

富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金
二〇一三年年度报告

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。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 2013 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
§2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
§3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4	管理人报告.....	9
4.1	基金管理人及基金经理.....	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核报告.....	12
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§5	托管人报告.....	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 13	
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.....	13
§6	审计报告.....	13
§7	年度财务报表.....	14
7.1	资产负债表.....	15
7.2	利润表.....	16
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4	报表附注.....	18
§8	投资组合报告.....	37
8.1	期末基金资产组合情况.....	37
8.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	38
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
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.....	44
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	44
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.....	44

8.9	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	44
8.10	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
8.11	投资组合报告附注	45
§9	基金份额持有人信息	46
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
§10	开放式基金份额变动	46
§11	重大事件揭示	46
11.1	基金份额持有人大会决议	46
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	46
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
11.4	基金投资策略的改变	47
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	47
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	47
11.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
11.8	其他重大事件	49
§12	备查文件目录	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	富国天成红利混合
基金主代码	100029
交易代码	前端交易代码：100029 后端交易代码：100030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年05月28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	3,047,505,637.61份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于红利型股票与稳健成长型股票，兼顾红利收益与资本增值；力争通过灵活合理的大类资产配置与专业的个券精选，在精细化风险管理的基础上构建优化组合，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、行业细分、公司价值评估以及组合风险管理全过程中。
业绩比较基准	中信标普 300 指数×55%+中信标普国债指数×45%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金，风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金、保本型基金与货币市场基金，属于中高风险的证券投资基金品种。

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		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	李芳菲
	联系电话	021-20361818	010-66060069
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95599
传真		021-20361616	010-63201816
注册地址		上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		上海市浦东世纪大道8号上海国金中心二期16-17层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9

邮政编码	200120	100031
法定代表人	陈敏	蒋超良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
注册登记机构	富国基金管理有限公司	上海市浦东世纪大道8号上海国金中心二期16-17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	2013年	2012年	2011年
本期已实现收益	216,979,311.43	-27,290,529.08	-24,991,265.28
本期利润	435,660,400.03	109,056,945.46	-197,286,415.86
加权平均基金份额本期利润	0.2344	0.0949	-0.2913
本期加权平均净值利润率	18.46%	8.63%	-22.71%
本期基金份额净值增长率	21.98%	7.72%	-17.29%
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
期末可供分配利润	266,322,170.03	15,522,279.05	69,959,093.85
期末可供分配基金份额利润	0.0874	0.0113	0.0830
期末基金资产净值	4,097,109,964.13	1,573,343,845.85	930,089,953.29
期末基金份额净值	1.3444	1.1473	1.1035
3.1.3 累计期末指标	2013年12月31日	2012年12月31日	2011年12月31日

基金份额累计净值增长率	68.85%	38.43%	28.51%
-------------	--------	--------	--------

注：1. 本基金合同生效日为 2008 年 5 月 28 日。

2. 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。

期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.65%	1.03%	-2.26%	0.63%	4.91%	0.40%
过去六个月	13.85%	0.96%	3.72%	0.70%	10.13%	0.26%
过去一年	21.98%	1.02%	-2.08%	0.76%	24.06%	0.26%
过去三年	8.68%	0.97%	-9.67%	0.72%	18.35%	0.25%
过去五年	112.10%	1.10%	26.87%	0.84%	85.23%	0.26%
自基金合同生效日起至今	68.85%	1.15%	-6.96%	0.96%	75.81%	0.19%

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×55%+中信标普国债指数×45%。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（benchmark_t）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_t = 55\% * [\text{中信标普 300 指数}_t / (\text{中信标普 300 指数}_{t-1}) - 1] + 45\% * [\text{中信标普国债指数}_t / (\text{中信标普国债指数}_{t-1}) - 1];$$

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

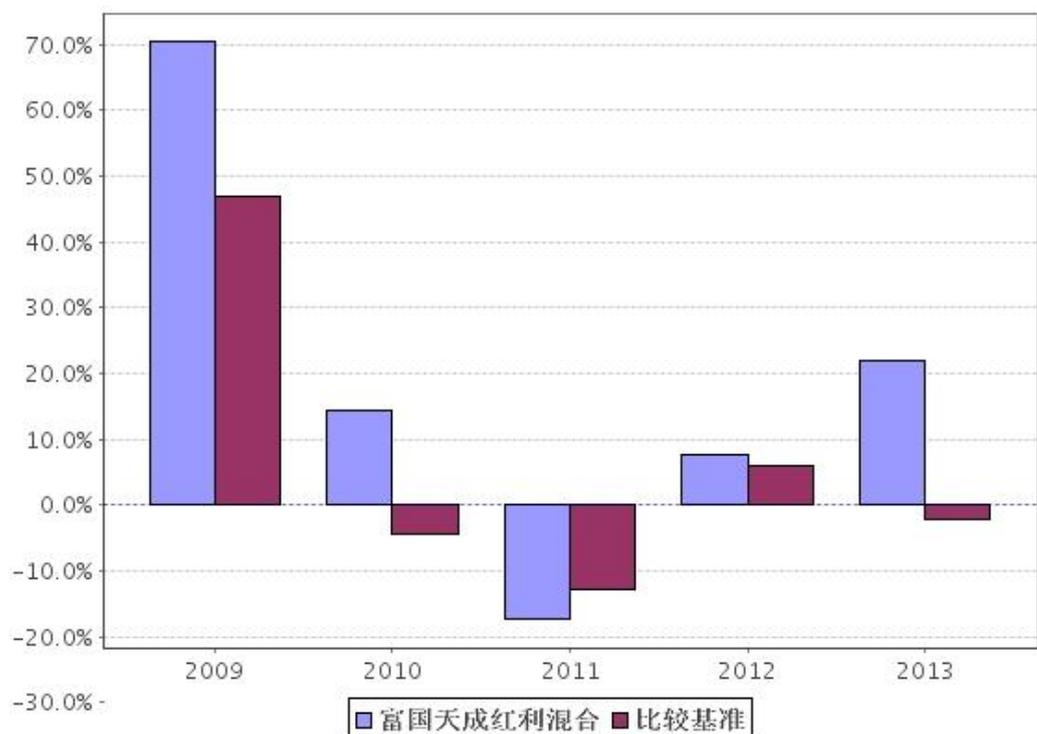
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：截止日期为 2013 年 12 月 31 日。

本基金于 2008 年 5 月 28 日成立，建仓期 6 个月，从 2008 年 5 月 28 日至 2008 年 11 月 27 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	0.500	66,220,192.65	25,525,386.86	91,745,579.51	5次分红
2012年	0.400	27,281,610.03	12,391,193.15	39,672,803.18	4次分红
2011年	1.060	41,118,313.89	17,982,838.37	59,101,152.26	7次分红
合计	1.960	134,620,116.57	55,899,418.38	190,519,534.95	—

§ 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		
于江勇	本基金基金经理兼任权益投资总监	2008-05-28	—	17年	硕士，曾任华夏证券研究所研究员；2001年4月任富国基金管理有限公司行业研究员、高级行业研究员，2008年5月至今任富国天成基金经理，兼任权益投资总监。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 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成红利灵活配置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》、《富国天成红利灵活配置混合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。

4.3 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31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，A股市场呈现显著分化，上证指数全年跌幅6.75%，但创业板指上涨82.73%，中小板综指上涨26.34%。这是继2010年后的第二次显著分化，有过之而无不及。从行业上看，不但电子、软件、医药等行业表现良好，而且传媒板块大幅上涨，这是创业板获得巨大涨幅的重要因素。

在中国经济结构调整、增长方式转型的大背景下，本基金在均衡配置的同时，坚持了精选优质成长股的长期投资策略。但由于市场整体已经偏重成长，本基金的成长风格已显得不是很激进。

在操作方面，2013年表现好的方面是：个股选择，通过自下而上选择了一批表现良好的个股。

2013年表现不好的方面：第一是风格不够激进，部分传统行业估值大幅下降，对组合产生损失。而且市场风格大幅分化使得仓位选择失效。例如6月份，尽管指数下跌，中小板和创业板的上涨使得保持低仓位的策略没有显著收益；第二是对传媒行业配置不够。

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1.3444元，份额累计净值为1.6354元。报告期内，本基金份额净值增长率为21.98%，同期业绩比较基准收益率为-2.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年，我们判断中国经济处于底部区域，“弱复苏”即使存在，也不明显。但另一方面，这种底部也孕育新的经济增长。因此市场整体处于震荡格局，指数上行空间受到高利率和低经济增速的限制，创业板中小板也面临扩容压力。

但是从中长期的角度看，中国经济处于转型期，全面改革已经启动，一批新兴企业面临很好的发展前景，经历多年下跌，指数下行空间不大，这些因素使我们对于中长期的行情转向乐观。

因此，我们判断 2014 年，A 股市场较为震荡，如果新股市场如期扩容，那么创业板的溢价将减少，但彻底的风格切换不太可能发生。短期，操作上我们继续强调自下而上的谨慎操作。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告

本基金管理人一贯坚持“风险管理是公司发展的生命线”的理念，并把维护持有人利益作为己任。在监察稽核基础性工作基础上，2013 年本基金管理人着重开展了如下与监察稽核有关的工作：

1、着力推进制度建设，加强制度的可操作性

根据法律法规的要求，监察稽核部结合公司运作情况，协同业务部门对现有制度和流程进行了持续修订和完善。如：修订了《富国基金管理有限公司固有资金投资管理办法》，以更切合公司对固有资金管理的需要；草拟了《富国基金管理有限公司董事、监事及员工证券交易行为管理暂行办法》，以更有效地管理从业人员的证券交易行为。

2、提高风控的主动性，提升投资风控的效率

在“事前防范为主、事中监控为辅、事后稽核为补”工作原则的指导下，监察稽核部主动梳理了投资组合的合规指标、规范了交易系统权限设置、完善了场内外交易对手库管理。此外，主动推进股指期货风控模块的改进，为确保新系统平稳有效运行，在系统风控相关模块有效性测试的基础上，还开展了后续跟踪评估，以减少新系统可能带来的不兼容风险。

3、积极开展合规培训，提升全员业务合规意识

为提高业务部门一线风控水平，在各部门自学法律法规的基础上，监察稽核部门还邀请外部律师开展专题讲座培训，结合工作实际的培训内容，以深入浅出的培训内容和形式，及时、有效地传达最新的法律法规，既提升了员工的风险合规意识，又使公司及业务的内部控制和风险管理得到夯实和优化。

4、全面加强合规管理，深化业务开展的合规性

立足于“及时掌握监管动态，熟练知晓法律要求、全面提高服务水平”，监察稽核部通过主动与业务部门沟通，切实履行合规的建言、建议权，从源头上保障业务开展的合规性，通过配合做好召开持有人大会等合规外延性工作，最大限度地发挥合规管理工作的协同效应。此外，结合常规的季度监察稽核工作，有针对性地开展了六次专项审计，严格规范基金运作和公司经营所涉及的业务流程。

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

本基金对 2013 年报告期内利润共进行六次收益分配。分别于 2013 年 03 月 01 日公告每 10 份基金份额派发红利 0.10 元; 2013 年 05 月 02 日公告每 10 份基金份额派发红利 0.10 元; 2013 年 07 月 01 日公告每 10 份基金份额派发红利 0.10 元; 2013 年 09 月 02 日公告每 10 份基金份额派发红利 0.10 元; 2013 年 11 月 01 日公告每 10 份基金份额派发红利 0.10 元; 2014 年 1 月 2 日公告每 10 份基金份额派发红利 0.10 元; 共计派发 2013 年度红利 122,318,630.99 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

在托管富国天成红利灵活配置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《富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》的约定, 对富国天成红利灵活配置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成红利灵活配置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成红利灵活配置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, 未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的富国天成红利灵活配置混

	<p>合型证券投资基金财务报表,包括 2013 年 12 月 31 日的资产负债表和 2013 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p>	
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是基金管理人富国基金管理有限公司的责任。这种责任包括:</p> <p>(1) 按照企业会计准则的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2) 设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。</p>	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	<p>我们认为,上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金 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。</p>	
注册会计师的姓名	徐 艳	黎 燕
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼	
审计报告日期	2014 年 03 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：富国天成红利灵活配置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)
资 产：		
银行存款	195,861,741.03	190,551,695.52
结算备付金	5,940,132.50	2,675,156.45
存出保证金	629,967.77	532,443.35
交易性金融资产	3,559,801,280.55	1,339,875,301.30
其中：股票投资	2,866,366,548.86	1,097,888,374.76
基金投资	—	—
债券投资	693,434,731.69	241,986,926.54
资产支持证券投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	270,491,125.74	150,000,000.00
应收证券清算款	43,335,263.15	34,254,855.84
应收利息	16,511,227.60	5,919,625.32
应收股利	—	—
应收申购款	92,633,782.63	704,168.28
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	4,185,204,520.97	1,724,513,246.06
负债和所有者权益	本期末 (2013年12月31日)	上年度末 (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	77,398,436.99	93,473,208.17
应付赎回款	2,675,608.44	53,112,565.66
应付管理人报酬	4,288,767.63	1,931,033.26
应付托管费	714,794.60	321,838.88
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	1,990,737.95	818,910.28
应交税费	822,054.20	640,866.20
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	204,157.03	870,977.76

负债合计	88,094,556.84	151,169,400.21
所有者权益：		
实收基金	3,047,505,637.61	1,371,375,552.29
未分配利润	1,049,604,326.52	201,968,293.56
所有者权益合计	4,097,109,964.13	1,573,343,845.85
负债和所有者权益总计	4,185,204,520.97	1,724,513,246.06

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3444 元，基金份额总额 3,047,505,637.61 份。

7.2 利润表

会计主体：富国天成红利灵活配置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)
一、收入	486,617,214.55	135,465,935.71
1. 利息收入	27,417,694.05	10,706,630.83
其中：存款利息收入	1,402,936.50	1,092,450.14
债券利息收入	15,896,033.09	9,169,566.70
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	10,118,724.46	444,613.99
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	239,538,661.47	-12,073,513.66
其中：股票投资收益	212,996,353.16	-31,188,293.05
基金投资收益	—	—
债券投资收益	6,064,758.18	5,717,780.97
资产支持证券投资收益	—	—
衍生工具投资收益	—	—
股利收益	20,477,550.13	13,396,998.42
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	218,681,088.60	136,347,474.54
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	979,770.43	485,344.00
减：二、费用	50,956,814.52	26,408,990.25
1. 管理人报酬	35,182,911.47	18,904,452.26
2. 托管费	5,863,818.57	3,150,742.07
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	9,317,968.72	4,154,562.63
5. 利息支出	280,949.97	4,094.75
其中：卖出回购金融资产支出	280,949.97	4,094.75
6. 其他费用	311,165.79	195,138.54

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	435,660,400.03	109,056,945.46
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	435,660,400.03	109,056,945.46

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国天成红利灵活配置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）	1,371,375,552.29	201,968,293.56	1,573,343,845.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	435,660,400.03	435,660,400.03
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）	1,676,130,085.32	503,721,212.44	2,179,851,297.76
其中：1. 基金申购款	2,266,533,117.44	668,992,491.68	2,935,525,609.12
2. 基金赎回款	-590,403,032.12	-165,271,279.24	-755,674,311.36
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）	—	-91,745,579.51	-91,745,579.51
五、期末所有者权益（基金净值）	3,047,505,637.61	1,049,604,326.52	4,097,109,964.13
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）	842,846,862.25	87,243,091.04	930,089,953.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	109,056,945.46	109,056,945.46
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）	528,528,690.04	45,341,060.24	573,869,750.28
其中：1. 基金申购款	875,899,482.31	85,648,248.75	961,547,731.06
2. 基金赎回款	-347,370,792.27	-40,307,188.51	-387,677,980.78
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）	—	-39,672,803.18	-39,672,803.18
五、期末所有者权益（基金净值）	1,371,375,552.29	201,968,293.56	1,573,343,845.85

注：所附附注为本会计报表的组成部分

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

富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金（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[2008]317号文《关于核准富国天成红利灵活配置混合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 2008 年 5 月 28 日正式生效，首次设立募集规模为 341,107,991.95 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及注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市 的股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具或金融衍生工具。本基金业绩比较基准为中信标普 300 指数×55%+中信标普国债指数×45%。

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制定的《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。

7.4.4.1 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、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

(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。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

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；

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；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

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

卖出股票于交易日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于交易日结转；

(2) 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本，按交易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

行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；
卖出债券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；

(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；

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

(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(2)、(3)中相关原则进行计算；

(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）在实际持有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

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。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 股票投资

(1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的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，按最近交易日的收盘价估值；如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，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。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市的股票的估值

A. 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；

B. 首次公开发行的股票，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，按其成本价计算；

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；

C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 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的首次取得成本时，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；

b. 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的非公开发行股票的初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理；

2) 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的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，按最近交易日的收盘价估值；如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，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。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场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。估值日无交易的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，按最近交易日债券收盘净价估值；如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，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。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，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，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

3) 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的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，按最近交易日的收盘价估值；如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，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。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市流通的权证，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，按成本计量；

(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；

4) 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 2)、3) 中的相关原则进行估值；

5) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，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方法估值；

(2) 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

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) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 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；

(5) 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；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 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；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 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；

(10) 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 1.50%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 0.25%的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购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；

(4) 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) 基金收益分配比例按有关规定制定；
- (2) 本基金每年收益分配次数最多为 12 次，年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的 50%；
- (3) 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按除息日的基金份额净值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；
- (4) 基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- (5) 基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；
- (6) 本基金采用的定期收益分配机制：
 - a. 分红周期、分红额度的约定与公告：本基金管理人将遵循“谨慎性原则”、“稳健性原则”、“合理性原则”与“可行性原则”，在对本基金实际投资运作进行充分分析的基础上，结合对未来宏观、中观、微观环境的理性判断与合理预期，运用历史数据模拟、情景分析、压力测试等分析手段，通过测算，拟定当年分红周期（每季、双月、每月等）与预定分红数额（例如：每 10 份基金份额分红 0.10 元）。本基金管理人将于每年年初（不迟于 1 月 20 日）向基金份额持有人公布当年预定方案；基金合同生效所在年度，本基金管理人将最迟于本基金建仓期届满（即基金合同生效后 6 个月）后择时公布当年预定方案；
 - b. 分红结算日：收益分配周期的最后一个工作日（若收益分配周期为季度，则为每季度最后一个工作日；若支付周期为双月，则为第二个月最后一个工作日，若支付周期为月度，则为每月最后一个工作日）；
 - c. 分红前提：分红结算日基金份额净值超过 1.00 元，且基金产生已实现收益；
 - d. 分红规则：在分红结算日，当本基金满足《基金合同》分红条件且已实现收益高于预定分红数额时，本基金管理人将分配预定分红数额；当本基金满足《基金合同》分红条件但已实现收益不高于预定分红数额时，本基金管理人将全额分配已实现收益（每份基金份额的最小分配单位为 0.1 分）；
 - e. 分红登记日与除权日：基金管理人于分红结算日（T 日）决定是否分红，若确定分红，经基金托管人核实后，T+1 日为权益登记日，T+2 日为除权日；
 - f. 在当年最后一个分红周期，若本基金按照预定分红数额分配后，仍无法满足《基金合同》规定的“年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的 50%”时，本基金管理人有权提高当年最后一个分红周期的分红数额，以满足上述的收益分配原则；
- (7) 本基金约定于每个周期内结算收益，但并不保证每个周期一定能够实现分红；
- (8) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配一次，但若基金合同生效不满 3 个月则不进行收益分配；
- (9) 每一基金份额享有同等分配权；
- (10) 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

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流

普通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

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	195,861,741.03	190,551,695.52
定期存款	—	—
其中：存款期限1-3个月	—	—
其他存款	—	—
合计	195,861,741.03	190,551,695.52

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。

7.4.7.2 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	2,647,112,254.68	2,866,366,548.86	219,254,294.18	
债券	交易所市场	396,531,944.23	395,200,731.69	-1,331,212.54
	银行间市场	301,031,688.21	298,234,000.00	-2,797,688.21
	合计	697,563,632.44	693,434,731.69	-4,128,900.75
资产支持证券	—	—	—	
其他	—	—	—	
合计	3,344,675,887.12	3,559,801,280.55	215,125,393.43	
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	1,107,115,035.89	1,097,888,374.76	-9,226,661.13	
债券	交易所市场	195,498,987.29	201,267,926.54	5,768,939.25
	银行间市场	40,816,973.29	40,719,000.00	-97,973.29
	合计	236,315,960.58	241,986,926.54	5,670,965.96
资产支持证券	—	—	—	
其他	—	—	—	
合计	1,343,430,996.47	1,339,875,301.30	-3,555,695.17	

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

金额单位：人民币元

项目	本期末（2013年12月31日）	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间	270,491,125.74	0.00
合计	270,491,125.74	0.00

金额单位：人民币元

项目	上年度末（2012年12月31日）	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所	150,000,000.00	0.00
合计	150,000,000.00	0.00

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	52,347.42	33,826.10
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	2,673.10	1,203.80
应收债券利息	15,974,730.54	5,853,405.40
应收买入返售证券利息	481,193.14	31,190.02
应收申购款利息	—	—
其他	283.40	—
合计	16,511,227.60	5,919,625.32

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 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	1,982,913.19	817,337.29
银行间市场应付交易费用	7,824.76	1,572.99
合计	1,990,737.95	818,910.28

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	—	500,000.00
应付赎回费	12,153.80	200,977.76

其他	12,000.00	—
预提审计费	80,000.00	70,000.00
预提信息披露费	100,003.23	100,000.00
合计	204,157.03	870,977.76

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	1,371,375,552.29	1,371,375,552.29
本期申购	2,266,533,117.44	2,266,533,117.44
本期赎回（以“-”号填列）	-590,403,032.12	-590,403,032.12
本期末	3,047,505,637.61	3,047,505,637.61

注：申购含红利再投资、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	15,522,279.05	186,446,014.51	201,968,293.56
本期利润	216,979,311.43	218,681,088.60	435,660,400.03
本期基金份额交易产生的变动数	125,566,159.06	378,155,053.38	503,721,212.44
其中：基金申购款	166,637,811.72	502,354,679.96	668,992,491.68
基金赎回款	-41,071,652.66	-124,199,626.58	-165,271,279.24
本期已分配利润	-91,745,579.51	—	-91,745,579.51
本期末	266,322,170.03	783,282,156.49	1,049,604,326.52

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01月01日至2012年12月31日)
活期存款利息收入	1,223,766.88	1,064,649.70
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	75,686.26	27,800.44
其他	103,483.36	—
合计	1,402,936.50	1,092,450.14

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01月01日至2012年12月31日)
卖出股票成交总额	2,632,730,414.64	1,272,433,548.92
减：卖出股票成本总额	2,419,734,061.48	1,303,621,841.97
买卖股票差价收入	212,996,353.16	-31,188,293.05

7.4.7.13 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	479,953,809.01	284,688,304.76
减：卖出债券（含债转股及债券到期兑付）成本总额	459,963,987.75	269,289,294.32
减：应收利息总额	13,925,063.08	9,681,229.47
债券投资收益	6,064,758.18	5,717,780.97

7.4.7.14 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。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 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。

7.4.7.15.2 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。

7.4.7.16 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	20,477,550.13	13,396,998.42
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	20,477,550.13	13,396,998.42

7.4.7.17 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	218,681,088.60	136,347,474.54
股票投资	228,480,955.31	134,293,670.62
债券投资	-9,799,866.71	2,053,803.92
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	218,681,088.60	136,347,474.54

7.4.7.18 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	849,752.87	216,819.43
基金转换费收入	93,112.00	268,101.18
其他	36,905.56	—
印花税返还	—	423.39
合计	979,770.43	485,344.00

7.4.7.19 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	9,308,568.72	4,153,612.63
银行间市场交易费用	9,400.00	950.00
合计	9,317,968.72	4,154,562.63

7.4.7.20 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	80,000.00	70,000.00
信息披露费	200,003.23	100,000.00
银行费用	13,162.56	7,138.54
债券账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	311,165.79	195,138.54

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于资产负债表日之后、年度报告批准报出日之前批准、公告或实施的利润分配的情况如下：

2014年1月2日登记日、1月3日除息日对本基金份额持有人按每10份基金份额分配人民币0.10元进行分红，实际分配收益为人民币30,573,051.48元，其中现金分红22,780,838.10元，再投资分红7,792,213.38元。

2014年3月3日登记日、3月4日除息日对本基金份额持有人按每10份基金份额分配人民币0.10元进行分红，实际分配收益为人民币34,898,080.93元，其中现金分红26,293,559.11元，再投资分红8,604,521.82元。

除以上情况之外，无其他需要说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 回购交易

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回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均没有应支付的关联方佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 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	35,182,911.47	18,904,452.26
其中：支付销售机构的客户维护费	1,429,196.43	958,518.68

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%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。

7.4.10.2.2 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	5,863,818.57	3,150,742.07

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。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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	195,861,741.03	1,223,766.88	190,551,695.52	1,064,649.70

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放	再投资形式发放	利润分配合计
1	2013-03-01	2013-03-04	0.100	11,497,452.94	4,715,827.27	16,213,280.21
2	2013-05-02	2013-05-03	0.100	11,249,306.27	4,961,892.71	16,211,198.98
3	2013-07-01	2013-07-02	0.100	13,143,535.31	5,203,252.03	18,346,787.34
4	2013-09-02	2013-09-03	0.100	13,568,825.03	5,371,030.57	18,939,855.60
5	2013-11-01	2013-11-04	0.100	16,761,073.10	5,273,384.28	22,034,457.38
合计			0.500	66,220,192.65	25,525,386.86	91,745,579.51

注：本基金于资产负债表日之后、财务报表批准报出日之前批准、公告或实施的利润分配情况请参见资产负债表日后事项（附注7.4.8.2）。

7.4.12 期末（2013年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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。

7.4.12.2 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
002021	中捷股份	2013-12-25	筹划重大事项	6.12	2014-03-10	6.73	2,674,884	13,272,663.21	16,370,290.08	—
600141	兴发集团	2013-12-20	筹划重大事项	12.48	2014-01-27	13.28	583,789	7,579,355.44	7,285,686.72	—

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

本期末（2013年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	195,861,741.03	—	—	—	—	—	195,861,741.03
结算备付金	5,940,132.50	—	—	—	—	—	5,940,132.50
存出保证金	629,967.77	—	—	—	—	—	629,967.77
交易性金融资产	100,610,000.00	119,468,824.35	342,259,504.84	121,338,404.80	9,757,997.70	2,866,366,548.86	3,559,801,280.55
买入返售金融资产	270,491,125.74	—	—	—	—	—	270,491,125.74
应收证券清算款	—	—	—	—	—	43,335,263.15	43,335,263.15
应收利息	—	—	—	—	—	16,511,227.60	16,511,227.60
应收申购款	26,521,146.92	—	—	—	—	66,112,635.71	92,633,782.63
资产总计	600,054,113.96	119,468,824.35	342,259,504.84	121,338,404.80	9,757,997.70	2,992,325,675.32	4,185,204,520.97
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	77,398,436.99	77,398,436.99
应付赎回款	—	—	—	—	—	2,675,608.44	2,675,608.44
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	4,288,767.63	4,288,767.63
应付托管费	—	—	—	—	—	714,794.60	714,794.60
应付交易费用	—	—	—	—	—	1,990,737.95	1,990,737.95
应付税费	—	—	—	—	—	822,054.20	822,054.20
其他负债	—	—	—	—	—	204,157.03	204,157.03
负债总计	—	—	—	—	—	88,094,556.84	88,094,556.84
利率敏感度缺口	600,054,113.96	119,468,824.35	342,259,504.84	121,338,404.80	9,757,997.70	2,904,231,118.48	4,097,109,964.13
上年度末（2012年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计

月 31 日)							
资产							
银行存款	190,551,695.52	—	—	—	—	—	190,551,695.52
结算备付金	2,675,156.45	—	—	—	—	—	2,675,156.45
存出保证金	—	—	—	—	—	532,443.35	532,443.35
交易性金融资产	—	—	29,425,185.50	194,647,188.24	17,914,552.80	1,097,888,374.76	1,339,875,301.30
买入返售金融资产	150,000,000.00	—	—	—	—	—	150,000,000.00
应收证券清算款	—	—	—	—	—	34,254,855.84	34,254,855.84
应收利息	—	—	—	—	—	5,919,625.32	5,919,625.32
应收申购款	—	—	—	—	—	704,168.28	704,168.28
资产总计	343,226,851.97	—	29,425,185.50	194,647,188.24	17,914,552.80	1,139,299,467.55	1,724,513,246.06
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	93,473,208.17	93,473,208.17
应付赎回款	—	—	—	—	—	53,112,565.66	53,112,565.66
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	1,931,033.26	1,931,033.26
应付托管费	—	—	—	—	—	321,838.88	321,838.88
应付交易费用	—	—	—	—	—	818,910.28	818,910.28
应付税费	—	—	—	—	—	640,866.20	640,866.20
其他负债	—	—	—	—	—	870,977.76	870,977.76
负债总计	—	—	—	—	—	151,169,400.21	151,169,400.21
利率敏感度缺口	343,226,851.97	—	29,425,185.50	194,647,188.24	17,914,552.80	988,130,067.34	1,573,343,845.85

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

假设	1. 影响生息资产的其他变量不变，仅利率发生变动； 2. 利率变动范围合理。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）	
		本期末(2013年12月31日)	上年度末(2012年12月31日)
	1. 基准点利率增加 0.1%	-846,568.46	-751,277.22
2. 基准点利率减少 0.1%	846,568.46	751,277.22	

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具或金融衍生工具。其中，股票资产的投资比例占基金资产的30%-80%；权证资产的投资比例占基金资产净值的0-3%；债券资产的投资比例占基金资产的15%-65%，其中资产支持证券类资产占基金资产净值的0-20%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：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）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	2,866,366,548.86	69.96	1,097,888,374.76	69.78
交易性金融资产—债券投资	693,434,731.69	16.92	241,986,926.54	15.38
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—

合计	3,559,801,280.55	86.89	1,339,875,301.30	85.16
----	------------------	-------	------------------	-------

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关； 2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：元）	
		本期末（2013年12月 31日）	上年度末（2012年12月 31日）
	1. 业绩比较基准增加1%	47,709,084.81	21,220,279.53
	2. 业绩比较基准减少1%	-47,709,084.81	-21,220,279.53

7.4.14 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	2,866,366,548.86	68.49
	其中：股票	2,866,366,548.86	68.49
2	固定收益投资	693,434,731.69	16.57
	其中：债券	693,434,731.69	16.57
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	—	—
4	买入返售金融资产	270,491,125.74	6.46
	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	201,801,873.53	4.82
6	其他各项资产	153,110,241.15	3.66

7	合计	4,185,204,520.97	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	6,879,861.66	0.17
B	采矿业	58,754,541.29	1.43
C	制造业	1,831,141,187.19	44.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,808,379.45	0.75
E	建筑业	726,630.80	0.02
F	批发和零售业	213,154,508.15	5.20
G	交通运输、仓储和邮政业	22,009,240.49	0.54
H	住宿和餐饮业	31,504,707.72	0.77
I	信息传输、软件和信息技术服务业	339,099,813.88	8.28
J	金融业	174,043,651.48	4.25
K	房地产业	95,073,124.07	2.32
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	17,020,770.48	0.42
N	水利、环境和公共设施管理业	12,710,560.80	0.31
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	29,548,523.40	0.72
S	综合	3,891,048.00	0.09
	合计	2,866,366,548.86	69.96

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601166	兴业银行	9,464,362	95,968,630.68	2.34
2	300253	卫宁软件	802,548	58,273,010.28	1.42
3	600150	中国船舶	2,285,098	55,276,520.62	1.35
4	000651	格力电器	1,649,643	53,877,340.38	1.32
5	600372	中航电子	2,247,392	53,622,773.12	1.31
6	300287	飞利信	1,639,773	53,095,849.74	1.30
7	600637	百视通	1,381,977	51,091,689.69	1.25
8	600309	万华化学	2,454,595	50,810,116.50	1.24
9	300217	东方电热	2,535,258	47,789,613.30	1.17
10	002271	东方雨虹	1,661,757	43,820,532.09	1.07
11	000423	东阿阿胶	1,061,593	41,996,619.08	1.03
12	002450	康得新	1,720,420	41,806,206.00	1.02
13	002153	石基信息	859,162	40,793,011.76	1.00

14	002422	科伦药业	863,710	39,635,651.90	0.97
15	600208	新湖中宝	12,038,835	38,524,272.00	0.94
16	600060	海信电器	3,237,434	37,359,988.36	0.91
17	000581	威孚高科	1,205,250	37,121,700.00	0.91
18	002176	江特电机	3,273,125	36,495,343.75	0.89
19	600703	三安光电	1,463,272	36,274,512.88	0.89
20	600583	海油工程	4,644,175	36,038,798.00	0.88
21	601318	中国平安	862,400	35,987,952.00	0.88
22	600887	伊利股份	902,309	35,262,235.72	0.86
23	600062	华润双鹤	1,554,789	34,780,629.93	0.85
24	600894	广日股份	2,863,292	34,416,769.84	0.84
25	600406	国电南瑞	2,218,808	32,993,674.96	0.81
26	600276	恒瑞医药	839,012	31,865,675.76	0.78
27	600754	锦江股份	1,966,586	31,504,707.72	0.77
28	000550	江铃汽车	1,201,104	30,520,052.64	0.74
29	002223	鱼跃医疗	1,326,474	30,296,666.16	0.74
30	000024	招商地产	1,455,769	30,250,879.82	0.74
31	000921	海信科龙	2,581,363	30,098,692.58	0.73
32	600118	中国卫星	1,597,601	29,603,546.53	0.72
33	300133	华策影视	926,286	29,548,523.40	0.72
34	601933	永辉超市	2,219,247	29,493,792.63	0.72
35	600089	特变电工	2,712,849	29,081,741.28	0.71
36	002226	江南化工	2,026,072	28,709,440.24	0.70
37	600699	均胜电子	1,833,147	28,248,795.27	0.69
38	600858	银座股份	3,735,914	28,243,509.84	0.69
39	600694	大商股份	925,816	26,737,566.08	0.65
40	600048	保利地产	3,187,633	26,297,972.25	0.64
41	601607	上海医药	1,682,703	24,887,177.37	0.61
42	002214	大立科技	1,601,571	24,327,863.49	0.59
43	002648	卫星石化	820,658	23,782,668.84	0.58
44	002111	威海广泰	2,300,337	23,463,437.40	0.57
45	000800	一汽轿车	1,947,980	23,180,962.00	0.57
46	002421	达实智能	1,283,798	23,044,174.10	0.56
47	300045	华力创通	885,945	22,060,030.50	0.54
48	600893	航空动力	1,147,159	21,945,151.67	0.54
49	300157	恒泰艾普	932,955	21,877,794.75	0.53
50	600171	上海贝岭	2,404,157	21,709,537.71	0.53
51	002385	大北农	1,302,264	21,292,016.40	0.52
52	300196	长海股份	775,608	21,282,683.52	0.52
53	600855	航天长峰	1,307,291	20,642,124.89	0.50
54	002581	万昌科技	1,411,902	20,599,650.18	0.50

55	002311	海大集团	1,754,467	20,597,442.58	0.50
56	600316	洪都航空	1,178,300	20,478,854.00	0.50
57	002550	千红制药	576,265	20,353,679.80	0.50
58	600511	国药股份	1,053,023	19,870,544.01	0.48
59	002353	杰瑞股份	249,012	19,764,082.44	0.48
60	000712	锦龙股份	849,590	19,498,090.50	0.48
61	600562	国睿科技	431,422	19,452,817.98	0.47
62	300119	瑞普生物	731,331	18,590,434.02	0.45
63	300005	探路者	1,158,920	18,426,828.00	0.45
64	300123	太阳鸟	1,053,842	18,073,390.30	0.44
65	002085	万丰奥威	865,452	17,724,456.96	0.43
66	601006	大秦铁路	2,356,091	17,411,512.49	0.42
67	600536	中国软件	458,639	17,276,931.13	0.42
68	002484	江海股份	848,473	17,147,639.33	0.42
69	300215	电科院	702,177	17,020,770.48	0.42
70	300085	银之杰	604,419	16,923,732.00	0.41
71	600824	益民集团	3,027,503	16,802,641.65	0.41
72	600859	王府井	923,170	16,764,767.20	0.41
73	000001	平安银行	1,361,735	16,681,253.75	0.41
74	002612	朗姿股份	593,022	16,592,755.56	0.40
75	002021	中捷股份	2,674,884	16,370,290.08	0.40
76	600066	宇通客车	891,900	15,661,764.00	0.38
77	000999	华润三九	625,346	15,564,861.94	0.38
78	600521	华海药业	1,132,392	15,343,911.60	0.37
79	600499	科达机电	759,348	15,255,301.32	0.37
80	000876	新希望	1,053,427	15,095,608.91	0.37
81	002630	华西能源	580,798	14,996,204.36	0.37
82	600729	重庆百货	649,555	14,147,307.90	0.35
83	002410	广联达	443,188	13,960,422.00	0.34
84	600685	广船国际	775,468	13,113,163.88	0.32
85	002701	奥瑞金	342,117	13,092,817.59	0.32
86	600782	新钢股份	4,172,507	12,934,771.70	0.32
87	300258	精锻科技	1,003,937	12,890,551.08	0.31
88	002693	双成药业	816,174	12,813,931.80	0.31
89	000748	长城信息	704,734	12,805,016.78	0.31
90	000826	桑德环境	365,246	12,710,560.80	0.31
91	300224	正海磁材	849,237	12,662,123.67	0.31
92	600739	辽宁成大	717,077	12,577,530.58	0.31
93	000657	中钨高新	1,031,909	12,475,779.81	0.30
94	600519	贵州茅台	95,312	12,236,154.56	0.30
95	600036	招商银行	1,072,453	11,679,013.17	0.29

96	300212	易华录	402,342	11,354,091.24	0.28
97	300074	华平股份	502,822	11,283,325.68	0.28
98	002241	歌尔声学	315,678	11,073,984.24	0.27
99	600016	民生银行	1,414,979	10,923,637.88	0.27
100	600803	威远生化	873,263	10,837,193.83	0.26
101	002215	诺普信	1,053,770	10,126,729.70	0.25
102	300210	森远股份	467,290	9,883,183.50	0.24
103	002486	嘉麟杰	1,258,661	9,729,449.53	0.24
104	600990	四创电子	320,743	9,051,367.46	0.22
105	600292	中电远达	348,345	9,018,652.05	0.22
106	002063	远光软件	463,234	9,009,901.30	0.22
107	601616	广电电气	2,130,139	8,392,747.66	0.20
108	000028	国药一致	178,619	8,270,059.70	0.20
109	002371	七星电子	351,911	7,569,605.61	0.18
110	000778	新兴铸管	1,181,023	7,523,116.51	0.18
111	600563	法拉电子	326,989	7,425,920.19	0.18
112	002662	京威股份	1,007,278	7,403,493.30	0.18
113	600141	兴发集团	583,789	7,285,686.72	0.18
114	002041	登海种业	197,754	6,879,861.66	0.17
115	300325	德威新材	612,439	6,620,465.59	0.16
116	002341	新纶科技	387,000	6,412,590.00	0.16
117	002594	比亚迪	169,689	6,393,881.52	0.16
118	000960	锡业股份	584,278	6,240,089.04	0.15
119	002437	誉衡药业	147,817	6,223,095.70	0.15
120	300309	吉艾科技	323,172	6,214,597.56	0.15
121	600827	友谊股份	583,300	5,757,171.00	0.14
122	601989	中国重工	1,000,000	5,610,000.00	0.14
123	300019	硅宝科技	460,109	5,571,919.99	0.14
124	300024	机器人	114,367	5,569,672.90	0.14
125	002079	苏州固锝	893,596	5,424,127.72	0.13
126	600270	外运发展	451,200	4,597,728.00	0.11
127	300057	万顺股份	394,736	4,559,200.80	0.11
128	000400	许继电气	145,421	4,521,138.89	0.11
129	002227	奥特迅	153,521	4,475,137.15	0.11
130	600019	宝钢股份	1,078,113	4,409,482.17	0.11
131	300095	华伍股份	327,549	4,353,126.21	0.11
132	002327	富安娜	287,216	4,293,879.20	0.10
133	600079	人福医药	146,957	4,166,230.95	0.10
134	600879	航天电子	432,109	4,044,540.24	0.10
135	601258	庞大集团	798,258	3,999,272.58	0.10
136	002179	中航光电	239,900	3,994,335.00	0.10

137	000725	京东方A	1,845,900	3,968,685.00	0.10
138	600256	广汇能源	445,200	3,891,048.00	0.09
139	000932	华菱钢铁	1,948,100	3,779,314.00	0.09
140	002465	海格通信	172,615	3,586,939.70	0.09
141	002456	欧菲光	66,900	3,216,552.00	0.08
142	300303	聚飞光电	154,272	3,086,982.72	0.08
143	600280	中央商场	237,620	3,046,288.40	0.07
144	300003	乐普医疗	181,744	3,044,212.00	0.07
145	000783	长江证券	269,535	2,803,164.00	0.07
146	600778	友好集团	275,823	2,556,879.21	0.06
147	600207	安彩高科	467,681	2,291,636.90	0.06
148	600970	中材国际	198,672	1,648,977.60	0.04
149	600422	昆明制药	67,700	1,597,043.00	0.04
150	000898	*ST 鞍钢	482,900	1,550,109.00	0.04
151	300030	阳普医疗	82,076	1,445,358.36	0.04
152	601231	环旭电子	62,382	1,313,141.10	0.03
153	600580	卧龙电气	188,067	1,171,657.41	0.03
154	600267	海正药业	63,264	937,572.48	0.02
155	300164	通源石油	50,754	837,948.54	0.02
156	300298	三诺生物	10,600	729,916.00	0.02
157	002482	广田股份	37,073	726,630.80	0.02
158	002571	德力股份	68,000	721,480.00	0.02
159	002028	思源电气	20,050	298,745.00	0.01
160	601100	恒立油缸	6,004	72,588.36	0.00

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	600016	民生银行	94,276,298.18	5.99
2	601166	兴业银行	79,907,493.39	5.08
3	600372	中航电子	66,417,398.40	4.22
4	000423	东阿阿胶	61,619,592.68	3.92
5	600637	百视通	59,505,673.30	3.78
6	600309	万华化学	57,927,858.37	3.68
7	600060	海信电器	51,349,508.13	3.26
8	600150	中国船舶	50,107,668.89	3.18
9	601318	中国平安	45,732,877.36	2.91
10	000651	格力电器	44,590,225.94	2.83
11	601006	大秦铁路	42,858,892.95	2.72
12	002701	奥瑞金	42,176,678.90	2.68

13	600316	洪都航空	40,563,965.10	2.58
14	000024	招商地产	40,259,970.35	2.56
15	002353	杰瑞股份	39,936,081.84	2.54
16	600030	中信证券	38,532,745.87	2.45
17	600048	保利地产	38,198,381.19	2.43
18	600583	海油工程	38,020,444.37	2.42
19	600406	国电南瑞	37,932,755.69	2.41
20	000002	万科A	37,356,348.38	2.37
21	600887	伊利股份	37,251,472.32	2.37
22	000063	中兴通讯	37,182,435.81	2.36
23	002176	江特电机	36,474,013.03	2.32
24	002630	华西能源	35,866,369.96	2.28
25	600062	华润双鹤	35,532,363.15	2.26
26	600894	广日股份	34,382,645.37	2.19
27	002422	科伦药业	33,663,800.69	2.14
28	601933	永辉超市	32,301,672.04	2.05
29	600118	中国卫星	32,132,003.34	2.04
30	600699	均胜电子	31,986,792.07	2.03
31	300059	东方财富	31,539,457.58	2.00

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	600016	民生银行	111,433,965.67	7.08
2	000063	中兴通讯	58,062,624.18	3.69
3	300059	东方财富	57,967,770.90	3.68
4	600521	华海药业	53,939,415.08	3.43
5	600060	海信电器	51,146,077.62	3.25
6	002570	贝因美	48,443,395.56	3.08
7	002701	奥瑞金	45,862,528.32	2.91
8	000002	万科A	38,138,869.19	2.42
9	600030	中信证券	38,111,169.55	2.42
10	601800	中国交建	33,830,910.69	2.15
11	002450	康得新	33,507,147.09	2.13
12	600048	保利地产	32,567,780.73	2.07
13	002277	友阿股份	32,505,327.32	2.07
14	600000	浦发银行	32,404,394.37	2.06
15	002353	杰瑞股份	32,107,201.31	2.04
16	300124	汇川技术	30,442,237.74	1.93
17	600372	中航电子	28,201,540.50	1.79
18	002055	得润电子	28,040,937.37	1.78
19	000625	长安汽车	27,871,270.61	1.77

20	601169	北京银行	27,318,135.90	1.74
----	--------	------	---------------	------

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	3,959,731,280.27
卖出股票收入（成交）总额	2,632,730,414.64

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	108,193,600.00	2.64
2	央行票据	—	—
3	金融债券	78,827,000.00	1.92
	其中：政策性金融债	78,827,000.00	1.92
4	企业债券	291,660,549.19	7.12
5	企业短期融资券	170,593,000.00	4.16
6	中期票据	38,930,000.00	0.95
7	可转债	5,230,582.50	0.13
8	其他	—	—
9	合计	693,434,731.69	16.92

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	041360002	13 广汇集团 CP001	600,000	60,582,000.00	1.48
2	041360061	13 润华 CP001	500,000	49,795,000.00	1.22
3	019307	13 国债 07	500,000	49,755,000.00	1.21
4	020062	13 贴债 04	500,000	48,703,600.00	1.19
5	122023	09 万业债	471,670	47,162,283.30	1.15

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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	629,967.77
2	应收证券清算款	43,335,263.15
3	应收股利	—
4	应收利息	16,511,227.60
5	应收申购款	92,633,782.63
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	153,110,241.15

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(%)
38266	79,640.04	2,546,609,187.46	83.56	500,896,450.15	16.44

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	1,715,377.29	0.0563

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(2008年05月28日)基金份额总额	341,107,991.95
报告期期初基金份额总额	1,371,375,552.29
本报告期基金总申购份额	2,266,533,117.44
减：本报告期基金总赎回份额	590,403,032.12
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	3,047,505,637.61

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 8 万元人民币,其已为本公司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 (%)	
中信证券	2	2,814,418,885.92	42.74	360,102,500.09	56.39	350,400,000.00	9.18	—	—	2,513,252.36	42.54	—
西部证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中银国际	1	1,483,496,639.39	22.53	20,995,974.88	3.29	—	—	—	—	1,312,747.14	22.22	—
兴业证券	1	1,602,924,814.89	24.34	183,162,600.22	28.68	3,336,000,000.00	87.41	—	—	1,459,297.56	24.70	—
中金公司	1	683,505,368.61	10.38	74,346,464.05	11.64	130,300,000.00	3.41	—	—	622,261.07	10.53	—

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。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国基金管理有限公司关于提请广大投资者持有效身份证件办理相关业务的公告	中国证券报	2013年01月04日
2	富国基金管理有限公司关于富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金2013年分红规则设定的公告	中国证券报、上海证券报	2013年01月11日
3	富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金二〇一三年第一次收益分配公告	中国证券报、上海证券报	2013年03月01日
4	富国基金管理有限公司关于撤销深圳分公司的公告	中国证券报	2013年04月18日
5	富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金二〇一三年第二次收益分配公告	中国证券报、上海证券报	2013年05月02日
6	富国基金管理有限公司关于高管人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013年06月07日
7	富国基金管理有限公司关于新增部分基金后端收费模式及后端收费模式基金转换费率计算方式变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013年06月15日
8	富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金二〇一三年第三次收益分配公告	中国证券报、上海证券报	2013年07月01日
9	富国基金管理有限公司关于设立子公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013年08月16日
10	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金最低申购金额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013年08月19日
11	富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金二〇一三年第四次收益分配公告	中国证券报、上海证券报	2013年09月02日
12	富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金二〇一三年第五次收益分配公告	中国证券报、上海证券报	2013年11月01日

§ 12 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
<p>1、中国证监会批准设立富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金的文件</p> <p>2、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金基金合同</p> <p>3、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金托管协议</p> <p>4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件</p> <p>5、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金财务报表及报表附注</p> <p>6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告</p>	<p>上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层</p>	<p>投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。</p> <p>咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）</p> <p>公 司 网 址： http://www.fullgoal.com.cn</p>