

中海消费主题精选股票型证券投资基金 2012 年年度报告摘要

2012 年 12 月 31 日

基金管理人：中海基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司(以下简称“农业银行”)根据本基金合同规定，于 2013 年 3 月 26 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。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 2012 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--------------------|
| 基金简称 | 中海消费股票 |
| 基金主代码 | 398061 |
| 交易代码 | 398061 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2011 年 11 月 9 日 |
| 基金管理人 | 中海基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 52, 587, 450. 20 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|---|
| 投资目标 | 通过投资于消费主题行业及其中的优势上市公司，分享其发展和成长的机会，力争获取超越业绩比较基准的中长期稳定收益。 |
| 投资策略 | <p>本基金是一只采用主题投资方法的股票型基金产品，主要投资于消费主题行业及其中的优势上市公司。</p> <p>1、消费主题行业范畴的界定</p> <p>本基金采用的行业分类基准是万得资讯发布的行业分类标准。本基金拟投资的消费主题行业主要包括工业、可选消费、日常消费和医疗保健等 8 个一级行业和 19 个二级行业。</p> <p>如果万得资讯调整或停止行业分类，或者基金管理人认为有更适当的消费主题行业划分标准，基金管理人可对消费主题行业的界定方法进行调整。</p> <p>2、大类资产配置</p> <p>大类资产配置主要采取自上而下的方式。在资产配置中，本基金主要考虑如下因素： 宏观经济，政策层面，市场估值，市场情绪。</p> <p>本基金将深入分析上述四方面的情况，通过对各种因素的综合分析，增加该阶段下市场表现优于其他资产类别的资产的配置，减少市场表现相对较差的资产类别的配置，以规避或分散市场风险，提高基金经风险调整后的收益。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>本基金 80%以上的股票资产投资于消费主题类股票。本基金对消费主题行业内的个股将采用定量分析与定性分析相结合的方法，选择其中具有优势的上市公司进行投资。</p> <p>(1) 定量分析</p> |

| | |
|--------|--|
| | <p>本基金通过综合考察上市公司的成长优势、财务优势和估值优势来进行个股的筛选。</p> <p>本基金综合考察上市公司的成长指标、财务指标和估值指标，通过归一化等量化处理，对入选的上市公司按照其在每项指标的高低顺序进行打分，得到一个标准化的指标分数。再将指标分数进行等权相加，得到一个总分。按照总分的高低进行排序，选取排名靠前的股票。</p> <p>(2) 定性分析</p> <p>本基金主要通过实地调研等方法，综合考察评估公司的管理水平，并坚决规避那些管理水平差的公司，以确保最大程度地规避投资风险。</p> <p>4、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资以降低组合总体波动性从而改善组合风险构成为目的，在对利率走势和债券发行人基本面进行分析的基础上，采取积极主动的投资策略，投资于国债、金融债、企业债、可转债、央票、短期融资券以及资产证券化产品，在获取较高利息收入的同时兼顾资本利得，谋取超额收益。</p> <p>本基金通过数量分析，在剩余期限、久期、到期收益率基本接近的同类债券之间，确定最优个券。个券选择遵循相对价值原则和流动性原则。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证内地消费指数涨跌幅×80%+中国债券总指数涨跌幅×20% |
| 风险收益特征 | 本基金是一只主动投资的股票型基金，其预期风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，属于较高预期风险、较高预期收益特征的基金品种。 |

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 | | 中海基金管理有限公司 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 王莉 | 李芳菲 |
| | 联系电话 | 021-38429808 | 010-66060069 |
| | 电子邮箱 | wangl@zhfund.com | lifangfei@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-888-9788、 021-38789788 | 95599 |
| 传真 | | 021-68419525 | 010-63201816 |

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 | www.zhfund.com |
|--------------------|----------------|

| | |
|------------|------------------------------------|
| 址 | |
| 基金年度报告备置地点 | 上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层 |

§ 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 11 月 9 日(基金合同生效日)-2011 年 12 月 31 日 | 2010 年 |
|---------------|---------------|---|---------|
| 本期已实现收益 | -467,622.45 | 715,639.72 | - |
| 本期利润 | 6,152,266.72 | 255,632.62 | - |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1076 | 0.0010 | - |
| 本期基金份额净值增长率 | 9.72% | -0.20% | - |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2012 年末 | 2011 年末 | 2010 年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0376 | -0.0021 | - |
| 期末基金资产净值 | 55,435,632.52 | 83,283,852.59 | - |
| 期末基金份额净值 | 1.054 | 0.998 | - |

注 1：以上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，开放式基金的申购、赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

注 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。

3.2 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

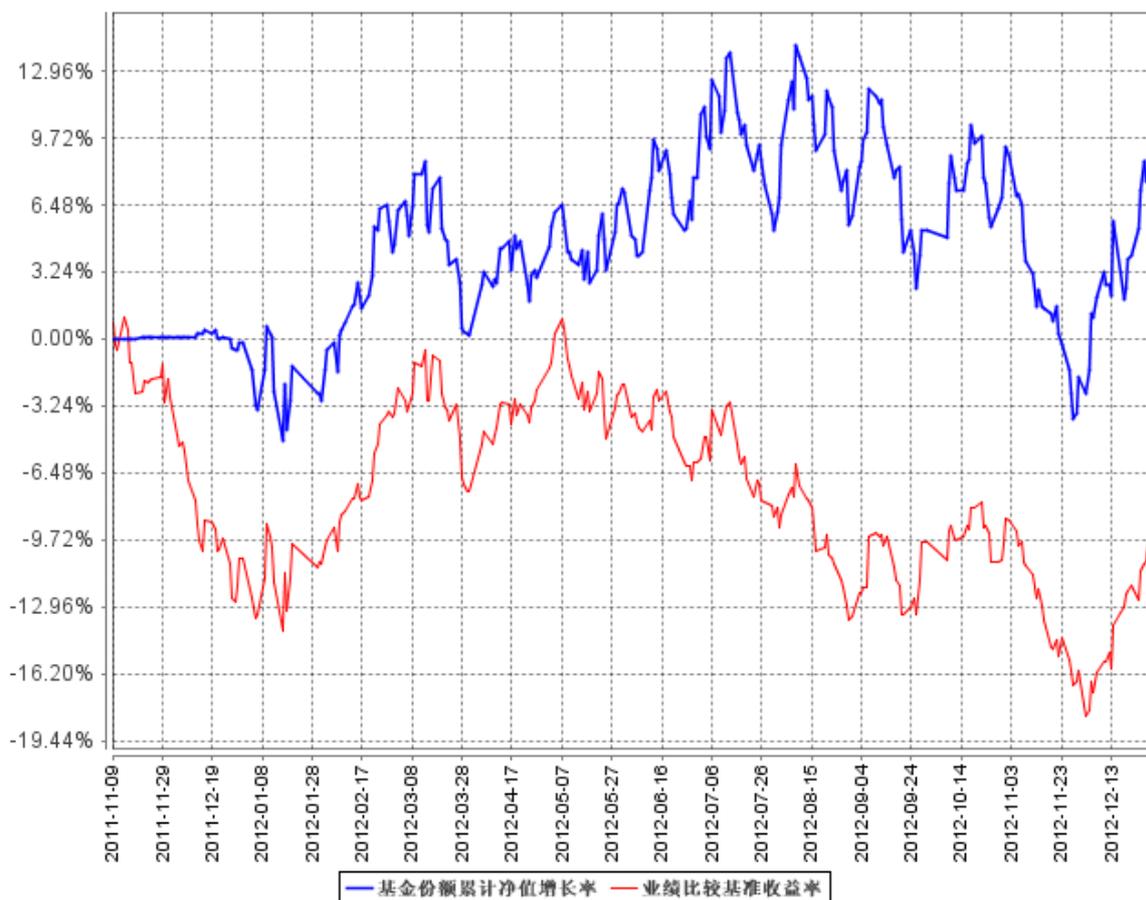
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-----------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 4.05% | 1.20% | 0.59% | 0.92% | 3.46% | 0.28% |
| 过去六个月 | 1.54% | 1.27% | -3.59% | 0.94% | 5.13% | 0.33% |
| 过去一年 | 9.72% | 1.24% | 1.43% | 1.02% | 8.29% | 0.22% |
| 自基金合同生效日起至 今 | 9.51% | 1.15% | -9.32% | 1.01% | 18.83% | 0.14% |

注 1：“自基金合同生效起至今”指 2011 年 11 月 9 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日。

注 2：本基金的业绩比较基准为中证内地消费指数涨跌幅×80%+中国债券总指数涨跌幅×20%，由于本基金为消费主题基金，我们选取市场认同度很高的中证内地消费指数、中国债券总指数作为计算业绩基准指数的基础指数。本基金投资股票的比例为 60%-95%，在一般市场状况下，本基金股票投资比例会控制在 80%左右，债券投资比例控制在 20%左右。我们根据本基金在一般市场状况下的资产配置比例来确定本基金业绩基准指数加权的权重，以使业绩比较更加合理。本基金业绩基准指数每日按照 80%、20%的比例对基础指数进行再平衡，然后得到加权后的业绩基准指数的时间序列。

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

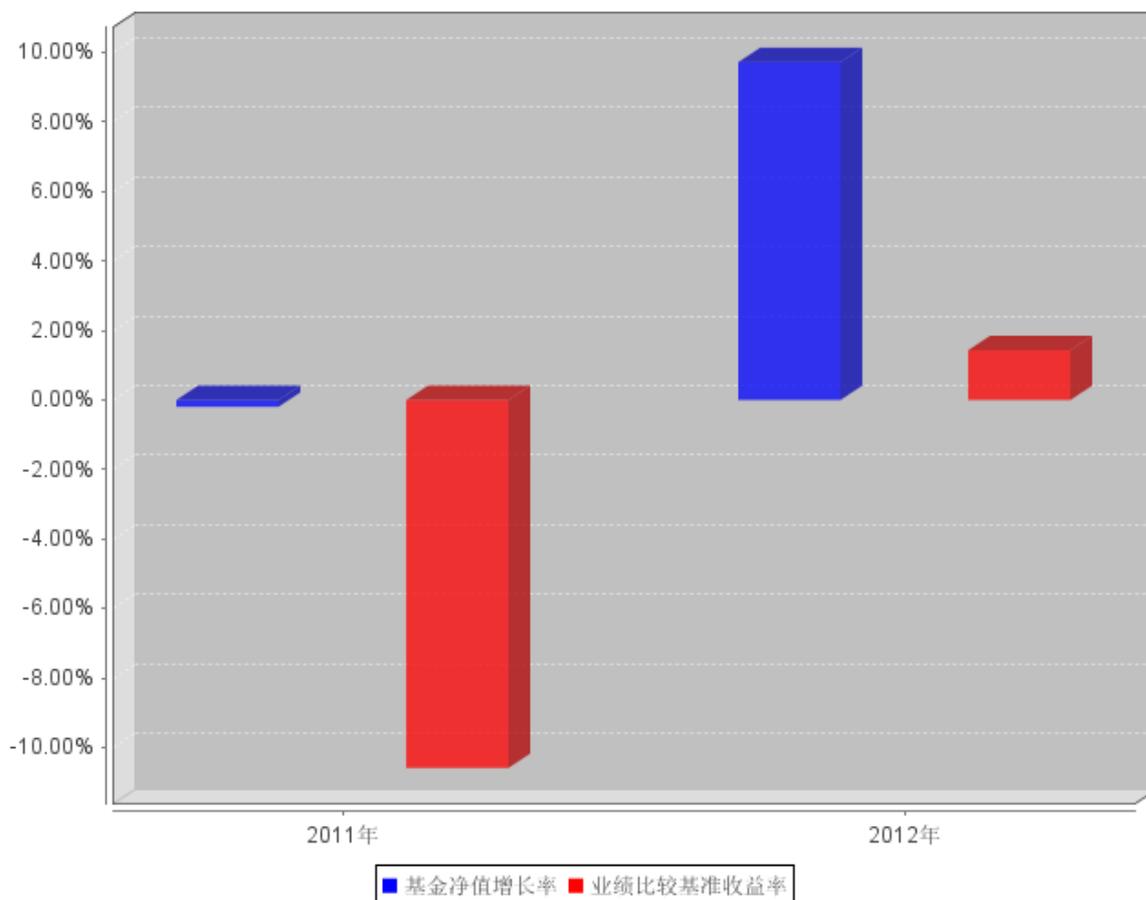
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按相关法规规定，本基金自基金合同 2011 年 11 月 9 日生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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

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对比图



注：上图中 2011 年度是指 2011 年 11 月 9 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日，相关数据未按自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度 | 每10份基金份额 分红数 | 现金形式发放 总额 | 再投资形式发 放总额 | 年度利润分配合 计 | 备注 |
|------|-----------------|--------------|---------------|--------------|----|
| 2012 | 0.4000 | 1,637,665.18 | 123,242.54 | 1,760,907.72 | |
| 2011 | - | - | - | - | |
| 合计 | 0.4000 | 1,637,665.18 | 123,242.54 | 1,760,907.72 | |

注：2011 年是指 2011 年 11 月 9 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日，下同。

§ 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

基金管理人自 2004 年 3 月 18 日成立以来，始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则，严格履行基金管理人的责任和义务，依靠强大的投研团队、规范的业务管理模式、严密科学的风险管理和内部控制体系，为广大基金份额持有人提供规范、专业的资产管理服务。截至 2012 年 12 月 31 日，共管理开放式证券投资基金 13 只。

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 | | |
| 骆泽斌 | 研究总监、本基金基金经理 | 2011 年 11 月 9 日 | - | 13 | 骆泽斌先生，南开大学区域经济学专业博士。历任广发证券股份有限公司研究员、基金筹备组研究负责人，广发基金管理有限公司研究员，天治基金管理有限公司研究总监、投资总监，长信基金管理有限公司研究总监。2010 年 6 月进入本公司工作，现任研究总监。2011 年 11 月至今任中海消费主题精选股票型证券投资基金基金经理。 |

注 1：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

注 2：证券从业的含义遵从行业协会《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合规守信情况的说明

基金管理人在报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、《基金合同》的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为，不存在违法违规或未履行基金合同承诺。

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《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司 2011 年修订了《中海基金公平交易管理办法》，从投研决策内部控制、交易执行内部控制、行为监控和分析评估、监察稽核和信息披露等方面对股票、债券、可转债的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动进行全程公平交易管理。

投研决策内部控制方面：(1) 公司研究平台共享, 基金经理和专户投资经理通过研究平台平等获取研究信息。(2) 公司建立投资组合投资信息的管理及保密制度, 除分管投资副总及投资总监因业务管理的需要外, 不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

交易执行内部控制方面：(1) 对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易, 各投资组合经理根据研究报告独立确定申购价格和数量, 在获配额度确定后, 根据公司制度规定应遵循公平原则对获配额度进行分配, 按照价格优先的原则进行分配, 如果申购价格相同, 则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配, 如有特殊情况, 制度规定需书面留痕。

(2) 投资交易指令统一通过交易室下达, 通过启用公平交易模块, 力求保证时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡交易原则得以落实。(3) 根据公司制度, 通过系统禁止公司组合之间 (除指数被动投资组合外) 的同日反向交易。(4) 债券场外交易, 交易部在银行间市场上公平公正地进行询价, 并由风险管理部对询价收益率偏离、交易对手及交易方式进行事前审核。(5) 在特殊情况下, 投资组合因合规性或应对大额赎回等原因需要进行特定交易时, 由投资组合经理发起暂停投资风控阈值的流程, 在获得相关审批后, 由风险管理部暂时关闭投资风控系统的特定阈值。完成该交易后, 风险管理部立即启动暂停的投资风控阈值。

行为监控和分析评估方面：(1) 公司每季度和每年度对所有投资组合进行同向交易价差分析、反向及异常交易分析。(2) 公司对所有组合在 2012 年全年日内, 3 日, 5 日同向交易数据进行了采集, 并进行两两比对, 对于相关采集样本进行了 95%置信区间, 假设溢价率为 0 的 T 分布检验。

(3) 对于不同时间期间的同组合反向交易及公司制度规定的异常交易, 公司根据交易价格、交易频率、交易数量、交易时机等进行综合分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

2012 年全年, 公司遵循《中海基金公平交易管理办法》相关要求, 整体上贯彻执行制度约定, 加强了对投资组合公平交易的事后分析,

(1) 对于两两组合的同向交易, 我们从日内、3 日、5 日三个时间区间进行假设价差为零, T 分布的检验, 对于未通过假设检验的情况, 公司结合比较两两组合间的交易占优比、采集的样本

数量是否达到一定水平从而具有统计学意义、模拟利益输送金额的绝对值、模拟利益输送金额占组合资产平均净值的比例、模拟利益的贡献率占组合收益率的比例、两两组合的持仓相似度及两两组合收益率差的比较等多方面进行综合比较。

(2) 对于两两组合的反向交易，公司采集同一组合对同一投资品种相邻交易日反向交易、5 日反向交易；两两组合对同一投资品种相邻交易日反向交易、5 日反向交易；并结合市场该投资品种的总成交量进行综合分析。

(3) 对于公司制度规定的异常交易，相关组合经理均根据制度要求提交审批单并书面留痕。

综合而言，本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未发现组合存在有可能导致重大不公平交易和利益输送的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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不存在超过该证券当日成交量的 5% 的情况，对于一级市场证券申购、二级市场证券交易中出现的可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易情况，风险管理部均根据制度规定要求组合经理提供相关情况说明予以留痕。

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

报告期内本基金采取了稳健的投资策略，主要是遵循自下而上的原则进行选股，集中配置了科技、医药、地产、汽车、家电、医药等行业内估值合理，未来业绩增长确定的个股。

尽管如此，对于成长型公司的过度偏好，导致本基金无法根据市场的变化及时有效的调整，暴露了我们在组合管理方面的诸多缺陷，并造成基金净值波动较大。

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 1.054 元(累计净值 1.094 元)。报告期内本基金净值增长率为 9.72%，高于业绩比较基准 8.29 个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

一方面，2012 年 4 季度以来，随着宏观领先指标的持续回升，标志着中国经济已经开启了新的库存周期。从总需求的变化趋势看，经济见底回升的时间不仅已经过去，而且变得更加确定。从国际上看，美国经济将继续维持逐步回暖的趋势。同时，尽管欧洲债务危机的压力仍然存在，但其经济有望在 2013 年的下半年逐渐走出低谷。另一方面，制度环境的持续回暖及新股发行的暂

停有效提振了市场的情绪，缓解了资金供求的压力。因此，无论是基于宏观经济，还是基于制度与流动性分析，2013 年的 A 股市场总体上均面临比较好的市场环境。

尽管如此，风险的约束依然存在。无论是国内经济还是国际经济，周期复苏的力度是有限的，仍将受到通胀预期的约束。更为关键的因素，是新股发行的恢复仍将构成市场上行的压力。从国际上看，美元指数的可能上行将在很大程度上影响包括中国资本市场在内的新兴市场的资本流动，从而有可能逆转新兴市场的运行趋势。

基于上述分析，我们认为，2013 年的 A 股市场短期内可以保持乐观的预期，但是，全年来看，我们仍然显得谨慎，甚至非常悲观，预期市场的趋势性上升仍将需要更为漫长的时间，防御仍将是我们的基本策略。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人严格按照新准则、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。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的估值核算小组，组成人员包括督察长、风险控制总监、监察稽核负责人及基金会计负责人等，成员均具有多年基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。负责估值核算的小组成员中不包括投资总监及基金经理，但对于非活跃投资品种，投资总监及基金经理可以向估值核算小组提供估值建议。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规以及本基金合同的相关规定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 10 次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%；本基金本报告期末可供分配利润为-1,978,842.96 元，报告期内实施利润分配 1 次，实际分配金额为 1,760,907.72 元；本基金在本报告期末无应分配但尚未实施的利润。

§ 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

在托管中海消费主题精选股票型证券投资基金的过程中，本基金托管人—中国农业银行严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《中海消费主题精选股票型证券投资基金基金合同》、《中海消费主题精选股票型证券投资基金托管协议》的约定，对中海消费主题精选股票型证券投资基金管理人中海基金管理有限公司 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，中海基金管理有限公司在中海消费主题精选股票型证券投资基金的投资运作、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，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，中海基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的中海消费主题精选型证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

江苏公证天业会计师事务所有限公司对本基金出具了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：中海消费主题精选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 | | 3,233,552.92 | 9,185,315.32 |
| 结算备付金 | | 87,524.75 | 3,204,545.45 |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | | 52,592,763.30 | 23,095,478.84 |
| 其中：股票投资 | | 52,592,763.30 | 23,095,478.84 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | | - | - |
| 买入返售金融资产 | | - | 40,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | | 2,535,774.20 | 14,698,216.88 |
| 应收利息 | | 687.10 | 12,820.98 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 130,149.55 | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 58,580,451.82 | 90,196,377.47 |
| 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 | | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 764,238.47 | 5,190,181.44 |
| 应付赎回款 | | 2,017,401.17 | 1,357,115.37 |
| 应付管理人报酬 | | 69,833.44 | 254,404.09 |
| 应付托管费 | | 11,638.91 | 42,400.69 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | | 131,105.99 | 20,301.15 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 150,601.32 | 48,122.14 |
| 负债合计 | | 3,144,819.30 | 6,912,524.88 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | | 52,587,450.20 | 83,456,756.17 |
| 未分配利润 | | 2,848,182.32 | -172,903.58 |
| 所有者权益合计 | | 55,435,632.52 | 83,283,852.59 |
| 负债和所有者权益总计 | | 58,580,451.82 | 90,196,377.47 |

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.054 元，基金份额总额 52,587,450.20 份。

本基金基金合同生效日 2011 年 11 月 9 日，下同。

7.2 利润表

会计主体：中海消费主题精选股票型证券投资基金

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 | 附注号 | 本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2011 年 11 月 9 日(基 金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日 |
|----------------------------|-----|---|--|
| 一、收入 | | 8,712,742.43 | 960,958.67 |
| 1. 利息收入 | | 100,809.52 | 1,141,627.59 |
| 其中：存款利息收入 | | 81,296.87 | 395,401.30 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 19,512.65 | 746,226.29 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 1,880,645.75 | -37,758.00 |
| 其中：股票投资收益 | | 1,574,221.38 | -37,758.00 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |
| 股利收益 | | 306,424.37 | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | | 6,619,889.17 | -460,007.10 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | | 111,397.99 | 317,096.18 |
| 减：二、费用 | | 2,560,475.71 | 705,326.05 |
| 1. 管理人报酬 | | 878,902.58 | 544,991.47 |
| 2. 托管费 | | 146,483.74 | 90,831.93 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | | 1,176,495.27 | 25,175.16 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 其他费用 | | 358,594.12 | 44,327.49 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 6,152,266.72 | 255,632.62 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填 | | 6,152,266.72 | 255,632.62 |

| | | | |
|----|--|--|--|
| 列) | | | |
|----|--|--|--|

注：上年度可比期间是指 2011 年 11 月 9 日（基金合同生效日）至 2011 年 12 月 31 日，下同。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中海消费主题精选股票型证券投资基金

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） | 83,456,756.17 | -172,903.58 | 83,283,852.59 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 6,152,266.72 | 6,152,266.72 |
| 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） | -30,869,305.97 | -1,370,273.10 | -32,239,579.07 |
| 其中：1. 基金申购款 | 56,246,650.43 | 1,007,292.08 | 57,253,942.51 |
| 2. 基金赎回款 | -87,115,956.40 | -2,377,565.18 | -89,493,521.58 |
| 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） | - | -1,760,907.72 | -1,760,907.72 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 52,587,450.20 | 2,848,182.32 | 55,435,632.52 |
| 项目 | 上年度可比期间 2011 年 11 月 9 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） | 336,549,461.88 | - | 336,549,461.88 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 255,632.62 | 255,632.62 |
| 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） | -253,092,705.71 | -428,536.20 | -253,521,241.91 |
| 其中：1. 基金申购款 | 153,862.46 | 411.64 | 154,274.10 |

| | | | |
|--|-----------------|-------------|-----------------|
| 2. 基金赎回款 | -253,246,568.17 | -428,947.84 | -253,675,516.01 |
| 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） | 83,456,756.17 | -172,903.58 | 83,283,852.59 |

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：

| | | |
|-----------|-----------|-----------|
| <u>黄鹏</u> | <u>宋宇</u> | <u>曹伟</u> |
| 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 基金基本情况

中海消费主题精选股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）由中海基金管理有限公司依照《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》及有关法规规定，经中国证券监督管理委员会证监许可【2011】1112 号《关于核准中海消费主题精选股票型证券投资基金募集的批复》核准募集。

本基金为契约型开放式，存续期限不定，基金管理人为中海基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司；有关基金募集文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案；基金合同于 2011 年 11 月 9 日生效，该日的基金份额总额为 336,549,461.88 份。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和中国证监会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的相关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金在本报告期内的会计报表遵循了企业会计准则及其他有关规定。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本报告期为 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

7.4.4.3.1 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

7.4.4.3.2 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

7.4.4.4.1 金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

7.4.4.4.2 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，

应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

7.4.4.4.3 当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.4.4 本基金金融工具的成本计价方法具体如下：

7.4.4.4.4.1 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价，于股权分置改革方案实施后的股票复牌日，冲减股票投资成本；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

7.4.4.4.4.2 债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入未上市债券和银行间同业市场交易的债券，于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按实际成交价款入账，应支付的相关交易费用直接计入当期损益。其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限计算应收利息，并按上述会计处理方法核算；

卖出证券交易所交易和银行间同业市场交易的债券均于成交日确认债券投资收益；

卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

7.4.4.4.4.3 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

配股权证及由股权分置改革而被动获得的权证，在确认日记录所获分配的权证数量，该等权证初始成本为零；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

7.4.4.4.4.4 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付

的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述 7.4.4.4.2 和 7.4.4.4.3 中的相关方法进行计算。

7.4.4.4.5 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购）以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

本基金以上述原则确定的公允价值进行估值，本基金主要金融工具的估值方法如下：

7.4.4.5.1 上市证券的估值

7.4.4.5.1.1 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

7.4.4.5.1.2 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

7.4.4.5.1.3 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债

券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

7.4.4.5.1.4 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

7.4.4.5.2 未上市证券的估值

7.4.4.5.2.1 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值，即依照上述 7.4.4.5.1.1 和 7.4.4.5.1.4 的相关方法进行估值；

7.4.4.5.2.2 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

7.4.4.5.2.3 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值，即依照上述 7.4.4.5.1.1 和 7.4.4.5.1.4 的相关方法进行估值；

7.4.4.5.2.4 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，应采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，应按中国证监会相关规定处理；

7.4.4.5.3 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

7.4.4.5.4 全国银行间债券市场交易的债券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

7.4.4.5.5 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 7.4.4.5.1 中的相关方法进行估值；

7.4.4.5.6 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值；

7.4.4.5.7 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

7.4.4.5.8 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

基金管理人的管理人报酬根据《中海消费主题精选股票型证券投资基金基金合同》的规定按基金资产净值的 1.5%的年费率逐日计提。

基金托管人的托管费根据《中海消费主题精选股票型证券投资基金基金合同》的规定按基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 10 次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

每一基金份额享有同等分配权；

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期没有发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期没有发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内不存在重大会计差错。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税字 [2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的

通知》、财税字 [2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11 号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2007]84 号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

7.4.6.1

以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

7.4.6.2

基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

7.4.6.3

对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

7.4.6.4

基金买卖股票于 2008 年 4 月 24 日之前按照 0.3%的税率缴纳股票交易印花税,自 2008 年 4 月 24 日起至 2008 年 9 月 18 日止按 0.1%的税率缴纳。自 2008 年 9 月 19 日起基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.6.5

基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|-------------------------------|---------------|
| 中海基金管理有限公司 (“中海基金”) | 基金管理人、直销机构 |
| 农业银行 | 基金托管人、代销机构 |
| 中海信托股份有限公司 (“中海信托”) | 基金管理人的股东 |
| 国联证券股份有限公司 (“国联证券”) | 基金管理人的股东、代销机构 |
| 法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司 (“法国洛希尔银行”) | 基金管理人的股东 |
| 华英证券有限责任公司 | 基金管理人股东的控股子公司 |
| 中海石油财务有限责任公司 | 基金管理人的关联方 |

注:华英证券有限责任公司为基金管理人股东国联证券的控股子公司。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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11月9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 |
| 国联证券 | 148,489,189.67 | 18.97% | 8,973,189.82 | 36.77% |

债券交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

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11月9日(基金合同生效日)至2011年 12月31日 | |
|-------|-----------------------------|----------------------------|--|----------------------------|
| | 回购成交金额 | 占当期债券 回购 成交总额的 比例 | 回购成交金额 | 占当期债券 回购 成交总额的比 例 |
| 国联证券 | 87,000,000.00 | 89.69% | 1,716,000,000.00 | 100.00% |

7.4.8.1.2 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 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 |
| 国联证券 | 127,972.65 | 19.15% | 8,086.38 | 6.17% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2011年11月9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 |
|------|----------|----------------|----------|------------------|
| 国联证券 | 7,627.11 | 37.83% | 7,627.11 | 37.83% |

注：上述佣金按市场佣金率计算，已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

沪市实际交易佣金=股票成交金额×【0.1%】—股票交易经手费—股票交易证管费—证券结算风险基金

深市实际交易佣金=股票成交金额×【0.1%】—股票交易经手费—股票交易证管费—证券结算风险基金

国联证券符合我司选择证券经营机构、使用其席位作为基金专用交易席位的标准，与其签订的席位租用合同是在正常业务中按照一般商业条款订立的。其为本基金提供证券投资研究成果和 market 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11月9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 | 878,902.58 | 544,991.47 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 250,520.94 | 251,812.78 |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提，计算方法如下：

$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$ （H 为每日应支付的基金管理费，E 为前一日的基金资产净值）

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。

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 月31日 | 上年度可比期间 2011年11月9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托管费 | 146,483.74 | 90,831.93 |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。

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

注：本基金在本报告期及上年度可比期间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

注：本报告期及上年度可比期间基金管理人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

注：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 | | 上年度可比期间 | |
|--------|----------------------------------|-----------|--|-----------|
| | 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日 | | 2011 年 11 月 9 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 |
| 中国农业银行 | 3,233,552.92 | 68,181.36 | 9,185,315.32 | 53,441.36 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，并按银行间同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

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

注：本基金在本报告期末没有因认购新发/增发而持有流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金在本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额，因此无抵押债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额，因此无抵押债券

§ 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 | 52,592,763.30 | 89.78 |
| | 其中：股票 | 52,592,763.30 | 89.78 |
| 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 | 3,321,077.67 | 5.67 |
| 6 | 其他各项资产 | 2,666,610.85 | 4.55 |
| 7 | 合计 | 58,580,451.82 | 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 | 1,124,484.37 | 2.03 |
| B | 采掘业 | 1,201,827.00 | 2.17 |
| C | 制造业 | 31,663,445.54 | 57.12 |
| C0 | 食品、饮料 | - | - |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | - | - |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 1,230,184.00 | 2.22 |
| C5 | 电子 | 12,760,577.66 | 23.02 |
| C6 | 金属、非金属 | 2,974,645.46 | 5.37 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 9,065,035.33 | 16.35 |
| C8 | 医药、生物制品 | 5,633,003.09 | 10.16 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 582,283.00 | 1.05 |

| | | | |
|---|----------|---------------|-------|
| E | 建筑业 | 4,013,543.00 | 7.24 |
| F | 交通运输、仓储业 | - | - |
| G | 信息技术业 | 4,194,805.89 | 7.57 |
| H | 批发和零售贸易 | 1,321,788.00 | 2.38 |
| I | 金融、保险业 | 547,281.00 | 0.99 |
| J | 房地产业 | 5,140,881.50 | 9.27 |
| K | 社会服务业 | 2,802,424.00 | 5.06 |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 52,592,763.30 | 94.87 |

8.3 期末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 | 002236 | 大华股份 | 85,684 | 3,971,453.40 | 7.16 |
| 2 | 300270 | 中威电子 | 91,070 | 3,185,628.60 | 5.75 |
| 3 | 601886 | 江河幕墙 | 145,085 | 3,162,853.00 | 5.71 |
| 4 | 002415 | 海康威视 | 99,889 | 3,107,546.79 | 5.61 |
| 5 | 601117 | 中国化学 | 340,100 | 2,802,424.00 | 5.06 |
| 6 | 002241 | 歌尔声学 | 63,056 | 2,377,211.20 | 4.29 |
| 7 | 600587 | 新华医疗 | 70,100 | 2,180,811.00 | 3.93 |
| 8 | 000656 | 金科股份 | 125,800 | 1,824,100.00 | 3.29 |
| 9 | 600418 | 江淮汽车 | 215,100 | 1,469,133.00 | 2.65 |
| 10 | 000423 | 东阿阿胶 | 36,265 | 1,465,468.65 | 2.64 |

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。

8.4 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 | 600837 | 海通证券 | 6,268,028.00 | 7.53 |
| 2 | 000725 | 京东方 A | 6,081,917.00 | 7.30 |
| 3 | 600383 | 金地集团 | 5,619,824.00 | 6.75 |
| 4 | 300136 | 信维通信 | 5,595,110.23 | 6.72 |

| | | | | |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 5 | 600518 | 康美药业 | 5,120,253.88 | 6.15 |
| 6 | 002241 | 歌尔声学 | 5,104,231.70 | 6.13 |
| 7 | 600519 | 贵州茅台 | 5,048,125.75 | 6.06 |
| 8 | 002415 | 海康威视 | 4,209,069.75 | 5.05 |
| 9 | 600157 | 永泰能源 | 4,010,422.73 | 4.82 |
| 10 | 002236 | 大华股份 | 3,948,009.40 | 4.74 |
| 11 | 600332 | 广州药业 | 3,936,181.64 | 4.73 |
| 12 | 600048 | 保利地产 | 3,824,837.50 | 4.59 |
| 13 | 002477 | 雏鹰农牧 | 3,738,279.91 | 4.49 |
| 14 | 300270 | 中威电子 | 3,721,011.45 | 4.47 |
| 15 | 300115 | 长盈精密 | 3,718,272.18 | 4.46 |
| 16 | 600976 | 武汉健民 | 3,681,619.87 | 4.42 |
| 17 | 601668 | 中国建筑 | 3,667,671.00 | 4.40 |
| 18 | 000568 | 泸州老窖 | 3,545,364.41 | 4.26 |
| 19 | 300090 | 盛运股份 | 3,448,037.93 | 4.14 |
| 20 | 300039 | 上海凯宝 | 3,358,210.10 | 4.03 |
| 21 | 600340 | 华夏幸福 | 3,216,136.00 | 3.86 |
| 22 | 000049 | 德赛电池 | 3,206,798.65 | 3.85 |
| 23 | 002138 | 顺络电子 | 3,117,555.73 | 3.74 |
| 24 | 601886 | 江河幕墙 | 3,075,571.36 | 3.69 |
| 25 | 000661 | 长春高新 | 2,873,421.50 | 3.45 |
| 26 | 300104 | 乐视网 | 2,747,689.80 | 3.30 |
| 27 | 300267 | 尔康制药 | 2,737,848.95 | 3.29 |
| 28 | 002405 | 四维图新 | 2,708,603.46 | 3.25 |
| 29 | 300027 | 华谊兄弟 | 2,694,272.56 | 3.24 |
| 30 | 000069 | 华侨城 A | 2,668,715.00 | 3.20 |
| 31 | 600895 | 张江高科 | 2,667,390.12 | 3.20 |
| 32 | 002273 | 水晶光电 | 2,579,525.30 | 3.10 |
| 33 | 002475 | 立讯精密 | 2,539,760.23 | 3.05 |
| 34 | 002179 | 中航光电 | 2,519,959.17 | 3.03 |
| 35 | 002230 | 科大讯飞 | 2,510,754.52 | 3.01 |
| 36 | 600036 | 招商银行 | 2,508,986.00 | 3.01 |
| 37 | 601928 | 凤凰传媒 | 2,505,297.60 | 3.01 |
| 38 | 600266 | 北京城建 | 2,504,589.94 | 3.01 |
| 39 | 000679 | 大连友谊 | 2,498,191.10 | 3.00 |
| 40 | 002262 | 恩华药业 | 2,464,415.76 | 2.96 |

| | | | | |
|----|--------|--------|--------------|------|
| 41 | 600673 | 东阳光铝 | 2,447,276.89 | 2.94 |
| 42 | 002106 | 莱宝高科 | 2,442,614.22 | 2.93 |
| 43 | 300110 | 华仁药业 | 2,407,414.28 | 2.89 |
| 44 | 601117 | 中国化学 | 2,401,282.66 | 2.88 |
| 45 | 002638 | 勤上光电 | 2,381,704.00 | 2.86 |
| 46 | 601336 | 新华保险 | 2,353,013.80 | 2.83 |
| 47 | 000100 | TCL 集团 | 2,348,920.00 | 2.82 |
| 48 | 600322 | 天房发展 | 2,345,888.00 | 2.82 |
| 49 | 300017 | 网宿科技 | 2,307,372.53 | 2.77 |
| 50 | 002124 | 天邦股份 | 2,292,614.07 | 2.75 |
| 51 | 000590 | 紫光古汉 | 2,257,838.92 | 2.71 |
| 52 | 300298 | 三诺生物 | 2,254,927.20 | 2.71 |
| 53 | 000800 | 一汽轿车 | 2,228,779.01 | 2.68 |
| 54 | 600059 | 古越龙山 | 2,225,752.13 | 2.67 |
| 55 | 600809 | 山西汾酒 | 2,225,345.70 | 2.67 |
| 56 | 600587 | 新华医疗 | 2,172,474.48 | 2.61 |
| 57 | 600197 | 伊力特 | 2,163,666.02 | 2.60 |
| 58 | 600237 | 铜峰电子 | 2,110,544.00 | 2.53 |
| 59 | 600880 | 博瑞传播 | 2,072,158.08 | 2.49 |
| 60 | 600585 | 海螺水泥 | 2,071,601.00 | 2.49 |
| 61 | 601699 | 潞安环能 | 2,059,666.71 | 2.47 |
| 62 | 002025 | 航天电器 | 2,051,191.00 | 2.46 |
| 63 | 002146 | 荣盛发展 | 2,040,337.86 | 2.45 |
| 64 | 601788 | 光大证券 | 2,037,861.26 | 2.45 |
| 65 | 600690 | 青岛海尔 | 2,014,879.29 | 2.42 |
| 66 | 000961 | 中南建设 | 1,997,581.82 | 2.40 |
| 67 | 300146 | 汤臣倍健 | 1,997,168.06 | 2.40 |
| 68 | 600893 | 航空动力 | 1,995,872.74 | 2.40 |
| 69 | 000809 | 铁岭新城 | 1,990,616.41 | 2.39 |
| 70 | 600393 | 东华实业 | 1,981,934.00 | 2.38 |
| 71 | 000776 | 广发证券 | 1,949,065.00 | 2.34 |
| 72 | 000002 | 万 科 A | 1,947,768.00 | 2.34 |
| 73 | 600067 | 冠城大通 | 1,938,103.63 | 2.33 |
| 74 | 002375 | 亚厦股份 | 1,933,341.63 | 2.32 |
| 75 | 000656 | 金科股份 | 1,887,977.21 | 2.27 |
| 76 | 000630 | 铜陵有色 | 1,882,271.00 | 2.26 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 77 | 600108 | 亚盛集团 | 1,870,088.83 | 2.25 |
| 78 | 600888 | 新疆众和 | 1,818,088.00 | 2.18 |
| 79 | 000536 | 华映科技 | 1,813,319.73 | 2.18 |
| 80 | 601939 | 建设银行 | 1,746,525.00 | 2.10 |
| 81 | 000858 | 五粮液 | 1,738,853.07 | 2.09 |
| 82 | 600702 | 沱牌舍得 | 1,731,310.77 | 2.08 |
| 83 | 600276 | 恒瑞医药 | 1,719,050.00 | 2.06 |
| 84 | 600030 | 中信证券 | 1,699,358.00 | 2.04 |
| 85 | 600594 | 益佰制药 | 1,685,546.96 | 2.02 |
| 86 | 600373 | 中文传媒 | 1,679,182.00 | 2.02 |
| 87 | 000960 | 锡业股份 | 1,673,202.39 | 2.01 |
| 88 | 300207 | 欣旺达 | 1,670,574.52 | 2.01 |

注：本报告期内，买入股票成本总额是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，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 | 600837 | 海通证券 | 6,538,323.99 | 7.85 |
| 2 | 600383 | 金地集团 | 6,433,772.64 | 7.73 |
| 3 | 000725 | 京东方A | 6,427,110.27 | 7.72 |
| 4 | 300136 | 信维通信 | 5,681,623.31 | 6.82 |
| 5 | 600519 | 贵州茅台 | 5,160,805.78 | 6.20 |
| 6 | 600518 | 康美药业 | 4,956,966.75 | 5.95 |
| 7 | 601336 | 新华保险 | 4,525,775.86 | 5.43 |
| 8 | 600157 | 永泰能源 | 4,358,616.59 | 5.23 |
| 9 | 600976 | 武汉健民 | 4,174,508.15 | 5.01 |
| 10 | 002477 | 雏鹰农牧 | 4,154,081.16 | 4.99 |
| 11 | 002241 | 歌尔声学 | 4,113,447.17 | 4.94 |
| 12 | 300090 | 盛运股份 | 4,019,530.44 | 4.83 |
| 13 | 600048 | 保利地产 | 3,841,536.33 | 4.61 |
| 14 | 601668 | 中国建筑 | 3,657,585.45 | 4.39 |
| 15 | 000002 | 万科A | 3,597,790.46 | 4.32 |
| 16 | 000568 | 泸州老窖 | 3,564,849.25 | 4.28 |
| 17 | 000661 | 长春高新 | 3,548,351.69 | 4.26 |
| 18 | 600332 | 广州药业 | 3,268,084.72 | 3.92 |

| | | | | |
|----|--------|--------|--------------|------|
| 19 | 002415 | 海康威视 | 3,167,681.36 | 3.80 |
| 20 | 002138 | 顺络电子 | 3,082,884.37 | 3.70 |
| 21 | 600340 | 华夏幸福 | 3,082,701.50 | 3.70 |
| 22 | 300115 | 长盈精密 | 3,023,034.78 | 3.63 |
| 23 | 300104 | 乐视网 | 2,995,217.25 | 3.60 |
| 24 | 300027 | 华谊兄弟 | 2,868,600.74 | 3.44 |
| 25 | 600895 | 张江高科 | 2,844,892.89 | 3.42 |
| 26 | 300267 | 尔康制药 | 2,652,531.65 | 3.18 |
| 27 | 600673 | 东阳光铝 | 2,626,935.27 | 3.15 |
| 28 | 000069 | 华侨城 A | 2,600,114.34 | 3.12 |
| 29 | 600266 | 北京城建 | 2,586,146.75 | 3.11 |
| 30 | 000679 | 大连友谊 | 2,579,554.49 | 3.10 |
| 31 | 000927 | 一汽夏利 | 2,578,268.30 | 3.10 |
| 32 | 000527 | 美的电器 | 2,577,027.20 | 3.09 |
| 33 | 002179 | 中航光电 | 2,566,109.68 | 3.08 |
| 34 | 600809 | 山西汾酒 | 2,546,022.09 | 3.06 |
| 35 | 300298 | 三诺生物 | 2,513,326.18 | 3.02 |
| 36 | 300017 | 网宿科技 | 2,493,115.03 | 2.99 |
| 37 | 600036 | 招商银行 | 2,485,442.98 | 2.98 |
| 38 | 000590 | 紫光古汉 | 2,472,436.07 | 2.97 |
| 39 | 002405 | 四维图新 | 2,450,602.79 | 2.94 |
| 40 | 002475 | 立讯精密 | 2,449,849.18 | 2.94 |
| 41 | 002638 | 勤上光电 | 2,441,087.46 | 2.93 |
| 42 | 300039 | 上海凯宝 | 2,440,504.18 | 2.93 |
| 43 | 600322 | 天房发展 | 2,431,780.00 | 2.92 |
| 44 | 002262 | 恩华药业 | 2,407,859.31 | 2.89 |
| 45 | 000100 | TCL 集团 | 2,401,454.00 | 2.88 |
| 46 | 000800 | 一汽轿车 | 2,389,908.43 | 2.87 |
| 47 | 002146 | 荣盛发展 | 2,371,539.14 | 2.85 |
| 48 | 601928 | 凤凰传媒 | 2,357,875.12 | 2.83 |
| 49 | 002230 | 科大讯飞 | 2,356,357.68 | 2.83 |
| 50 | 000961 | 中南建设 | 2,321,214.62 | 2.79 |
| 51 | 600521 | 华海药业 | 2,301,198.48 | 2.76 |
| 52 | 002236 | 大华股份 | 2,228,972.79 | 2.68 |
| 53 | 600067 | 冠城大通 | 2,170,668.55 | 2.61 |
| 54 | 601628 | 中国人寿 | 2,165,536.26 | 2.60 |
| 55 | 002106 | 莱宝高科 | 2,147,460.00 | 2.58 |
| 56 | 600893 | 航空动力 | 2,142,405.46 | 2.57 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 57 | 300146 | 汤臣倍健 | 2,121,718.87 | 2.55 |
| 58 | 002124 | 天邦股份 | 2,075,970.35 | 2.49 |
| 59 | 002375 | 亚厦股份 | 2,063,222.00 | 2.48 |
| 60 | 300048 | 合康变频 | 2,063,078.92 | 2.48 |
| 61 | 600880 | 博瑞传播 | 2,053,957.30 | 2.47 |
| 62 | 600393 | 东华实业 | 2,012,782.73 | 2.42 |
| 63 | 601788 | 光大证券 | 2,004,978.11 | 2.41 |
| 64 | 600059 | 古越龙山 | 1,982,038.96 | 2.38 |
| 65 | 000776 | 广发证券 | 1,945,276.05 | 2.34 |
| 66 | 600585 | 海螺水泥 | 1,939,443.91 | 2.33 |
| 67 | 600197 | 伊力特 | 1,925,825.75 | 2.31 |
| 68 | 601699 | 潞安环能 | 1,917,013.91 | 2.30 |
| 69 | 002025 | 航天电器 | 1,884,904.26 | 2.26 |
| 70 | 600309 | 烟台万华 | 1,829,035.89 | 2.20 |
| 71 | 000630 | 铜陵有色 | 1,826,036.46 | 2.19 |
| 72 | 601939 | 建设银行 | 1,792,756.96 | 2.15 |
| 73 | 002055 | 得润电子 | 1,788,882.65 | 2.15 |
| 74 | 002024 | 苏宁电器 | 1,784,399.28 | 2.14 |
| 75 | 000536 | 华映科技 | 1,780,126.56 | 2.14 |
| 76 | 000809 | 铁岭新城 | 1,772,557.40 | 2.13 |
| 77 | 600276 | 恒瑞医药 | 1,771,791.91 | 2.13 |
| 78 | 300110 | 华仁药业 | 1,754,571.69 | 2.11 |
| 79 | 600888 | 新疆众和 | 1,748,607.00 | 2.10 |
| 80 | 300015 | 爱尔眼科 | 1,737,334.86 | 2.09 |
| 81 | 000049 | 德赛电池 | 1,730,536.46 | 2.08 |
| 82 | 000960 | 锡业股份 | 1,729,729.28 | 2.08 |
| 83 | 601998 | 中信银行 | 1,726,507.60 | 2.07 |
| 84 | 600030 | 中信证券 | 1,712,637.69 | 2.06 |
| 85 | 601633 | 长城汽车 | 1,682,413.00 | 2.02 |
| 86 | 300101 | 国腾电子 | 1,681,246.48 | 2.02 |
| 87 | 000651 | 格力电器 | 1,676,235.49 | 2.01 |
| 88 | 600594 | 益佰制药 | 1,666,087.65 | 2.00 |

注：本报告期内，卖出股票收入总额以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，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 | 402,135,532.57 |
|--------------|----------------|

| | |
|--------------|----------------|
| 卖出股票收入（成交）总额 | 380,832,358.66 |
|--------------|----------------|

注：本报告期内，买入股票成本总额和卖出股票收入总额都是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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

注：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

注：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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.9.3 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 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,535,774.20 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 687.10 |
| 5 | 应收申购款 | 130,149.55 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,666,610.85 |

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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 |
| 1,941 | 27,092.97 | 33,155,867.51 | 63.05% | 19,431,582.69 | 36.95% |

9.2 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 | 16,115.35 | 0.0306% |

注：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11月9日）基金份额总额 | 336,549,461.88 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 83,456,756.17 |
| 本报告期基金总申购份额 | 56,246,650.43 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 87,115,956.40 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 52,587,450.20 |

注：报告期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本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

本报告期内，本基金管理人免去李延刚先生副总经理职务；聘请俞忠华先生担任副总经理职务。

本报告期内，托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请江苏公证天业会计师事务所有限公司提供审计服务，本报告期内已预提审计费 43,000.00 元，截至 2012 年 12 月 31 日暂未支付；本基金成立以来一直由该会计师事务所提供审计服务。

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

本报告期内本基金管理人、托管机构及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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 | |
| 光大证券 | 1 | 193,839,874.11 | 24.76% | 158,793.36 | 23.77% | - |
| 国联证券 | 1 | 148,489,189.67 | 18.97% | 127,972.65 | 19.15% | - |
| 民生证券 | 2 | 142,866,907.24 | 18.25% | 126,337.10 | 18.91% | - |

| | | | | | | |
|--------|---|---------------|-------|-----------|-------|---|
| 国金证券 | 1 | 56,952,679.16 | 7.27% | 49,617.56 | 7.43% | - |
| 银河证券 | 2 | 43,599,479.58 | 5.57% | 37,086.59 | 5.55% | - |
| 中信证券 | 2 | 38,616,945.42 | 4.93% | 31,976.27 | 4.79% | - |
| 海通证券 | 1 | 37,162,871.82 | 4.75% | 31,064.31 | 4.65% | - |
| 兴业证券 | 1 | 35,259,023.47 | 4.50% | 29,970.36 | 4.49% | - |
| 华宝证券 | 1 | 25,343,809.18 | 3.24% | 22,426.57 | 3.36% | - |
| 安信证券 | 1 | 24,752,898.91 | 3.16% | 21,039.81 | 3.15% | - |
| 招商证券 | 1 | 15,539,568.14 | 1.98% | 13,750.92 | 2.06% | - |
| 中信建投 | 1 | 10,881,261.85 | 1.39% | 9,894.87 | 1.48% | - |
| 平安证券 | 1 | 5,804,708.94 | 0.74% | 4,716.32 | 0.71% | - |
| 长江证券 | 1 | 2,754,853.18 | 0.35% | 2,508.18 | 0.38% | - |
| 国信证券 | 1 | 1,082,096.00 | 0.14% | 957.56 | 0.14% | - |
| 国泰君安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 齐鲁证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 宏源证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中航证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 红塔证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注 1：本基金以券商研究服务质量作为交易单元的选择标准，具体评分指标分为研究支持和服务支持，研究支持包括券商研究报告质量、投资建议、委托课题、业务培训、数据提供等；服务支持包括券商组织上门路演，联合调研和各类投资研讨会。根据我公司及基金法律文件中对券商交易单元的选择标准，并参照我公司券商研究服务质量评分标准，确定拟租用交易单元的所属券商名单；由我公司相关部门分别与券商对应部门进行商务谈判，草拟证券交易单元租用协议并汇总修改意见完成协议初稿；报监察稽核部审核后确定租用交易单元。

注 2：本报告期内租用了红塔证券、民生证券、中信建投的上海交易单元和民生证券的深圳交易单元，退租了银河证券、金元证券、渤海证券的上海交易单元。

注 3：上述佣金按市场佣金率计算，已扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示

注 4：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

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 | | 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 |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | - | - | 87,000,000.00 | 89.69% | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | 10,000,000.00 | 10.31% | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华宝证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 齐鲁证券 | - | - | - | - | - | - |
| 宏源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中航证券 | - | - | - | - | - | - |
| 红塔证券 | - | - | - | - | - | - |

中海基金管理有限公司
2013 年 3 月 30 日