

富国天源平衡混合型证券投资基金

二〇一三年年度报告

(摘要)

2013年12月31日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2014年03月29日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、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根据本基金合同规定，于 2014 年 3 月 27 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。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、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 2013 年 1 月 1 日起至 2013 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	富国天源平衡混合
基金主代码	100016
交易代码	前端交易代码：100016 后端交易代码：100017
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年08月16日
基金管理人	富国基金管理有限公司
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	996,084,203.64份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	尽可能减少和分散投资风险，力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长。本基金为平衡型证券投资基金，将基金资产按比例投资于股票和债券，在股票投资中主要投资于成长型股票和价值型股票，并对基金的投资组合进行主动的管理，从而使投资者在承受相对较小风险的情况下，尽可能获得稳定的投资收益。
投资策略	采取自上而下主动性管理策略，资产配置突出两个层面的平衡，一、资产配置的平衡，通过主动调整基金资产中股票和债券的投资比例，以求基金资产在股票市场和债券市场的投资中达到风险和收益的最佳平衡；二、持股结构的平衡，即通过调整股票资产中成长型股票和价值型股票的投资比例实现持股结构的平衡。在投资于良好成长性上市公司的同时，兼顾收益稳定的价值型上市公司。
业绩比较基准	本基金采用“证券市场平均收益率”作为衡量本基金操作水平的比较基准。 证券市场平均收益率=中信标普300指数收益率×65%+中信国债指数收益率×30%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金为平衡型证券投资基金，属于证券投资基金中的中低风险品种，其长期平均的风险和预期收益低于积极成长型基金，高于债券和货币市场基金。

### 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	富国基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	范伟隽
	联系电话	021-20361818
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn
		李芳菲
		010-66060069
		lifangfei@abchina.com

客户服务电话	95105686、4008880688	95599
传真	021-20361616	010-63201816

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的 管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道8号 上海国金中心二期16-17层 中国农业银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9

## §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	2013年	2012年	2011年
本期已实现收益	148,397,076.97	-70,611,731.26	-115,534,553.93
本期利润	167,515,903.30	36,098,610.83	-252,338,668.25
加权平均基金份额本期利润	0.1766	0.0384	-0.2088
本期基金份额净值增长率	20.17%	4.37%	-15.56%
3.1.2 期末数据和指标	2013年12月31日	2012年12月31日	2011年12月31日
期末可供分配基金份额利润	0.1030	-0.0821	-0.1205
期末基金资产净值	1,098,683,446.98	828,615,181.46	872,540,456.67
期末基金份额净值	1.1030	0.9179	0.8795

注：上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、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。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	0.91%	0.87%	-2.38%	0.74%	3.29%	0.13%
过去六个月	13.11%	0.92%	4.57%	0.83%	8.54%	0.09%
过去一年	20.17%	0.99%	-2.77%	0.89%	22.94%	0.10%
过去三年	5.90%	0.93%	-13.31%	0.85%	19.21%	0.08%
过去五年	87.14%	1.05%	27.82%	0.99%	59.32%	0.06%
自基金合同生效日起至今	216.24%	1.08%	75.03%	1.12%	141.21%	-0.04%

注：根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定，本基金的业绩比较基准= 中信标普 300 指数×65%+中信国债指数×30%+同业存款利率×5%。本基金股票投资部分的业绩比较基准采用中信标普 300 指数，债券投资部分的业绩比较基准采用中信标普国债指数。中信标普 300 指数和中信标普国债指数具有较强的代表性。中信标普 300 指数由深沪两市具有行业代表性的公司构成，样本股经过流动性和财务稳定性的审慎检查，能较全面地描述中国 A 股市场的总体趋势，是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。中信标普国债指数反映了交易所国债整体走势，是目前市场上较有影响力的债券投资业绩比较基准。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，1 日收益率（benchmarkt）按下列公式计算：

$$\text{benchmarkt} = 65\% * [\text{中信标普 300 指数 } t / (\text{中信标普 300 指数 } t-1) - 1] + 30\% * [\text{中信国债指数 } t / (\text{中信国债指数 } t-1) - 1] + 5\% * \text{同业存款利率} / 360 ;$$

其中，t=1, 2, 3, ..., T, T 表示时间截至日；

期间 T 日收益率（benchmarkT）按下列公式计算：

$$\text{benchmarkT} = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmarkt})] - 1$$

其中，T=2, 3, 4, ...； $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmarkt})$  表示 t 日至 T 日的  $(1 + \text{benchmarkt})$  数学连乘。

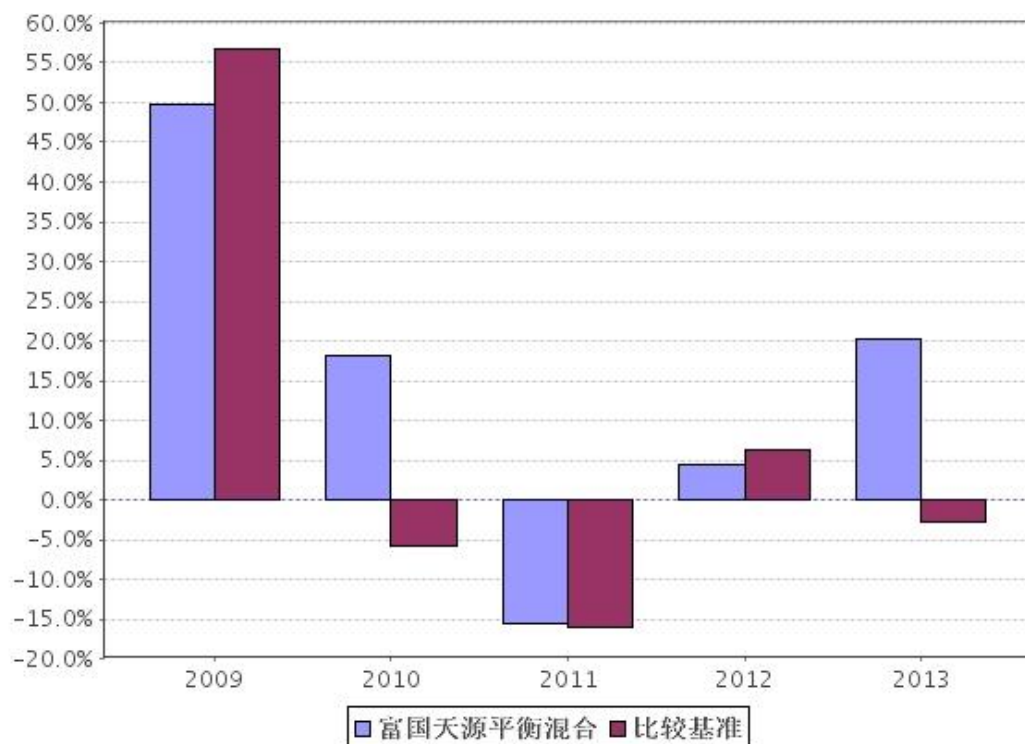
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：截止日期为 2013 年 12 月 31 日止。

本基金于 2002 年 8 月 16 日成立，建仓期 6 个月，从 2002 年 8 月 16 日至 2003 年 2 月 15 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

### 3.2.3 过去五年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



### 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
2013年	—	—	—	—	—
2012年	—	—	—	—	—
2011年	1.350	96,247,702.77	43,824,008.28	140,071,711.05	1次分红
合计	1.350	96,247,702.77	43,824,008.28	140,071,711.05	—

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富国基金管理有限公司于 1999 年 4 月 13 日获国家工商行政管理局登记注册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一，公司于 2001 年 3 月从北京迁址上海。2003 年 9 月加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立

的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。截至 2013 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理汉盛证券投资基金、汉兴证券投资基金、富国天源平衡混合型证券投资基金、富国天利增长债券投资基金、富国天益价值证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国天时货币市场基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、富国天博创新主题股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、富国天丰强化收益债券型证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国优化增强债券型证券投资基金、富国沪深 300 增强证券投资基金、富国通胀通缩主题轮动股票型证券投资基金、富国汇利回报分级债券型证券投资基金、富国全球债券证券投资基金、富国可转换债券证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国天盈分级债券型证券投资基金、富国全球顶级消费品股票型证券投资基金、富国低碳环保股票型证券投资基金、富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）、富国产业债债券型证券投资基金、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金、富国高新技术产业股票型证券投资基金、富国中国中小盘（香港上市）股票型证券投资基金、富国 7 天理财宝债券型证券投资基金、富国纯债债券型发起式证券投资基金、富国强收益定期开放债券型证券投资基金、富国强回报定期开放债券型证券投资基金、富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金、富国信用增强债券型证券投资基金、富国信用债债券型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国医疗保健行业股票型证券投资基金、富国创业板指数分级证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金、富国恒利分级债券型证券投资基金四十二只证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李晓铭	本基金基金经理兼任富国低碳环保股票型证券投资基金基金经理	2009-10-29	—	9 年	硕士，曾任华富基金管理有限公司行业研究员，2006 年 4 月至 2009 年 10 月任富国基金管理有限公司行业研究部行业研究员，富国天博创新主题股票型证券投资基金基金经理助理，2009 年 10 月至今任富国天源基金经理，2011 年 8 月起任富国低碳环保股票型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。

注：上述表格内基金经理的任职日期指公司作出决定并公告披露之日。

证券从业的涵义遵从行业协会《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

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国天源平衡混合型证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国天源平衡证券投资基金基金合同》以及其它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，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标，无损害基金持有人利益的行为，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

### **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**

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。

事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，监察稽核部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。

#### **4.3.2 公平交易制度的执行情况**

本报告期，在同向交易价差分析方面，公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1日内、3日内、5日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及95%的置信水平下，对同向交易价差进行t分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

#### **4.3.3 异常交易行为的专项说明**

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现19次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。



## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年，国内宏观经济增速平稳，通胀维持较低水平。GDP增速7.7%，CPI为同比上涨2.6%。证券市场在1季度普遍接受中国经济将进行彻底转型的观点，去杠杆、发展模式转变、以内需为主、互联网化生存、全方位改革成为影响市场的主流因素，在此背景下，传统的投资思路与方法已经无法与新的市场趋势相匹配。

本基金在1季度进行了风格转变，以适应市场的发展趋势。适度减持了周期类、投资依赖型行业的配置，增加了新兴产业的配置比例，取得了一些效果。但是传统消费类行业仍然配置比例较高，拖累组合整体表现。在个股选择层面，本基金适度降低估值影响因素，着力点放置在适应国家政策变化与消费趋势变化的公司。组合层面，本基金降低了组合的集中度，增加持股数量，降低换手率，以增加组合信息容量，更大程度获得市场热点的容纳。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年12月31日，本基金份额净值为1.1030元，份额累计净值为2.5666元。报告期内，本基金份额净值增长率为20.17%，同期业绩比较基准收益率为-2.77%。

## 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2014年，宏观经济仍然在转型改革的道路上平稳增长。从整体上看，主板指数经历了2013年的下跌之后，风险有所释放，但未来一年却面临与2013年相似的不确定性和风险。成长风格的股票经历了2013年的大涨之后，未来空间更多取决于对上市公司本身质地的考验。

本基金将继续保持原有风格，在风险可控的情况下最大化收益。适度保持风格的多样性，尽力规避未来一年可能出现的主要经济风险与市场风险。更重要的是，在2014年，将更多考虑长期风险收益与短期收益风险之间的匹配。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司按照相关法律法规的规定成立了估值委员会，并制订了《富国基金管理有限公司估值委员会运作管理办法》。估值委员会是公司基金估值的主要决策机关，由主管运营副总经理负责，成员包括基金清算、监察稽核、金融工程方面的业务骨干以及相关基金经理，所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会负责提出估值意见、提供和评估估值技术、执行估值决策和程序、对外信息披露等工作，保证基金估值的公允性和合理性，维护基金持有人的利益。基金经理是估值委员会的重要成员，必须列席估值委员会的定期会议，提出基金估值流程及估值技术中存在的潜在问题，参与估值程序和估值技术的决策。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于2014年01月20日公告对2013年报告期内利润进行收益分配，每10份基金份额派发红利0.85元，共计派发红利91483208.98元。

本基金本期分红已符合相关法律法规及《基金合同》约定。

## § 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

在托管富国天源平衡混合型证券投资基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同》、《富国天源平衡混合型证券投资基金托管协议》的约定,对富国天源平衡混合型证券投资基金管理人—富国基金管理有限公司 2013 年 1 月 1 日至 2013 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,富国基金管理有限公司在富国天源平衡混合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、基金费用开支及利润分配等问题上,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,富国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富国天源平衡混合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,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

## § 6 审计报告

本基金审计的注册会计师出具的是无保留意见的审计报告。  
投资者可通过本基金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:富国天源平衡混合型证券投资基金

报告截止日:2013 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资产	本期末 (2013 年 12 月 31 日)	上年度末 (2012 年 12 月 31 日)

<b>资产：</b>		
银行存款	32,523,786.10	18,543,424.14
结算备付金	2,862,678.10	1,890,190.61
存出保证金	255,547.72	2,000,000.00
交易性金融资产	1,061,449,608.29	808,403,346.53
其中：股票投资	728,706,085.99	556,923,452.53
基金投资	—	—
债券投资	332,743,522.30	251,479,894.00
资产支持证券投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	—	—
应收利息	4,701,490.33	2,979,325.63
应收股利	—	—
应收申购款	399,058.89	622,767.58
递延所得税资产	—	—
其他资产	547.03	547.03
资产总计	1,102,192,716.46	834,439,601.52
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>(2013年12月31日)</b>	<b>(2012年12月31日)</b>
<b>负 债：</b>		
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	—	1,267,651.14
应付赎回款	964,857.04	1,142,067.06
应付管理人报酬	1,423,904.05	988,927.32
应付托管费	237,317.33	164,821.21
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	646,907.75	801,822.99
应交税费	34,926.80	34,926.80
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	201,356.51	1,424,203.54
负债合计	3,509,269.48	5,824,420.06
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	996,084,203.64	902,700,876.06
未分配利润	102,599,243.34	-74,085,694.60
所有者权益合计	1,098,683,446.98	828,615,181.46
负债和所有者权益总计	1,102,192,716.46	834,439,601.52

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1030 元，基金份额总额

996,084,203.64 份。

## 7.2 利润表

会计主体：富国天源平衡混合型证券投资基金

本报告期：2013 年 01 月 01 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2013 年 01 月 01 日至 2013 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2012 年 01 月 01 日至 2012 年 12 月 31 日)
<b>一、收入</b>	190,588,214.48	59,201,324.14
1. 利息收入	12,297,723.18	10,364,820.27
其中：存款利息收入	417,340.88	234,518.82
债券利息收入	11,616,102.65	10,130,301.45
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	264,279.65	—
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	158,738,636.54	-58,068,635.20
其中：股票投资收益	151,636,933.40	-62,656,676.27
基金投资收益	—	—
债券投资收益	-350,514.57	78,507.14
资产支持证券投资收益	—	—
衍生工具投资收益	—	—
股利收益	7,452,217.71	4,509,533.93
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	19,118,826.33	106,710,342.09
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	433,028.43	194,796.98
<b>减：二、费用</b>	23,072,311.18	23,102,713.31
1. 管理人报酬	14,607,751.81	12,552,934.03
2. 托管费	2,434,625.31	2,092,155.72
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	5,836,192.31	8,202,609.10
5. 利息支出	—	63,118.73
其中：卖出回购金融资产支出	—	63,118.73
6. 其他费用	193,741.75	191,895.73
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	167,515,903.30	36,098,610.83
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	167,515,903.30	36,098,610.83

## 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国天源平衡混合型证券投资基金

本报告期：2013 年 01 月 01 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 (2013年01月01日至2013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)	902,700,876.06	-74,085,694.60	828,615,181.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	167,515,903.30	167,515,903.30
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)	93,383,327.58	9,169,034.64	102,552,362.22
其中：1.基金申购款	565,711,666.05	24,494,073.41	590,205,739.46
2.基金赎回款	-472,328,338.47	-15,325,038.77	-487,653,377.24
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)	996,084,203.64	102,599,243.34	1,098,683,446.98
项目	上年度可比期间 (2012年01月01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)	992,088,396.96	-119,547,940.29	872,540,456.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	36,098,610.83	36,098,610.83
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)	-89,387,520.90	9,363,634.86	-80,023,886.04
其中：1.基金申购款	120,371,292.25	-13,088,732.32	107,282,559.93
2.基金赎回款	-209,758,813.15	22,452,367.18	-187,306,445.97
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)	902,700,876.06	-74,085,694.60	828,615,181.46

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：

陈 戈

林志松

雷青松

基金管理人负责人

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报告相一致。

### 7.4.2 会计差错更正的说明

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 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2013年12月31日）	上年度末（2012年12月31日）
活期存款	32,523,786.10	18,543,424.14
定期存款	—	—
其中：存款期限1-3个月	—	—
其他存款	—	—
合计	32,523,786.10	18,543,424.14

注：本基金本报告期内及上年度可比期内均未投资于定期存款。

#### 7.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2013年12月31日）			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	659,817,842.35	728,706,085.99	68,888,243.64	
债券	交易所市场	31,930,886.40	31,875,522.30	-55,364.10
	银行间市场	319,180,150.00	300,868,000.00	-18,312,150.00
	合计	351,111,036.40	332,743,522.30	-18,367,514.10
资产支持证券	—	—	—	
其他	—	—	—	
合计	1,010,928,878.75	1,061,449,608.29	50,520,729.54	
项目	上年度末（2012年12月31日）			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	522,671,078.45	556,923,452.53	34,252,374.08	
债券	交易所市场	40,891,994.87	40,737,094.00	-154,900.87
	银行间市场	213,438,370.00	210,742,800.00	-2,695,570.00
	合计	254,330,364.87	251,479,894.00	-2,850,470.87
资产支持证券	—	—	—	
其他	—	—	—	
合计	777,001,443.32	808,403,346.53	31,401,903.21	

#### 7.4.3.3 衍生金融资产/负债

注：本报告期末及上年度末本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.3.4 买入返售金融资产

##### 7.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本报告期末及上年度末本基金未持有买断式逆回购中取得的债券。

#### 7.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末（2013年12月31日）	上年度末（2012年12月31日）
应收活期存款利息	10,184.24	3,486.48
应收定期存款利息	—	—
应收其他存款利息	—	—
应收结算备付金利息	1,288.20	850.60
应收债券利息	4,689,902.89	2,974,988.55
应收买入返售证券利息	—	—
应收申购款利息	—	—
其他	115.00	—
合计	4,701,490.33	2,979,325.63

#### 7.4.3.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末（2013年12月31日）	上年度末（2012年12月31日）
其他应收款	547.03	547.03
待摊费用	—	—
合计	547.03	547.03

#### 7.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末（2013年12月31日）	上年度末（2012年12月31日）
交易所市场应付交易费用	642,425.42	801,312.99
银行间市场应付交易费用	4,482.33	510.00
合计	646,907.75	801,822.99

#### 7.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2013年12月31日）	上年度末（2012年12月31日）
应付券商交易单元保证金	—	1,250,000.00
应付赎回费	1,356.51	4,203.54
其他	30,000.00	—
预提审计费	70,000.00	70,000.00
预提信息披露费	100,000.00	100,000.00
合计	201,356.51	1,424,203.54

#### 7.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年12月31日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	902,700,876.06	902,700,876.06
本期申购	565,711,666.05	565,711,666.05
本期赎回（以“-”号填列）	-472,328,338.47	-472,328,338.47
本期末	996,084,203.64	996,084,203.64

注：申购含红利再投资、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	97,978,071.29	-172,063,765.89	-74,085,694.60
本期利润	148,397,076.97	19,118,826.33	167,515,903.30
本期基金份额交易产生的变动数	19,232,409.99	-10,063,375.35	9,169,034.64
其中：基金申购款	124,025,843.08	-99,531,769.67	24,494,073.41
基金赎回款	-104,793,433.09	89,468,394.32	-15,325,038.77
本期已分配利润	—	—	—
本期末	265,607,558.25	-163,008,314.91	102,599,243.34

#### 7.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期(2013年01月01日至2013年12月31日)	上年度可比期间(2012年01月01日至2012年12月31日)
活期存款利息收入	356,530.38	192,943.70
定期存款利息收入	—	—
其他存款利息收入	—	—
结算备付金利息收入	29,082.79	41,128.71
其他	31,727.71	446.41
合计	417,340.88	234,518.82

#### 7.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年12月31日）	上年度可比期间(2012年01月01日至2012年12月31日)
卖出股票成交总额	1,936,587,096.13	2,714,196,195.95
减：卖出股票成本总额	1,784,950,162.73	2,776,852,872.22
买卖股票差价收入	151,636,933.40	-62,656,676.27

#### 7.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元



项目	本期（2013年01月01日至2013年12月31日）	上年度可比期间（2012年01月01日至2012年12月31日）
卖出债券（、含债转股及债券到期兑付）成交总额	115,359,709.77	107,316,889.75
减：卖出债券（、含债转股及债券到期兑付）成本总额	112,754,403.07	104,293,649.76
减：应收利息总额	2,955,821.27	2,944,732.85
债券投资收益	-350,514.57	78,507.14

#### 7.4.3.14 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.3.15 衍生工具收益

##### 7.4.3.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无权证投资收益。

##### 7.4.3.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无其他衍生工具收益。

#### 7.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年12月31日）	上年度可比期间（2012年01月01日至2012年12月31日）
股票投资产生的股利收益	7,452,217.71	4,509,533.93
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	7,452,217.71	4,509,533.93

#### 7.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2013年01月01日至2013年12月31日）	上年度可比期间（2012年01月01日至2012年12月31日）
1. 交易性金融资产	19,118,826.33	106,710,342.09
股票投资	34,635,869.56	113,824,809.83
债券投资	-15,517,043.23	-7,114,467.74
资产支持证券投资	—	—
基金投资	—	—
2. 衍生工具	—	—
权证投资	—	—
3. 其他	—	—
合计	19,118,826.33	106,710,342.09

#### 7.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年12月31日）	上年度可比期间（2012年01月01日至2012年12月31日）
----	-----------------------------	----------------------------------

基金赎回费收入	305,842.27	146,123.02
基金转换费收入	42,552.49	39,523.29
其他	84,633.67	9,150.67
合计	433,028.43	194,796.98

#### 7.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期(2013年01月01日至 2013年12月31日)	上年度可比期间(2012年01 月01日至2012年12月31日)
交易所市场交易费用	5,834,792.31	8,201,374.10
银行间市场交易费用	1,400.00	1,235.00
合计	5,836,192.31	8,202,609.10

#### 7.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期(2013年01月01日至2013 年12月31日)	上年度可比期间(2012年01 月01日至2012年12月31日)
审计费用	70,000.00	70,000.00
信息披露费	100,000.00	100,000.00
银行费用	5,741.75	3,895.73
债券账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	193,741.75	191,895.73

#### 7.4.4 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
申银万国证券股份有限公司(“申银万国”)	基金管理人的股东、基金代销机构
山东省国际信托有限公司	基金管理人的股东
蒙特利尔银行	基金管理人的股东
中国农业银行股份有限公司(“农业银行”)	基金托管人、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.5.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2013年01月01日至2013年12月31 日)		上年度可比期间(2012年01月01日至 2012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(%)
海通证券	434,873,892.18	11.29	519,590,713.60	9.66
申银万国	407,557,792.34	10.58	1,074,198,035.21	19.97

### 7.4.5.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 7.4.5.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2013年01月01日至2013年12月31日)		上年度可比期间(2012年01月01日至2012年12月31日)	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)
申银万国	23,077,931.70	22.63	20,235,161.60	22.10

### 7.4.5.1.4 回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2013年01月01日至2013年12月31日)		上年度可比期间(2012年01月01日至2012年12月31日)	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期回购成交总额的比例(%)
申银万国	47,000,000.00	23.86	—	—

### 7.4.5.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2013年01月01日至2013年12月31日)			
	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(%)
海通证券	384,819.89	11.14	3,248.86	0.51
申银万国	367,858.69	10.65	8,379.24	1.30
关联方名称	上年度可比期间(2012年01月01日至2012年12月31日)			
	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(%)
海通证券	428,864.70	9.33	28,060.34	3.50
申银万国	918,886.23	20.00	77,490.17	9.67

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

### 7.4.5.2 关联方报酬

#### 7.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期(2013年01月01日至2013年12月31日)	上年度可比期间(2012年01月01日至2012年12月31日)
当期发生的基金应支付的管理费	14,607,751.81	12,552,934.03
其中：支付销售机构的客户维护费	1,530,906.21	1,511,110.43

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 7.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期(2013年01月01日至 2013年12月31日)	上年度可比期间(2012年01 月01日至2012年12月31日)
当期发生的基金应支付的 托管费	2,434,625.31	2,092,155.72

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，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 7.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.5.4.2 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：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 7.4.5.5 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(2013年01月01日至2013年12月31 日)		上年度可比期间(2012年01月01日至2012 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
中国农业银行股份有限公司	32,523,786.10	356,530.38	18,543,424.14	192,943.70

#### 7.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.5.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联方交易事项。

#### 7.4.6 期末（2013年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600547	山东黄金	2013-12-26	筹划重大事项	17.25	2014-01-02	17.52	567,404	11,185,479.30	9,787,719.00	—

##### 7.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末2013年12月31日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013年12月31日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.7 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	728,706,085.99	66.11
	其中：股票	728,706,085.99	66.11
2	固定收益投资	332,743,522.30	30.19
	其中：债券	332,743,522.30	30.19
	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	35,386,464.20	3.21
6	其他各项资产	5,356,643.97	0.49
7	合计	1,102,192,716.46	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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	6,007,465.20	0.55
B	采矿业	9,787,719.00	0.89
C	制造业	494,429,229.96	45.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,991,710.25	2.82
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	55,759,403.76	5.08
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	61,030,590.73	5.55
J	金融业	27,401,625.00	2.49
K	房地产业	9,634,836.19	0.88
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	11,787,904.00	1.07
N	水利、环境和公共设施管理业	6,959,512.80	0.63
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	14,916,089.10	1.36
S	综合	—	—
	合计	728,706,085.99	66.33

## 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	600060	海信电器	3,755,668	43,340,408.72	3.94
2	002153	石基信息	910,422	43,226,836.56	3.93
3	000581	威孚高科	1,380,000	42,504,000.00	3.87
4	600309	万华化学	2,000,000	41,400,000.00	3.77
5	600694	大商股份	1,236,702	35,715,953.76	3.25
6	600887	伊利股份	899,993	35,171,726.44	3.20
7	600276	恒瑞医药	663,085	25,183,968.30	2.29
8	000423	东阿阿胶	560,000	22,153,600.00	2.02
9	600803	威远生化	1,673,203	20,764,449.23	1.89
10	000712	锦龙股份	899,995	20,654,885.25	1.88

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于富国基金管理有限公司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	600309	万华化学	65,640,520.26	7.92
2	600060	海信电器	60,192,305.93	7.26
3	600887	伊利股份	57,551,845.98	6.95
4	300059	东方财富	51,869,397.19	6.26
5	600585	海螺水泥	50,292,858.01	6.07
6	000024	招商地产	46,128,121.71	5.57
7	000063	中兴通讯	41,319,727.41	4.99
8	600583	海油工程	38,208,271.97	4.61
9	600858	银座股份	37,498,156.13	4.53
10	002049	同方国芯	37,106,837.68	4.48
11	600519	贵州茅台	34,494,714.23	4.16
12	600518	康美药业	34,039,595.24	4.11
13	000001	平安银行	33,797,383.34	4.08
14	002466	天齐锂业	31,314,077.31	3.78
15	600166	福田汽车	29,326,380.12	3.54
16	601166	兴业银行	27,952,291.04	3.37
17	600475	华光股份	23,238,521.86	2.80
18	600276	恒瑞医药	22,807,014.24	2.75
19	600803	威远生化	22,560,220.01	2.72
20	601258	庞大集团	22,120,089.76	2.67
21	000671	阳光城	21,603,067.51	2.61
22	600048	保利地产	20,531,186.55	2.48
23	000732	泰禾集团	20,090,627.24	2.42
24	002153	石基信息	19,589,611.39	2.36
25	002271	东方雨虹	19,524,638.33	2.36
26	002080	中材科技	19,046,047.30	2.30
27	000712	锦龙股份	18,606,325.91	2.25
28	002630	华西能源	17,964,065.20	2.17
29	600761	安徽合力	17,710,672.00	2.14
30	600801	华新水泥	17,249,279.41	2.08
31	000937	冀中能源	17,204,833.54	2.08
32	300005	探路者	17,104,935.65	2.06
33	600547	山东黄金	16,828,882.47	2.03
34	601318	中国平安	16,788,510.62	2.03
35	600089	特变电工	16,719,105.16	2.02

#### 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	300059	东方财富	87,272,241.52	10.53
2	000625	长安汽车	69,575,261.88	8.40
3	600060	海信电器	54,476,661.13	6.57
4	000671	阳光城	49,536,335.73	5.98
5	000063	中兴通讯	46,741,646.76	5.64
6	000024	招商地产	43,191,295.63	5.21
7	300124	汇川技术	41,714,737.05	5.03
8	600583	海油工程	40,845,602.18	4.93
9	002049	同方国芯	37,296,861.48	4.50
10	000001	平安银行	36,163,924.34	4.36
11	600518	康美药业	35,619,730.09	4.30
12	600546	山煤国际	34,753,459.35	4.19
13	002422	科伦药业	32,606,542.22	3.94
14	600887	伊利股份	32,261,820.06	3.89
15	600031	三一重工	32,260,914.38	3.89
16	002466	天齐锂业	31,912,915.10	3.85
17	600585	海螺水泥	30,436,896.27	3.67
18	600519	贵州茅台	29,889,608.64	3.61
19	600166	福田汽车	29,042,062.42	3.50
20	000725	京东方A	28,219,572.60	3.41
21	600309	万华化学	27,879,374.45	3.36
22	600521	华海药业	27,771,560.21	3.35
23	002153	石基信息	26,767,711.68	3.23
24	600570	恒生电子	26,717,199.30	3.22
25	000709	河北钢铁	26,289,347.18	3.17
26	600208	新潮中宝	25,523,619.04	3.08
27	002080	中材科技	24,677,543.25	2.98
28	601166	兴业银行	24,390,123.70	2.94
29	600475	华光股份	23,655,030.03	2.85
30	600089	特变电工	21,712,786.55	2.62
31	000581	威孚高科	21,558,557.25	2.60
32	600048	保利地产	20,676,885.20	2.50
33	601258	庞大集团	20,650,922.89	2.49
34	300090	盛运股份	20,139,893.12	2.43
35	300159	新研股份	18,994,268.11	2.29
36	002482	广田股份	18,454,676.19	2.23
37	000887	中鼎股份	17,954,171.49	2.17
38	300036	超图软件	17,925,015.24	2.16



39	002630	华西能源	17,759,577.28	2.14
40	300005	探路者	17,726,410.79	2.14
41	000732	泰禾集团	17,519,201.72	2.11
42	300273	和佳股份	17,441,413.41	2.10
43	600967	北方创业	17,023,611.13	2.05
44	000800	一汽轿车	17,020,411.26	2.05

#### 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	1,922,096,926.63
卖出股票收入（成交）总额	1,936,587,096.13

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，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

金额单位：人民币元

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	61,416,522.30	5.59
2	央行票据	—	—
3	金融债券	271,327,000.00	24.70
	其中：政策性金融债	271,327,000.00	24.70
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	332,743,522.30	30.29

#### 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

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110258	11 国开 58	1,400,000	126,938,000.00	11.55
2	110202	11 国开 02	600,000	55,374,000.00	5.04
3	130326	13 进出 26	500,000	49,155,000.00	4.47
4	130017	13 付息国债 17	300,000	29,541,000.00	2.69
5	130201	13 国开 01	200,000	19,998,000.00	1.82

#### 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.9.1 报告期末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投资股指期货。

### 8.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

## 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

### 8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

### 8.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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。

### 8.11.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

### 8.11.3 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	255,547.72
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	4,701,490.33
5	应收申购款	399,058.89
6	其他应收款	547.03
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	5,356,643.97

### 8.11.4 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。

### 8.11.5 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。

### 8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 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(%)
46087	21,613.13	417,111,662.76	41.88	578,972,540.88	58.12

### 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	144,974.70	0.0146

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

2、本基金的基金经理持有本基金份额总量为0至10万份。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2002年08月16日)基金份额总额	4,616,913,656.00
报告期期初基金份额总额	902,700,876.06
本报告期基金总申购份额	565,711,666.05
减：本报告期基金总赎回份额	472,328,338.47
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	996,084,203.64

注：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

本报告期内本基金没有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**

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

本报告期，基金管理人公告窦玉明先生自 2013 年 6 月 5 日不再担任公司总经理职务，并自该日起由公司董事长陈敏女士代行公司总经理职责。

本基金管理人已于 2014 年 1 月 29 日和 2014 年 1 月 30 日发布公告，陈戈先生自 2014 年 1 月 29 日起由公司副总经理转任公司总经理。

## **11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

## **11.4 基金投资策略的改变**

本报告期本基金投资策略无改变。

## **11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所的报酬为 7 万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 11 年。

## **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**

本报告期内基金管理人和基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

### 11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		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 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
齐鲁证券	1	83,990,830.29	2.18	2,005,999.70	1.97	—	—	—	—	76,464.73	2.21	—
国联证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
宏源证券	2	289,566,786.63	7.52	9,849,500.00	9.66	—	—	—	—	259,853.35	7.53	—
兴业证券	2	1,348,694,312.66	35.00	17,798,784.20	17.45	—	—	—	—	1,203,024.12	34.84	—
国泰君安	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国海证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
东方证券	2	814,926,068.47	21.15	4,513,500.00	4.43	—	—	—	—	730,018.92	21.14	—
海通证券	1	434,873,892.18	11.29	—	—	—	—	—	—	384,819.89	11.14	—
华鑫证券	1	473,401,933.59	12.29	44,725,407.50	43.86	150,000,000.00	76.14	—	—	430,984.19	12.48	—
申银万国	2	407,557,792.34	10.58	23,077,931.70	22.63	47,000,000.00	23.86	—	—	367,858.69	10.65	—

注：我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期内本基金租用券商交易单元无变更。

