

# 信息披露 Disclosure

## 广发理财年年红债券型证券投资基金

### 2013 年 度 报 告 摘 要

由于投资品种剩余期限的限制,本基金以短期债券为主,因此受2013年债市深度调整的影响较小,全年取得正收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现  
广发年年红本基金报告期内增长率为5.06%,业绩比较基准收益率为3.04%。

4.5管理人及宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望  
对于2014年,经济增速将放缓以及宏观经济企稳的预期相对确定的,这种宏观环境奠定了债市市场走牛的基础,不确定性在于决定经济中长期走市的政策调整进程,及其相关的配套政策的落实。

我们认为,改革将成为2014年宏观经济的主基调。但由于中国经济在旧的经济关系下,各类关系盘根错节,相互依赖性极强,主动改革的意愿不强,推动改革的难度非常大,因此,在一个相当长的时间内,维持一个中性的策略的金融面推动经济去杠杆是其最佳的进程。在这个过程中,将伴随以可控的方式释放出来的风险教育,在上述背景下,我们认为债市今年走牛的概率大于走牛的概率。由于当前她对收益率已经较高,只要保守操作,即可获得可观的票息收入。

本基金目前的杠杆比例已经在2013年的收益率高点附近加到接近上限的水平,加杠杆的空间已经非常小,由于存量资产的静态收益率较高,杠杆操作仍会贡献超额收益,因此当前高杠杆会维持到第二个运作期结束。

对于下一个运作期,由于交易所存债规模中满足期限要求的债券规模逐步增加,交易所信用债的配置仓位会提高;对于银行间债券,考虑到信用债占比10%的外部监管规定可能在2014年推出,投资策略需要根据下一期的基金规模而定。如果下一期的基金规模仍在10亿元以下,银行间债券的操作空间将非常小,本基金将以交易所债券作为投资主体。

4.6管理人及报告期内基金估值程序等事项的说明  
公司设有估值委员会,按照相关法律法规和证监会的相关规定,负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序,并选取适当的估值方法,经公司管理层批准后执行。估值委员会成员包括:公司总经理、估值委员会的副经理、督察长、投资管理部负责人、研究发展部负责人、金融工程部负责人、监察稽核部负责人和基金会计负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价,在发生了影响估值政策和程序的有效性及时性的情况后及时修订估值方法,以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计具体执行,并确保和托管行统一。投资研究人员及时提供公允价值变化,证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素,向估值委员会提出估值建议,确保估值的公允性。金融工程部负责提供涉及估值模型的技术支持。监察稽核部负责定期和不定期对估值程序和方法进行检查,确保估值委员会的各项决议得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验,为保证基金估值的客观独立,基金经理不参与估值的具体操作,但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况,可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突,切实维护基金持有人利益为准则。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明  
根据本基金合同中“基金收益与分配”之“(三)基金收益分配原则”的相关规定,本基金本年度未进行利润分配,符合合同约定。

5.1 报告期内本基金托管人遵守信守情况  
本报告期内,本基金托管人在对广发理财年年红债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同有关规定,不存在任何损害基金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义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵守程序、净值计算、利润分配等情况的说明  
本报告期内,广发理财年年红债券型证券投资基金的托管人——广发基金管理有限公司在广发理财年年红债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金基金份额持有人利益的行为,在各项重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,广发理财年年红债券型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等的真实、准确和完整发表意见  
本托管人依法对广发基金管理有限公司编制的广发理财年年红债券型证券投资基金2013年年度报告中财务报告、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

本年度报告的基金财务会计报告经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师 郭新华郭增光签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

7.1 资产估值表  
会计主体:广发理财年年红债券型证券投资基金  
报告截止日:2013年12月31日

| 资产       | 期末<br>2013年12月31日 | 上年度末<br>2012年12月31日 |
|----------|-------------------|---------------------|
| 货币       | 77,324.97         | 1,208,129.65        |
| 银行存款     | 290,226.89        | 49,090.01           |
| 存放债券     | 3,659.30          | 53,571.42           |
| 交易性金融资产  | 103,560,434.74    | 539,104,773.58      |
| 其中:股票投资  | -                 | -                   |
| 债券投资     | 103,560,434.74    | 539,104,773.58      |
| 资产支持证券投资 | -                 | -                   |
| 贵金属投资    | -                 | -                   |
| 应收款项     | -                 | 2,500,000.00        |
| 买入返售金融资产 | 100,000.00        | -                   |
| 应收利息     | 2,317,832.31      | 10,366,764.15       |
| 应收申购款    | -                 | -                   |
| 递延所得税资产  | -                 | -                   |
| 其他资产     | -                 | -                   |
| 资产总计     | 106,309,478.21    | 553,279,329.71      |

| 负债和所有者权益   | 期末<br>2013年12月31日 | 上年度末<br>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  | 38,599,764.45     | -                   |
| 应付证券清算款    | -                 | -                   |
| 应付赎回款      | -                 | -                   |
| 应付管理人报酬    | 15,448.21         | 126,278.49          |
| 应付托管费      | 4,577.23          | 37,414.06           |
| 应付销售服务费    | -                 | -                   |
| 应付交易费用     | 2,723.33          | 1,880.00            |
| 应付股利       | -                 | -                   |
| 应付利息       | 35,190.00         | -                   |
| 应付利润       | -                 | -                   |
| 递延所得税负债    | -                 | -                   |
| 其他负债       | 159,000.00        | 80,000.00           |
| 合计         | 38,816,705.52     | 245,450.45          |
| 所有者权益:     |                   |                     |
| 实收基金       | 63,108,641.30     | 543,111,437.13      |
| 未分配利润      | 4,384,133.69      | 9,922,321.13        |
| 所有者权益合计    | 67,492,774.99     | 553,033,759.26      |
| 负债和所有者权益总计 | 106,309,478.21    | 553,279,329.71      |

注:1.报告截止日2013年12月31日,基金份额净值人民币1.019元,基金份额总额66,238,424.25份。  
2.上年度会计期间为2012年7月19日至2012年12月31日。

7.2 利润表  
会计主体:广发理财年年红债券型证券投资基金  
本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

| 项目                    | 本期<br>2013年1月1日至2013年12月31日 | 上年度可比期间<br>2012年7月19日至2012年12月31日 |
|-----------------------|-----------------------------|-----------------------------------|
| 一、收入                  | 20,529,970.01               | 11,011,921.67                     |
| 1.利息收入                | 15,523,995.75               | 9,527,347.81                      |
| 其中:存款利息收入             | 1,134,900.53                | -                                 |
| 债券利息收入                | 12,580,087.73               | 8,242,110.98                      |
| 资产支持证券投资收入            | -                           | -                                 |
| 公允价值变动损益              | 1,809,011.49                | 310,563.80                        |
| 其他业务收入                | -                           | -                                 |
| 二、投资收益(损失以“-”号填列)     | 5,089,276.26                | 1,484,573.86                      |
| 其中:股票投资收益             | -                           | -                                 |
| 债券投资收益                | 5,089,276.26                | 1,484,573.86                      |
| 资产支持证券投资损益            | -                           | -                                 |
| 贵金属投资收益               | -                           | -                                 |
| 其他综合收益                | -                           | -                                 |
| 三、公允价值变动损益(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 四、其他业务收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 五、其他收入(损失以“-”号填列)     | -                           | -                                 |
| 六、其他收入(损失以“-”号填列)     | -                           | -                                 |
| 七、其他收入(损失以“-”号填列)     | -                           | -                                 |
| 八、其他收入(损失以“-”号填列)     | -                           | -                                 |
| 九、其他收入(损失以“-”号填列)     | -                           | -                                 |
| 十、其他收入(损失以“-”号填列)     | -                           | -                                 |
| 十一、其他收入(损失以“-”号填列)    | -                           | -                                 |
| 十二、其他收入(损失以“-”号填列)    | -                           | -                                 |
| 十三、其他收入(损失以“-”号填列)    | -                           | -                                 |
| 十四、其他收入(损失以“-”号填列)    | -                           | -                                 |
| 十五、其他收入(损失以“-”号填列)    | -                           | -                                 |
| 十六、其他收入(损失以“-”号填列)    | -                           | -                                 |
| 十七、其他收入(损失以“-”号填列)    | -                           | -                                 |
| 十八、其他收入(损失以“-”号填列)    | -                           | -                                 |
| 十九、其他收入(损失以“-”号填列)    | -                           | -                                 |
| 二十、其他收入(损失以“-”号填列)    | -                           | -                                 |
| 二十一、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 二十二、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 二十三、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 二十四、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 二十五、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 二十六、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 二十七、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 二十八、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 二十九、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 三十、其他收入(损失以“-”号填列)    | -                           | -                                 |
| 三十一、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 三十二、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 三十三、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 三十四、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 三十五、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 三十六、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 三十七、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 三十八、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 三十九、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 四十、其他收入(损失以“-”号填列)    | -                           | -                                 |
| 四十一、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 四十二、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 四十三、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 四十四、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 四十五、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 四十六、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 四十七、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 四十八、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 四十九、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 五十、其他收入(损失以“-”号填列)    | -                           | -                                 |
| 五十一、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 五十二、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 五十三、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 五十四、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 五十五、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 五十六、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 五十七、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 五十八、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 五十九、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 六十、其他收入(损失以“-”号填列)    | -                           | -                                 |
| 六十一、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 六十二、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 六十三、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 六十四、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 六十五、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 六十六、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 六十七、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 六十八、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 六十九、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 七十、其他收入(损失以“-”号填列)    | -                           | -                                 |
| 七十一、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 七十二、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 七十三、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 七十四、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 七十五、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 七十六、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 七十七、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 七十八、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 七十九、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 八十、其他收入(损失以“-”号填列)    | -                           | -                                 |
| 八十一、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 八十二、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 八十三、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 八十四、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 八十五、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 八十六、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 八十七、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 八十八、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 八十九、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 九十、其他收入(损失以“-”号填列)    | -                           | -                                 |
| 九十一、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 九十二、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 九十三、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 九十四、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 九十五、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 九十六、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 九十七、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 九十八、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 九十九、其他收入(损失以“-”号填列)   | -                           | -                                 |
| 一百、其他收入(损失以“-”号填列)    | -                           | -                                 |
| 一百零一、其他收入(损失以“-”号填列)  | -                           | -                                 |
| 一百零二、其他收入(损失以“-”号填列)  | -                           | -                                 |
| 一百零三、其他收入(损失以“-”号填列)  | -                           | -                                 |
| 一百零四、其他收入(损失以“-”号填列)  | -                           | -                                 |
| 一百零五、其他收入(损失以“-”号填列)  | -                           | -                                 |
| 一百零六、其他收入(损失以“-”号填列)  | -                           | -                                 |
| 一百零七、其他收入(损失以“-”号填列)  | -                           | -                                 |
| 一百零八、其他收入(损失以“-”号填列)  | -                           | -                                 |
| 一百零九、其他收入(损失以“-”号填列)  | -                           | -                                 |
| 一百一十、其他收入(损失以“-”号填列)  | -                           | -                                 |
| 一百一十一、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百一十二、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百一十三、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百一十四、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百一十五、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百一十六、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百一十七、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百一十八、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百一十九、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百二十、其他收入(损失以“-”号填列)  | -                           | -                                 |
| 一百二十一、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百二十二、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百二十三、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百二十四、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百二十五、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百二十六、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百二十七、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百二十八、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百二十九、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百三十、其他收入(损失以“-”号填列)  | -                           | -                                 |
| 一百三十一、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百三十二、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百三十三、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百三十四、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百三十五、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百三十六、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百三十七、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百三十八、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百三十九、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百四十、其他收入(损失以“-”号填列)  | -                           | -                                 |
| 一百四十一、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百四十二、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百四十三、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百四十四、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百四十五、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百四十六、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百四十七、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百四十八、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百四十九、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百五十、其他收入(损失以“-”号填列)  | -                           | -                                 |
| 一百五十一、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百五十二、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百五十三、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百五十四、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百五十五、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百五十六、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百五十七、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百五十八、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百五十九、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百六十、其他收入(损失以“-”号填列)  | -                           | -                                 |
| 一百六十一、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百六十二、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百六十三、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百六十四、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百六十五、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百六十六、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百六十七、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百六十八、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百六十九、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百七十、其他收入(损失以“-”号填列)  | -                           | -                                 |
| 一百七十一、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百七十二、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百七十三、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百七十四、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百七十五、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百七十六、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百七十七、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百七十八、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百七十九、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百八十、其他收入(损失以“-”号填列)  | -                           | -                                 |
| 一百八十一、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百八十二、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百八十三、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百八十四、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百八十五、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百八十六、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百八十七、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百八十八、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百八十九、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百九十、其他收入(损失以“-”号填列)  | -                           | -                                 |
| 一百九十一、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百九十二、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百九十三、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百九十四、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百九十五、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百九十六、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百九十七、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百九十八、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 一百九十九、其他收入(损失以“-”号填列) | -                           | -                                 |
| 二百、其他收入(损失以“-”号填列)    | -                           | -                                 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表  
会计主体:广发理财年年红债券型证券投资基金  
本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

|          |                    |                     |   |
|----------|--------------------|---------------------|---|
| 股权投资     | -                  | -                   | 本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方佣金,本报告期末及上年度末无应支付关联方佣金余款。 |
| 应收申购款    | -                  | -                   | 7.48.2关联方报酬                                       |
| 递延所得税资产  | -                  | -                   | 7.48.2.1基金管理费                                     |
| 其他资产     | -                  | -                   | 7.48.2.1基金管理人                                     |
| 资产总计     | 106,309,478.21     | 553,279,329.71      | 单位:人民币元   |
| 负债和所有者权益 |                    |                     |   |
|          | 本期末<br>2013年12月31日 | 上年度末<br>2012年12月31日 |   |