（上接B348版）

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2014年4月30日起至2014年6月30日止。

7.4.4.2记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，起按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2)债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益；

卖出债券的成本按移动加权平均法结转

(3)权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4)分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5)回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1）股票投资

(1)上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2)未上市的股票的估值

A.送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B.首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

C.非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票的初始取得成本时，应采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的初始取得成本时，应按中国证监会相关规定处理。

2）债券投资

(1)证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3)未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4)在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

3）权证投资

(1)上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2)未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3)因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

4)分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述2)、3)中的相关原则进行估值；

5）其他

(1)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2)如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5)股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6)债券投资收益/(损失)于成交日确认债券投资收益/(损失)，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7)衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8)股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9)公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10费用的确认和计量

(1)基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率逐日计提；

(2)基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提；

(3)卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4)其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次；若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；基金合同生效满3个月后，若基金在每季度最后一个自然日收盘后每10份基金份额可供分配利润金额高于0.1元(含)，则本基金须在10个工作日之内进行收益分配；

(2) 每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的20%；

(3) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(4) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值

(5) 每一基金份额享有同等分配权；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1会计政策变更的说明

本基金本期未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3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。

7.4.6税项

1.印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。1.印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税；根据财政部、国家税务总局财税字[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，对于证券投资基金通过公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

7.4.7关联方关系

7.4.7.1本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本期内本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

7.4.7.2本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金发起人
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
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

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。

7.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
海通证券	897,765,528.54	27.64

注：本基金转型日为2014年4月30日。

7.4.8.1.2权证交易

注：1、本基金转型日为2014年4月30日。

2、本基金本期（2014年4月30日至2014年6月30日）未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3债券交易

注：1、本基金转型日为2014年4月30日。

2、本基金本期（2014年4月30日至2014年6月30日）未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.4回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年6月30日	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例(%)
海通证券	60,000,000.00	12.24

注：本基金转型日为2014年4月30日。

7.4.8.1.5应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年6月30日			
	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
海通证券	798,822.26	27.58	798,822.26	27.58

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，扣除由证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和买（卖）证管费等）。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

2、本基金转型日为2014年4月30日。

7.4.8.2关联方报酬

7.4.8.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,701,492.52
其中：支付销售机构的客户维护费	50,834.18

注：基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.5%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.8.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	783,840.32

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.25%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.4各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年6月30日
基金转型日(2014年04月30日)持有的基金份额	10,000,000.00
期初持有的基金份额	–
期间申购/买入总份额	–
期间因拆分变动份额	149,094.02
减：期间赎回/卖出总份额	–
期末持有的基金份额	10,149,094.02
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.61%

注：本基金转型日为2014年04月30日。本基金管理人持有本基金份额由原汉盛证券投资基金转型而来。

7.4.8.4.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末(2014年06月30日)	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)
申银万国证券股份有限公司	10,149,094.03	0.61
山东省国际信托有限公司	5,074,547.01	0.31

注：本基金转型日为2014年04月30日。本基金管理人持有本基金份额由原汉盛证券投资基金转型而来。

7.4.8.5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2014年4月30日(基金转型日)至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	80,877,053.21	522,199.99

7.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.8.7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事项。

7.4.9期末（2014年06月30日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.9.1.1受限证券类别：股票

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	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002727	一心堂	2014-06-25	2014-07-02	新股认购	12.20	12.20	4,484	54,704.80	54,704.80	–
603328	依顿电子	2014-06-23	2014-07-01	新股认购	15.31	15.31	31,770	486,398.70	486,398.70	–

7.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002340	格林美	2014-06-26	筹划重大事项	11.19	2014-07-24	11.77	294,496	3,355,593.10	3,295,410.24	–
300088	长信科技	2014-03-13	筹划重大事项	19.49	2014-07-01	18.00	366,450	8,026,990.26	7,142,110.50	–
300137	先河环保	2014-06-16	筹划重大事项	20.86	2014-08-15	14.31	562,688	11,809,604.06	11,737,671.68	–
300323	华灿光电	2014-04-28	筹划重大事项	18.68	2014-07-28	11.21	422,257	7,431,672.63	7,887,760.76	–

7.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额；没有因正回购而作为抵押的银行间市场债券。

7.4.9.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无证券交易所债券正回购余额，未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 转型前基金（原汉盛证券投资基金）投资组合报告

8.1转型前最后一日基金资产组合情况

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	1,007,692,357.13	49.59
	其中：股票	1,007,692,357.13	49.59
2	固定收益投资	810,581,433.30	39.89
	其中：债券	810,581,433.30	39.89
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	192,775,453.60	9.49
7	其他各项资产	21,002,028.29	1.03
8	合计	2,032,051,272.32	100.00

注：转型前最后一日为2014年4月29日。8.2转型前最后一日按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	3,746,979.00	0.19
B	采矿业	2,746,140.80	0.14
C	制造业	637,125,968.68	31.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	76,068,302.91	3.77
E	建筑业	41,842,710.00	2.08
F	批发和零售业	9,234,201.04	0.46
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	128,090,197.65	6.35
J	金融业	–	–
K	房地产业	104,881,479.45	5.20
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	3,956,377.60	0.20
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	1,007,692,357.13	49.98

注：转型前最后一日为2014年4月29日。

8.3转型前最后一日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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600703	三安光电	7,832,593	186,259,061.54	9.24
2	000712	锦龙股份	2,839,429	76,068,302.91	3.77
3	300085	银之杰	5,065,222	74,712,024.50	3.71
4	002520	日发精机	2,082,214	55,053,738.16	2.73
5	600340	华夏幸福	1,599,376	40,640,144.16	2.02
6	002405	四维图新	2,546,738	39,296,167.34	1.95
7	300129	泰胜风能	3,078,818	37,869,461.40	1.88
8	600584	长电科技	4,880,428	36,310,384.32	1.80
9	002415	海康威视	1,813,110	33,433,748.40	1.66
10	000961	中南建设	4,755,172	32,144,962.72	1.59

注：转型前最后一日为2014年4月29日。

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于富国基金管理有限公司网站的半年度报告正文

8.4期初至转型前最后一日（2014年1月1日至2014年4月29日）股票投资组合的重大变动

8.4.1累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600584	长电科技	102,385,791.15	4.10
2	000712	锦龙股份	86,261,444.93	3.45
3	300266	兴源过滤	72,532,570.16	2.90
4	300129	泰胜风能	69,295,085.80	2.77
5	000961	中南建设	59,030,050.98	2.36
6	300183	东软载波	52,852,250.45	2.12
7	002520	日发精机	49,173,510.52	1.97
8	002586	围海股份	48,996,823.47	1.96
9	600340	华夏幸福	48,774,060.18	1.95
10	002405	四维图新	46,186,964.75	1.85
11	600563	法拉电子	44,963,339.86	1.80
12	600894	广日股份	44,947,558.37	1.80
13	002440	闰土股份	44,021,493.68	1.76
14	000801	四川九洲	43,444,190.75	1.74
15	002415	海康威视	40,490,120.42	1.62
16	600685	广船国际	40,064,972.19	1.60
17	000671	阳 光 城	39,921,803.44	1.60
18	601933	永辉超市	36,235,176.59	1.45
19	000997	新 大 陆	35,479,191.75	1.42
20	002206	海 利 得	34,988,537.41	1.40

注：转型前最后一日为2014年4月29日。“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000423	东阿阿胶	127,522,191.32	5.11
2	600060	海信电器	116,274,102.30	4.65
3	600859	王府井	92,062,391.41	3.69
4	600584	长电科技	86,408,685.10	3.46
5	600703	三安光电	68,224,688.61	2.73
6	000651	格力电器	62,223,820.07	2.49
7	601607	上海医药	60,115,227.20	2.41
8	300266	兴源过滤	57,238,996.54	2.29
9	600649	城投控股	55,061,148.43	2.20
10	600894	广日股份	54,772,522.18	2.19
11	600066	宇通客车	51,690,236.61	2.07
12	002214	大立科技	50,029,133.59	2.00
13	600761	安徽合力	49,713,231.35	1.99
14	000801	四川九洲	43,298,083.05	1.73
15	300253	卫宁软件	43,057,498.59	1.72
16	002586	围海股份	41,863,920.13	1.68
17	600685	广船国际	39,619,197.06	1.59
18	600171	上海贝岭	38,677,567.43	1.55
19	002049	同方国芯	38,238,509.62	1.53
20	300183	东软载波	38,131,572.12	1.53

注：转型前最后一日为2014年4月29日。“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本(成交)总额	2,143,000,019.82
卖出股票收入(成交)总额	2,657,542,608.90

注：买入股票成本（成交）总额 和卖出股票收入（成交）总额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5转型前最后一日按债券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	8,791,200.00	0.44
2	央行票据	–	–
3	金融债券	783,906,000.00	38.88
	其中：政策性金融债	783,906,000.00	38.88
4	企业债券	17,679,941.10	0.88
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	204,292.20	0.01
8	其他	–	–
9	合计	810,581,433.30	40.20

注：转型前最后一日为2014年4月29日。

8.6转型前最后一日按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

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	140317	14进出17	1,000,000	99,880,000.00	4.95
2	130227	13国开27	800,000	79,976,000.00	3.97
3	090304	09进出04	700,000	69,944,000.00	3.47
4	130236	13国开36	600,000	60,042,000.00	2.98
5	130428	13农发28	500,000	50,110,000.00	2.49

注：转型前最后一日为2014年4月29日。

8.7转型前最后一日按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：转型前最后一日为2014年4月29日。本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8转型前最后一日按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：转型前最后一日为2014年4月29日。本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9转型前最后一日按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：转型前最后一日为2014年4月29日。本基金本报告期末未持有权证。

8.10转型前最后一日本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1转型前最后一日本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：转型前最后一日为2014年4月29日。本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2期初至转型前最后一日（2014年1月1日至2014年4月29日）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。

8.11转型前最后一日本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1期初至转型前最后一日（2014年1月1日至2014年4月29日）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。

8.11.2转型前最后一日本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：转型前最后一日为2014年4月29日。本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.3期初至转型前最后一日（2014年1月1日至2014年4月29日）国债期货投资评价

转型前最后一日为2014年4月29日。本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12投资组合报告附注

8.12.1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。

8.12.2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。

8.12.3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	1,972,773.43
2	应收证券清算款	3,055,795.96
3	应收股利	–
4	应收利息	15,973,458.90
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	21,002,028.29

注：转型前最后一日为2014年4月29日。

8.12.4转型前最后一日持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113003	重工转债	9,510.30	0.00
2	110015	石化转债	3,078.30	0.00

注：转型前最后一日为