富国天益价值证券投资基金

[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：交通银行股份有限公司
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。

基金托管人中国交通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	富国天益价值股票
基金主代码	100020
交易代码	前端交易代码：100020 后端交易代码：100021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年06月15日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	7,569,600,784.67份
基金合同存续期	不定期

2.2基金产品说明

投资目标	本基金属价值型基金，主要投资于内在价值被低估的上市公司的股票，或与同类型上市公司相比具有更高相对价值的上市公司的股票。本基金通过对投资组合的动态调整来分散和控制风险，在注重基金资产安全的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采取积极的投资策略，本基金在大类资产配置和行业配置层面，遵循自上而下的积极策略，个股选择层面，遵循自下而上的积极策略，根据基金经理对股票市场变动的趋势的判断，决定基金资产在股票、债券、现金等金融资产上的分布，并进行动态配比以规避系统性风险的影响，最大限度地确保基金资产的安全。
业绩比较基准	95%的中信标普300指数+5%的中信国债指数
风险收益特征	本基金为价值型证券投资基金，属于证券投资基金中的中低风险品种。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	范伟男	裘学敏
	联系电话	021-20361818	95559
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	peixm@bankcomm.com
客户服务电话		95105686，4008880688	95559
传真		021-20361616	021-62701216

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层 交通银行 上海市浦东新区银城中路188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	287,777,369.30	-466,964,221.67	86,986,604.31
本期利润	510,247,443.47	498,560,052.61	-2,239,138,208.93
加权平均基金份额本期利润	0.0578	0.0500	-0.2131
本期基金份额净值增长率	6.46%	5.91%	-21.23%
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	-0.1495	-0.1795	-0.2011
期末基金资产净值	6,818,918,256.92	8,509,557,786.16	8,135,800,759.10
期末基金份额净值	0.9008	0.8461	0.7989

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	-1.52%	1.21%	-3.09%	1.08%	1.57%	0.13%
过去六个月	10.76%	1.19%	6.78%	1.21%	3.98%	-0.02%
过去一年	6.46%	1.24%	-5.05%	1.30%	11.51%	-0.06%
过去三年	-11.18%	1.14%	-22.97%	1.24%	11.79%	-0.10%
过去五年	40.82%	1.23%	30.68%	1.46%	10.14%	-0.23%
自基金合同生效日起至今	462.87%	1.38%	131.09%	1.70%	331.78%	-0.32%

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＝95%的中信标普300指数+5%的中信国债指数。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国债指数。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股市场总体趋势。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（benchmarkt）按下列公式计算：

benchmarkt =95% *[中信标普300指数t/(中信标普300指数t-1)-1] +5%*[中信国债指数t/(中信国债指数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（benchmarkT）按下列公式计算：

benchmarkT =[∏Tt=1(1+benchmarkt)]-1

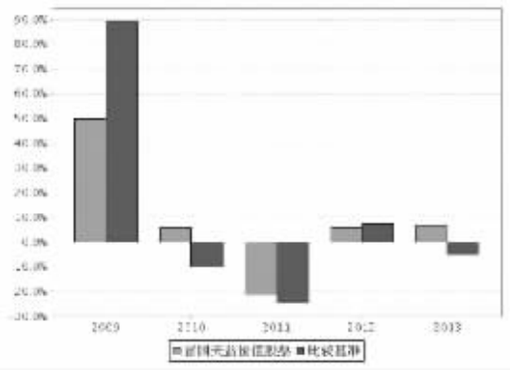
其中，T=2，3，4，…；∏Tt=1(1+benchmarkt)表示t日至T日的(1+benchmarkt)数字连乘。

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2004年6月15日成立，建仓期6个月，从2004年6月15日至2004年12月14日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。本基金于2007年11月6日大比例分红规模急剧扩大，建仓期3个月，从2007年11月5日至2008年2月4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

注：本基金过往三年未发生利润分配。

§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		
陈戈	本基金基金经理兼任公司副总经理	2005-04-13	-	17年	硕士，曾任国泰君安证券有限责任公司研究所研究员；2000年10月任富国基金管理有限公司研究员、行业研究主管、研究策划部经理、总经理助理。2005年4月至今任富国天益基金经理，兼任公司副总经理。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指公司作出决定并公告披露之日。

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富国天益价值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》、《富国天益价值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83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，中国的经济增速在7.4%-7.8%的狭小区间内波动，但投资者对中国经济的预期却经历了极大的起伏，从年初对经济增长的乐观，到年中钱荒阴影下的悲观，再到下半年改革预期下的重新乐观，最后是年末流动性偏紧影响下的再度悲观。受此影响，主板市场随之跌宕起伏。然而，创业板市场却是风景独好。在新股停发、融资盘增加、投资者风格偏好强化的共同作用下，创业板指屡创新高。

本基金在风格配置上偏向价值。较多仓位集中在估值偏低、成长性中等的个股上，对增速更高的创业板配置很低。这样的配置和今年市场的表现相违背，对基金业绩构成了拖累。

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0.9008元，份额累计净值为3.9121元。报告期内，本基金份额净值增长率为6.46%，同期业绩比较基准收益率为-5.05%。

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年的中国经济，上行风险在于出口，这取决于海外经济，最大的下行风险还是在于流动性，我们需要对流动性是否还会持续偏紧保持警惕，这不仅会对投资增速造成拖累，还会导致信用风险事件的出现，进而对经济增速造成明显的不利冲击。2014年的中国股市，还面临着新股发行和注册制改革等供给层面的压力。

从较长的时间区间来看，目前权益资产的估值有较大的吸引力。在宏观流动性和股市供给压力得到阶段性好转的时期，A股市场有望明显反弹。本基金的核心仓位将继续以合理的价格持有具有长期竞争力的公司，分享企业自身成长带来的价值。同时，我们预期优质中速成长的龙头公司的估值回升或许能提供额外的净值贡献。

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

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，2013年报告期末本基金未满足收益分配条件，故不进行收益分配。

§5 托管人报告

5.1报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2013年度，基金托管人在富国天益价值证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2013年度，富国基金管理有限公司在富国天益价值证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

2013年度，由富国基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关富国天益价值证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§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：富国天益价值证券投资基金
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	52,010,643.12	376,136,014.14
结算备付金	262,686,278.30	18,812,399.38
存出保证金	1,612,502.25	1,523,789.92
交易性金融资产	6,380,399,706.36	8,061,262,343.91
其中：股票投资	6,019,695,426.56	7,245,232,266.51
基金投资	-	-
债券投资	360,704,279.80	816,030,077.40
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	260,000,000.00	131,560,345.84
应收证券清算款	50,254,598.29	40,752,821.37
应收利息	7,326,668.16	11,126,221.99
应收股利	-	-
应收申购款	744,173.43	1,112,707.74
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	7,015,034,569.91	8,642,286,644.29
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	160,213,865.05	111,106,233.03
应付赎回款	21,017,833.90	5,238,728.93
应付管理人报酬	8,893,910.35	10,164,771.25
应付托管费	1,482,318.39	1,694,128.56
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,403,826.04	2,819,688.54
应交税费	776,180.80	776,180.80
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	328,378.46	929,127.02
负债合计	196,116,312.99	132,728,858.13
所有者权益：		
实收基金	7,569,600,784.67	10,056,919,250.94
未分配利润	-750,682,527.75	-1,547,361,464.78
所有者权益合计	6,818,918,256.92	8,509,557,786.16
负债和所有者权益总计	7,015,034,569.91	8,642,286,644.29

注：报告截止日2013年12月31日，基金份额净值0.9008元，基金份额总额7,569,600,784.67份。

7.2利润表

会计主体：富国天益价值证券投资基金
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	671,964,707.36	659,269,252.13
1.利息收入	21,790,735.93	35,007,341.42
其中：存款利息收入	2,390,985.34	5,943,258.10
债券利息收入	13,143,476.12	18,301,943.51
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	6,256,274.47	10,762,139.81
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	426,908,786.17	-341,491,096.45
其中：股票投资收益	310,297,513.72	-443,268,307.73
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6,261,151.76	-2,561,930.00
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具投资收益	-	-
股利收益	110,350,120.69	104,339,141.28
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	222,470,074.17	965,524,274.28
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	795,111.09	228,732.88
减：二、费用	161,717,263.89	160,709,199.52
1.管理人报酬	116,811,646.06	122,127,105.97
2.托管费	19,468,607.65	20,354,517.79
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	25,014,380.43	17,526,554.18
5.利息支出	-	237,812.27
其中：卖出回购金融资产支出	-	237,812.27
6.其他费用	422,629.75	463,209.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	510,247,443.47	498,560,052.61
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	510,247,443.47	498,560,052.61

7.3所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国天益价值证券投资基金
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）	10,056,919,250.94	-1,547,361,464.78	8,509,557,786.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	510,247,443.47	510,247,443.47
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）	-2,487,318,466.27	286,431,493.56	-2,200,886,972.71
其中：1.基金申购款	353,613,564.45	-40,222,574.00	313,390,990.45
2.基金赎回款	-2,840,932,030.72	326,654,067.56	-2,514,277,963.16
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）	7,569,600,784.67	-750,682,527.75	6,818,918,256.92
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）	10,184,339,922.30	-2,048,539,163.20	8,135,800,759.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	498,560,052.61	498,560,052.61
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）	-127,420,671.36	2,617,645.81	-124,803,025.55
其中：1.基金申购款	830,319,298.38	-159,403,224.06	670,916,074.32
2.基金赎回款	-957,739,969.74	162,020,869.87	-795,719,099.87
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）	10,056,919,250.94	-1,547,361,464.78	8,509,557,786.16

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	52,010,643.12	376,136,014.14
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-
合计	52,010,643.12	376,136,014.14

注：本基金本报告期内及上年度可比期间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		5,337,769,387.71	6,019,695,426.56	681,926,038.85
债券	交易所市场	97,076,427.87	91,960,279.80	-5,116,148.07
	银行间市场	269,909,200.00	268,744,000.00	-1,165,200.00
	合计	366,985,627.87	360,704,279.80	-6,281,348.07
资产支持证券		-	-	-
其他		-	-	-
合计		5,704,755,015.58	6,380,399,706.36	675,644,690.78
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		6,795,249,828.89	7,245,232,266.51	449,982,437.62
债券	交易所市场	464,313,298.41	468,860,077.40	4,546,778.99
	银行间市场	348,524,600.00	347,170,000.00	-1,354,600.00
	合计	812,837,898.41	816,030,077.40	3,192,178.99
资产支持证券		-	-	-
其他		-	-	-
合计		7,608,087,727.30	8,061,262,343.91	453,174,616.61

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	260,000,000.00	0.00
合计	260,000,000.00	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	61,000,000.00	0.00
银行间	70,560,345.84	0.00
合计	131,560,345.84	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	11,795.88	82,695.71
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	79,110.55	16,079.42
应收债券利息	7,161,913.39	10,953,959.45
应收买入返售证券利息	73,122.74	73,487.41
应收申购款利息	-	-
其他	725.60	-
合计	7,326,668.16	11,126,221.99

7.4.3.6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。

7.4.3.7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	3,403,391.06	2,795,003.94
银行间市场应付交易费用	434.98	24,684.60
合计	3,403,826.04	2,819,688.54

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	-	500,000.00
应付赎回费	10,378.46	9,127.02
预提审计费	100,000.00	120,000.00
预提信息披露费	200,000.00	300,000.00
其他应付款其他	18,000.00	-
合计	328,378.46	929,127.02

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	10,056,919,250.94	10,056,919,250.94
本期申购	353,613,564.45	353,613,564.45
本期赎回（以“-”号填列）	-2,840,932,030.72	-2,840,932,030.72
本期末	7,569,600,784.67	7,569,600,784.67

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。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	-1,805,541,052.51	258,179,587.73	-1,547,361,464.78
本期利润	287,777,369.30	222,470,074.17	510,247,443.47
本期基金份额交易产生的变动数	385,911,912.38	-99,480,418.82	286,431,493.56
其中：基金申购款	-56,189,782.63	15,967,208.63	-40,222,574.00
基金赎回款	442,101,695.01	-115,447,627.45	326,654,067.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,131,851,770.83	381,169,243.08	-750,682,527.75

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	623,680.30	2,636,093.96
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	1,739,414.39	3,306,867.34
其他	27,890.65	296.80
合计	2,390,985.34	5,943,258.10

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	8,851,089,148.23	5,794,013,481.44
减：卖出股票成本总额	8,540,791,634.51	6,237,281,789.17
买卖股票差价收入	310,297,513.72	-443,268,307.73

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	798,084,832.51	904,542,066.28
减：卖出债券（、含债转股及债券到期兑付）成本总额	775,188,294.90	879,683,360.00
减：应收利息总额	16,635,385.85	27,420,636.28
债券投资收益	6,261,151.76	-2,561,930.00

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	110,350,120.69	104,339,141.28
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	110,350,120.69	104,339,141.28

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	222,470,074.17	965,524,274.28
股票投资	231,943,601.23	964,320,470.08
债券投资	-9,473,527.06	1,203,804.20
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	222,470,074.17	965,524,274.28

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	448,088.62	80,367.42
基金转换费收入	200,649.04	102,138.43
其他	146,373.43	46,227.03
合计	795,111.09	228,732.88

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	25,011,555.43	17,510,029.18
银行间市场交易费用	2,825.00	16,525.00
合计	25,014,380.43	17,526,554.18

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	120,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行费用	4,629.75	25,209.31
债券账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	422,629.75	463,209.31

7.4.4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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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。

7.4.5本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.5.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.5.1.1股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2013年01月01日至2013年12月31日）		上年度可比期间（2012年01月01日至2012年12月31日）	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
海通证券	1,630,413,469.68	10.23	1,149,198,211.05	10.00
申银万国	2,350,052,272.28	14.75	2,090,038,910.21	18.18

7.4.5.1.2权证交易

注：本基金本年度及上年度未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.5.1.3债券交易

金额单位：人民币元

|