富安达优势成长股票型证券投资基金

2012年12月31日

【2012】年度报告摘要

基金管理人:富安达基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
送出日期:2013年3月27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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年3月22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。

本报告中的财务资料经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司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。

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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富安达优势成长股票型证券投资基金
基金简称	富安达优势成长股票
基金主代码	710001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月21日
基金管理人	富安达基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	365,375,116.10
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金定位为股票型证券投资基金。在充分控制风险的前提下,精选具有竞争优势及持续成长性的上市公司,分享中国经济高速发展带来的收益,力争获得超越投资基准的收益。
投资策略	本基金采用自上而下的多维经济模型,通过对全球经济发展形势,国内经济情况及经济政策、物价水平变动趋势、资金供求关系和市场估值的分析,结合FED模型,对未来一定时期各大类资产的收益风险变化趋势作出预测,并据此适时动态的调整本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例。同时将定性分析与定量分析贯穿于行业配置和个股选择的投资全过程中。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金,属于证券投资基金中预期风险和预计收益较高的基金产品。

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		富安达基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	蒋晓刚	斐学敏
	联系电话	021-61870999	021-32169999
	电子邮箱	service@fadfunds.com	zh_jjb@bankcomm.com
客户服务电话		400-630-6999(免长途)021-61870666	95559
传真		021-61870888	021-62701262
注册地址		上海市浦东新区世纪大道1568号中建大厦29楼	上海市浦东新区银城中路188号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道1568号中建大厦29楼	上海市仙霞路18号
邮政编码		200122	200120
法定代表人		张华东	胡怀邦

2.4 信息披露方式

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

§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9月21日-2011年12月31日
本期已实现收益	-68,567,292.15	-6,063,452.18
本期利润	-23,115,372.61	-13,260,882.55
加权平均基金份额本期利润	-0.0569	-0.0190
本期加权平均净值利润率	-6.32%	-1.90%
本期基金份额净值增长率	-5.30%	-4.61%
3.1.2 期末数据和指标	**2012年末**	**2011年末**
期末可供分配利润	-68,962,921.39	-20,336,288.44
期末可供分配基金份额利润	-0.1887	-0.0461
期末基金资产净值	330,045,394.17	420,970,976.58
期末基金份额净值	0.9033	0.9539
3.1.3 累计期末指标	**2012年末**	**2011年末**
基金份额累计净值增长率	-9.67%	-4.61%

注:1.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,例如:基金的认购、申购、赎回费等,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.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。

3.期末可供分配利润为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	7.20%	1.21%	7.72%	0.96%	-0.52%	0.25%
过去六个月	0.03%	1.21%	2.44%	0.93%	-2.41%	0.28%
过去一年	-5.30%	1.23%	6.88%	0.96%	-12.18%	0.27%
自基金合同生效日起至今(2011年09月21日-2012年12月31日)	-9.67%	1.15%	-3.08%	0.99%	-6.59%	0.16%

注:①本基金业绩比较基准为:75%×沪深300指数+25%×上证国债指数。

②本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,按下列公式计算:

Return t =75%× [沪深300指数t / 沪深300指数 (-1)-1]+25%× [上证国债指数t / 上证国债指数 (-1) -1]

Benchmark t = 1+Return t>Benchmark (-1)

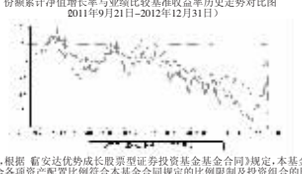
其中,t =1,2,3,…T,T 表示时间截至日。

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

富安达优势成长股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

2011年9月21日-2012年12月31日)



注:本基金于2011年9月21日成立,根据《富安达优势成长股票型证券投资基金基金合同》规定,本基金建仓期为6个月,建仓截止日为2012年3月20日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净资值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金合同于2011年9月21日生效,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

本基金自基金合同生效以来未实施利润分配。

§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

富安达基金管理有限公司由南京证券股份有限责任公司、江苏交通控股有限公司、南京市河西新城区国有资产经营控股(集团)有限责任公司三家单位共同发起设立。公司办公地点为上海浦东世纪大道1568号中建大厦,注册资本2.88亿元人民币。公司秉承诚信、稳健、规范、创新的经营理念,以基金持有人利益最大化为首要经营目标,为客户提供卓越的理财服务。

截至2012年12月31日,公司共管理三只开放式基金:富安达优势成长股票型证券投资基金、富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金和富安达债券型证券投资基金。

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		
孔学兵先生	本基金的基金经理、投资管理部副总监	2011年9月21日	-	17年	工商管理硕士。1996年加入南京证券有限责任公司,历任投资管理总部高级投资经理,资产管理总部高级投资经理。2010年1月加入富安达基金筹备组,2011年4月任富安达基金管理有限公司投资管理部副总监,投资决策委员会成员。

注:1.任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日;担任新成立基金的基金经理,任职日期为基金合同生效日。

2.证券从业的含义遵从行业协会关于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

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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》及其各项实施准则、《富安达优势成长股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

本基金无违法、违规行为。

本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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

本基金管理人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》,制定了《富安达基金管理有限公司公平交易制度》,并建立了健全有效的公平交易执行和监控体系,涵盖了所有投资品种、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节,确保公平对待旗下的每一个投资组合。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

监察稽核部从管理人旗下第二个投资组合成立之日起,分季度对各基金公平交易执行情况进行了统计分析,发现在各个计算周期内,1日、3日、5日和30日时间窗的同向交易样本数量均少于30个,不满足T检验所需的样本个数,并通过对各投资组合间以及单个组合与组合类别的公平交易结果分析,在特定时间窗内交易证券的溢价率和溢价金额均在正常范围内,因此不构成潜在利益输送的显著性。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。

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

2012年,宏观经济在经历持续下行之后,终于迎来了触底后的温和复苏。改革新政重构中长期信心,叠加新型城镇化带来的投资驱动力,推动A股市场走出最黑暗,触底反弹重现活力。

四季度本基金投资策略侧重于"低估值基础上的稳定增长",投资组合重点倾斜于地产、建筑建材(铁路建设)、汽车等行业,同时,重点减持了医药、消费电子、新兴产业等估值偏高的成长类股票。

回顾2012年全年的投资,我们未能取得好的绩效,主要失误在于一季度本基金建仓期未在仓位管理和配置方向上未能更好地契合市场,导致阶段性跑输基准较多。今后我们将在不断总结的基础上,更加注重攻守平衡,力争以良好的长期投资绩效,回馈持有人的信任。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2012年12月31日,本基金份额净值为0.9033元,本报告期份额净值增长率为-5.30%,同期业绩比较基准收益率为6.88%。

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,经济处于温和复苏、但复苏力度和可持续性尚待观察。2012年四季度自下滑开始的小幅复苏,能否顺利向中上游传导将决定2013全年投资机会的多寡。一季度将成为重要的观察窗口,宏观复苏能够多大程度上体现到微观企业盈利的改善,以及市场流动性的转移程度,将决定周期股的估值修复空间,而成长股的投资机会在于经济下行风险得到遏制后管理层对经济转型的推动力度。2013年市场风险将主要集中于地产调控可能引发的经济下行担忧,新型城镇化将以何种方式推进也尚待观察。我们认为,2013年经济增长的驱动因素在于:积极的财政政策将促进基建投资稳中有升;下游企业去库存基本结束;全球经济增长前景仍然很弱但总体趋向平稳,净出口在2013年不再对经济增长形成拖累;在新政府看力改善民生的背景下,消费预计保持平稳增长。微观企业盈利方面,实体经济有望依赖自身韧性走出最黑夜。2013年市场总体环境好于2012年,但动荡与反复依然不可避免。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人持续推进内控体系和机制建设,强化内部管理,不断提升自身合规风控能力。报告期内,公司进一步梳理完善内部相关规章制度及业务流程,强化内控基础建设;牢头开展了多形式的合规培训,强化员工职业道德教育和合规意识培育,从源头上防范合规风险;建立健全防控内幕交易机制,确保基金投资的独立性、公平性和合规性;加强业务日常合规审核和合规监测,并加大对重要业务和关键业务环节的监督检查,确保各项法规和管理制度有效落实,使业务在可稽可控的范围内有序开展。

本报告期内,本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规,有效保障了基金份额持有人利益。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,建立健全面风险管理体系,不断提高监察稽核工作的科学性和有效性,最大限度地防范和化解经营风险,充分保护基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会,公司总经理担任估值委员会主席,研究发展部、投资管理部、监察稽核部和基金事务部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序,指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验,熟悉相关法律法规,具备行业研究、风险管理、法律介规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内,参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供银行间可以市场交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期未进行收益分配。

§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

2012年度,基金托管人在富安达优势成长股票型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2012年度,富安达基金管理有限公司在富安达优势成长股票型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配,符合基金合同的规定。

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

2012年度,由富安达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关富安达优势成长股票型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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	普华永道中天审字(2013)第21031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	富安达优势成长股票型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的富安达优势成长股票型证券投资基金(以下简称"富安达优势成长基金")的财务报表,包括2012年12月31日的资产负债表、2012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富安达优势成长基金的基金管理人富安达基金管理有限公司 管理层的责任。这种责任包括: (1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,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管理层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,上述富安达优势成长基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了富安达优势成长股票2012年12月31日的财务状况以及2012年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	单峰、张晓艺
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限公司
会计师事务所的地址	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
审计报告日期	2013-03-26

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:富安达优势成长股票型证券投资基金

报告截止日:2012年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	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	7.4.7.1	23,358,988.17	379,738.75
结算备付金		6,626,404.90	155,600,483.32
存出保证金		2,250,000.00	1,250,000.00
交易性金融资产	7.4.7.2	296,277,641.13	185,235,814.42
其中:股票投资		296,277,641.13	185,235,814.42
基金投资			
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	88,930,373.40
应收证券清算款		5,162,150.08	2,339,063.53
应收利息	7.4.7.5	14,951.22	265,365.25
应收股利		-	-
应收申购款		3,163.64	44,364.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		333,693,299.14	434,045,203.22
负债和所有者权益	附注号	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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	9,222,469.63
应付赎回款		120,062.29	696,340.58
应付管理人报酬		388,336.65	563,095.20
应付托管费		64,722.76	93,849.20
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	864,543.94	1,115,847.65
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	2,210,239.33	1,382,624.38
负债合计		3,647,904.97	13,074,226.64
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	365,375,116.10	441,307,265.02
未分配利润	7.4.7.10	-35,329,721.93	-20,336,288.44
所有者权益合计		330,045,394.17	420,970,976.58
负债和所有者权益总计		333,693,299.14	434,045,203.22

注:1.报告截止日2012年12月31日,基金份额净值0.9033元,基金份额总额365,375,116.10份。

7.2 利润表

会计主体:富安达优势成长股票型证券投资基金

本报告期:2012年1月1日-2012年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2012年1月1日-2012年12月31日	上年度可比期间 2011年9月21日-2011年12月31日
一、收入		-10,277,049.52	-7,083,054.55
1.利息收入		2,065,848.13	3,887,640.71
其中:存款利息收入	7.4.7.11	1,254,393.51	2,358,039.52
债券利息收入		-	242.33
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		811,454.62	1,529,358.86
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-57,894,514.60	-4,558,502.36
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-60,292,686.65	-4,558,532.36
基金投资收益			
债券投资收益	7.4.7.13	-	30.00
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	2,398,172.05	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.16	45,451,919.54	-7,197,430.37
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)			
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	99,697.41	785,237.47
减:二、费用		12,838,323.09	6,177,828.00
1.管理人报酬		5,506,204.08	2,996,487.94
2.托管费		917,700.73	499,414.69
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.18	6,014,819.78	2,448,730.87
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.19	399,598.50	233,194.50
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-23,115,372.61	-13,260,882.55
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-23,115,372.61	-13,260,882.55

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:富安达优势成长股票型证券投资基金

本报告期:2012年1月1日-2012年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2012年1月1日-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)	441,307,265.02	-20,336,288.44	420,970,976.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-23,115,372.61	-23,115,372.61
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)	-75,932,148.92	8,121,939.12	-67,810,209.80
其中:1.基金申购款	19,565,714.16	-1,243,603.79	18,322,110.37
2.基金赎回款	-95,497,863.08	9,365,542.91	-86,132,320.17
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)	365,375,116.10	-35,329,721.93	330,045,394.17

项 目	上年度可比期间 2011年9月21日-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)	1,052,684,607.12	-	1,052,684,607.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-13,260,882.55	-13,260,882.55
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)	-611,377,342.10	-7,075,405.89	-618,452,747.99
其中:1.基金申购款	9,817,760.06	-97,464.97	9,720,295.09
2.基金赎回款	-621,195,102.16	-6,977,940.92	-628,173,043.08
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)	441,307,265.02	-20,336,288.44	420,970,976.58

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:

李剑锋	蒋晓刚	袁欣
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 报表附注

7.4.1 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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

7.4.2 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

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
富安达基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司("交通银行")	基金托管人、基金销售机构
南京证券股份有限公司("南京证券")	基金管理人的控股股东、基金销售机构
江苏交通控股有限公司("江苏交通")	基金管理人的股东
南京市河西新城区国有资产经营控股(集团)有限责任公司("南京河西")	基金管理人的股东

注:1.南京证券有限责任公司于2012年9月21日发布公告,经中国证监会证监许可【2012】1217号文核准批复,其公司名称变更为"南京证券股份有限公司"。

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。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 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-2012年12月31日		上年度可比期间 2011年9月21日-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
南京证券	954,852,134.49	23.88%	330,237,071.18	19.63%

7.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日-2012年12月31日			上年度可比期间 2011年9月21日-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	占应付佣金余额的比例	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占应付佣金余额的比例
南京证券	836,798.83	24.39%	281,218.78	32.53%	273,471.53	19.72%	-	-

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。

7.4.4.1.4 债券交易

注:本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.4.1.5 债券回购交易

注:本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日-2012年12月31日	上年度可比期间 2011年9月21日-2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,506,204.08	2,996,487.94
其中:支付销售机构的客户维护费	1,582,733.03	1,033,019.90

注:1.支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

2.客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日-2012年12月31日	上年度可比期间 2011年9月21日-2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	917,700.73	499,414.69

注:支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告内未与关联方进行银行间同业市场的债券(回购)交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日-2012年12月31日	上年度可比期间 2011年9月21日-2011年12月31日
基金合同生效日(2011年9月21日)持有的基金份额	-	19,999,400.00
期初持有的基金份额	19,999,400.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	19,999,400.00	19,999,400.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.47%	4.53%

7.4.4.4.2 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
南京证券	13,999,000.00	3.83%	13,999,000.00	3.17%
南京河西	39,999,800.00	10.95%	39,999,800.00	9.06%

7.4.4.5 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-2012年12月31日		上年度可比期间 2011年9月21日-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
交通银行活期存款	23,358,988.17	128,515.15	379,738.75	45,417.93
交通银行定期存款	-	-	-	451,388.89

注:1.本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管,按银行间业利率计息。

2.本基金用于证券交易结算的资金通过"交通银行基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司,按银行间业利率计息。于2012年12月31日的相关余额在资产负债表中的"结算备付金"科目中单独列示(2011年12月31日:同)。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内直接购入关联方承销证券。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.5 期末(2012年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未因认购新股/新债而持有流通受限证券。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末(2012年12月31日),本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	296,277,641.13	88.79
	其中:股票	296,277,641.13	88.79
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	29,985,393.07	8.99
6	其他各项资产	7,430,264.94	2.23
7	合计	333,693,299.14	100.00

8.2 期末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	10,133,400.00	3.07
B	采掘业	3,734,100.00	1.13
C	制造业	80,285,274.40	24.33
C0	食品、饮料	1,484,600.00	0.45
C1	纺织、服装、皮毛	3,071,187.36	0.93
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	9,866,323.00	2.99
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	16,790,100.00	5.09
C7	机械、设备、仪表	45,653,064.04	13.83
C8	医药、生物制品	3,420,000.00	1.04
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	72,425,607.32	21.94
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	7,534,100.00	2.28
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	6,888,800.00	2.09
J	房地产业	102,072,959.41	30.93
K	社会服务业	1,303,400.00	0.39
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	11,900,000.00	3.61
合计		296,277,641.13	89.77

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

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	000024	招商地产	782,859	23,399,655.51	7.09
2	600048	保利地产	1,289,902	17,542,667.20	5.32
3	002146	荣盛发展	1,160,000	16,228,400.00	4.92
4	000961	中南建设	1,160,000	15,915,200.00	4.82
5	002244	滨江集团	1,457,902	15,818,236.70	4.79
6	601668	中国建筑	3,930,000	15,327,000.00	4.64
7	600805	悦达投资	1,000,000	11,900,000.00	3.61
8	600741	华域汽车	906,378	10,133,306.04	3.07
9	000656	金科股份