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2013年3月17日，有关财务数据和净值表现截止日为2012年12月31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：上海市浦东新区浦电路360号陆家嘴投资大厦9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：吕宜振
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，兼任万家共赢资产管理有限公司董事长，2011年3月起任本公司董事长。

董事马永春先生，政治经济学硕士学位，曾任新疆自治区党委政策研究室科长，新疆通宝投资有限公司总经理，新疆对外经贸集团总经理，新疆天山股份有限公司董事，现任新疆国际实业股份有限公司副董事长兼总经理。

董事吕祥友先生，中共党员，大学本科，硕士学位，高级经济师，曾任莱芜钢铁集团有限公司财务处科长、鲁银投资集团股份有限公司办公室主任兼董事会秘书、天同证券风险处置工作小组托管组成员、齐鲁证券有限公司人力资源部总经理、董事会秘书、党委组织部部长、人力资源部总经理、董事、鲁证期货有限公司董事，现任齐鲁证券有限公司董事会秘书、党委组织部部长、人力资源部总经理、鲁证期货有限公司董事。

董事吕宜振先生，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5月起加入本公司，历任公司副总经理，现任公司总经理。

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，现任山东财经大学校长兼党委副书记，并从事企业财务管理方向的理论研究。

独立董事陈增敬先生，中国民主建国会成员，博士研究生，教授，曾任山东烟台十一中学教师，山东大学数学院讲师兼副教授，法国国家信息与自动化研究所博士后，加拿大西安大略大学保险系访问学者、兼职教授，山东大学金融研究院常务副院长兼教授，山东大学数学院副院长（兼）、教授，现任山东大学金融研究院院长（兼数学院副院长）、教授。

独立董事骆玉鼎先生，中共党员，研究生，经济学博士，副教授，曾任上海财经大学金融学院银行系讲师，上海财经大学证券期货学院院长助理，美国国际管理研究生院（霍鸟）访问研究员，上海财经大学证券期货学院副院长兼副教授，新疆财经学院金融系支教教师，上海财经大学金融学院副院长兼常务副院长，上海财经大学金融学院副教授，现任上海财经大学商学院副院长。

2、基金管理人监事会成员

监事会主席李洞起先生，硕士学位，经济师。1996年1月起，任宏源证券股份有限公司文艺路营业部客户主管、公司投行部项目经理，2012年3月起任新疆国际实业股份有限公司证券事务代表、董事会秘书，现任新疆国际实业股份有限公司董事会秘书兼副总经理。

监事崔朋朋先生，中共党员，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。

监事李丽女士，中共党员，硕士，中级讲师，先后任职于中国工商银行济南分行、济南卓越外语学校、山东中医药大学。2008年3月起任万家基金管理有限公司，现任公司综合管理部副总监。

监事蔡鹏鹏女士，本科，先后任职于北京幸福之光商贸有限公司销售主管、北方之星数码技术（北京）有限公司高级客户经理、路通资讯香港有限公司北京代表处高级业务经理，2007年4月起任职于万家基金管理有限公司渠道客服部渠道经理、机构理财部总监助理。现任公司机构理财部副总监。

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：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，本公司副总经理等职。2012年12月起任本公司总经理。

督察长：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、监事会主席等职。2012年4月起任本公司督察长。

4、本基金基金经理简历

吴涛，男，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、南方总部副总经理等职，2002年起任万家基金管理有限公司监察稽核部总监，负责公司投资风险管理、监察稽核等工作。2010年3月起任180基金基金经理。2012年2月起任本基金基金经理。现任量化投资部总监、兼任万家180指数基金基金经理、万家中证创业成长指数分级基金基金经理。

张鹏，男，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副主管、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。2012年7月起任本基金基金经理。现任量化投资部副总监。

5、投资决策委员会成员

委员会主任：吕宜振
委员：刘芳洁、吴涛、陈靖、华光磊、朱虹
吕宜振先生，万家基金管理有限公司总经理
刘芳洁先生，万家基金管理有限公司总经理助理、权益投资总监、权益投资部总监（兼）
吴涛先生，本基金基金经理、量化投资部总监兼万家180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、万家和谐基金基金经理
朱虹女士，固定收益部总监、万家信用恒利债券基金基金经理、万家添利分级债券型证券投资基金基金经理、万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理

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：王洪章
成立时间：2004年09月17日
组织形式：股份有限公司
注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
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：田青
联系电话：（010）6759 5096

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2012 年9月30日，中国建设银行资产总额132,964.82亿元，较上年末增长8.26%。截至2012年9月30日止九个月，中国建设银行实现净利润1,585.19亿元，较上年同期增长13.87%。年化平均资产回报率为1.65%，年化加权平均净资产收益率为24.18%。利息净收入2,610.24亿元，较上年同期增长17.05%。净利差为2.57%，净利息收益率为2.74%，分别较上年同期提高0.01 和0.06 个百分点。手续费及佣金净收入699.21亿元，较上年同期增长1.64%。

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、台北设有代表处，海外机构已覆盖到全球13个国家和地区，基本完成在全球主要金融中心的网络布局，24 小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行20家，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、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司，为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

2012年上半年，本集团各方面良好表现，得到市场与社会各界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的30多个重要奖项。本集团在英国《银行家》2012年“全球银行1000强”中位列第6，较去年上升2位；在美国《财富》世界500强中排名77位，较去年上升31位；在美国《福布斯》2012年度全球上市公司2000强排名第13位，较去年上升4位。本集团是境内唯一一家连续四年蝉联香港《亚洲公司治理》杂志颁发的“亚洲企业管治年度大奖”的上市公司，并先后获得《环球金融》、《财资》、中国银行业协会等颁发的“中国最佳银行”、“卓越管理及公司管治”与“2011年度最具社会责任金融机构”等奖项。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、核算处、清算处、监督稽核处、涉外资产核算团队、养老金托管处、托管业务系统规划与管理团队、上海备份中心等12个职能处室、团队，现有员工209人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，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，投资托管业务部总经理，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，投资托管业务部副总经理，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。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，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2012年9月30日，中国建设银行已托管267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。中国建设银行在2005年及自2009年起连续三年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”，在2007年及2008年连续被《财资》杂志评为“国内最佳托管银行”奖，并获和讯网2011年度和2012年度中国“最佳资产托管银行”奖。

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
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
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
客户服务电话：95588
网址：www.icbc.com.cn

（4）华夏银行股份有限公司
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
客户服务热线：95528
公司网站：www.spdb.com.cn

（6）中国农业银行股份有限公司
客户服务电话：95599（或拨打各城市营业网点咨询电话）
网址：www.abchina.com

（7）中国银河证券股份有限公司
客户服务电话：400-888-8888
网址：www.chinastock.com.cn

（8）齐鲁证券有限公司
客服电话：95538
网址：www.qlzq.com.cn

（9）招商证券股份有限公司
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/

（10）江海证券有限公司
客户服务热线：400-666-2288
网址：www.jhzq.com.cn

（11）广发证券股份有限公司
统一客户服务电话：95575或致电各营业网点
网址：www.gf.com.cn

（12）中航证券有限公司
客服电话：4008866567
网址：www.avicsec.com

（13）中信证券股份有限公司
统一客服电话：95558
公司网站地址：http://www.citics.com

（14）海通证券股份有限公司
注册地址：上海市淮海中路98号
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

（15）天相投资顾问有限公司
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

（16）国泰君安证券股份有限公司
客户服务热线：4008888666
网址：www.gtja.com

（17）上海证券有限责任公司
客户服务电话：021）962518
网址：www.962518.com.cn

（18）中信建投有限责任公司
客户服务电话：400-888-8108
网址：www.csc108.com

（19）华泰证券股份有限公司
客服电话：95597
网址：www.htsc.com.cn

（20）信达证券股份有限公司
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
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
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
客服电话：400-666-1618
网址：www.i618.com.cn

（24）民生证券有限责任公司
联系传真：010-85127917
客服电话：4006198888
公司网址：www.mszq.com

（25）五矿证券有限责任公司
客服电话：40018-40028
网址：www.wkzq.com.cn

（26）华龙证券有限责任公司
客服电话：4006898888
网址：www.hlzqgs.com

（27）宏源证券股份有限公司
客服电话：4008-000-562
网址：www.hysec.com

（28）中国国际金融有限公司
电话：010-65051166
网址：www.cicc.com.cn

（29）光大证券股份有限公司
客服电话：4008888788
网址：www.ebscn.com

（30）中信万通证券有限责任公司
客服电话：96577
网址：www.zxwt.com.cn

（31）东吴证券股份有限公司
客户服务电话：0512-96288
网址：www.dwjq.com.cn

（32）中信证券（浙江）有限责任公司（原中信金通证券）
客服电话：0571-96598
网址：www.bigsun.com.cn

（33）日信证券有限责任公司
客服电话：4006609839
网址：http://www.rxzq.com.cn

（34）中银国际证券有限责任公司
客服电话：4006208888
网址：http://www.bocichina.com

（35）杭州数米基金销售有限公司
客服电话：4000-766-123
网址：www.fund123.cn

（36）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司
客服电话：400-821-5399
网址：www.noah-fund.com

（37）上海长量基金销售投资顾问有限公司
客服电话：400-089-1289
网址：www.erichfund.com

（38）上海好买基金销售有限公司
客服电话：400-700-9665
网址：www.ehowbuy.com

（39）深圳众禄基金销售有限公司
客服电话：4006-788-887
网址：www.zlfund.cn及www.jjmmw.com

（40）北京展恒基金销售有限公司
客服电话：400-888-6661
网址：www.myfund.com

（41）上海天天基金销售有限公司
客服电话：400-1818-188
网址：www.1234567.com.cn

（42）华鑫证券有限责任公司
客服电话：021-32109999；029-68918888
网址：www.cfsc.com.cn

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2013年4月 12 日复核了本报告中的财务报告、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2012年12月31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	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	其他资产	5,850,005.93	0.61
7	合计	954,181,217.71	100.00

2.报告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	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

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.报告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	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

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。

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	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

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	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附息国债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。

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。

8.2 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	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

8.4 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处于转股期的可转换债券。

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2012年12月31日。

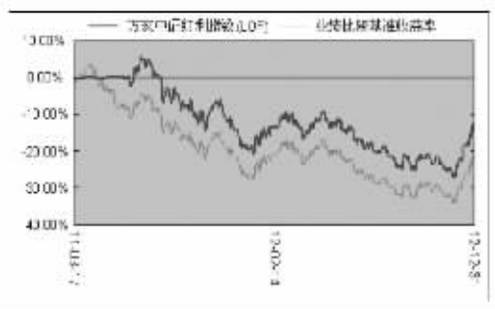
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（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
2012年	6.93%	1.15%	6.82%	1.15%	0.11%	0.00%
基金成立日至2011年12月31日	-18.51%	1.01%	-26.16%	1.14%	7.65%	-0.13%
基金成立日至2012年12月31日	-12.86%	1.09%	-21.12%	1.15%	8.26%	-0.06%

（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2012年12月31日）



注：本基金成立于2011年3月17日，建仓期为6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。

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2012年10月30日刊登的本基金招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

1、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。
2、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。
3、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。
4、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。
5、在招募说明书的“九、基金份额的申购、赎回”部分，更新了定期定额服务机构。
6、在招募说明书的“十、基金的投资”部分，增加了基金最近一期（2012年第四季度）投资组合报告内容。
7、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。
8、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
2013年4月27日

万家基金管理有限公司关于旗下基金持有的“圣农发展”股票估值方法变更的提示性公告

根据“圣农发展”股票代码002299）发布的停牌公告，该股票自 2013年2月28日起停牌。依据中国证监会〔2008〕38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的规定，经与相关基金托管行协商一致，本公司决定于2013年4月26日起对旗下万家中证创业成长指数分级证券投资基金、万家精选股票型证券投资基金所持有的“圣农发展”股票采用“指数收益法”进行估值。待该股票复牌交易并且体现出活跃市场交易特征后，将恢复为采用当日收盘价格进行估值，届时将不再另行公告。

本公司将严格按照《企业会计准则》、中国证监会的相关规定及基金合同中关于估值的约定对基金所持有的投资品种进行估值，请广大投资者关注。

特此公告。

万家基金管理有限公司
2013年4月27日

国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金基金合同生效公告

公告送出日期：2013年4月27日

1.公告基本信息

基金名称	国泰中国企业境外高收益债券型证