

序号		债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1		国家债券	-	-
2		央行票据	99,680,000.00	3.30
3		金融债券	29,835,000.00	0.99
		其中:政策性金融债	29,835,000.00	0.99
4		企业债券	-	-
5		企业短期融资券	-	-
6		中期票据	-	-
7		可转债	61,637,565.90	2.04

8	其他			
9	合计		191,152,565.90	6.34
7.6 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	10010709	10央行票据79	1,000,000	99,680,000.00 3.30
2	113002	工行转债	494,330	49,147,715.40 1.63
3	130201	13国开01	300,000	29,835,000.00 0.99
4	110022	同仁转债	96,350	12,489,850.50 0.41
7.7 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。				
7.8 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。				
7.9 报告期内本基金投资的股指期货交易情况说明				
7.9.1 报告期内本基金投资的股指期货持仓和损益明细				
注:本基金本报告期末未持有股指期货。				
7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策				
本基金合同规定,本基金不能投资于股指期货。				
7.10 投资组合报告附注				
7.10.1 本基金报告期内,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。				
7.10.2 报告期内,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。				
7.10.3 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	3,608,606.64
2	应收证券清算款	23,507,284.80
3	应收股利	13,021,794.49
4	应收利息	2,900,265.71
5	应收申购款	511,604.06
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	43,549,555.70

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110022	同仁转债	12,489,850.50	0.41
2	113002	工行转债	49,147,715.40	1.63

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.10.5.1 期末前十大股票前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

7.10.5 期末积极投资前五只股票中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

8.1 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
328,383	18,040.67	182,470,058.16	3.08%	5,741,780,611.57	96.92%

8.2 期末基金管理人从业人数持有本基金的情况

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	526,238.58	0.01%

注：1、截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究人员3人每人持有本基金份额总数的数量区间均为0；

2、截止本报告期末，本基金基金经理持有本基金份额总数的数量区间为0。

§9 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	
本报告期期初基金份额总额	9,649,789,525.65	
本报告期基金总申购份额	1,921,123,815.79	
本报告期基金总赎回份额	527,478,374.90	
减：本报告期基金总赎回份额	4,244,351,520.96	
本报告期基金净变动份额		
本报告期末基金份额总额	5,924,250,669.73	

64 第十节 附注

10.1 基金仍期待有大会会
报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 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
管理人：经公司2013年第一次临时股东大会一致通过，选举毕国、吕永春、吕祥友、吕宣顺、刘兴云、陈增敏、路玉刚为万家基金管理有限公司第四届董事董事，其中刘兴云、陈增敏、路玉刚为第四届董事会独立董董事。

2. 经本公司第四届董董事第一次会议审议通过，聘请詹志令、李杰为本分公司副副总经理。
托托管人：
2013年3月17日，根据国家金融工作需要，肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董董事长职务。中国银行股份有限公司已于2013年3月17日公告上述事项。
2013年6月1日，中国银行股份有限公司发布公告，自2013年5月31日起，田国立先生就任本行董董事长、执行董事、董董事会战略发展委员会主席及委员。

10.3 涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务等的诉讼
报告期内无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生重大改变。						
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况						
报告期内为基金进行审计的会计师事务所情况未发生重大改变。						
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受奖惩或处罚等情况						
无						
10.7 基金申购赎回基金交易单元的有关情况						
10.7.1 基金申购赎回基金交易单元进行股票投资佣金支付情况						
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	1,531,161,989.77	37.72%	1,393,966.50	37.72%	-
申银万国	1	501,072,504.94	12.34%	456,175.13	12.34%	-
广发证券	4	464,253,613.40	11.44%	422,654.61	11.44%	-
五矿证券	1	438,293,544.94	10.80%	399,022.84	10.80%	-
银河证券	1	335,917,928.26	8.27%	305,819.82	8.27%	-
东方证券	2	294,031,478.57	7.24%	267,685.56	7.24%	-
上海证券	1	181,756,117.10	4.48%	165,470.95	4.48%	-
中航证券	1	180,736,852.27	4.45%	164,552.19	4.45%	-

广证证券	1	160,740,852.32	4.45%	169,332.18	4.45%	-
长江证券	1	68,441,050.96	1.69%	62,308.69	1.69%	-
华宝证券	1	50,003,879.62	1.23%	45,523.40	1.23%	-
中信万通	1	14,005,036.90	0.34%	12,750.15	0.34%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
华夏证券	1	-	-	-	-	-
远东证券	1	-	-	-	-	-
山东齐鲁证 券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

注：基金专用交易席位的选择标准如下：q 经营行为稳健规范，内部控制度健全，在业内有良好的声誉；

提供高质量近实时的高效、安全的通讯条件,交易撮合系统基金进行证券交易的平台;

④ 具有较完善的全方位风险控制能力与手段,包括但不限于:有较广的授权能力和执行分析能力;能及时、全面地向公司提供市场相关的利率、行业及市场走向、个股分析数据及丰富全面的信息服务;能根据公司所管理基金的特点要求,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服务和支撑。

3、基金专用交易席位的选择程序如下:

① 基金管理人根据上述标准考核后确定选择交易席位的证券经营机构;

② 基金管理人根据上述标准考核后签订席位使用协议;

3、基金专用交易席位的变化情况:

无

10.7.2 基金利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	76,725,623.20	35.96%	1,254,700,000.00	36.82%	-	-
申银万国	46,897,238.60	21.98%	560,000,000.00	16.43%	-	-
广发证券	43,535,170.90	20.40%	100,000,000.00	2.93%	-	-
五矿证券	5,998,920.00	2.81%	714,700,000.00	20.97%	-	-

银河证券	38,901,284.10	18.23%	65,000,000.00	1.91%	-	-
东方证券	86,558.60	0.04%	240,000,000.00	7.04%	-	-
上海证券	86,015.80	0.04%	153,000,000.00	4.49%	-	-
中航证券	-	-	110,000,000.00	3.23%	-	-
长江证券	1,147,329.60	0.54%	210,000,000.00	6.16%	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
中信万通	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华夏证券	-	-	-	-	-	-
远东证券	-	-	-	-	-	-
山东齐鲁证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-