

富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金  
二〇一四年年度报告  
(摘要)

2014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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2015年03月28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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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 2014 年 1 月 1 日起至 2014 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	富国宏观策略灵活配置混合
基金主代码	000029
交易代码	前端交易代码：000029 后端交易代码：000161
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年04月12日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	525,204,673.86份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争通过灵活合理的大类资产配置与专业的个券选择，实现基金资产较高的长期回报。
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	沪深300指数收益率×65%+中债综合指数收益率×35%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	范伟隽	田青
	联系电话	021-20361818	010-67595096
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		95105686、4008880688	010-67595096
传真		021-20361616	010-66275853

### 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楼 中国建设银行股份有限公司 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

### § 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	2014 年	2013 年 4 月 12 日 (基金合同生效日) 至 2013 年 12 月 31 日
本期已实现收益	100,593,127.66	47,391,911.93
本期利润	106,451,353.53	68,086,923.25
加权平均基金份额本期利润	0.1821	0.0876
本期基金份额净值增长率	17.15%	7.20%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年 12 月 31 日	2013 年 12 月 31 日
期末可供分配基金份额利润	0.1340	0.0527
期末基金资产净值	610,064,174.79	648,377,827.78
期末基金份额净值	1.162	1.072

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	6.07%	1.39%	28.25%	1.07%	-22.18%	0.32%
过去六个月	14.27%	1.06%	39.89%	0.86%	-25.62%	0.20%
过去一年	17.15%	1.10%	36.24%	0.79%	-19.09%	0.31%
自基金合同生效日起至今	25.59%	1.12%	30.32%	0.84%	-4.73%	0.28%

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为：沪深 300 指数收益率×65%+中债综合指数收益率×35%。

沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高、流通市值大的主流股票，能够反映 A 股市场总体价格走势。中债综合指数是由中

央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

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：

$$\text{benchmarkt} = 65\% * [\text{沪深 300 指数 } t / (\text{沪深 300 指数 } t-1) - 1] + 35\% * [\text{中债综合指数 } t / (\text{中债综合指数 } t-1) - 1];$$

其中，t=1, 2, 3, ..., T, T 表示时间截至日；

期间 T 日收益率（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+benchmarkt) 数学连乘。

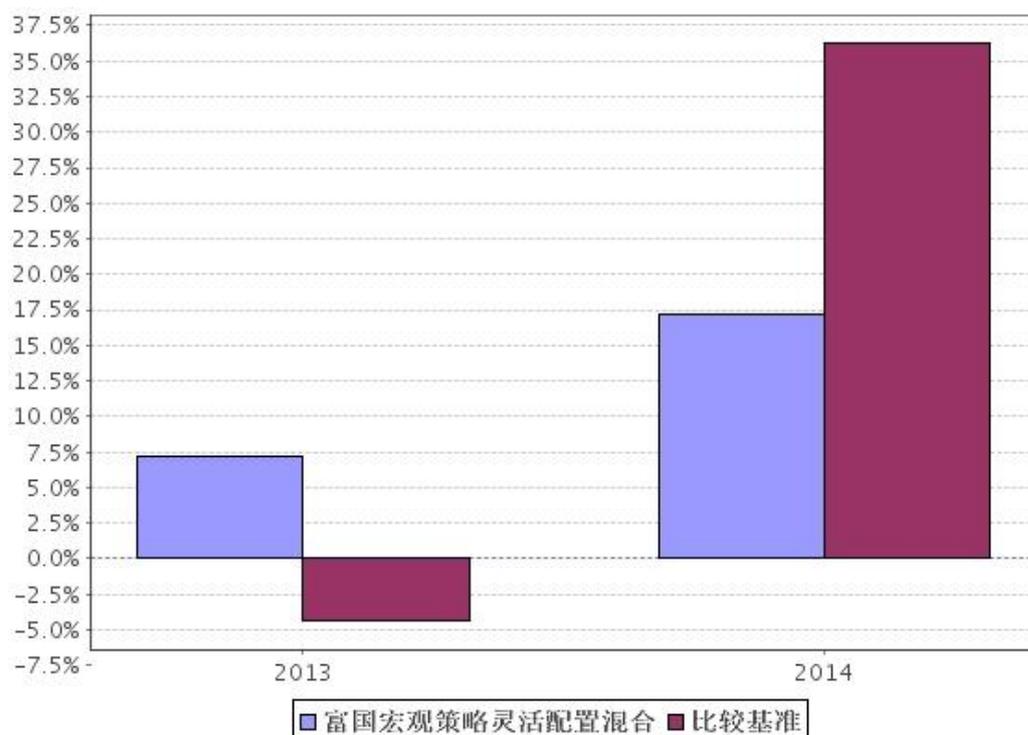
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2014 年 12 月 31 日。

2、本基金建仓期 6 个月，即从 2013 年 4 月 12 日起至 2013 年 10 月 11 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：2013 年按实际存续期计算。

### 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
2014年	1.000	39,802,223.83	12,060,340.34	51,862,564.17	1次分红
2013年	—	—	—	—	—
合计	1.000	39,802,223.83	12,060,340.34	51,862,564.17	—

注：基金合同生效日为 2013 年 4 月 12 日。

## § 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 2014 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国消费主题混合型证券投资基金、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、富国城镇发展股票型证券投资基金、富国高端制造行业股票型证券投资基金、富国收益增强债券型证券投资基金、富国新回报灵活配置混合型证券投资基金、富国研究精选灵活配置混合型证券投资基金、富国中证军工指数分级证券投资基金、富国中证移动互联网指数分级证券投资基金、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金、富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金、富国富钱包货币市场基金、富国收益宝货币市场基金等五十三只证券投资基金。

#### 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		
袁宜	本基金基金经理兼任富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2013-04-12	—	8年	博士，曾任申银万国证券研究所有限公司宏观分析师、高级宏观分析师、高级策略分析师、首席策略分析师；2011年3月加入富国基金管理有限公司，任首席经济学家兼基金经理助理；2012年10月至2014年4月29日任汉盛证券投资基金基金经理，2013年4月起任富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年4月30日起任富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

注：上述表格内基金经理的任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司决定确定的解聘日期。

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宏观策略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》、《富国宏观策略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，管理和运用基金资产，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 65 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

2014 年，中国经济波澜不惊，A 股市场在经历了上半年的窄幅波动后，于 7 月开始大幅上涨。在政府主动压低无风险利率以及 A 股市场赚钱效应的双重影响下，场外资金大举入市，场内投资者纷纷增加杠杆，由此导致股指上行势头凌厉，期间每次回调都很浅。11 月下旬以后，主板市场加速上行，并表现出明显的二八分化，大盘蓝筹股涨势迅猛。

本基金在上半年保持了相对灵活的仓位，在下半年的多数时间则维持了较高的仓位，但在 8 月有过一次并不成功的减仓，在四季度的配置相对均衡，跑输业绩基准。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.162 元，份额累计净值为 1.262 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 17.15%，同期业绩比较基准收益率为 36.24%。

## 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 2015 年，中国经济面临较大的下行压力，对通货紧缩的担忧可能升温，因而预计流动性环境将保持相对宽松，对房地产等行业的限制性政策有望继续放松。二季度以后，美联储加息的预期可能进一步引发全球资金从新兴市场的流出，并对中国的经济金融环境构成压力。

对 A 股市场而言，依旧将处于流动性主导的格局中。一方面，宽松的宏观政策环境以及居民资产的再配置将对股指构成支撑，国企改革、京津冀协同、一带一路、海西等主题热点有望轮番表现；另一方面，上市公司的利润或将表现平平，而股票供给的增加、对杠杆融资的规范以及美联储加息带动的资本外流，则会带来阶段性的剧烈震荡。相对看好金融、地产、白马成长。

## 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投资基金行业从业经验。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

本基金对 2014 年报告期内利润共进行一次收益分配。2014 年 12 月 04 日公告每 10 份基金份额派发红利 1.00 元，共计派发红利 51862564.17 元。

本基金本期分红已符合相关法律法规及《基金合同》约定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期无需要说明的相关情形。

### § 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 51,862,564.17 元。

#### 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

本托管人复核审查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。

### § 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：富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末	上年度末
----	-----	------

	(2014年12月31日)	(2013年12月31日)
<b>资产:</b>		
银行存款	20,100,149.93	3,745,842.72
结算备付金	8,802,842.82	26,278,677.97
存出保证金	1,005,135.17	1,512,675.44
交易性金融资产	579,756,653.77	531,845,284.44
其中: 股票投资	549,711,653.77	501,878,562.84
基金投资	—	—
债券投资	30,045,000.00	29,966,721.60
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	95,000,000.00
应收证券清算款	6,702,056.46	19,551,078.89
应收利息	1,012,542.46	449,139.53
应收股利	—	—
应收申购款	919,795.18	2,905,273.14
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	618,299,175.79	681,287,972.13
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>(2014年12月31日)</b>	<b>(2013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	—	13,474,447.71
应付赎回款	1,922,410.21	15,827,509.00
应付管理人报酬	810,963.26	848,514.63
应付托管费	135,160.56	141,419.11
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	5,079,214.52	2,398,345.04
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	287,252.45	219,908.86
负债合计	8,235,001.00	32,910,144.35
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	525,204,673.86	605,097,796.32
未分配利润	84,859,500.93	43,280,031.46
所有者权益合计	610,064,174.79	648,377,827.78

负债和所有者权益总计	618,299,175.79	681,287,972.13
------------	----------------	----------------

注：报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.162 元，基金份额总额 525,204,673.86 份。

## 7.2 利润表

会计主体：富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2014 年 01 月 01 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2014 年 01 月 01 日至 2014 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2013 年 4 月 12 日(基 金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日)
<b>一、收入</b>	136,542,911.83	94,176,939.14
1. 利息收入	3,693,981.51	7,903,382.52
其中：存款利息收入	1,016,109.55	621,936.32
债券利息收入	1,366,592.24	977,873.50
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	1,311,279.72	6,303,572.70
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	126,391,733.80	64,519,255.05
其中：股票投资收益	123,476,860.07	60,032,505.71
基金投资收益	—	—
债券投资收益	-15,409.66	-489,144.69
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具投资收益	—	—
股利收益	2,930,283.39	4,975,894.03
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	5,858,225.87	20,695,011.32
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	598,970.65	1,059,290.25
<b>减：二、费用</b>	30,091,558.30	26,090,015.89
1. 管理人报酬	9,871,426.19	8,925,481.53
2. 托管费	1,645,237.67	1,487,580.23
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	18,195,125.85	15,395,987.82
5. 利息支出	64,043.70	20,428.22
其中：卖出回购金融资产支出	64,043.70	20,428.22
6. 其他费用	315,724.89	260,538.09
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	106,451,353.53	68,086,923.25
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	106,451,353.53	68,086,923.25

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2014年01月01日至2014年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 (2014年01月01日至2014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）	605,097,796.32	43,280,031.46	648,377,827.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	106,451,353.53	106,451,353.53
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）	-79,893,122.46	-13,009,319.89	-92,902,442.35
其中：1. 基金申购款	335,505,595.48	49,095,846.15	384,601,441.63
2. 基金赎回款	-415,398,717.94	-62,105,166.04	-477,503,883.98
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）	—	-51,862,564.17	-51,862,564.17
五、期末所有者权益（基金净值）	525,204,673.86	84,859,500.93	610,064,174.79
项目	上年度可比期间(2013年4月12日(基金合同生效日) 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）	985,181,503.69	—	985,181,503.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	68,086,923.25	68,086,923.25
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）	-380,083,707.37	-24,806,891.79	-404,890,599.16
其中：1. 基金申购款	394,112,320.66	32,544,231.88	426,656,552.54
2. 基金赎回款	-774,196,028.03	-57,351,123.67	-831,547,151.70
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）	605,097,796.32	43,280,031.46	648,377,827.78

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 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

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则及应用指南、《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。

### 7.4.2 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 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（现名：申万宏源证券有限公司）	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
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	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。

### 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2014年01月01日至2014年12月31日)		上年度可比期间(2013年4月12日(基金合同生效日)至2013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	1,596,676,964.46	13.30	2,813,640,468.41	27.26
申银万国	860,003,347.74	7.16	924,630,684.16	8.96

##### 7.4.4.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比区间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 7.4.4.1.3 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比区间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 7.4.4.1.4 回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2014年01月01日至2014年12月31日)	上年度可比期间(2013年4月12日(基金合同生效日)至2013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	270,000,000.00	4.77	499,000,000.00	2.02
申银万国	159,000,000.00	2.81	6,705,500,000.00	27.18

#### 7.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2014年01月01日至2014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	1,414,232.62	13.16	721,573.14	14.21
申银万国	782,944.85	7.29	439,658.32	8.66
关联方名称	上年度可比期间（2013年4月12日（基金合同生效日）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	2,492,736.22	26.92	654,567.24	27.29
申银万国	841,782.66	9.09	86,106.51	3.59

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。

#### 7.4.4.2 关联方报酬

##### 7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2014年01月01日至2014年12月31日）	上年度可比期间（2013年4月12日（基金合同生效日）至2013年12月31日）
当期发生的基金应支付的管理费	9,871,426.19	8,925,481.53
其中：支付销售机构的客户维护费	1,659,678.73	2,991,995.77

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付。

##### 7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2014年01月01日至2014年12月31日）	上年度可比期间（2013年4月12日（基金合同生效日）至2013年12月31日）
当期发生的基金应支付的托管费	1,645,237.67	1,487,580.23

注：基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付。

#### 7.4.4.3 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。

#### 7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.4.4.1 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。

##### 7.4.4.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末（2014年12月31日）		上期末（2013年12月31日）	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
申银万国证券股份有限公司	19,274,479.57	3.67	—	—

#### 7.4.4.5 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（2014年01月01日至2014年12月31日）		上年度可比期间（2013年4月12日（基金合同生效日）至2013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
中国建设银行股份有限公司	20,100,149.93	889,863.46	3,745,842.72	350,236.16

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.5 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

##### 7.4.5.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位: 股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002466	天齐锂业	2014-03-12	2015-03-13	非公开发行股票	28.00	38.16	400,000	11,200,000.00	15,264,000.00	—

#### 7.4.5.2 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
002070	众和股份	2014-09-05	筹划重大事项	9.49	2015-03-11	10.00	1,009,094	10,101,856.70	9,576,302.06	—
002329	皇氏集团	2014-12-01	筹划重大事项	27.85	2015-01-30	27.61	102,022	2,336,157.06	2,841,312.70	—
002507	涪陵榨菜	2014-12-22	筹划重大事项	28.80	2015-03-23	31.68	156,827	4,421,757.52	4,516,617.60	—
600754	锦江股份	2014-11-10	筹划重大事项	25.11	2015-01-19	27.00	522,419	11,736,033.03	13,117,941.09	—

#### 7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

注: 截至本报告期末 2014 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。

##### 7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2014 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。

#### 7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

###### 7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债, 其因剩余期限不长, 公允价值与账面价值相若。

###### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2014 年 12 月 31 日, 本基金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中属于第一层次的余额为人民币 504,395,480.32 元, 属于第二层次的余额为人民币 75,361,173.45 元, 属于第三层次余额为人民币 0.00 元 (于 2013 年 12 月 31 日, 第一层次的余额为人民币 502,013,284.44 元, 属于第二层次的余额为人民币 29,832,000.00 元, 属于第三层次余额为人民币 0.00 元)。

###### 7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨

跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

#### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

#### 7.4.14.3 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	549,711,653.77	88.91
	其中:股票	549,711,653.77	88.91
2	固定收益投资	30,045,000.00	4.86
	其中:债券	30,045,000.00	4.86
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
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	银行存款和结算备付金合计	28,902,992.75	4.67
7	其他各项资产	9,639,529.27	1.56
8	合计	618,299,175.79	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	—	—
B	采矿业	8,871,407.60	1.45
C	制造业	145,085,416.39	23.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,884,565.95	0.80
E	建筑业	24,152,874.00	3.96
F	批发和零售业	7,144,087.49	1.17

G	交通运输、仓储和邮政业	15,118,012.00	2.48
H	住宿和餐饮业	13,117,941.09	2.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,963,412.34	3.60
J	金融业	184,398,425.30	30.23
K	房地产业	111,225,008.31	18.23
L	租赁和商务服务业	13,750,503.30	2.25
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
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	—	—
S	综合	—	—
	合计	549,711,653.77	90.11

### 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	601318	中国平安	415,400	31,034,534.00	5.09
2	600016	民生银行	2,591,500	28,195,520.00	4.62
3	601336	新华保险	542,810	26,901,663.60	4.41
4	000002	万科A	1,898,399	26,387,746.10	4.33
5	600048	保利地产	2,155,800	23,325,756.00	3.82
6	600352	浙江龙盛	940,143	18,502,014.24	3.03
7	601601	中国太保	548,049	17,701,982.70	2.90
8	000712	锦龙股份	585,900	15,936,480.00	2.61
9	002466	天齐锂业	400,000	15,264,000.00	2.50
10	600383	金地集团	1,329,400	15,168,454.00	2.49

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	000712	锦龙股份	86,549,769.48	13.35
2	000002	万科A	83,078,920.52	12.81
3	600048	保利地产	72,415,418.19	11.17
4	601601	中国太保	67,131,003.22	10.35
5	600340	华夏幸福	65,494,709.87	10.10
6	601336	新华保险	64,789,721.33	9.99

7	601318	中国平安	64,406,692.81	9.93
8	000671	阳光城	62,392,450.53	9.62
9	300129	泰胜风能	60,964,135.79	9.40
10	601628	中国人寿	59,538,903.96	9.18
11	000402	金融街	58,781,120.40	9.07
12	000592	平潭发展	55,336,784.56	8.53
13	000961	中南建设	54,507,116.95	8.41
14	600352	浙江龙盛	52,863,922.42	8.15
15	000656	金科股份	51,111,245.72	7.88
16	002366	丹甫股份	49,535,233.92	7.64
17	601668	中国建筑	49,256,036.38	7.60
18	300059	东方财富	48,789,884.20	7.52
19	002421	达实智能	48,494,272.91	7.48
20	300226	上海钢联	48,485,781.09	7.48
21	600016	民生银行	47,544,625.19	7.33
22	000024	招商地产	46,647,857.31	7.19
23	600887	伊利股份	44,144,328.59	6.81
24	000732	泰禾集团	41,986,816.99	6.48
25	601800	中国交建	41,951,863.64	6.47
26	600104	上汽集团	41,351,039.65	6.38
27	600584	长电科技	41,263,523.73	6.36
28	601166	兴业银行	40,759,320.67	6.29
29	600210	紫江企业	40,460,194.19	6.24
30	002153	石基信息	39,553,708.30	6.10
31	600755	厦门国贸	38,974,028.06	6.01
32	000997	新大陆	38,929,141.81	6.00
33	002642	荣之联	38,517,385.38	5.94
34	600212	江泉实业	38,179,072.79	5.89
35	300170	汉得信息	37,180,155.93	5.73
36	300150	世纪瑞尔	35,314,274.57	5.45
37	600021	上海电力	35,155,269.32	5.42
38	600153	建发股份	34,677,539.34	5.35
39	300253	卫宁软件	34,384,256.16	5.30
40	000651	格力电器	34,083,288.78	5.26
41	600030	中信证券	33,484,409.59	5.16
42	601933	永辉超市	33,366,928.89	5.15
43	600685	广船国际	32,392,469.09	5.00
44	601555	东吴证券	30,343,088.16	4.68
45	601818	光大银行	29,635,932.00	4.57
46	601006	大秦铁路	29,442,857.68	4.54
47	300254	仟源医药	28,778,341.24	4.44

48	300287	飞利信	28,590,465.16	4.41
49	600019	宝钢股份	27,654,840.79	4.27
50	601688	华泰证券	27,625,573.81	4.26
51	002176	江特电机	27,160,539.70	4.19
52	600415	小商品城	26,979,865.75	4.16
53	600036	招商银行	26,792,194.91	4.13
54	300356	光一科技	26,748,798.85	4.13
55	600000	浦发银行	26,571,153.77	4.10
56	600089	特变电工	26,306,084.39	4.06
57	002030	达安基因	26,107,342.96	4.03
58	600066	宇通客车	25,761,474.04	3.97
59	000401	冀东水泥	25,559,976.56	3.94
60	300133	华策影视	25,063,884.31	3.87
61	600802	福建水泥	24,986,137.38	3.85
62	002520	日发精机	24,956,304.20	3.85
63	300203	聚光科技	24,647,461.90	3.80
64	002488	金固股份	24,433,022.20	3.77
65	000858	五粮液	24,283,159.73	3.75
66	000776	广发证券	23,962,993.05	3.70
67	300266	兴源过滤	23,929,771.61	3.69
68	002382	蓝帆医疗	23,710,149.03	3.66
69	300115	长盈精密	23,678,573.41	3.65
70	600835	上海机电	23,413,900.76	3.61
71	000685	中山公用	23,249,561.66	3.59
72	000783	长江证券	23,207,744.00	3.58
73	601788	光大证券	22,651,046.21	3.49
74	300183	东软载波	22,347,298.38	3.45
75	600114	东睦股份	22,154,068.35	3.42
76	002051	中工国际	22,086,103.88	3.41
77	300257	开山股份	21,639,263.42	3.34
78	600057	象屿股份	21,405,591.82	3.30
79	600570	恒生电子	21,290,311.21	3.28
80	000709	河北钢铁	20,928,693.26	3.23
81	300037	新宙邦	20,876,702.87	3.22
82	600894	广日股份	20,663,173.12	3.19
83	600521	华海药业	20,081,693.30	3.10
84	000400	许继电气	20,069,835.35	3.10
85	300212	易华录	20,068,163.51	3.10
86	002440	闰土股份	20,020,487.84	3.09
87	002415	海康威视	19,932,794.79	3.07
88	002008	大族激光	19,699,751.74	3.04

89	600309	万华化学	19,628,029.35	3.03
90	000977	浪潮信息	19,611,837.52	3.02
91	600598	*ST 大荒	19,459,271.00	3.00
92	000861	海印股份	19,426,183.78	3.00
93	002466	天齐锂业	19,399,081.53	2.99
94	600015	华夏银行	19,308,062.85	2.98
95	601231	环旭电子	19,182,538.64	2.96
96	600199	金种子酒	18,936,994.80	2.92
97	600900	长江电力	18,928,839.85	2.92
98	002085	万丰奥威	18,900,019.56	2.91
99	300352	北信源	18,898,522.63	2.91
100	002049	同方国芯	18,805,665.68	2.90
101	600115	东方航空	18,469,847.65	2.85
102	600028	中国石化	18,421,775.72	2.84
103	300032	金龙机电	18,362,010.44	2.83
104	300020	银江股份	18,228,418.82	2.81
105	600158	中体产业	17,976,045.86	2.77
106	600312	平高电气	17,912,385.03	2.76
107	000333	美的集团	17,662,345.31	2.72
108	600563	法拉电子	17,143,993.29	2.64
109	600585	海螺水泥	16,961,710.17	2.62
110	002060	粤水电	16,835,012.41	2.60
111	600699	均胜电子	16,763,974.43	2.59
112	002405	四维图新	16,752,080.06	2.58
113	300058	蓝色光标	16,627,624.86	2.56
114	600446	金证股份	16,567,357.38	2.56
115	002236	大华股份	16,460,360.87	2.54
116	000895	双汇发展	16,394,480.78	2.53
117	002475	立讯精密	16,174,155.27	2.49
118	300038	梅泰诺	16,064,732.36	2.48
119	002108	沧州明珠	16,034,553.88	2.47
120	600999	招商证券	15,861,420.33	2.45
121	600208	新湖中宝	15,742,469.04	2.43
122	601918	国投新集	15,707,733.09	2.42
123	002568	百润股份	15,571,844.38	2.40
124	300024	机器人	15,536,838.56	2.40
125	600171	上海贝岭	15,433,262.02	2.38
126	300121	阳谷华泰	15,328,479.90	2.36
127	000801	四川九洲	15,279,536.17	2.36
128	002310	东方园林	15,203,413.66	2.34
129	600266	北京城建	14,861,375.95	2.29

130	601377	兴业证券	14,830,990.24	2.29
131	601992	金隅股份	14,822,889.83	2.29
132	600637	百视通	14,737,335.66	2.27
133	002357	富临运业	14,530,032.18	2.24
134	002586	围海股份	14,456,214.45	2.23
135	600287	江苏舜天	14,401,590.69	2.22
136	600694	大商股份	14,383,681.64	2.22
137	002111	威海广泰	14,262,173.74	2.20
138	600376	首开股份	14,089,894.20	2.17
139	600383	金地集团	14,066,757.20	2.17
140	002170	芭田股份	14,005,301.90	2.16
141	300074	华平股份	13,854,691.97	2.14
142	300010	立思辰	13,850,360.22	2.14
143	000937	冀中能源	13,694,692.62	2.11
144	002146	荣盛发展	13,516,403.17	2.08
145	002368	太极股份	13,464,231.56	2.08
146	300323	华灿光电	13,148,548.02	2.03
147	000778	新兴铸管	13,011,918.00	2.01
148	000547	闽福发 A	12,968,996.97	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	300085	银之杰	72,081,458.95	11.12
2	000671	阳光城	72,009,736.61	11.11
3	300226	上海钢联	70,973,187.80	10.95
4	000712	锦龙股份	70,881,869.06	10.93
5	600340	华夏幸福	63,078,723.82	9.73
6	000592	平潭发展	62,019,049.61	9.57
7	300253	卫宁软件	61,163,796.04	9.43
8	000002	万科 A	58,859,516.42	9.08
9	601628	中国人寿	56,407,272.68	8.70
10	600048	保利地产	55,881,193.55	8.62
11	000656	金科股份	54,295,990.00	8.37
12	300129	泰胜风能	51,670,092.23	7.97
13	600584	长电科技	51,665,244.60	7.97
14	601668	中国建筑	50,128,408.47	7.73
15	601601	中国太保	49,616,493.99	7.65
16	000961	中南建设	49,422,546.02	7.62
17	600060	海信电器	48,673,539.99	7.51
18	002421	达实智能	48,401,433.33	7.47
19	600887	伊利股份	48,397,346.32	7.46

20	002153	石基信息	47,342,327.24	7.30
21	000402	金融街	47,240,140.47	7.29
22	600066	宇通客车	46,880,271.46	7.23
23	000651	格力电器	43,715,333.79	6.74
24	002366	丹甫股份	43,686,987.07	6.74
25	601800	中国交建	43,581,725.91	6.72
26	600210	紫江企业	43,252,275.91	6.67
27	300059	东方财富	43,059,869.41	6.64
28	600755	厦门国贸	40,977,877.78	6.32
29	600030	中信证券	38,866,524.13	5.99
30	300170	汉得信息	38,775,016.76	5.98
31	000024	招商地产	38,673,465.11	5.96
32	002642	荣之联	38,355,556.21	5.92
33	601336	新华保险	38,207,919.39	5.89
34	000997	新大陆	38,109,308.51	5.88
35	600153	建发股份	37,094,643.14	5.72
36	000732	泰禾集团	36,684,050.01	5.66
37	300287	飞利信	36,500,721.50	5.63
38	601318	中国平安	36,147,646.18	5.58
39	600212	江泉实业	36,142,019.64	5.57
40	002049	同方国芯	35,726,307.43	5.51
41	600104	上汽集团	35,334,452.15	5.45
42	300150	世纪瑞尔	34,815,399.65	5.37
43	600309	万华化学	34,335,434.68	5.30
44	600352	浙江龙盛	34,232,705.64	5.28
45	600021	上海电力	33,497,970.93	5.17
46	600894	广日股份	33,104,826.23	5.11
47	601166	兴业银行	33,031,156.06	5.09
48	300212	易华录	33,001,195.04	5.09
49	601933	永辉超市	32,760,044.39	5.05
50	601555	东吴证券	32,291,840.86	4.98
51	002176	江特电机	30,225,364.31	4.66
52	600089	特变电工	30,067,818.79	4.64
53	601688	华泰证券	28,399,668.72	4.38
54	000776	广发证券	28,260,089.80	4.36
55	002030	达安基因	26,803,712.20	4.13
56	601788	光大证券	26,755,783.81	4.13
57	300133	华策影视	26,561,943.80	4.10
58	600699	均胜电子	26,368,542.92	4.07
59	000977	浪潮信息	26,169,914.40	4.04
60	300356	光一科技	26,062,570.63	4.02

61	000685	中山公用	25,957,089.12	4.00
62	600036	招商银行	25,782,604.78	3.98
63	300203	聚光科技	25,560,834.37	3.94
64	600802	福建水泥	25,236,178.54	3.89
65	002382	蓝帆医疗	24,907,805.49	3.84
66	600171	上海贝岭	24,819,971.20	3.83
67	601231	环旭电子	24,673,626.33	3.81
68	300115	长盈精密	24,477,384.56	3.78
69	300266	兴源过滤	24,442,159.29	3.77
70	000748	长城信息	24,380,661.51	3.76
71	600703	三安光电	24,160,411.28	3.73
72	300254	仟源医药	23,450,133.96	3.62
73	002488	金固股份	23,231,393.95	3.58
74	002051	中工国际	23,041,004.81	3.55
75	600115	东方航空	22,812,858.54	3.52
76	300183	东软载波	22,765,202.21	3.51
77	600685	广船国际	22,555,440.00	3.48
78	000401	冀东水泥	22,527,577.63	3.47
79	300020	银江股份	22,490,663.59	3.47
80	600114	东睦股份	22,401,690.98	3.46
81	600057	象屿股份	22,120,125.23	3.41
82	002415	海康威视	22,011,400.56	3.39
83	601818	光大银行	21,929,285.68	3.38
84	600028	中国石化	21,822,532.52	3.37
85	601006	大秦铁路	21,730,935.03	3.35
86	002520	日发精机	21,671,795.97	3.34
87	600563	法拉电子	21,553,083.93	3.32
88	300352	北信源	21,476,943.41	3.31
89	000858	五粮液	21,275,413.83	3.28
90	600835	上海机电	21,095,244.22	3.25
91	300257	开山股份	21,035,524.95	3.24
92	300037	新宙邦	20,953,655.69	3.23
93	600570	恒生电子	20,560,239.63	3.17
94	600598	*ST 大荒	20,520,919.76	3.16
95	600521	华海药业	20,405,807.84	3.15
96	002008	大族激光	20,036,670.60	3.09
97	000861	海印股份	19,985,409.46	3.08
98	000333	美的集团	19,494,301.54	3.01
99	000400	许继电气	18,996,923.04	2.93
100	002085	万丰奥威	18,924,921.41	2.92
101	002440	闰土股份	18,642,909.06	2.88

102	300024	机器人	18,200,065.12	2.81
103	002405	四维图新	17,892,135.05	2.76
104	600158	中体产业	17,646,836.67	2.72
105	600000	浦发银行	17,564,160.82	2.71
106	600016	民生银行	17,472,759.15	2.69
107	300121	阳谷华泰	17,458,083.86	2.69
108	002214	大立科技	17,317,250.09	2.67
109	300032	金龙机电	17,015,854.65	2.62
110	600312	平高电气	16,785,235.34	2.59
111	600446	金证股份	16,721,070.28	2.58
112	300038	梅泰诺	16,569,939.78	2.56
113	000783	长江证券	16,481,383.14	2.54
114	002475	立讯精密	16,274,812.34	2.51
115	300058	蓝色光标	15,926,714.17	2.46
116	600999	招商证券	15,834,711.99	2.44
117	000801	四川九洲	15,717,321.14	2.42
118	600585	海螺水泥	15,716,838.14	2.42
119	600415	小商品城	15,666,801.36	2.42
120	000895	双汇发展	15,586,498.77	2.40
121	601377	兴业证券	15,582,811.58	2.40
122	002108	沧州明珠	15,579,598.44	2.40
123	002568	百润股份	15,502,723.64	2.39
124	002060	粤水电	15,292,815.33	2.36
125	002236	大华股份	15,236,804.94	2.35
126	000423	东阿阿胶	15,150,269.80	2.34
127	002111	威海广泰	15,049,312.64	2.32
128	300010	立思辰	14,999,926.91	2.31
129	002456	欧菲光	14,941,656.42	2.30
130	002368	太极股份	14,880,373.91	2.30
131	600185	格力地产	14,811,949.94	2.28
132	600208	新潮中宝	14,778,907.66	2.28
133	600637	百视通	14,734,969.87	2.27
134	002310	东方园林	14,706,307.99	2.27
135	002170	芭田股份	14,466,624.76	2.23
136	000559	万向钱潮	14,264,782.09	2.20
137	600019	宝钢股份	14,050,802.10	2.17
138	002357	富临运业	13,923,989.68	2.15
139	600266	北京城建	13,876,980.03	2.14
140	600900	长江电力	13,718,388.38	2.12
141	601992	金隅股份	13,674,818.63	2.11
142	002104	恒宝股份	13,646,734.38	2.10

143	000937	冀中能源	13,532,034.96	2.09
144	002586	围海股份	13,509,467.96	2.08
145	600287	江苏舜天	13,501,421.67	2.08
146	600009	上海机场	13,465,403.49	2.08
147	002241	歌尔声学	13,458,800.79	2.08
148	600015	华夏银行	13,317,602.41	2.05
149	000049	德赛电池	13,226,851.69	2.04
150	601333	广深铁路	13,204,772.41	2.04
151	601918	国投新集	13,077,707.41	2.02
152	002206	海利得	12,984,532.91	2.00

### 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	5,969,279,328.22
卖出股票收入（成交）总额	6,050,597,614.83

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	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	30,045,000.00	4.92
	其中：政策性金融债	30,045,000.00	4.92
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	30,045,000.00	4.92

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	140327	14 进出 27	300,000	30,045,000.00	4.92

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 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。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 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	1,005,135.17
2	应收证券清算款	6,702,056.46
3	应收股利	—
4	应收利息	1,012,542.46
5	应收申购款	919,795.18
6	其他应收款	—

7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	9,639,529.27

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002466	天齐锂业	15,264,000.00	2.50	非公开发行股票

#### 8.12.6 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(%)
6108	85,986.36	385,850,380.80	73.47	139,354,293.06	26.53

### 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	1,295,702.19	0.2467

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 50 万份至 100 万份（含）；

2、本基金基金经理未持有本基金。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	50~100
本基金基金经理持有本开放式	0

基金	
----	--

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2013年04月12日)基金份额总额	985,181,503.69
报告期期初基金份额总额	605,097,796.32
本报告期基金总申购份额	335,505,595.48
减：本报告期基金总赎回份额	415,398,717.94
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	525,204,673.86

## § 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，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。

本基金管理人已于2014年5月13日发布公告，孟朝霞女士自2014年5月12日起不再担任公司副总经理。

本基金管理人已于2014年6月20日发布公告，陆文佳女士自2014年6月19日起担任公司副总经理。

本基金管理人已于2014年12月24日发布公告，陈敏女士自2014年12月21日起不再担任公司董事长。

本基金管理人已于2015年1月10日发布公告，李笑薇女士、朱少醒先生自2015年1月9日起担任公司副总经理。

本基金管理人已于2015年1月31日发布公告，薛爱东先生自2015年1月30日起担任公司董事长。

本报告期内，本基金托管人中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）已于2014年2月7日发布任免通知，解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。本基金托管人已于2014年11月03日发布公告，聘任赵观甫为中国建设银行投资托管业务部总经理。

### 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，其已提供审计服务的连续年限为 12 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**

2014 年 6 月 23 日，中国证券监督管理委员会上海监管局向我司下发了《关于对富国基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，要求我司于 2014 年 7 月 8 日前予以改正，并对相关责任人采取了行政监管措施。对此我司高度重视，成立了整改工作小组，梳理相关制度流程，排查现行内控漏洞，针对性的制定了整改执行方案，完善了公司内部控制措施，并已向中国证券监督管理委员会上海监管局提交了整改报告。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 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	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国泰君安	2	3,077,714,558.11	25.64	—	—	870,000,000.00	15.36	—	—	2,739,142.29	25.49	—
西南证券	2	243,539,238.61	2.03	—	—	42,000,000.00	0.74	—	—	215,100.01	2.00	—
中银国际	1	1,248,322,886.99	10.40	—	—	—	—	—	—	1,104,641.98	10.28	—
兴业证券	1	4,530,442.70	0.04	—	—	—	—	—	—	4,124.61	0.04	—
太平洋证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
高华证券	1	110,448,003.71	0.92	—	—	40,000,000.00	0.71	—	—	100,551.65	0.94	—
湘财证券	1	577,588,611.14	4.81	—	—	1,022,000,000.00	18.04	—	—	525,836.03	4.89	—
信达证券	2	412,868,649.35	3.44	132,110.40	100.00	10,000,000.00	0.18	—	—	363,501.16	3.38	—
中投证券	1	91,672,332.17	0.76	—	—	17,000,000.00	0.30	—	—	83,458.30	0.78	—
中信证券	1	191,162,608.25	1.59	—	—	75,000,000.00	1.32	—	—	174,035.28	1.62	—
德邦证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
海通证券	2	1,596,676,964.46	13.30	—	—	270,000,000.00	4.77	—	—	1,414,232.62	13.16	—
长城证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
长江证券	2	1,592,509,546.63	13.27	—	—	2,808,000,000.00	49.57	—	—	1,448,551.87	13.48	—
国信证券	1	1,136,762,490.57	9.47	—	—	—	—	—	—	1,005,921.93	9.36	—

安信证券	1	816,414,380.30	6.80	—	—	232,000,000.00	4.10	—	—	743,263.41	6.92	—
上海证券	1	44,097,395.43	0.37	—	—	120,000,000.00	2.12	—	—	40,146.35	0.37	—
申银万国	1	860,003,347.74	7.16	—	—	159,000,000.00	2.81	—	—	782,944.85	7.29	—
中信建投	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

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。本报告期本基金新增券商交易单元：太平洋证券 29291；太平洋证券 395502；西南证券 28432；西南证券 394283；长江证券 398689。其余租用券商交易单元未发生变动。

