汉盛证券投资基金

2013 年度报告摘要

基金管理人：	富国基金管理有限公司
基金托管人：	中国农业银行股份有限公司
送出日期：	2014年03月29日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2013年1月1日起至2013年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	富国汉盛封闭
基金主代码	500005
交易代码	500005
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年05月10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	2,000,000,000.00份
基金合同存续期	15年
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	1999年5月18日

2.2 基金产品说明

投资目标	为投资者减少和分散投资风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。
投资策略	"精选品种、组合投资、长线持有、波段操作"，通过研究和发掘具有良好发展前景的上市公司进行组合投资。以长期投资为主轴，同时依据"顺势而为"的原则进行一些短线操作。
业绩比较基准	无
风险收益特征	无

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	范伟男	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

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 中国农业银行 北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦 上海证券交易所 上海市浦东南路528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	2011年
本期已实现收益	450,050,124.31	633,418.54	76,277,430.57
本期利润	398,014,185.79	167,710,600.95	-414,094,002.81
加权平均基金份额本期利润	0.1990	0.0839	-0.2070
本期基金份额净值增长率	18.57%	8.13%	-16.01%
3.1.2期末数据和指标	2013年12月31日	2012年12月31日	2011年12月31日
期末可供分配基金份额利润	0.2286	0.0416	0.0411
期末基金资产净值	2,497,926,041.59	2,175,911,856.39	2,082,201,256.46
期末基金份额净值	1.2490	1.0880	1.0411

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，封闭式基金交易佣金、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。

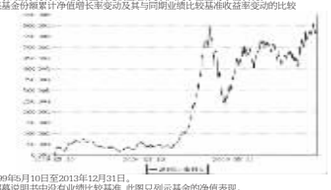
3.2 基金净值表现

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	-1.07%	2.46%	-	-	-	-
过去六个月	5.63%	1.96%	-	-	-	-
过去一年	18.57%	2.13%	-	-	-	-
过去三年	7.69%	1.96%	-	-	-	-
过去五年	84.92%	2.06%	-	-	-	-
自基金合同生效日起至今	574.07%	2.56%	-	-	-	-

注：由于基金汉盛在其基金合同和招募说明书中没有业绩比较基准，此表计列示基金的净值表现。

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

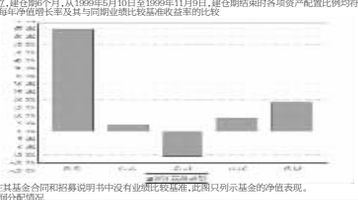


注：本图中所示时间区间为1999年5月10日至2013年12月31日。

由于本基金在其基金合同和招募说明书中没有业绩比较基准，此图只列示基金的净值表现。

本基金于1999年5月10日成立，建仓期6个月，从1999年5月10日至1999年11月9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



注：由于汉盛证券投资基金在其基金合同和招募说明书中没有业绩比较基准，此图只列示基金的净值表现。

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	0.380	76,000,000.59	-	76,000,000.59	1次分红
2012年	0.370	74,000,001.02	-	74,000,001.02	1次分红
2011年	3.750	750,000,001.97	-	750,000,001.97	1次分红
合计	4.500	900,000,003.58	-	900,000,003.58	-

§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指数证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金、富国精选蓝筹股票型证券投资基金、富国红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、富国天添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、富国新大陆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、富国大规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、富国纯债三年定期开放债券型证券投资基金、富国纯债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共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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
何特	本基金基金经理兼任公司权益投资副总监，富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金基金经理	2010-01-13	-	12年	硕士，曾任中国银行云南省分行国际业务部银行职员；世利普证券公司分析员，中银国际证券有限责任公司资产管理部分析员，中银基金管理有限公司投资部助理副总裁；汇丰晋信基金管理公司投资管理部投资经理，基金经理；富国基金管理有限公司官网策略与产品部高级营销策划经理、权益投资部策略分析师；2010年1月起任汉盛证券投资基金基金经理；2012年9月起任富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金基金经理，兼任富国基金管理有限公司权益投资副总监。具有基金从业资格，中国国籍。
贺轶	本基金基金经理兼任公司权益投资副总监，富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金基金经理	2010-01-13	-	12年	硕士，曾任中国银行云南省分行国际业务部银行职员；世利普证券公司分析员，中银国际证券有限责任公司资产管理部分析员，中银基金管理有限公司投资部助理副总裁；汇丰晋信基金管理公司投资管理部投资经理，基金经理；富国基金管理有限公司官网策略与产品部高级营销策划经理、权益投资部策略分析师；2010年1月起任汉盛证券投资基金基金经理；2012年9月起任富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金基金经理，兼任富国基金管理有限公司权益投资副总监。具有基金从业资格，中国国籍。
袁宜	本基金基金经理兼任富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2012-10-12	-	7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月至今任富国基金管理有限公司首席经济学家；2011年3月至2012年10月任基金经理助理；2012年10月起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。具有基金从业资格，中国国籍。
戴益强	本基金基金经理兼任富国医疗保健行业股票型证券投资基金基金经理	2012-10-12	-	7年	硕士，曾任易方达基金管理有限公司行业研究员；2008年9月至2012年10月任富国基金管理有限公司行业研究员；2012年10月起任汉盛证券投资基金基金经理，2013年4月起任富国医疗保健行业股票型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。

注：1、上述表格内基金经理的任职日期均指公司作出决定并公告披露之日。

证券从业的描述遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

2、本公司于2014年01月11日在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站上刊登公告，聘请张先生自公告日起不再担任本基金基金经理；于2014年01月29日在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站上刊登公告，贺轶先生自公告日起不再担任本基金基金经理；袁宜先生继续管理本基金。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为汉盛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》、《汉盛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，制定了内控的《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、关行事前控制、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、市场种类的控制，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、同一基金组合程管理的不同组合，对同一投资标的实用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同向、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，并重点分析同类机会（股票池、组合池、债券池）间、不同产品系统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，监察稽核岗有权要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报稽区监管机构。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，并按督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备监查。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期，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分布假设检验并对检验结果进行调踪分析。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102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，尽管中国经济不时受到"钱荒"因素的困扰，但经济增速整体表现平稳，物价温和可控。在人民币场上，受到顺贬余额不断高涨，以及机构投资者更为偏好中小市值板块的影响，主板与创业板出现冰火两重天的格局。期间，改革、安全值得期待的政策，资金趋于宽松，资产价格上涨的机会。

本基金在六月曾对仓位进行了较大的调整，增持规避了钱荒的冲击。下半年，积极参与了日银区、国企改革等主题，并对LED等热点行业做了重点配置，整体而言，基金业绩表现向可。

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1.2490元，份额累计净值为4.4496元。报告期内，本基金份额净值增长率为18.57%。

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，对中国经济而言，最大的变数在于流动性，以及由此导致的信用风险事件；对中国股市而言，还需要考虑新股发行节奏给压力的大小。

本基金将密切关注宏观政策动向和股市供给压力这两个变量，趋势上还因素得到阶段性缓解的窗口期，积极操作。在行业配置上，将更偏好泵气相对确定的领域，如LED、军工、去IOE等。

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、投资稽核、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原则、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当然委员，必须同所在估值委员会的定期会议，提出基金估值政程及估值技术中存在的潜在问题，参与估值程序和估值技术的决策。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于2013年4月16日公告对2012年报内的利润进行收益分配，每10份基金份额派发现金红利0.38元，共计派发现金红利76,000,000.59元。

本基金于2014年3月19日公告对2013年报内的利润进行收益分配，每10份基金份额派发现金红利2.06元，共计派发现金红利412,000,001.06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

在托管汉盛证券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《汉盛证券投资基金基金合同》、《汉盛证券证券投资基金托管协议》的约定，对汉盛证券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汉盛证券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汉盛证券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

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：汉盛证券投资基金

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	43,030,384.32	183,533,776.35
结算备付金	27,355,869.61	18,112,941.58
存出保证金	3,123,524.39	864,460.73
交易性金融资产	2,229,595,717.79	1,935,187,341.84
其中：股票投资	1,587,339,546.39	1,460,216,569.84
基金投资	-	-
债券投资	642,256,171.40	474,970,772.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	175,600,000.00	50,000,000.00
应收证券清算款	23,565,225.76	6,734,076.09
应收利息	8,573,880.13	8,511,352.11
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	24.36	24.36
资产总计	2,510,844,326.36	2,202,943,973.06
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	-	16,145,741.85
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	3,186,064.30	2,613,268.29
应付托管费	531,010.73	435,544.74
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	7,130,651.02	5,459,672.27
应交税费	1,478,558.72	1,477,889.52
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	592,000.00	900,000.00
负债合计	12,918,284.77	27,032,116.67
所有者权益：		
实收基金	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未分配利润	497,926,041.59	175,911,856.39
所有者权益合计	2,497,926,041.59	2,175,911,856.39
负债和所有者权益总计	2,510,844,326.36	2,202,943,973.06

注：报告截止日2013年12月31日，基金份额净值1.2490元，基金份额总额2,000,000,000.00份。

7.2 利润表

会计主体：汉盛证券投资基金

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	489,441,805.78	228,961,789.94
1.利息收入	28,350,256.57	19,731,946.16
其中：存款利息收入	1,320,796.12	1,341,832.78
债券利息收入	23,228,959.59	16,978,231.59
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,800,500.86	1,412,181.79
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）	512,992,498.67	42,135,339.22
其中：股票投资收益	500,700,102.87	15,531,983.52
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-2,561,419.14	3,937,146.12
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具投资收益	-	-
股利收益	14,853,814.94	22,666,209.58
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	-52,035,938.52	167,077,182.41
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	134,989.06	17,322.15
减：二、费用	91,427,619.99	61,251,188.99
1.管理人报酬	36,478,280.20	31,884,267.90
2.托管费	6,079,713.32	5,314,044.73
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	48,140,690.25	23,011,429.24
5.利息支出	-	324,392.23
其中：卖出回购金融资产支出	-	324,392.23
6.其他费用	728,936.22	717,054.89
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	398,014,185.79	167,710,600.95
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	398,014,185.79	167,710,600.95

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汉盛证券投资基金

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）	2,000,000,000.00	175,911,856.39	2,175,911,856.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	398,014,185.79	398,014,185.79
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	-	-76,000,000.59	-76,000,000.59
五、期末所有者权益（基金净值）	2,000,000,000.00	497,926,041.59	2,497,926,041.59

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）	2,000,000,000.00	82,201,256.46	2,082,201,256.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	167,710,600.95	167,710,600.95
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	-	-74,000,001.02	-74,000,001.02
五、期末所有者权益（基金净值）	2,000,000,000.00	175,911,856.39	2,175,911,856.39

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 林忠松 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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报告相一致。

7.4.2 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.3 重要财务报表项目的说明

7.4.3.1 银行存款 单位：人民币元

项目	本期末（2013年12月31日）	上年度末（2012年12月31日）
活期存款	43,030,384.32	183,533,776.35
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-
合计	43,030,384.32	183,533,776.35

注：本基金本报告期内及上年度可比期内均未投资于定期存款。

7.4.3.2 交易性金融资产 单位：人民币元

项目		本期末（2013年12月31日）		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,536,427,719.63	1,587,339,546.39	50,911,826.76
债券	交易所市场	34,462,434.53	33,450,171.40	-1,012,263.13
	银行间市场	618,018,995.45	608,806,000.00	-9,212,995.45
	合计	652,481,429.98	642,256,171.40	-10,225,258.58
资产支持证券		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,188,909,149.61	2,229,595,717.79	40,686,568.18

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		1,366,348,193.58	1,460,216,569.84	93,868,376.26
债券	交易所市场	235,252,691.56	235,708,772.00	456,080.44
	银行间市场	240,863,950.00	239,262,000.00	-1,601,950.00
	合计	476,116,641.56	474,970,772.00	-1,145,869.56
资产支持证券		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,842,464,835.14	1,935,187,341.84	92,722,506.70

7.4.3.3 衍生金融资产/负债

注：本报告期末及上年度末本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.4.3.4 买入返售金融资产

7.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额 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
交易所	175,600,000.00	0.00
合计	175,600,000.00	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
交易所市场	50,000,000.00	0.00
合计	50,000,000.00	0.00

7.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本报告期末及上年度末本基金未持有买断式逆回购中取得的债券。

7.4.3.5 应收利息 单位：人民币元

项目	本期末（2013年12月31日）	上年度末（2012年12月31日）
应收活期存款利息	30,050.72	24,592.48
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	12,310.00	8,150.80
应收债券利息	8,381,705.34	8,470,728.29
应收买入返售证券利息	148,408.47	7,880.54
应收申购款利息	-	-
其他	1,405.60	-
合计	8,573,880.13	8,511,352.11

7.4.3.6 其他资产 单位：人民币元

项目	本期末（2013年12月31日）	上年度末（2012年12月31日）
其他应收款	24.36	24.36
待摊费用	-	-
合计	24.36	24.36

7.4.3.7 应付交易费用 单位：人民币元

项目	本期末（2013年12月31日）	上年度末（2012年12月31日）
交易所市场应付交易费用	7,120,139.77	5,454,291.14
银行间市场应付交易费用	10,511.25	5,381.13
合计	7,130,651.02	5,459,672.27

7.4.3.8 其他负债 单位：人民币元

项目	本期末（2013年12月31日）	上年度末（2012年12月31日）
应付券商交易单元保证金	250,000.00	500,000.00
应付赎回费	-	-
其他	42,000.00	-
预提审计费	100,000.00	100,000.00
预提信息披露费	200,000.00	300,000.00
合计	592,000.00	900,000.00

7.4.3.9 实收基金 金额单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年12月31日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
本期申购	-	-
本期赎回（以"-"号填列）	-	-
本期末	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00

注：本报告期末，本基金的发起人海通证券股份有限公司持有500万份，占比0.25%，申银万国证券股份有限公司持有1,000万份，占比0.50%，国泰基金管理有限公司持有1,000万份，占比0.50%，华泰证券股份有限公司持有500万份，占比0.25%，山东省国际信托有限公司持有500万份，占比0.25%，福建省投资开发集团有限责任公司持有500万份，占比0.25%。

7.4.3.10 未分配利润 单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	83,189,349.69	92,722,506.70	175,911,856.39
本期利润	450,050,124.31	-52,035,938.52	398,014,185.79
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-76,000,000.59	-	-76,000,000.59
本期末	457,239,473.41	40,686,568.18	497,926,041.59

7.4.3.11 存款利息收入 单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年12月31日）	上年度可比期间（2012年01月01日至2012年12月31日）
活期存款利息收入	951,197.69	1,227,016.85
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	332,709.62	114,069.52
其他	36,888.81	446.41
合计	1,320,796.12	1,341,532.78

7.4.3.12 股票投资收益 单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年12月31日）	上年度可比期间（2012年01月01日至2012年12月31日）
卖出股票成交总额	16,008,780,436.05	7,608,522,147.40
减：卖出股票成本总额	15,508,080,333.18	7,592,990,163.88
买卖股票差价收入	500,700,102.87	15,531,983.52

7.4.3.13 债券投资收益 单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年12月31日）	上年度可比期间（2012年01月01日至2012年12月31日）
卖出债券（、含债转股及债券到期兑付）成交总额	3,465,312,267.38	826,181,638.81
减：卖出债券（、含债转股及债券到期兑付）成本总额	3,412,780,509.98	806,167,000.09
减：应收利息总额	55,093,176.54	16,077,492.60
债券投资收益	-2,561,419.14	3,937,146.12

7.4.3.14 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.3.15 衍生工具收益

7.4.3.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无权证投资收益。

7.4.3.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无其他衍生工具收益。

7.4.3.16 股利收益 单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年12月31日）	上年度可比期间（2012年01月01日至2012年12月31日）
股票投资产生的股利收益	14,853,814.94	22,666,209.58
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	14,853,814.94	22,666,209.58

7.4.3.17 公允价值变动收益 单位：人民币元

项目名称	本期（2013年01月01日至2013年12月31日）	上年度可比期间（2012年01月01日至2012年12月31日）
1.交易性金融资产	-52,035,938.52	167,077,182.41
股票投资	-42,956,549.50	172,925,614.07
债券投资	-9,079,389.02	-5,848,431.66
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	-52,035,938.52	167,077,182.41

7.4.3.18 其他收入 单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年12月31日）	上年度可比期间（2012年01月01日至2012年12月31日）
基金赎回费收入	-	-
其他	134,989.06	-
印花税返还	-	17,322.15
合计	134,989.06	17,322.15

7.4.3.19 交易费用 单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年12月31日）	上年度可比期间（2012年01月01日至2012年12月31日）
交易所市场交易费用	48,104,890.25	23,004,004.24
银行间市场交易费用	35,800.00	7,425.00
合计	48,140,690.25	23,011,429.24

7.4.3.20 其他费用 单位：人民币元

项目	本期（2013年01月01日至2013年12月31日）	上年度可比期间（2012年01月01日至2012年12月31日）
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行费用	21,436.22	13,954.89
上市费	60,000.00	60,000.00
债券账户维护费	18,000.00	18,000.00
分红手续费	228,000.