

富国中国中小盘（香港上市）股票型证券投资基金
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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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、净值表现和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。

1.2

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	富国中国中小盘股票（QDII）
基金主代码	100061
交易代码	前端交易代码：100061 后端交易代码：000162
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年09月04日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	78,347,730.76份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于香港市场中的中国概念中小盘股票，通过精选个股和风险控制，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	通过积极主动的投资，精选香港市场中具有中国概念的优质股票进行投资，分享中国经济快速成长的成果。中小盘股票成长空间大，且往往存在估值洼地，能够为投资者带来超额收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：MSCI 中国自由投资中小盘股票指数(MSCI China Free SMID Index)收益率×80%+香港三个月期银行同业拆借利率(Hong Kong 3-Month Interbank Offer Rate)×20%。
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的投资品种。

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		富国基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	范伟隽	赵会军
	联系电话	021-20361818	010—66105799
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105686、4008880688	95588
传真		021-20361616	010—66105798

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目	境外投资顾问	境外资产托管人

名称	英文	-	The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited
	中文	-	香港上海汇丰银行有限公司
注册地址	-	-	香港中环皇后大道中一号汇丰总行大厦
办公地址	-	-	香港九龙深旺道一号, 汇丰中心一座六楼
邮政编码	-	-	无

2.5 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 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街55号

§ 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9月4日(基金合同生效日)至 2012年12月31日
本期已实现收益	15,741,539.18	3,090,336.23
本期利润	16,680,194.01	7,729,933.10
加权平均基金份额本期利润	0.4149	0.0647
本期基金份额净值增长率	39.11%	12.50%
3.1.2 期末数据和指标	2013年12月31日	2012年12月31日
期末可供分配基金份额利润	0.4650	0.0497
期末基金资产净值	122,646,796.11	48,105,853.54
期末基金份额净值	1.565	1.125

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	10.29%	0.80%	6.59%	0.67%	3.70%	0.13%
过去六个月	20.57%	0.84%	13.39%	0.71%	7.18%	0.13%
过去一年	39.11%	1.10%	7.39%	0.91%	31.72%	0.19%
自基金合同生效日起至今	56.50%	0.99%	28.76%	0.87%	27.74%	0.12%

注：本基金的业绩比较基准为：MSCI 中国自由投资中小盘股票指数(MSCI China Free SMID Index)收益率×80%+香港三个月期银行同业拆借利率（Hong Kong 3-Month Interbank Offer Rate）×20%。

MSCI 中国自由投资中小盘股票指数，是由 MSCI 编制的反映在香港上市的中国内地中小企业整体状况的指数。

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（benchmark_t）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_t = [\text{MSCI 中国自由投资中小盘股票指数 } t / (\text{MSCI 中国自由投资中小盘股票指数 } t-1) - 1] * 80\% + [\text{香港三个月期银行同业拆借利率} / 365] * 20\%;$$

其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ， T 表示时间截至日；

期间 T 日收益率（benchmark_T）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_T = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)] - 1$$

其中， $T=2, 3, 4, \dots$ ； $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)$ 表示 t 日至 T 日的 $(1 + \text{benchmark}_t)$ 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。

本基金建仓期 6 个月，即从 2012 年 9 月 4 日起至 2013 年 3 月 3 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 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



注：本基金合同生效日为 2012 年 9 月 4 日，2012 年净值增长率按实际存续期计算。

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
2013年	—	—	—	—	—
2012年	—	—	—	—	—
合计	—	—	—	—	—

§ 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		
张峰	本基金基金经理兼任海外投资副总监、富国全球顶级消费品股票型证券投资基金基金经理	2012-09-04	—	12年	硕士，曾任摩根史丹利研究部助理，里昂证券股票分析员，摩根大通执行董事，美林证券高级董事；自2009年7月至2011年4月任富国基金管理有限公司周期性行业研究负责人，2011年4月至2012年12月起任富国全球债券证券投资基金基金经理，自2011年7月起任富国全球顶级消费品股票型证券投资基金基金经理，自2012年9月起任富国中国中小盘（香港上市）股票型证券投资基金基金经理，兼任海外投资副总监。具有基金从业资格，中国香港。

注：上述表格内基金经理的任职日期为本基金基金合同生效日。

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：本基金无境外投资顾问。

4.3 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中国中小盘(香港上市)股票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》、《富国中国中小盘(香港上市)股票型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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.4.3 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未出现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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年香港整体股市受到内地大盘表现平淡的影响，表现一般。香港MSCI中小盘指数表现优于恒生指数和国企指数等大盘股为主的权重指数。

我们获得比较高的超额收益的原因主要来自于我们自下而上的选股和行业配置。我们2013年的重仓股都取得了比较好的收益。

行业配置上，我们比较看好医药、新能源等类股票，其中医药板块明显获得了超额收益。

全年基金净值除了受到二季度末内地钱荒的影响，回调较多外，全年基本保持比较好的稳定上涨态势。主要原因也在于我们精选了相对稳健的股票投资组合。

4.5.2 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1.565元，份额累计净值为1.565元。报告期内，本基金份额净值增长率为39.11%，同期业绩比较基准收益率为

7.39%。

4.6 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，宏观经济方面，欧美经济可能继续回暖，并有复苏步伐加快的迹象。中国国内的经济面临增长减速的问题，但国家也不会容忍经济增速大幅下滑。所以，我们的基本判断是国内经济区间运行。

行业方面，国内的经济减速和转型会对过剩产业和依赖投资拉动的产业有比较大的影响。与此同时，以 TMT、医药和新能源为代表的行业可能会继续较快地增长。

综合来看，宏观基本面温和，对股市的影响相对中性。在这种经济环境下，自下而上的选股可能会继续是 2014 年的主题和跑赢指数的关键所在。行业上我们看好 TMT、医药、新能源和节能环保等产业。2014 年金融地产和周期性行业有没有机会，取决于国家对通胀的控制和银根的松紧。总而言之，我们会关注宏观面，同时精选个股，力争为投资者取得比较好的投资收益。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，2013 年报告期内本基金未进行收益分配。

§ 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

本报告期内，本基金托管人在对富国中国中小盘（香港上市）股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，富国中国中小盘（香港上市）股票型证券投资基金的管理人——富国基金管理有限公司在富国全球顶级消费品股票型证券投资基金的投资运作、基

金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，富国全球顶级消费品股票型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露富国中国中小盘（香港上市）股票型证券投资基金 2013 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行资产托管部
2014 年 3 月 27 日

§ 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：富国中国中小盘（香港上市）股票型证券投资基金

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)
资产：		
银行存款	16,613,458.96	3,905,928.83
结算备付金	169,047.62	463,636.36
存出保证金	—	—
交易性金融资产	103,416,327.76	44,512,743.54
其中：股票投资	103,148,852.31	44,512,743.54
基金投资	267,475.45	—
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	—	—
应收证券清算款	5,908,223.06	1,021,895.65
应收利息	2,343.39	1,139.93
应收股利	2,800.16	13,073.95

应收申购款	4,734,861.24	2,221,534.68
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	130,847,062.19	52,139,952.94
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	(2013年12月31日)	(2012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	5,409,325.40	—
应付赎回款	2,565,526.63	3,773,909.02
应付管理人报酬	147,985.24	72,393.48
应付托管费	27,747.23	13,573.76
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	—	—
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	49,681.58	174,223.14
负债合计	8,200,266.08	4,034,099.40
所有者权益:		
实收基金	78,347,730.76	42,746,423.88
未分配利润	44,299,065.35	5,359,429.66
所有者权益合计	122,646,796.11	48,105,853.54
负债和所有者权益总计	130,847,062.19	52,139,952.94

注：1.报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.565 元，基金份额总额 78,347,730.76 份。

2.本基金合同于 2012 年 9 月 4 日生效，上年度可比期间自 2012 年 9 月 4 日至 2012 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：富国中国中小盘（香港上市）股票型证券投资基金

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 9 月 4 日(基 金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日)

一、收入	18,543,815.36	8,950,448.60
1. 利息收入	75,606.79	640,678.02
其中：存款利息收入	47,599.71	114,447.89
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	28,007.08	526,230.13
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	17,284,651.81	3,272,203.75
其中：股票投资收益	16,144,755.26	3,189,726.13
基金投资收益	-14,169.11	-2,312.70
债券投资收益	—	—
资产支持证券投资收益	—	—
衍生工具投资收益	481.56	—
股利收益	1,153,584.10	84,790.32
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	938,654.83	4,639,596.87
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	106,434.82	130,041.66
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	138,467.11	267,928.30
减：二、费用	1,863,621.35	1,220,515.50
1. 管理人报酬	877,913.19	644,851.64
2. 托管费	164,608.75	120,909.65
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	750,812.41	292,772.71
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 其他费用	70,287.00	161,981.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	16,680,194.01	7,729,933.10
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	16,680,194.01	7,729,933.10

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国中国中小盘（香港上市）股票型证券投资基金

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）	42,746,423.88	5,359,429.66	48,105,853.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	16,680,194.01	16,680,194.01
三、本期基金份额交易产生的基金	35,601,306.88	22,259,441.68	57,860,748.56

净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	120,511,587.21	47,738,606.80	168,250,194.01
2. 基金赎回款	-84,910,280.33	-25,479,165.12	-110,389,445.45
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）	78,347,730.76	44,299,065.35	122,646,796.11
项目	上年度可比期间(2012年9月4日(基金合同生效日)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）	249,999,292.07	—	249,999,292.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	7,729,933.10	7,729,933.10
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）	-207,252,868.19	-2,370,503.44	-209,623,371.63
其中：1. 基金申购款	4,358,812.00	359,182.25	4,717,994.25
2. 基金赎回款	-211,611,680.19	-2,729,685.69	-214,341,365.88
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）	42,746,423.88	5,359,429.66	48,105,853.54

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

富国中国中小盘（香港上市）股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2012]955号《关于核准富国中国中小盘（香港上市）股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2012年9月4日正式生效，首次设立募集规模为249,999,292.07份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，境外资产托管人为香港上海汇丰银行有限公司（The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited）。

本基金的投资范围包括但不限于在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的股票,在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金(含ETF)、债券、货币市场工具、金融衍生品以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关要求)。

本基金为股票型基金,投资于股票及其他权益类资产的比例不低于基金资产的60%。现金、债券及中国证监会允许投资的其他金融工具市值占基金资产的比例不高于40%,其中现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金将以不低于股票资产的80%投资于在香港证券市场交易的中小盘中国概念股。

本基金的业绩基准为:MSCI中国自由投资中小盘股票指数(MSCI China Free SMID Index)收益率 \times 80%+香港三个月期银行同业拆借利率(Hong Kong 3-Month Interbank Offer Rate) \times 20%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2013年12月31日的财务状况以及2013年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资和基金投资；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债；

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或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，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；

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债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；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。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；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

本基金持有的基金投资和股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 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；

(2) 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

重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，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；

(3) 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。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(3) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(4) 基金投资收益/(损失)于卖出/赎回基金成交日确认，并按卖出/赎回基金成交金额与其成本的差额入账；

(5) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(6) 股票股利收益于除息日确认，并按宣告的分红派息比例计算的金额扣除股票所在地使用的预缴所得税后的净额入账；基金投资在持有期间取得的红利于除息日确认；

(7) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损

失；

(8) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

- (1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.60%的年费率逐日计提；
- (2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.30%的年费率逐日计提；
- (3) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 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 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- (2) 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；
- (3) 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；
- (4) 每一基金份额享有同等分配权；
- (5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他境内外相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (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；
- (2) 基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征收营业税和企业所得税；
- (3) 基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 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	16,613,458.96	3,905,928.83
定期存款	—	—
其中：存款期限1-3个月	—	—
其他存款	—	—
合计	16,613,458.96	3,905,928.83

注：

本基金外币存款余额构成列示如下：			
币种	2013年12月31日		
	外币金额	折算汇率	折合人民币
港币	15,203,989.33	0.7862	11,953,832.53
合计			11,953,832.53
币种	2012年12月31日		
	外币金额	折算汇率	折合人民币
港币	1,070,316.94	0.8109	867,866.49
合计			867,866.49

7.4.7.2 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	97,520,244.51	103,148,852.31	5,628,607.80
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
基金	317,831.55	267,475.45	-50,356.10

其他	—	—	—
合计	97,838,076.06	103,416,327.76	5,578,251.70
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	39,873,146.67	44,512,743.54	4,639,596.87
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	39,873,146.67	44,512,743.54	4,639,596.87

7.4.7.3 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本报告期末及上年度末本基金未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 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	2,259.68	910.47
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	83.71	229.46
应收债券利息	—	—
应收买入返售证券利息	—	—
应收申购款利息	—	—
其他	—	—
合计	2,343.39	1,139.93

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

注：本基金本报告期末及上年度末均无应付交易费用余额。

7.4.7.8 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	—	—

应付赎回费	9,681.58	14,223.14
预提审计费	40,000.00	40,000.00
预提信息披露费	—	120,000.00
合计	49,681.58	174,223.14

7.4.7.9 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	42,746,423.88	42,746,423.88
本期申购	120,511,587.21	120,511,587.21
本期赎回（以“-”号填列）	-84,910,280.33	-84,910,280.33
本期末	78,347,730.76	78,347,730.76

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	2,124,998.95	3,234,430.71	5,359,429.66
本期利润	15,741,539.18	938,654.83	16,680,194.01
本期基金份额交易产生的变动数	18,561,321.28	3,698,120.40	22,259,441.68
其中：基金申购款	38,657,557.73	9,081,049.07	47,738,606.80
基金赎回款	-20,096,236.45	-5,382,928.67	-25,479,165.12
本期已分配利润	—	—	—
本期末	36,427,859.41	7,871,205.94	44,299,065.35

7.4.7.11 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9月4日(基金合同生效日)至2012年12月31日)
活期存款利息收入	45,775.55	103,380.85
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	345.86	11,067.04
其他	1,478.30	—
合计	47,599.71	114,447.89

7.4.7.12 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9月4日(基金合同生效日)至2012年12月31日)

卖出股票成交总额	192,858,082.68	70,118,930.67
减：卖出股票成本总额	176,713,327.42	66,929,204.54
买卖股票差价收入	16,144,755.26	3,189,726.13

7.4.7.13 基金投资收益

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9月4日 (基金合同生效日)至2012年12月 31日)
卖出/赎回基金成交总额	2,226,015.76	897,654.96
减：卖出/赎回基金成本总额	2,240,184.87	899,967.66
基金投资收益	-14,169.11	-2,312.70

7.4.7.14 债券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.15 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。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

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9 月4日(基金合同生效日)至 2012年12月31日)
卖出权证成交总额	481.56	—
减：卖出权证成本总额	—	—
买卖权证差价收入	481.56	—

7.4.7.16.2 衍生工具收益——买卖远期外汇差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖远期外汇差价收入。

7.4.7.17 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9月4日(基金合同生 效日)至2012年12月31 日)
股票投资产生的股利收益	1,123,850.57	84,790.32
基金投资产生的股利收益	29,733.53	—
合计	1,153,584.10	84,790.32

7.4.7.18 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9 月4日(基金合同生效日)至
------	---------------------------------	---------------------------------

		2012年12月31日)
1. 交易性金融资产	938,654.83	4,639,596.87
股票投资	989,010.93	4,639,596.87
债券投资	—	—
资产支持证券投资	—	—
基金投资	-50,356.10	—
2. 衍生工具	—	—
权证投资	—	—
3. 其他	—	—
合计	938,654.83	4,639,596.87

7.4.7.19 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9月4日(基金合同生效日)至2012年12月31日)
基金赎回费收入	138,085.14	267,928.30
其他	381.97	—
合计	138,467.11	267,928.30

7.4.7.20 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9月4日(基金合同生效日)至2012年12月31日)
交易所市场交易费用	750,812.41	292,772.71
银行间市场交易费用	—	—
合计	750,812.41	292,772.71

7.4.7.21 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9月4日(基金合同生效日)至2012年12月31日)
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	30,000.00	120,000.00
银行汇划费	287.00	81.50
账户维护费	—	1,500.00
其他	—	400.00
合计	70,287.00	161,981.50

7.4.7.22 分部报告

本基金目前以一个经营分部运作。

7.4.8 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
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
香港上海汇丰银行有限公司(“汇丰银行”)	基金境外托管行
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
海通国际证券集团有限公司	基金管理人的股东控制的子公司
申银万国证券(香港)有限公司	基金管理人的股东控制的子公司

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。

7.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.9.1.1 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9月4日(基金合同生效日)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(%)
香港上海汇丰银行有限公司	10,932,360.90	2.57	43,938,382.21	24.83
海通国际证券集团有限公司	6,260,976.82	1.47	—	—
申银万国证券(香港)有限公司	8,599,461.45	2.02	—	—

7.4.9.1.2 权证交易

注：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。

7.4.9.1.3 债券交易

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债券交易。

7.4.9.1.4 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9月4日(基金合同生效日)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(%)
海通证券股份有限公司	—	—	248,200,000.00	13.73
申银万国证券股份有限公司	—	—	319,900,000.00	17.70

7.4.9.1.5 基金交易

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(%)

香港上海汇丰银行有限公司	—	—	448,334.37	24.94
申银万国证券（香港）有限公司	360,364.49	7.53	—	—

7.4.9.1.6 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（%）
香港上海汇丰银行有限公司	4,372.94	1.62	—	—
海通国际证券集团有限公司	6,722.92	2.49	—	—
申银万国证券（香港）有限公司	9,341.55	3.47	—	—
关联方名称	上年度可比期间（2012年9月4日（基金合同生效日）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（%）
香港上海汇丰银行有限公司	17,754.58	17.88	—	—

7.4.9.2 关联方报酬

7.4.9.2.1 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9月4日（基金合同生效日）至2012年12月31日）
当期发生的基金应支付的管理费	877,913.19	644,851.64
其中：支付销售机构的客户维护费	332,626.68	176,302.21

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.60%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.60\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金的管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.9.2.2 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9月4日（基金合同生效日）至2012年12月31日）
当期发生的基金应支付的托管费	164,608.75	120,909.65

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.30%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

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。

7.4.9.3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。

7.4.9.4各关联方投资本基金的情况

7.4.9.4.1 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。

7.4.9.4.2 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。

7.4.9.5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9月4日（基金合同生效日）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
中国工商银行股份有限公司	4,659,661.82	45,775.55	3,038,062.34	103,380.85
香港上海汇丰银行有限公司	11,953,797.14	—	867,866.49	—

7.4.9.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期（2013年01月01日至2013年12月31日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
香港上海汇丰银行有限公司	8138 HK	同仁堂国药	新股发行	57,119	139,008.91

金额单位：人民币元

上年度可比期间（2012年9月4日（基金合同生效日）至2012年12月31日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
—	—	—	—	—	—

7.4.9.7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。

7.4.10 期末（2013年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.10.1 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。

7.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末，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。

7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，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。

7.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期无需要说明的其他事项。

§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	103,148,852.31	78.83
	其中：普通股	103,148,852.31	78.83
	存托凭证	—	—
2	基金投资	267,475.45	0.20
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
	其中：远期	—	—
	期货	—	—
	期权	—	—
	权证	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	货币市场工具	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	16,782,506.58	12.83
8	其他各项资产	10,648,227.85	8.14
9	合计	130,847,062.19	100.00

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	103,148,852.31	84.10
合计	103,148,852.31	84.10

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
非必需消费品	28,282,303.29	23.06
工业	20,555,342.56	16.76
金融	16,334,479.39	13.32
医疗保健	13,461,973.46	10.98
信息技术	6,875,797.56	5.61
公用事业	6,800,936.68	5.55
材料	5,922,367.89	4.83
能源	3,458,696.53	2.82
必需消费品	1,456,954.95	1.19
合计	103,148,852.31	84.10

8.4 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	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券 代码	所在证券 市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允 价值	占基金 资产净 值比例 (%)
1	MINTH GROUP LTD	敏实集团	425 HK	香港交易所	中国香港	332000	4,202,556.60	3.43
2	GUOTAI JUNAN INTERNATIONAL	国泰君安国际	1788 HK	香港交易所	中国香港	1249000	3,869,085.00	3.15
3	DAWRAYS PHARMACEUTICAL HOLD	东瑞制药	2348 HK	香港交易所	中国香港	896000	3,472,998.05	2.83
4	EMPEROR ENTERTAINMENT HOTEL	英皇娱乐酒店	296 HK	香港交易所	中国香港	1085000	3,412,238.20	2.78
5	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	上海医药	2607 HK	香港交易所	中国香港	225200	3,360,579.74	2.74
6	HISENSE KELON ELEC HLD-H	海信科龙	921 HK	香港交易所	中国香港	324000	2,990,630.22	2.44

7	CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	中集集团	2039 HK	香港交易所	中国香港	227800	2,955,202.70	2.41
8	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	信义玻璃	868 HK	香港交易所	中国香港	522000	2,807,218.49	2.29
9	DONGJIANG ENVIRONMENTAL-H	东江环保	895 HK	香港交易所	中国香港	131500	2,662,273.06	2.17
10	VALUE PARTNERS GROUP LTD	惠理集团	806 HK	香港交易所	中国香港	531000	2,504,928.78	2.04

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

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	MINTH GROUP LTD	425 HK	5,019,847.44	10.44
2	GUOTAI JUNAN INTERNATIONAL	1788 HK	4,932,383.85	10.25
3	TRIGIANT GROUP LTD	1300 HK	4,520,840.06	9.40
4	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	868 HK	4,168,349.89	8.66
5	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	3618 HK	4,127,937.76	8.58
6	VALUE PARTNERS GROUP LTD	806 HK	3,991,772.21	8.30
7	EMPEROR ENTERTAINMENT HOTEL	296 HK	3,766,442.78	7.83
8	CHINA MINSHENG BANKING-H	1988 HK	3,501,167.53	7.28
9	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	2196 HK	3,438,842.88	7.15
10	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	2607 HK	3,327,996.82	6.92
11	XINCHEN CHINA POWER HOLDINGS	1148 HK	3,109,794.20	6.46
12	HUADIAN FUXIN	816 HK	2,957,504.25	6.15

	ENERGY CORP -H			
13	CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	2039 HK	2,882,723.92	5.99
14	DONGJIANG ENVIRONMENTAL-H	895 HK	2,830,406.14	5.88
15	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	813 HK	2,779,616.54	5.78
16	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	3900 HK	2,757,820.65	5.73
17	SHANGHAI PRIME MACHINERY-H	2345 HK	2,571,635.71	5.35
18	WINTEAM PHARMACEUTICAL GROUP	570 HK	2,569,755.84	5.34
19	CHINA SANJIANG FINE CHEMICAL	2198 HK	2,523,029.31	5.24
20	DAWNRAYS PHARMACEUTICAL HOLD	2348 HK	2,405,856.80	5.00
21	GUANGDONG INVESTMENT LTD	270 HK	2,382,072.66	4.95
22	TEXHONG TEXTILE GROUP	2678 HK	2,378,169.53	4.94
23	BBMG CORPORATION-H	2009 HK	2,334,560.63	4.85
24	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	2689 HK	2,317,896.10	4.82
25	FUFENG GROUP LTD	546 HK	2,311,894.69	4.81
26	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	489 HK	2,128,630.25	4.42
27	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	688 HK	2,116,080.78	4.40
28	CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	1093 HK	2,096,866.93	4.36
29	EIJING JINGNENG CLEAN ENE-H	579 HK	2,026,445.09	4.21
30	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1918 HK	1,970,654.79	4.10
31	KAISA GROUP HOLDINGS LTD	1638 HK	1,951,437.85	4.06
32	LANSEN	503 HK	1,909,529.71	3.97

	PHARMACEUTICAL HOLDIN			
33	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	386 HK	1,872,181.15	3.89
34	CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	6881 HK	1,824,318.75	3.79
35	MELCO INTERNATIONAL DEVELOP.	200 HK	1,808,928.01	3.76
36	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	2333 HK	1,803,258.43	3.75
37	HINA SINGYES SOLAR TECH	750 HK	1,767,234.31	3.67
38	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	1193 HK	1,758,894.84	3.66
39	CHINA OVERSEAS GRAND OCEANS	81 HK	1,758,717.55	3.66
40	SJM HOLDINGS LTD	880 HK	1,709,993.22	3.55
41	KINGSOFT CORP LTD	3888 HK	1,687,453.30	3.51
42	YASHILI INTERNATIONAL HOLDIN	1230 HK	1,668,939.11	3.47
43	GUANGZHOU SHIPYARD INTL CO-H	317 HK	1,644,103.84	3.42
44	PETROCHINA CO LTD-H	857 HK	1,633,900.07	3.40
45	SINO BIOPHARMACEUTICAL	1177 HK	1,617,714.33	3.36
46	CIMC ENRIC HOLDINGS LTD	3899 HK	1,593,906.68	3.31
47	OPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	754 HK	1,572,016.68	3.27
48	LIJUN INTL PHARMACETL HLDG	2005 HK	1,560,584.14	3.24
49	TCC INTL HLDGS LTD	1136 HK	1,489,635.33	3.10
50	GOODBABY INTERNATIONAL HOLDI	1086 HK	1,484,126.33	3.09
51	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	2007 HK	1,479,095.59	3.07
52	TECHNOVATOR	1206 HK	1,478,583.29	3.07

	INTERNATIONAL LT			
53	WEIQIAO TEXTILE CO LTD-H	2698 HK	1, 473, 533. 37	3. 06
54	FOSUN INTERNATIONAL	656 HK	1, 460, 074. 79	3. 04
55	TRULY INTERNATIONAL HOLDINGS	732 HK	1, 442, 637. 28	3. 00
56	HAINAN MEILAN INTL AIRPORT-H	357 HK	1, 409, 044. 96	2. 93
57	XINGDA INT'L HOLDINGS	1899 HK	1, 388, 809. 52	2. 89
58	CHINA OIL AND GAS GROUP LTD	603 HK	1, 386, 825. 97	2. 88
59	SINOTRANS SHIPPING LTD	368 HK	1, 344, 794. 88	2. 80
60	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	1114 HK	1, 334, 313. 53	2. 77
61	CHINA OILFIELD SERVICES-H	2883 HK	1, 321, 645. 67	2. 75
62	GEMDALE PROPERTIES AND INVES	535 HK	1, 318, 857. 64	2. 74
63	ZTE CORP-H	763 HK	1, 268, 376. 25	2. 64
64	FAR EAST HORIZON LTD	3360 HK	1, 238, 425. 58	2. 57
65	NEWOCEAN ENERGY HLDGS LTD	342 HK	1, 197, 987. 76	2. 49
66	SANDS CHINA LTD	1928 HK	1, 194, 113. 00	2. 48
67	CENTRAL CHINA REAL ESTATE	832 HK	1, 185, 028. 19	2. 46
68	BIOSTIME INTERNATIONAL HOLDI	1112 HK	1, 164, 480. 19	2. 42
69	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	2314 HK	1, 153, 283. 27	2. 40
70	CHINA CITIC BANK COR	998 HK	1, 102, 641. 58	2. 29
71	CHINA MERCHANTS BANK-H	3968 HK	1, 100, 917. 83	2. 29
72	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	1378 HK	1, 095, 146. 75	2. 28
73	AVICHINA INDUSTRY	2357 HK	1, 080, 490. 48	2. 25

	& TECH-H			
74	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	2601 HK	1,077,833.61	2.24
75	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	27 HK	1,076,190.01	2.24
76	HUADIAN POWER INTL CORP-H	1071 HK	1,075,363.40	2.24
77	CHINA POWER INTERNATIONAL	2380 HK	1,056,016.86	2.20
78	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	2238 HK	1,052,319.02	2.19
79	HISENSE KELON ELEC HLD-H	921 HK	1,007,082.64	2.09

8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	HISENSE KELON ELEC HLD-H	921 HK	5,261,254.44	10.94
2	CHINA MINSHENG BANKING-H	1988 HK	5,108,591.06	10.62
3	SINO BIOPHARMACEUTICAL	1177 HK	4,407,288.99	9.16
4	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	3618 HK	4,251,108.45	8.84
5	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	2196 HK	3,812,330.58	7.92
6	XINCHEN CHINA POWER HOLDINGS	1148 HK	3,229,223.75	6.71
7	CHINA SANJIANG FINE CHEMICAL	2198 HK	3,134,335.09	6.52
8	MINTH GROUP LTD	425 HK	3,087,429.70	6.42
9	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	1193 HK	2,754,468.48	5.73
10	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	2689 HK	2,682,104.08	5.58
11	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	2,559,492.45	5.32
12	WINTEAM PHARMACEUTICAL GROUP	570 HK	2,486,301.00	5.17
13	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	3900 HK	2,440,450.82	5.07

14	LIJUN INTL PHARMACETL HLDG	2005 HK	2, 282, 152. 19	4. 74
15	CENTRAL CHINA REAL ESTATE	832 HK	2, 266, 217. 64	4. 71
16	CHINA OVERSEAS GRAND OCEANS	81 HK	2, 258, 842. 41	4. 70
17	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	688 HK	2, 138, 142. 27	4. 44
18	XINGDA INT'L HOLDINGS	1899 HK	2, 133, 471. 29	4. 43
19	TRIGIANT GROUP LTD	1300 HK	2, 046, 642. 70	4. 25
20	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1918 HK	2, 036, 832. 09	4. 23
21	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	2007 HK	2, 006, 879. 78	4. 17
22	TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	1666 HK	1, 958, 111. 37	4. 07
23	VALUE PARTNERS GROUP LTD	806 HK	1, 910, 069. 37	3. 97
24	EIJING JINGNENG CLEAN ENE-H	579 HK	1, 862, 336. 83	3. 87
25	LE SAUNDA HOLDINGS	738 HK	1, 780, 706. 08	3. 70
26	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	2333 HK	1, 761, 072. 46	3. 66
27	BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY	963 HK	1, 735, 452. 72	3. 61
28	KINGSOFT CORP LTD	3888 HK	1, 734, 945. 16	3. 61
29	PETROCHINA CO LTD-H	857 HK	1, 570, 482. 20	3. 26
30	TRULY INTERNATIONAL HOLDINGS	732 HK	1, 547, 744. 45	3. 22
31	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	1114 HK	1, 542, 768. 82	3. 21
32	FOSUN INTERNATIONAL	656 HK	1, 529, 017. 79	3. 18
33	KAISA GROUP HOLDINGS LTD	1638 HK	1, 512, 183. 26	3. 14
34	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	489 HK	1, 494, 561. 25	3. 11
35	WEICHAI POWER CO LTD-H	2338 HK	1, 483, 838. 96	3. 08
36	HUADIAN FUXIN ENERGY CORP -H	816 HK	1, 477, 796. 56	3. 07
37	SHIMAO PROPERTY	813 HK	1, 468, 616. 40	3. 05

	HOLDINGS LTD			
38	FRANSHION PROPERTIES	817 HK	1,460,302.06	3.04
39	YASHILI INTERNATIONAL HOLDIN	1230 HK	1,437,111.90	2.99
40	TEXHONG TEXTILE GROUP	2678 HK	1,425,605.70	2.96
41	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	868 HK	1,373,769.48	2.86
42	ZHONGYU GAS HOLDINGS LTD	3633 HK	1,361,025.78	2.83
43	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	2314 HK	1,340,370.44	2.79
44	SHANGHAI FUDAN-ZHANGJIANG-H	8231 HK	1,273,545.36	2.65
45	BIOSTIME INTERNATIONAL HOLDI	1112 HK	1,262,421.07	2.62
46	SINOTRUK HONG KONG LTD	3808 HK	1,205,167.05	2.51
47	FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	1030 HK	1,200,608.06	2.50
48	SAMSONITE INTERNATIONAL SA	1910 HK	1,195,076.41	2.48
49	CHINA CITIC BANK COR	998 HK	1,194,379.54	2.48
50	GUOTAI JUNAN INTERNATIONAL	1788 HK	1,194,334.69	2.48
51	KWG PROPERTY HOLDING LTD	1813 HK	1,147,433.67	2.39
52	TIANJIN JINRAN PUBLIC UTIL-H	1265 HK	1,118,520.24	2.33
53	CHINA MERCHANTS BANK-H	3968 HK	1,115,837.77	2.32
54	HAIER ELECTRONICS GROUP CO	1169 HK	1,091,547.13	2.27
55	HUADIAN POWER INTL CORP-H	1071 HK	1,088,357.78	2.26
56	DONGYUE GROUP	189 HK	1,057,612.11	2.20
57	LEE'S PHARMACEUTICAL HLDGS	950 HK	1,031,933.90	2.15
58	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	1378 HK	1,030,391.40	2.14
59	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	2313 HK	1,010,706.00	2.10
60	CHINA OIL AND GAS	603 HK	1,005,212.93	2.09

	GROUP LTD			
61	SOHO CHINA LTD	410 HK	991,638.21	2.06
62	CHINA GAS HOLDINGS LTD	384 HK	977,663.52	2.03
63	DYNAM JAPAN HOLDINGS CO LTD	6889 HK	973,537.59	2.02
64	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	2688 HK	970,864.56	2.02
65	SJM HOLDINGS LTD	880 HK	964,422.38	2.00

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	234,360,425.26
卖出收入（成交）总额	192,858,082.68

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券资产。

8.8 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。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	YUEXIU REAL ESTATE INVEST MEN	开放式	其它基金	越秀房托资产管理有限公司	267,475.45	0.22

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。

本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

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。

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定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	—
2	应收证券清算款	5,908,223.06
3	应收股利	2,800.16
4	应收利息	2,343.39
5	应收申购款	4,734,861.24
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	10,648,227.85

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 (%)
4555	17,200.38	0.00	0.00	78,347,730.76	100.00

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	17,374.26	0.0222

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、本基金的基金经理未持有本基金。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2012年09月04日)基金份额总额	249,999,292.07
报告期期初基金份额总额	42,746,423.88
本报告期基金总申购份额	120,511,587.21
减：本报告期基金总赎回份额	84,910,280.33
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	78,347,730.76

§ 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4万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为10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		基金交易		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(%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
BOCOM International	—	20,148,086.68	4.73	—	—	—	—	—	—	354,307.28	7.41	14,694.68	5.45	—
CCB International	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
China Everbright Securities (HK) Limited	—	1,997,105.30	0.47	—	—	—	—	—	—	—	—	2,396.50	0.89	—
DBS Vickers	—	27,612,610.06	6.48	—	—	—	—	—	—	329,629.85	6.89	25,120.62	9.32	—
Goldman Sachs	—	97,084,672.11	22.80	—	—	—	—	—	—	361,324.74	7.55	49,451.31	18.35	—
HSBC	—	10,932,360.90	2.57	—	—	—	—	—	—	—	—	4,372.94	1.62	—
HAITONG INTERNATIONAL	—	6,260,976.82	1.47	—	—	—	—	—	—	—	—	6,722.92	2.49	—

Instinet Pacific Limited	—	57,945,316.68	13.61	—	—	—	—	—	—	1,202,220.81	25.13	29,574.28	10.97	—
Morgan Stanley	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Merrill Lynch	—	31,919,861.15	7.50	—	—	—	—	—	—	239,191.32	5.00	16,079.76	5.97	—
State Street Bank & Trust Company	—	152,421.70	0.04	—	—	—	—	—	—	—	—	152.42	0.06	—
Shenyin Wanguo Securities (H. K.)	—	8,599,461.45	2.02	—	—	—	—	—	—	360,364.49	7.53	9,341.55	3.47	—
UBS Securities Asia Limited	—	43,066,368.58	10.11	—	—	—	—	—	—	435,750.56	9.11	26,101.25	9.69	—
UOB Kay Hian (Hong Kong) Limited	—	86,284,308.76	20.26	—	—	—	—	—	—	1,220,786.28	25.52	53,727.40	19.94	—
安信证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
First Shanghai Securities	—	1,789,379.34	0.42	—	—	—	—	—	—	—	—	2,236.74	0.83	—
东兴证券	1	—	—	—	—	5,900,000.00	7.68	—	—	—	—	—	—	—
广发证券	1	—	—	—	—	31,500,000.00	41.02	—	—	—	—	—	—	—
国信证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

海通证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
宏源证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
红塔证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
华创证券	1	—	—	—	—	11,800,000.00	15.36	—	—	—	—	—	—	—	—
华西证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
民生证券	1	—	—	—	—	17,700,000.00	23.05	—	—	—	—	—	—	—	—
申银万国	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
湘财证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
兴业证券	1	—	—	—	—	9,900,000.00	12.89	—	—	—	—	—	—	—	—
China Merchants Securities	—	32,053,870.22	7.53	—	—	—	—	—	—	280,456.85	5.86	29,513.69	10.95	—	—
中投证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中信证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
招商证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

注：1. 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。

2. 基金债券回购交易与富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）共用交易单元。本报告期本基金新增券商交易单元：招商证券24594。其余租用券商交易单元未发生变动。

