

富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金

H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。
7.4.9.2.1 与关联方进行银行间同业拆借的债券(含回购)交易
注:本基金本报告期与关联方进行银行间同业拆借的债券(含回购)交易。
7.4.9.2.4 各关联方投资本基金的情况
7.4.9.2.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
注:本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。本基金合同生效日为2013年6月22日,上年度无对应比较数据。
7.4.9.2.4.2 报告期内除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况
注:本基金本报告期基金管理人之外的其他关联方未运用固有资金投资本基金。本基金合同生效日为2013年6月22日,上年度无对应比较数据。

7.4.9.2 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1月27日(含)前(含合同签署日或2013年12月31日)	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	504,125.89		372,674.24

7.4.9.26 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期末在承销期内直接购买关联方承销的证券。

7.4.9.27 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联方交易。

7.4.10 附注:(2013年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.10.21 因认购新发/增发证券于期末未持有的流通受限证券

7.4.10.21.1 受限证券类别:资产支持证券

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 （元）	数量 （单位，股）	期末 资产总额
					认购 溢价率 （%）		期末 负债总额
1387011	13惠元IA	2013-12-10	-	网下发行未上市	100.00	100.00	460,000.00
				网下发行未上市	100.00	0.00	46,000,000.00
				网下发行未上市	100.00	0.00	46,000,000.00

注：本基金于2013年12月10日认购13惠元IA，因该资产支持证券未上市，可流通日为未知。

7.4.10.2 期末持有的暂时停牌股票或暂停交易股票

注：本基金本报告期末持有暂时停牌的股票为：

7.4.10.2.1 期末债券违约回购交易中作为抵押品的债券

[illegible]

截至资产负债表日,本基金无需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	-		
	其中:股票	-		
2	固定收益投资	3,308,576,944.93	68.14	
	其中:债券	3,222,576,944.93	66.37	
	资产支持证券	86,000,000.00	1.77	
3	金融衍生品投资	-		

4	买入返售金融资产	25,480,158.22	0.52
	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	1,413,664,033.17	29.16
6	其他各项资产	105,698,298.83	2.18
7	合计	4,855,419,435.15	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

投资者欲了解本基金投资标的的所有相关信息，请参阅刊载于“富国基金管理有限公司网站”的年度报告正文。

8.4 报告期末股票投资组合的基本变动

注:本基金本报告期末有股票投资。

8.48 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

注:本基金本报告期末有股票投资。

8.49 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注:本基金本报告期末无股票交易。

8.5 期末按投资组合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	19,634,000.00	0.53

其中:政策类金融基金	19,610,000.00	0.55
4 企业债券	2,339,758,944.93	65.17
5 企业短期融资券	716,084,000.00	19.94
6 中期票据	147,118,000.00	4.10
7 可转债	-	-
8 其他	-	-
9 合计	3,222,576,944.93	89.76

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

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	123466	13年瑞	1,000,000	100,000,000.00	2.79

金额单位:人民币元

2	441366013	13国债CP01	1,000,000	99,210,000.00	2.76
3	441366070	13国债CP02	1,000,000	98,990,000.00	2.76
4	122942	09江证债	979,870	97,603,332.72	2.72
5	112060	12国债1	775,590	78,326,409.00	2.18

82 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1387011	13证金1A	460,000	46,000,000.00	1.28
2	123504	13证金A2	400,000	40,000,000.00	1.11

83 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。

8.9.2 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.9.2.1 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。

8.9.2.2 本基金投资股指期货的投资政策

8.9.2.3 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 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。

8.10.2 本基金投资国债期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.1 投资组合合规性附注

8.11.1.7 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、处罚的情形。

8.11.1.8 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名单。

本基金本报告期末未持有股票投资。

8.11.1.9 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	182,610.36	
2	应收证券清算款	27,956,000.00	

3	应收股利		
4	应收利息		77,559,688.37
5	应收申购款		
6	其他应收款		
7	待摊费用		
8	其他		
9	合计		105,698,298.83

8.11.10 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。

8.11.11 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

8.11.12 投资组合报告附注的其他文字描述事项:

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。

9.4 基金净值增长率与业绩比较基准相差较大的原因分析

9.4 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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
22348	158888.52	326,608,689.64	9.20	3,222,608,253.34	90.80		

9.5 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	基金从业人员持有数量(股)	基金从业人员持有比例(%)
基金高级管理人员持有	0	0.00
基金基金经理持有	0	0.00
基金其他从业人员持有	0	0.00

基金管理人所有从业人员持有本基金	383,079.13	0.0108
------------------	------------	--------

注1：本公司高级管理人员、基金投资和研究人员均不负责人员持有本基金。

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(2013年06月27日)基金份额总额	3,550,296,942.98
基金累计生效日2013年6月27日起至报告期末基金份额总额	
减：基金合同生效日2013年6月27日起至报告期末基金份额总额	
基金合同生效日2013年6月27日起至报告期末基金份额总额	
本报告期末基金份额总额	3,550,296,942.98

§ 11 重大事件揭示

11.4 基金持有人大会决议
本报报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

11.5 基金管理人、基金托管人及有门基金托管人的重大人事变动
本报报告期内基金托管人没有发生基金托管人变更的重大人事变动。

11.6 基金管理人、基金托管人及有门基金托管人的重大人事变动
本报报告期内基金管理人没有发生基金管理人变更的重大人事变动。

11.7 基金投资策略的改变
本报报告期内基金投资策略没有改变。

11.7 基金是否遵守会计师事务所聘请情况

本期报告期内本基金聘请了符合规定的会计师事务所。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所审计报酬为人民币1.00元,且其已为本公司提供审计服务的连续年限为11年。

11.9 管理人、托管人及其高级管理人员是否遵守或处罚等情况

本期报告期内基金管理人及基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员均未受到监管部门的稽查处罚。

74

11.10 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

股票交易	债券交易	债券回购交易	权证交易	应支付券商的费用
占	占	占	占	占

券商名称	交易单元数量	成交金额 股 票 交 易 成 交 总 额 的 比 例 (%)	成交金额 股 票 交 易 成 交 总 额 的 比 例 (%)	占当期净 成交额 的比例 (%)	成交金额 股 票 交 易 成 交 总 额 的 比 例 (%)	占当期权 证 交 易 成 交 总 额 的 比 例 (%)	佣金	占当期佣 金总额 的比例 (%)	备注
国泰君安	2	-	-	-	-	-	-	-	-

华夏证券	1	--	291,951,225.61	9.54	11,274,700,000.00	28.92	--	--	--	--
华夏万国	2	--	445,718,028.55	14.57	8,129,238,000.00	20.85	--	--	--	--
国泰君安	2	--	--	--	--	--	--	--	--	--
齐鲁证券	1	--	--	--	--	--	--	--	--	--
宏源证券	2	--	88,458,224.30	2.89	2,853,400,000.00	7.32	--	--	--	--
国海证券	2	--	--	--	--	--	--	--	--	--
兴业证券	2	--	1,891,459,696.22	61.82	7,788,306,000.00	19.98	--	--	--	--
东方证券	2	--	113,430,560.16	3.71	6,574,050,000.00	16.70	--	--	--	--

南方证券				11,277,107.00	3.71	0.245,727,666.68	10.77					
海通证券	1	-	-	228,717,799.96	7.48	2,415,050,000.00	6.19	-	-	-	-	-

注:我公司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。本基金于2013年06月27日成立,本表中所列券商交易单元均为本报告期新增。