技大学, 2006 年 10 月进入万家基金管理有限公司, 担任行业分析师, 基金经理助理等职务。2011 年 11 月 11 日起任万家公用基金基金

					基金经理, 2011 年 3 月起任万家红利基金基金经理。
--	--	--	--	--	-------------------------------

注:1、首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业含义遵从行业协会《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》、《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, 公司执行交易系统内的公平交易程序; (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。

本报告期内无下列情况: 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%。

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

2012 年中国经济总体疲软, 通胀维持在较低水平, 政府严控房地产, 依靠基建投资对冲经济下滑。企业 ROE 水平逐季下降, 财务杠杆不断攀升, 盈利能力显著下滑。A 股市场大致经历了一季度的“伪复苏”、12 月以前的不断探底和 12 月初开始的强劲反弹三个阶段。报告期本基金投资标的指数--中证红利指数收益率为 7.06%。

本基金作为被动投资的指数基金, 其投资目标是通过跟踪、复制中证红利指数, 为投资者获取股票市场

长期的平均收益。报告期内我们严格按照基金合同规定,采取了完全复制方法进行投资管理,努力拟合标的指数,减小跟踪误差。

报告期内,本基金采用有效的量化跟踪技术,将基金跟踪误差控制在较低范围内。跟踪误差主要是由于基金申购赎回、禁止投资成分股替代和标的指数成分股定期调整等因素所造成。

4.4.2 报告期内基金业绩的表现

截至报告期末,本基金份额净值为 0.8714 元,报告期内基金份额净值增长率为 6.93%,同期业绩比较基准收益率为 6.82%,基金日均跟踪偏离度为 0.07%,年化跟踪误差 1.10%,符合基金合同中日均跟踪偏离度低于 0.35%和年跟踪误差低于 4%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

展望 2013 年,经济弱复苏格局基本确立,需求将逐渐复苏,而由于当前整体库存水平不高,随着时间的推移,将会有一波补库存的动力来推升经济加速,我们预计若政策继续保持稳定,那么经济恢复的速度将逐步加强。通胀水平将温和回升,CPI 和 PPI 向上反弹并且裂口收窄,有利于企业盈利尤其是周期性企业盈利的改善。因此,从大类资产配置的角度来看,股票资产有很好的吸引力。

被动型指数基金的产品设计运作思路下,管理人日常运作中尽量避免用自己的观点判断干扰基金的运作。

4.6 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》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同规定:“基金收益每年最多分配 6 次,每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 20%(收益分配基准日可供分配利润指截至收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数)”。

结合法律法规及基金合同的规定,本基金 2012 年未达到利润分配条件,则未进行利润分配。

§ 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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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基金托管人应尽的义务。

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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管

理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

本基金 2012 年年度财务会计报告已经安永华明会计师事务所审计,注册会计师签字出具了安永华明(2013)审字第 60778298_B10 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 万家中证红利指数型证券投资基金(LOF)

报告截止日: 2012 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产:		
银行存款	10,736,330.59	31,663,607.68
结算备付金	1,169,387.54	57,993.82
存出保证金	500,000.00	267,397.92
交易性金融资产	936,425,493.65	507,952,389.62
其中: 股票投资	894,773,834.85	507,952,389.62
基金投资	-	-
债券投资	41,651,658.80	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	4,245,859.79	-
应收利息	1,100,987.02	16,496.60
应收股利	-	-
应收申购款	3,159.12	69,999,197.63
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	954,181,217.71	609,957,083.27
负债和所有者权益	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
负债:		
短期借款	-	-

交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	7,610,767.49	-
应付赎回款	606,304.07	100,613.98
应付管理人报酬	554,028.87	271,357.35
应付托管费	110,805.79	54,271.46
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	826,374.16	293,955.40
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	681,210.40	501,915.01
负债合计	10,389,490.78	1,222,113.20
所有者权益：		
实收基金	1,083,086,804.69	746,966,446.57
未分配利润	-139,295,077.76	-138,231,476.50
所有者权益合计	943,791,726.93	608,734,970.07
负债和所有者权益总计	954,181,217.71	609,957,083.27

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8714 元，基金份额总额

1,083,086,804.69 份。

7.2 利润表

会计主体：万家中证红利指数型证券投资基金(LOF)

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	2011 年 3 月 17 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日
一、收入	67,615,122.58	-60,352,500.17
1. 利息收入	938,904.14	5,644,404.22
其中：存款利息收入	183,853.97	821,692.77
债券利息收入	732,562.24	891.47
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	22,487.93	4,821,819.98
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-65,695,821.19	10,382,742.84
其中：股票投资收益	-84,132,536.12	-1,677,932.99
基金投资收益	-	-
债券投资收益	114,549.67	863,398.03
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	18,322,165.26	11,197,277.80

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	132,159,881.74	-77,314,612.42
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	212,157.89	934,965.19
减：二、费用	11,125,497.41	7,866,392.08
1. 管理人报酬	5,208,661.61	3,979,167.24
2. 托管费	1,041,732.46	795,833.45
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	4,180,957.79	2,568,129.72
5. 利息支出	2,907.60	-
其中：卖出回购金融资产支出	2,907.60	-
6. 其他费用	691,237.95	523,261.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	56,489,625.17	-68,218,892.25
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	56,489,625.17	-68,218,892.25

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家中证红利指数型证券投资基金(LOF)

本报告期：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012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）	746,966,446.57	-138,231,476.50	608,734,970.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	56,489,625.17	56,489,625.17
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）	336,120,358.12	-57,553,226.43	278,567,131.69
其中：1. 基金申购款	602,661,274.71	-97,808,713.98	504,852,560.73
2. 基金赎回款	-266,540,916.59	40,255,487.55	-226,285,429.04
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）	1,083,086,804.69	-139,295,077.76	943,791,726.93

项目	上年度可比期间		
	2011 年 3 月 17 日(基金合同生效日)至 2011 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)	1,088,639,584.43	-	1,088,639,584.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-68,218,892.25	-68,218,892.25
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)	-341,673,137.86	-70,012,584.25	-411,685,722.11
其中: 1. 基金申购款	385,692,500.85	-64,717,609.48	320,974,891.37
2. 基金赎回款	-727,365,638.71	-5,294,974.77	-732,660,613.48
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)	746,966,446.57	-138,231,476.50	608,734,970.07

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 _____
 基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 会计报表附注

7.4.1 基金基本情况

万家中证红利指数型证券投资基金(LOF)(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”)证监许可[2010]1388号文《关于核准万家中证红利指数证券投资基金(LOF)募集的批复》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2011年3月17日正式生效,首次设立募集规模为1,088,639,584.43份基金份额。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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括中证红利指数的成份股及经中证指数公司公告将要被选入中证红利指数的股票、新股(一级市场初次发行或增发)、债券以及法律法规或中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他金融产品出现后,本基金在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资于中证红利指数成份股及经中证指数公司公告将要被选入中证红利指数的股票的组合比例不低于基金资产净值的90%,现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:95%×中证红利指数收益率+5%×银行同业存款利率。

本基金采用被动式指数化投资方法,通过严格的投资纪律约束和数量化风险控制手段,在正常市场情况下,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪偏离度不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%,实现对中证红利指数的有效跟踪。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会

计准则、其后颁布的应用指南、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制定的《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。

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 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 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

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。

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。

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]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定,自 2005 年 6 月 13 日起,对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得,按照财税[2005]102 号文规定,扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时,减按 50%计算应纳税所得额。

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。

7.4.7 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、发起人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
齐鲁证券有限公司	基金管理人股东、基金代销机构
上海久事公司	基金管理人股东
深圳市中航投资管理有限公司	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

注:本报告期内,新疆国际实业股份有限公司分别于 2012 年 2 月和 7 月竞拍上海久事公司和深圳市中航投资管理有限公司挂牌出让的本基金管理人万家基金管理有限公司的 20%的股权。该两起股权转让事项于期后 2013 年 2 月 6 日经中国证券监督管理委员会证监许可[2013]119 号《关于核准万家基金管理有限公司变更股权的批复》核准,并已办理完毕工商变更登记手续。本次股权转让后,本基金管理人的股权结构变更为:齐鲁证券有限公司持股 49%,新疆国际实业股份有限公司持股 40%,山东省国有资产投资控股有限公司持股 11%。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2011 年 3 月 17 日(基金合同生效 日)至 2011 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	484,222,649.62	17.40%	683,966,993.83	37.03%

7.4.8.1.2 权证交易

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。

7.4.8.1.3 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2011 年 3 月 17 日(基金合同生效日)至 2011 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	6,093,647.20	3.99%	-	-

7.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年3月17日(基金合同生效日)至 2011年12月31日	
	成交金额	占当期债券回 购成交总额的 比例	成交金额	占当期债券回 购成交总额的 比例
齐鲁证券	6,000,000.00	3.27%	888,400,000.00	4.15%

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012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	425,421.19	17.51%	186,821.04	22.61%
关联方名称	上年度可比期间 2011年3月17日(基金合同生效日)至2011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	581,371.80	37.39%	51,773.94	17.61%

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12 月31日	上年度可比期间 2011年3月17日(基金合同生 效日)至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,208,661.61	3,979,167.24
其中：支付销售机构的客户维护费	810,568.01	1,412,949.22

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.75%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12	上年度可比期间 2011年3月17日(基金合同生
----	-------------------------	-----------------------------

	月 31 日	效日)至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,041,732.46	795,833.45

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15%的年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,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,经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度末均未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2012 年 12 月 31 日		上年度末 2011 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额 占基金总份 额 的比例	持有的 基金份额	持有的基金份 额 占基金总份 额 的比例
齐鲁证券	10,000,999.00	0.92%	10,000,999.00	1.34%

注:基金管理人之外的其他关联方于本基金募集期间认购本基金份额时所适用的费率与本基金公告的费率一致。

7.4.8.5 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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2011 年 3 月 17 日(基金合同生效日)至 2011 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
中国建设银行	10,736,330.59	146,195.68	31,663,607.68	653,426.73

注:除上表列示的金额外,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公司,2012 年度获得的利息收入为人民币 23,376.23 元(2011 年度:人民币 151,665.37 元),2012 年末结算备付金余额为人民币 1,169,387.54 元(2011 年末:人民币 57,993.82 元)。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

7.4.9 期末(2012 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

7.4.9.2 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
000903	云内动力	2012-12-29	重大事项停牌	4.65	2013-01-04	4.72	79,715	361,868.96	370,674.75	

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2012 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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2012 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金融资产款余额。

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	894,773,834.85	93.77
	其中：股票	894,773,834.85	93.77
2	固定收益投资	41,651,658.80	4.37
	其中：债券	41,651,658.80	4.37
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	11,905,718.13	1.25
6	其他各项资产	5,850,005.93	0.61
7	合计	954,181,217.71	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	5,428,725.60	0.58
B	采掘业	148,997,808.52	15.79
C	制造业	195,246,614.98	20.69
C0	食品、饮料	33,169,699.59	3.51
C1	纺织、服装、皮毛	9,284,645.79	0.98

C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	3,241,516.14	0.34
C4	石油、化学、塑胶、塑料	17,676,683.50	1.87
C5	电子	1,949,878.34	0.21
C6	金属、非金属	51,776,365.97	5.49
C7	机械、设备、仪表	53,115,873.21	5.63
C8	医药、生物制品	25,031,952.44	2.65
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	50,989,064.15	5.40
E	建筑业	15,392,505.12	1.63
F	交通运输、仓储业	37,255,340.64	3.95
G	信息技术业	3,930,771.02	0.42
H	批发和零售贸易	8,422,172.91	0.89
I	金融、保险业	409,115,555.58	43.35
J	房地产业	15,212,863.46	1.61
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	4,782,412.87	0.51
	合计	894,773,834.85	94.81

8.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

8.3.1 指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600036	招商银行	6,185,812	85,054,915.00	9.01
2	601166	兴业银行	4,076,058	68,029,408.02	7.21
3	600030	中信证券	3,945,115	52,706,736.40	5.58
4	601088	中国神华	2,031,390	51,495,736.50	5.46
5	600016	民生银行	5,678,466	44,632,742.76	4.73
6	601398	工商银行	8,405,810	34,884,111.50	3.70
7	601006	大秦铁路	3,935,081	26,601,147.56	2.82
8	601628	中国人寿	923,908	19,771,631.20	2.09
9	600000	浦发银行	1,958,200	19,425,344.00	2.06
10	601857	中国石油	2,148,465	19,422,123.60	2.06

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

8.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	141,560,088.86	23.25
2	600036	招商银行	126,644,563.39	20.80
3	601166	兴业银行	115,858,901.00	19.03
4	600030	中信证券	76,865,286.33	12.63
5	601988	中国银行	61,143,683.01	10.04
6	601088	中国神华	50,399,238.48	8.28
7	600016	民生银行	43,767,723.63	7.19
8	600999	招商证券	42,031,467.37	6.90
9	601006	大秦铁路	37,055,185.69	6.09
10	600900	长江电力	30,658,322.88	5.04
11	600028	中国石化	30,540,604.33	5.02
12	601857	中国石油	29,841,092.33	4.90
13	000402	金融街	28,116,291.93	4.62
14	000776	广发证券	27,761,747.65	4.56
15	600019	宝钢股份	24,279,127.25	3.99
16	000728	国元证券	21,522,748.91	3.54
17	000783	长江证券	21,383,623.06	3.51
18	601186	中国铁建	19,899,261.92	3.27
19	601788	光大证券	19,733,242.85	3.24
20	601628	中国人寿	19,085,412.16	3.14
21	600000	浦发银行	18,686,022.00	3.07
22	601699	潞安环能	18,088,679.87	2.97
23	002202	金风科技	16,685,197.07	2.74
24	000983	西山煤电	15,081,577.33	2.48
25	600642	申能股份	14,224,082.63	2.34
26	000568	泸州老窖	14,220,923.08	2.34
27	600011	华能国际	13,935,492.08	2.29
28	600005	武钢股份	13,691,920.00	2.25
29	000039	中集集团	13,082,626.09	2.15
30	601333	广深铁路	12,951,273.60	2.13
31	600535	天士力	12,458,272.71	2.05

注:1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,“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	601398	工商银行	143,945,386.57	23.65

2	601166	兴业银行	69,765,139.92	11.46
3	601988	中国银行	65,282,474.58	10.72
4	600030	中信证券	65,047,477.62	10.69
5	601328	交通银行	57,553,871.06	9.45
6	600036	招商银行	55,702,710.52	9.15
7	601088	中国神华	36,778,897.12	6.04
8	601006	大秦铁路	29,388,531.90	4.83
9	600999	招商证券	27,803,821.41	4.57
10	600900	长江电力	27,234,010.44	4.47
11	601857	中国石油	27,212,868.55	4.47
12	600019	宝钢股份	20,418,600.58	3.35
13	000402	金融街	18,459,598.96	3.03
14	601788	光大证券	17,109,053.86	2.81
15	000728	国元证券	16,644,981.43	2.73
16	000776	广发证券	15,493,578.87	2.55
17	601628	中国人寿	14,185,374.38	2.33
18	601699	潞安环能	14,076,945.53	2.31
19	600005	武钢股份	13,766,635.06	2.26
20	600642	申能股份	12,608,886.33	2.07
21	000783	长江证券	12,571,911.16	2.07

注:卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票,“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	1,601,419,688.72
卖出股票收入(成交)总额	1,262,689,861.81

注:买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,“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。卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票,“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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	41,651,658.80	4.41
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-

9	合计	41,651,658.80	4.41
---	----	---------------	------

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019202	12 国债 02	216,470	21,655,658.80	2.29
2	120001	12 付息国债 01	200,000	19,996,000.00	2.12

注：本基金本报告期末仅有上述债券投资持仓。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 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	500,000.00
2	应收证券清算款	4,245,859.79
3	应收股利	-
4	应收利息	1,100,987.02
5	应收申购款	3,159.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,850,005.93

8.9.4 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。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.9.5.1 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的情况。

8.9.5.2 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
7,927	136,632.62	829,698,891.13	76.61%	253,387,913.56	23.39%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	齐鲁证券有限公司	10,000,999.00	18.84%
2	西南证券股份有限公司	10,000,666.00	18.83%
3	山东天源热电有限公司	2,000,066.00	3.77%
4	尹宏伟	1,000,066.00	1.88%
5	兰欣	1,000,033.00	1.88%
6	邢守瑄	988,076.00	1.86%
7	黄少晖	587,975.00	1.11%
8	黄静贤	511,310.00	0.96%
9	罗峰	503,016.00	0.95%
10	北京星宇木业有限公司	488,031.00	0.92%

注：上述持有人为场内持有人

9.3 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
基金管理公司所有从业人员持有 本基金	409,014.22	0.04%

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(2011年3月17日)基金份额总额	1,088,639,584.43
本报告期期初基金份额总额	746,966,446.57
本报告期基金总申购份额	602,661,274.71
减：本报告期基金总赎回份额	266,540,916.59
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,083,086,804.69

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：

1、经中国证券监督管理委员会证监许可[2012]512 号核准，李振伟先生担任我公司督察长，甘世雄先生不再担任公司督察长，我公司于 2012 年 4 月 21 日发布了上述人事变动的公告。

2、本公司于 2012 年 6 月 2 日发布高级管理人员变更的公告，杨峰先生因个人原因辞去公司总经理职务，并由公司董事长毕玉国先生代为履行总经理职务。

3、经中国证券监督管理委员会证监许可[2012]1597 号核准，吕宜振先生担任我公司总经理职务，本公司董事长毕玉国先生不再代为履行总经理职务，我公司于 2012 年 12 月 6 日发布了上述人事变动的公告。

4、本基金于 2012 年 2 月 4 日发布基金经理变更公告，增聘吴涛担任本基金基金经理。

5、本基金于 2012 年 7 月 5 日发布基金经理变更公告，增聘张鹏担任本基金基金经理，朱颖不再担任本基金基金经理。

基金托管人：

2012 年 11 月 15 日，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管业务部总经理，其任职资格已经中国证监会审核批准(证监许可(2012)961 号)。聘任郑绍平为中国建设银行投资托管业务部副总经理，其任职资格已经中国证监会审核批准(证监许可(2012)1036 号)。

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

报告期间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

本基金自基金合同成立即 2011 年 3 月 17 日起聘请安永华明会计师事务所为本基金提供审计服务。

本基金 2012 年度需向安永华明会计师事务所支付审计费 80,000.00 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、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

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	
中信证券	2	1,028,664,225.32	36.97%	897,823.12	36.95%	-
齐鲁证券	1	484,222,649.62	17.40%	425,421.19	17.51%	-
民生证券	1	338,221,377.40	12.16%	295,193.87	12.15%	-
兴业证券	2	931,123,496.62	33.47%	811,262.71	33.39%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

中银国际	1	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

注:本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基字[2007]48号)的有关规定要求, 我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后, 向多家券商租用了基金专用交易席位。

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、基金专用交易席位的变更情况:

无。

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	
	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
中信证券	63,175,758.00	41.35%	87,200,000.00	47.57%
齐鲁证券	6,093,647.20	3.99%	6,000,000.00	3.27%
民生证券	-	-	-	-
兴业证券	83,529,249.90	54.67%	90,100,000.00	49.15%
国泰君安	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-

12 影响投资者决策的其他重要信息

1、2012年1月16日, 托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告, 自2012年1月16日起, 王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

2、2012年11月15日, 根据工作需要, 中国建设银行投资托管服务部更名为投资托管业务部。