富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金

【2013】第四季度报告

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
报告送出日期：	2014年01月22日

§1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会及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责任。

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2014年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至2013年12月31日。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额（单位：份）	605,097,796.32
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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2013年10月01日-2013年12月31日）
1.本期已实现收益	-26,639,427.86
2.本期利润	-27,106,966.71
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0423
4.期末基金资产净值	648,377,827.78
5.期末基金份额净值	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。

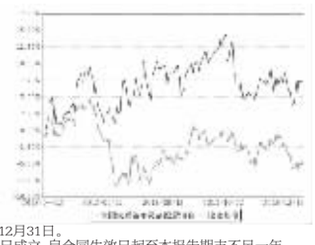
3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期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	净值增长率①	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	-3.51%	1.14%	-2.66%	0.74%	-0.85%	0.40%

注：过去三个月指2013年10月1日－2013年12月31日

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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2013年4月12日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

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。

§4 管理人报告

4.1 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汉盛证券投资基金基金经理	2013-04-12	-	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。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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，确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，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 公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

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。

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。

4.3.2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1次同日反向交易或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 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

回顾2013年四季度，整体经济增长稳中趋弱，在经历了三季度的反弹后，部分经济指标呈现出增长放缓的态势。随着十八届三中全会的召开，一方面经济改革的方向性和坚定性得到进一步地确认，但投资者同时担心改革初期会对经济增长造成一定负面影响。同时IPO重新开闸的消息也对市场情绪造成一定冲击，并伴之后资金分流和估值中枢未来可能下移给市场带来负面影响。综上所述，四季度市场呈现震荡下行走势，整个季度沪深300指数下跌3.28%。

在投资管理上，我们坚持采取量化策略进行指数增强和风险管理，量化增强策略获得了较好的表现，报告期内，本基金的超额收益为0.23%。本基金在报告期内遇到多次申购赎回，在一定程度上增加了本基金的交易成本。

展望2014年，中国经济改革将在2014加速推进，产业结构调整、财税体制改革、对外经济开放、国企改革、新兴城镇化和金融改革六个领域将成为改革的重点方向。货币信贷政策仍将稳中偏紧，投资者需要密切关注地方政府融资平台和影子银行监管等事件性风险。预计2014年整体将呈现先抑后扬走势，改革业绩的逐渐兑现将使得投资者对于经济的信心有系统性的回升。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期，本基金份额净值增长率为-2.89%，同期业绩比较基准收益率为-2.73%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	501,878,562.84	73.67
	其中：股票	501,878,562.84	73.67
2	固定收益投资	29,966,721.60	4.40
	其中：债券	29,966,721.60	4.40
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	95,000,000.00	13.94
	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	30,024,520.69	4.41
6	其他资产	24,418,167.00	3.58
7	合计	681,287,972.13	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	3,225,756.80	0.50
C	制造业	329,731,253.11	50.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,828,824.07	1.05
E	建筑业	7,064,030.54	1.09
F	批发和零售业	11,592,559.26	1.79
G	交通运输、仓储和邮政业	8,589,049.67	1.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	107,098,816.29	16.52
J	金融业	-	-
K	房地产业	27,748,273.10	4.28
L	租赁和商务服务业	-	-
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	501,878,562.84	77.41

5.3报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300085	银之杰	1,768,517	49,518,476.00	7.64
2	600060	海信电器	3,884,661	44,828,987.94	6.91
3	000651	格力电器	704,693	23,015,273.38	3.55
4	600703	三安光电	806,495	19,993,011.05	3.08
5	600066	宇通客车	1,108,757	19,469,772.92	3.00
6	300253	卫宁软件	259,526	18,844,182.86	2.91
7	600309	万华化学	866,800	17,942,760.00	2.77
8	002049	同方国芯	339,109	16,745,202.42	2.58
9	600894	广日股份	1,089,615	13,097,172.30	2.02
10	300226	上海钢联	342,269	12,663,953.00	1.95

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	29,832,000.00	4.60
	其中：政策性金融债	29,832,000.00	4.60
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	134,721.60	0.02
8	其他	-	-
9	合计	29,966,721.60	4.62

5.5报告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

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	130322	13进出22	300,000	29,832,000.00	4.60
2	113006	深燃转债	1,360	134,721.60	0.02

5.6报告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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7报告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。

5.8报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末股指期货。

5.8.2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。

5.9报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1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。

5.9.2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。

5.9.3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。

5.10投资组合报告附注

5.10.1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。

5.10.2申明本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。

5.10.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,512,675.44
2	应收证券清算款	19,551,078.89
3	应收股利	-
4	应收利息	449,139.53
5	应收申购款	2,905,273.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,418,167.00

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告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。

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	609,803,991.12
报告期期间基金总申购份额	97,772,478.62
减：报告期期间基金总赎回份额	102,478,673.42
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	605,097,796.32

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

基金托管人2013年12月5日发布任免通知，聘任黄秀莲为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

1、中国证监会批准设立富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金的文件

2、富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同

3、富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议

4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件

5、富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金财务报表及报表附注

6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

9.2存放地点

上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层

9.3查阅方式

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。

咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）

公司网址：http://www.fullgoal.com.cn

富国基金管理有限公司
2014年01月22日

富国沪深300增强证券投资基金

【2013】第四季度报告

基金管理人：	富国基金管理有限公司
基金托管人：	中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：	2014年01月22日

§1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国沪深300指数增强
基金主代码	100038
交易代码	前端交易代码：100038 后端交易代码：000154
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月16日
报告期末基金份额总额（单位：份）	3,761,232,477.52
投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对沪深300指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以“指数化投资为主、主动性投资为辅”，在复制目标指数的基础上一定程度地调整个股，力求投资收益能够跟踪并适度超越目标指数。
业绩比较基准	95%×沪深300指数收益率+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2013年10月01日-2013年12月31日）
1.本期已实现收益	26,692,173.90
2.本期利润	-98,564,222.89
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0229
4.期末基金资产净值	3,036,982,001.41
5.期末基金份额净值	0.807

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。

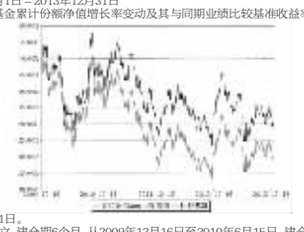
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-2.89%	1.05%	-2.73%	1.07%	-0.16%	-0.02%

注：过去三个月指2013年10月1日－2013年12月31日

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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2009年12月16日成立，建仓期6个月，从2009年12月16日至2010年6月15日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 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		
李笑薇	本基金基金经理兼任公司总经理助理、量化与海外投资部总经理、富国中证500指数增强型证券投资基金基金经理	2009-12-23	-	11年	博士，曾任摩根士丹利资本国际Barra公司(MSCIBARRA)，BARRA股票风险评估部高级研究员；巴克莱国际投资管理公司(BarclaysGlobal Investors)，大中华主动股票投资总监；高级基金经理及高级研究员；2009年6月加入富国基金管理有限公司，2011年1月至2012年5月任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基金经理，2009年12月至今任富国沪深300增强证券投资基金基金经理，2011年10月至今任富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理；兼任富国基金公司总经理助理、量化与海外投资部总经理；具有中国基金从业资格，美国国籍。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国沪深300增强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》、《富国沪深300增强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，确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，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 公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

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。

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。

4.3.2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1次同日反向交易或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 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

企业债收益率在四季度在6月下旬资金收紧收益率大幅上行后维持高位。四季度本基金按照基金的投资风格，仍然主要集中于信用债的投资，基金在仓位和券种选择上加强筛选力度。2014年一季度我们预期CPI维持低位以及经济增速向在预期范围内，基本面对债市的支撑尚在，但是供给需求的力量对比还有不确定性以及各项经济稳增长政策的推出，一季度将在继续维持基本仓位的基础上，做好组合结构调整。本基金一季度在保持本基金长期投资风格基础上，将继续着力于在市场泥沙俱下的环境下，以“信用优先”为前提，通过更深入的研究和实地调研挖掘市场个券品种的投资机会，力争为投资者带来稳定的长期回报。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期，本基金份额净值增长率为-0.46%，同期业绩比较基准收益率为-1.74%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	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	3,619,868,504.94	93.46
	其中：债券	3,616,868,504.94	93.38
	资产支持证券	3,000,000.00	0.08
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	138,638,350.04	3.58
6	其他资产	114,735,424.55	2.96
7	合计	3,873,242,279.53	100.00

5.2报告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。

5.3报告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。

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	313,562,000.00	13.32
	其中：政策性金融债	29,424,000.00	1.25
4	企业债券	3,185,289,504.94	135.29
5	企业短期融资券	49,981,000.00	2.12
6	中期票据	68,036,000.00	2.89
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	3,616,868,504.94	153.62

5.5报告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

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	18,531,693.67	0.61
B	采矿业	9,913,537.70	0.33
C	制造业	336,526,569.51	11.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,325.00	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	51,963,416.11	1.71
G	交通运输、仓储和邮政业	49,284,405.64	1.62
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,780,228.00	1.15
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	501,003,175.63	16.50

5.3 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	178,611,942.82	5.88
C	制造业	766,365,800.42	25.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	61,311,038.70	2.02
E	建筑业	108,852,489.05	3.58
F	批发和零售业	35,422,764.10	1.17
G	交通运输、仓储和邮政业	33,469,429.52	1.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,174,970.00	0.17
J	金融业	982,265,816.50	32.34
K	房地产业	195,002,303.60	6.42
L	租赁和商务服务业	12,359,451.10	0.41
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	3,429,613.44	0.11
S	综合	-	-
	合计	2,382,265,619.25	78.44

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.4.1报告期末指数投资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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	11,951,408	130,150,833.12	4.29
2	601318	中国平安	2,991,240	124,824,445.20	4.11
3	601166	兴业银行	10,774,760	109,256,066.40	3.60
4	600016	民生银行	13,232,626	102,155,872.72	3.36
5	000002	万 科A	10,901,958	87,542,722.74	2.88
6	000651	格力电器	2,397,370	78,298,104.20	2.58
7	601088	中国神华	4,580,505	72,463,589.10	2.39
8	601668	中国建筑	22,289,116	69,987,824.24	2.30
9	600887	伊利股份	1,761,843	68,852,824.44	2.27
10	600048	保利地产	7,762,582	64,041,301.50	2.11

5.4.2报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601000	唐山港	11,996,104	36,708,078.24	1.21
2	000050	深天马A	2,751,869	31,068,601.01	1.02
3	600737	中粮屯河	5,781,400	30,814,862.00	1.01
4	000951	中国重汽	2,452,150	28,052,596.00	0.92
5	600280	中央商场	1,733,821	22,227,585.22	0.73

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	9,691,830.00	0.32
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	9,691,830.00	0.32

5.6 报告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

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	019322	13国债22	82,000	8,199,180.00	0.27
2	019307	13国债07	15,000	1,492,650.00	0.05

5.7 报告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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 报告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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末股指期货。

5.9.2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。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1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。

5.10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末股指期货。

5.10.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1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。

本期，本基金持有的中国平安于2013年5月21日公告其集团控股子公司平安证券有限责任公司（以下简称“平安证券”）于近日收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《行政处罚和市场禁入事先告知书》，于2013年10月14日公告控股子公司平安证券近日收到《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》（〔2013〕48号），中国证监会决定责令平安证券改正及处予警告，没收其在万福生科（湖南）农业开发股份有限公司发行上市项目中的业务收入，并处罚款，暂停其保荐业务许可3个月。

中国平安为本基金跟踪标的指数的样本股，基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余9名证券的发行主体本期未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

5.11.2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。

本报告期本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,276,987.52
2	应收证券清算款	116,951,073.84
3	应收股利	-
4	应收利息	129,529.43
5	应收申购款	1,395,302.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	119,752,893.50

5.11.4报告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。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1期末指数投资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。

5.11.5.2期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	4,634,220,079.36
报告期期间基金总申购份额	169,469,225.13
减：报告期期间基金总赎回份额	1,042,456,826.97
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	3,761,232,477.52

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情