万家中证红利指数型证券投资基金（LOF）更新招募说明书摘要

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

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等有关法律、法规及基金合同的有关规定募集。并经中国证监会2010年10月11日证监许可［2010］1388号文核准。本基金的基金合同于2011年3月17日正式生效。

【重要提示】

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本基金招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅本基金的基金合同。

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2011年9月17日，有关财务数据和净值表现截止日为 2011年6月30日（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：万家基金管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区福山路450号新天国际大厦23楼
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
法定代表人：毕玉国
总经理：杨峰
成立日期：2002年8月23日
批准设立机关：中国证券监督管理委员会
批准设立文号：中国证监会证监基金字［2002］44号
组织形式：有限责任公司
注册资本：1亿元人民币
存续期间：持续经营
经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。
联系人：兰剑
电话：021-38619810
传真：021-38619888

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

董事长毕玉国先生，中共党员，研究生，高级会计师，曾任莱钢集团莱钢股份公司炼铁厂财务科科长，莱钢集团莱钢股份公司财务处成本科科长，莱钢集团财务部副部长，莱钢驻日照钢铁有限公司财务总监，齐鲁证券经纪有限公司计划财务部总经理。现任齐鲁证券有限公司副总经理兼财务负责人，2011年3月起任本公司董事长。

董事杨峰先生，中共党员，理学博士。历任山东大学助教、讲师、副教授等职，2000年7月至2002年北京大学博士后流动站、深圳证券交易所博士后工作站博士后，2002年3月至2004年3月在泰达荷银基金管理有限公司任组织与战略规划部总经理、公司职工监事等职，2004年3月至2005年9月在大成基金管理有限公司任规划发展部副总监（总监级）主持工作，2005年9月起任万家基金管理有限公司总经理助理，2008年4月起任公司副总经理，2011年3月起任本公司总经理。

董事陈晓龙先生，中共党员，研究生，硕士学位，经济师。曾任上海久事公司资产管理二部总经理助理、上海浦江镇投资发展有限公司副总经理等职，现任上海久事公司资产经营部经理。

董事魏颖晖先生，中共党员，大学本科，学士学位，经济师，曾任职于江西长运股份有限公司、江南证券有限责任公司，现任中航信托股份有限公司总经理助理。

独立董事刘兴云先生，中共党员，管理学博士，教授，曾任山东财政学院会计系副主任、党总支书记、教务长、副院长，中央人民政府驻香港特别行政区联络办公室行政财务部副部长、巡视员兼副部长，现任山东财政学院院长兼党委副书记，并从事企业财务管理方向的理论研究。

独立董事蔡荣生先生，中共党员，经济学博士，教授，曾任职于长春一汽集团、中共中央台湾工作办公室、国务院台湾事务办公室，现任中国人民大学招生就业处处长、商学院教授。

独立董事邓辉先生，中国民主促进会会员，法学博士，教授，曾任江西财经大学法学院副院长，现任江西财经大学法学院院长，江西省立法研究会副会长、中国法学会证券法学研究会常务理事、中国法学会商法学研究会理事。

2、基金管理人监事会成员

监事会主席李振伟先生，中共党员，大学本科，学士学位，高级经济师。1998年6月起从事证券监管工作，先后任证监会济南证管办党委办公室、上市处主任科员，证监会济南证管办上市处、机构处副处长，证监会山东证监局机构处副处长、处长，本公司总经理等职。2010年12月起任本公司监事会主席。

监事崔朋朋先生，中共预备党员，工商管理硕士，经济师，先后任职于山东智星计算机总公司、中创软件、山东山大华特科技股份有限公司、将军控股有限公司。现任山东省国有资产投资控股有限公司项目经理、副部长。

监事兰剑先生，法学硕士，律师、注册会计师，曾在江苏淮安知源律师事务所、上海和华利盛律师事务所从事律师工作，现为本公司信息披露负责人、合规稽核部总监。

3、基金管理人高级管理人员

董事长：毕玉国先生（简介请参见基金管理人董事会成员）

总经理：杨峰先生（简介请参见基金管理人董事会成员）

副总经理：吕宜振先生，中共党员，博士研究生。曾任易方达基金管理有限公司研究主管，信诚基金管理有限公司研究总监，天弘基金管理有限公司投资总监，2011年8月起任本公司副总经理。

督察长：甘世雄先生，中共党员，硕士。曾任山东金泰集团股份有限公司副总裁、天同证券有限责任公司业务总监、投资银行总部总经理，从事股份制改造及股票发行、购并重组工作多年。2004年至今担任公司督察长。

4、本基金基金经理简历

朱颖：男，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，2010年8月起任万家增强收益债券型证券投资基金基金经理。本基金成立时任基金经理

5、投资决策委员会成员

委员会主任：吕宜振
委员：邹昱、吴涛、陈靖、华光磊
吕宜振先生，万家基金管理有限公司副总经理
邹昱先生，固定收益部总监、万家稳健增利基金基金经理、万家货币基金基金经理、万家添利分级基金基金经理
吴涛先生，权益投资部副总监兼万家180基金基金经理
陈靖先生，交易部总监
华光磊先生，研究部总监助理

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

一、基金托管人情况

（一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）
住所：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人：郭树清
成立时间：2004年09月17日
组织形式：股份有限公司
注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字［1998］12号
联系人：尹 东
联系电话：（010）6759 5003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史，其前身 “中国人民建设银行”于1954年成立，1996年易名为 “中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行（股票代码：939）于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250，010，977，486股（包括240，417，319，880股H股及9，593，657，606股A股）。

截至2011 年3 月31 日，中国建设银行资产总额113，125.16 亿元，较上年末增加5，021.99 亿元，增长4.65%。2011年一季度，中国建设银行实现净利润472.33 亿元，较上年同期增长34.23%；年化平均资产回报率1.71%，年化加权平均净资产收益率26.19%；利息净收入716.30 亿元，较上年同期增长25.27%；净利差为2.58%，净利息收益率为2.69%，分别较上年同期提高0.28 和0.30 个百分点；手续费及佣金净收入231.54 亿元，较上年同期增长37.29%。其中，结算、理财、电子银行、贷记卡及保理等重点产品快速增长，收入结构日趋合理。

中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行，在莫斯科设有代表处，设立了湖北桃江建信村镇银行、浙江苍南建信村镇银行、安徽繁昌建信村镇银行、浙江青田建信华侨村镇银行、浙江武义建信村镇银行、陕西安塞建信村镇银行、河北丰宁建信村镇银行、上海浦东建信村镇银行、苏州常熟建信村镇银行9家村镇银行，拥有建行亚洲、建银国际、建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、中德住房储蓄银行等多家子公司。全行已安装运行自动柜员机（ATM）39，874台，拥有员工313，867人，为客户提供全面的金融服务。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可，2010年共获得100 多个国内外奖项。本集团在英国《银行家》杂志公布的“全球商业银行品牌十强”列第二 位，在“全球银行品牌500强”列第13位，并被评为2010年中国最佳银行；在美国《福布斯》杂志公布的“Interbrand2010年度最佳中国品牌价值排行榜”列第三 位，银行业第一位；被《亚洲金融》杂志评为2010 年度“中国最佳银行”；连续三年被香港《资本》杂志评为“中国杰出零售银行”；被中国红十字会总会授予“中国红十字杰出奉献奖章”。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室、团队，现有员工130余人。自2008年以来中国建设银行托管业务持续通过SAS70审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

杨新丰，投资托管服务部副总经理（主持工作），曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2011年6月30日，中国建设银行已托管195只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。2010年初，中国建设银行被总部设于英国伦敦的《全球托管人》杂志评为2009年度“国内最佳托管银行”（Domestic Top Rated），并连续第三年被香港《财资》杂志评为“中国最佳次托管银行”。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1.直销机构

本基金直销机构为本公司以及本公司的网上交易平台。

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
法定代表人：毕玉国
电话：（021）38619987
传真：（021）38619998
联系人：胡晨
客户服务热线：95538转6 ；（021）68644599；400-888-0800；
网址：http://www.wjasset.com

投资人可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、申购及赎回等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。网上交易网址：http://trade.wjasset.com/

2.代销机构

（1）中国建设银行股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人：郭树清
联系人：王琳
客户服务电话：95533
公司网站：www.ccb.com

（2）中国银行股份有限公司
住所：北京市复兴门内大街1号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街1 号中国银行总行办公大楼
法定代表人：肖钢
电话：（010）66596688
传真：（010）66594946
客户服务电话：95566
网址：www.boc.cn

（3）中国工商银行股份有限公司
住所、办公地址：北京市西城区复兴门内大街55 号
法定代表人：姜建清
客户服务电话：95588
网址：www.icbc.com.cn

（4）华夏银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街22号（100005）
办公地址：北京市东城区建国门内大街22号（100005）
法定代表人：吴建
客服电话：95577
网址：www.hxb.com.cn

（5）上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东南路500号
法定代表人：吉晓辉
客户服务热线：95528
公司网站：www.spdb.com.cn

（6）中国银河证券股份有限公司
住所、办公地址：北京市西城区金融大街35 号国际企业大厦C 座
法定代表人：顾伟国
电话：（010）66568888
传真：（010）66568536
联系人：李洋
客户服务电话：400-888-8888
网址：www.chinastock.com.cn

（7）齐鲁证券有限公司
住所、办公地址：山东省济南市市中区经七路86号
法定代表人：李玮
联系人：吴阳
客服电话：95538
网址：www.qlzq.com.cn

（8）招商证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人：宫少林
办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
办公地址邮编：518026
客户服务或投诉电话：95565、0755-26951111 、4008888111
公司电子邮箱：sbox@cmschina.com.cn
公司网址：http://www.newone.com.cn/

（9）江海证券有限公司
住所：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人：孙名扬
联系人：张宇宏
电话：0451-82336863
传真：0451-82287211
客户服务热线：400-666-2288
网址：www.jhzq.com.cn

（10）广发证券股份有限公司
住所：广州市天河北路183号大都会广场43楼
办公地址：广州市天河北路183 号大都会广场18、19、36、38、41、42 楼
法定代表人：王志伟
电话：（020）87555888
传真：（020）87555305
联系人：黄岚
统一客户服务电话：95575或致电各营业网点
网址：www.gf.com.cn

（11）中航证券有限公司
住所、办公地址：南昌市抚河北路291号
法定代表人：杜航
电话：（0791）6768763
传真：（0791）6789414
联系人：余雅娜
客服电话：4008866567
网址：www.avicsec.com

（12）中信证券股份有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层
法定代表人：王东明
统一客服电话：95558
公司网站地址：http://www.cities.com

（13）海通证券股份有限公司
注册地址：上海市淮海中路98号
法定代表人：王开国
电话：（021）23219000
联系人：金芸、李笑鸣
客服电话：400-8888-001、（021）95553 或拨打各城市营业网点咨询电话
网址：www.htsec.com

（14）天相投资顾问有限公司
注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701 邮编：100140
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层 邮编：100140
法定代表人：林义相
客服电话：010-66045678
传真：010-66045500
天相投顾网-网址：www.txsec.com
天相基金网-网址：www.txjijin.com

（15）国泰君安证券股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区商城路618号
办公地址：上海市浦东新区银城中路168号
法定代表人：万建华
客户服务热线：4008888666
网址：www.gtja.com

（16）上海证券有限责任公司
住所、办公地址：上海市西藏中路336 号
法定代表人：郁忠民
电话：（021）53519888
传真：（021）53519888
联系人：刘乔
客户服务电话：（021）962518
网址：www.962518.com.cn

（17）中信建投有限责任公司
住所：北京市朝阳区安立路66 号4 号楼
办公地址：北京市朝阳门内大街188 号
法定代表人：张佑君
联系人：权唐
客户服务电话：400-888-8108
网址：www.csc108.com

（18）华泰联合证券有限责任公司
住所、办公地址：深圳市福田区深南大道4011号香港中旅大厦24 楼
法定代表人：马昭明
客户服务电话：400-888-8555、（0755）25125666
网址：www.lhzq.com

（19）华泰证券股份有限公司
公司总部：南京市中山东路90号华泰证券大厦
客服电话：95597
网址：www.htsc.com.cn

（20）信达证券股份有限公司
注册（办公）地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人：张志刚
联系人：唐静
联系电话：010-63081000
传真：010-63080978
客服电话：400-800-8899
公司网址：www.cindasc.com

（21）申银万国证券股份有限公司
住所、办公地址：上海市常熟路171 号
法定代表人：丁国荣
电话：（021）54033888
传真：（021）54038844
联系人：邓寒冰
客户服务电话：（021）962505
网址：www.sw2000.com.cn

（22）国信证券股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
通讯地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦6楼
法人代表人：何如
联系电话：0755-82130833
传真：0755-82133952
客户服务电话：95536
公司网址：www.guosen.com.cn

（23）山西证券股份有限公司
办公（注册）地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人：侯巍
客服电话：400-666-1618
网址：www.i618.com.cn

（24）民生证券有限责任公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座
办公地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座
法定代表人：岳献春
联系人：赵明
联系电话：010-85127622
联系传真：010-85127917
客服电话：4006198888
公司网址：www.mszq.com

场内代销机构是指具有基金销售资格的深圳证券交易所会员，具体会员单位名单详见深圳证券交易所网站：

http://www.szse.cn/main/marketdata/catalog_hylb.aspx

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京西城区金融大街27号投资广场23层
电话：010-59378888
传真：010-59378828

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：东方昆仑（上海）律师事务所
住所：上海延安西路728号华敏·翰尊国际大厦13楼F座
负责人：陈冉
经办律师：田卫红、汪年俊
电话：021-62113098
联系人：田卫红

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所
住所：北京市东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层（邮编：100738）
办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心50楼（邮编：200120）
联系电话：（021）22288888
传真：（021）22280000
联系人：徐艳

四、基金的名称

万家中证红利指数型证券投资基金（LOF）

五、基金的类型

基金类别：股票型证券投资基金
基金运作方式：上市契约型开放式

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资方向

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%。

八、基金的投资策略

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。

1. 资产配置策略

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%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%。本基金将根据市场的实际情况，适当调整基金资产的配置比例，以保证对标的指数的有效跟踪。

2. 股票投资策略

本基金原则上采用完全复制法来跟踪中证红利指数，按照中证红利指数成份股的基准权重构建股票指数化投资组合。为求基金实际投资组合尽量贴近标的指数的表现，减小跟踪误差，基金管理人将根据实际情况对基金投资组合进行适当调整：

1）本基金股票组合根据所跟踪的中证红利指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整；

2）根据指数编制规则，中证红利指数成份股因增发、送配、分红或其他原因所造成的临时成份股调整，本基金将根据中证红利指数成份股临时调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整；

3）根据指数编制规则及调整公告，本基金在指数成份股调整生效前，对投资组合进行优化调整，以尽量减小指数成份股变动所造成的跟踪误差；

4）根据本基金的申购、赎回、分红等情况对投资组合的影响，以尽可能贴近标的指数表现为目的，对投资组合进行相应调整；

5）指数成份股因受股票停牌限制、股票流动性限制等市场因素限制或法律法规、基金合同等合规因素限制，使本基金无法依据指数购买某成份股的情况，本基金可以根据实际情况对投资组合进行调整；

6）其他影响指数复制的因素，本基金可以根据实际情况，结合以往经验，对本基金资产进行适当调整，力争在控制风险的前提下，获得更接近标的指数的收益率。

3.债券投资策略

本基金基于流动性管理的需要，以保证基金资产流动性为目的，可以投资于国债、金融债等到期日在一年以内的债券。本基金在构建债券投资组合时，合理评估收益性、流动性和信用风险，有效利用基金资产，提高基金资产投资收益。

4.其他金融衍生产品投资策略

在法律法规许可时，本基金可在充分考虑金融衍生产品风险和收益特征的前提下，结合对金融衍生产品的研究，运用金融衍生工具谨慎进行投资，提高投资效率。如有新的产品推出市场，本基金将在届时相应法律法规的框架内，制订符合本基金投资目标的投资策略。

九、基金的业绩比较基准

95%×中证红利指数收益率 + 5%×银行同业存款利率

十、基金的风险收益特征

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。

十一、投资组合报告

万家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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2011年10月10日复核了本报告中的财务指标、净值表现及投资组合报告的等内容，保证复核内容不存在虚假记载误导性陈述及重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2011年6月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	704，629，558.01	91.49
	其中：股票	704，629，558.01	91.49
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	46，769，265.00	6.07
6	其他资产	18，738，131.61	2.43
7	合计	770，136，954.62	100.00

2.期末按行业分类的股票投资组合

2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	4，790，114.00	0.65
B	采掘业	163，150，926.63	22.04
C	制造业	204，258，942.23	27.59
C0	食品、饮料	29，887，729.84	4.04
C1	纺织、服装、皮毛	9，294，401.71	1.26
C2	木材、家具	0.00	0.00
C3	造纸、印刷	5，195，774.79	0.70
C4	石油、化学、塑胶、塑料	40，734，990.75	5.50
C5	电子	6，442，276.98	0.87
C6	金属、非金属	56，382，400.23	7.62
C7	机械、设备、仪表	31，572，608.66	4.26
C8	医药、生物制品	21，434，491.27	2.90
C99	其他制造业	3，314，268.00	0.45
D	电力、煤气及水的生产和供应业	42，894，912.98	5.79
E	建筑业	8，430，923.76	1.14
F	交通运输、仓储业	54，939，294.76	7.42
G	信息技术业	7，582，690.24	1.02
H	批发和零售贸易	10，450，321.35	1.41
I	金融、保险业	199，078，761.52	26.89
J	房地产业	3，012，790.00	0.41
K	社会服务业	4，543，726.36	0.61
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	1，496，154.18	0.20
	合计	704，629，558.01	95.17

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

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

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601328	交通银行	11，970，057	66，314，115.78	8.96
2	601088	中国神华	1，678，677	50，595，324.78	6.83
3	600030	中信证券	3，347，532	43，785，718.56	5.91
4	601398	工商银行	9，426，444	42，041，940.24	5.68
5	601006	大秦铁路	3，020，081	24，734，463.39	3.34
6	601857	中国石油	1，908，827	20，787，126.03	2.81
7	601988	中国银行	6，009，391	18，869，487.74	2.55
8	000983	西山煤电	758，637	18，359，015.40	2.48
9	600900	长江电力	2，514，793	18，131，657.53	2.45
10	601699	潞安环能	468，054	15，356，851.74	2.07

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票

4. 报告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

5. 报告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

本基金本报告期末未持有债券

6 .报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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

7. 报告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. 投资组合报告附注

8.1 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。

8.2 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。

8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	15，592，896.88
3	应收股利	2，969，435.16
4	应收利息	17，600.87
5	应收申购款	51，109.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	107，088.82
8	其他	-
9	合计	18，738，131.61

8.4 报告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

8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.5.1 报告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

8.5.2报告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

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2011年6月30日。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一）本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	净值增长率①	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
基金成立日至2011年6月30日	2.96%	0.48%	-6.65%	1.00%	9.61%	-0.52%

（二）自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较（2011年3月17日至2011年6月30日）

注：本基金成立于2011年3月17日，截至2011年6月30日成立未满一年，根据基金合同规定，基金合同生效后6个月内为建仓期，截至2011年6月30日，本基金尚处于建仓期。

十三、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

1.基金管理人的管理费；
2.基金托管人的托管费；
3.基金上市费用；
4.基金财产拨划支付的银行费用；
5.基金合同生效后的基金信息披露费用；
6.基金份额持有人大会费用；
7.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
8.基金的证券交易费用；
9.基金的指数使用费

本基金指数许可使用基点费的收取标准为以中证红利指数作为跟踪标的的基金资产净值的万分之二，许可使用基点费的收取下限为每季度人民币伍万元；

10.依法可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

（三）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1.基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.75%年费率计提。计算方法如下：

H=E×年管理费率÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值

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。

2.基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。计算方法如下：

H=E×年托管费率÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值

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。

3.基金的指数使用费

在通常情况下，指数许可使用基点费按前一日基金资产净值的0.02%年费率计提。计算方法如下：

H=E×年托管费率÷当年天数
H为每日应计提的指数许可使用基点费
E为前一日基金资产净值

指数使用费从基金合同生效日开始每日计提，按季支付。收取下限为每季度人民币伍万元。

4.除管理费、托管费、指数使用费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（四）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（五）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

（六）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，对基金管理人于2011年2月10日刊登的本基金招募说明书进行了更新，并根据本基金管理人在本基金成立后对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要更新内容如下：

1、更新了招募说明书的目录。

2、在招募说明书的重要提示部分，明确了更新内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。

3、在招募说明书的“三、基金管理人”部分，更新了基金管理人的有关内容。

4、在招募说明书的“四、基金托管人”部分，更新了基金托管人的有关内容。

5、在招募说明书的“五、相关服务机构”部分，更新了代销机构的有关内容。

6、更新了“六、基金的募集”部分，列明了基金募集的有关情况。

7、更新了“七、基金合同的生效”部分，列明了基金成立的时间等内容。

8、更新了招募说明书的“八、基金份额的上市交易”部分，列明了本基金的上市交易时间等内容。

9、在招募说明书的“九、基金份额的申购、赎回”部分，增加了基金转换和定期定额投资计划的有关内容。

10、在招募说明书的“十、基金的投资”部分，增加了基金最近一期（2011年第二季度）投资组合报告内容。

11、在招募说明书中增加“十一、基金的业绩”部分，更新了基金成立以来的投资业绩。

12、在招募说明书的“二十一、托管协议部分”部分，更新了基金公司的有关内容。

13、在招募说明书的“二十二、对基金份额持有人的服务”部分，更新了客户对帐单服务的有关内容。

14、在招募说明书中增加“二十三、其他应披露事项”部分，并增加了招募说明书公告以来本基金的公告事项。

万家基金管理有限公司
2011年10月31日

中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信万通证券有限责任公司开通基金转换业务的公告

为满足广大投资者的理财需求，中欧基金管理有限公司（以下简称“本公司”）定于2011年10月31日起在代销机构中信万通证券有限责任公司办理本公司旗下部分开放式基金的基金转换业务，现将有关事项公告如下：

一、适用范围

本次开通的基金转换业务适用于中欧旗下以下基金之间的转换：

基金代码	基金名称
166001	中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)
166002	中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金
166003 166004	中欧稳健收益债券型证券投资基金A 中欧稳健收益债券型证券投资基金C
166005	中欧价值发现股票型证券投资基金
166006	中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)
166007	中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)
166009	中欧新动力股票型证券投资基金(LOF)

二、业务办理机构

自2011年10月31日起，本公司旗下上述七只基金的投资者可通过中信万通证券有限责任公司办理基金转换业务。

投资者须到同时代理拟转出和转入基金的同一销售机构办理基金的转换业务。具体转换办法以销售机构规定为准。

三、业务办理时间

基金办理转换业务的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所交易日（本公司公告暂停转换时除外）。具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易时间。

四、基金转换业务规则

1、基金转换是基金管理人给基金份额持有人提供的一种服务，是指基金份额持有人按基金管理人规定的条件将其持有的某一基金的基金份额转为同一基金管理人管理的另一只基金的基金份额的行为。基金转换只能在同一销售机构进行。转换的两只基金必须都是该销售机构代理的同一基金管理人管理的、在同一注册登记机构注册登记的基金，且申请当日拟转出基金和转入基金均处于正常交易状态，转出份额必须为可用份额，否则申请无效。目前场内不支持基金转换业务。

2、基金转换实行“份额转换、未知价”原则，即基金转换以份额为单位进行申请，基金的转换价格以转换申请受理当日各转出、转入基金的份额净值为基准进行计算。具体份额以注册登记机构的记录为准，转入基金的份额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。投资者T日