富国天源平衡混合型证券投资基金

2014 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：	中国农业银行股份有限公司
送出日期：	2015年03月28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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年3月26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2014年1月1日起至2014年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	富国天源平衡混合
基金主代码	100016
交易代码	前端交易代码：100016 后端交易代码：100017
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年08月16日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	815,014,727.68份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	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。本基金为平衡型证券投资基金，将基金资产按比例投资于股票和债券，在股票投资中主要投资于成长型股票和价值型股票，并对基金的投资组合进行主动的管理，从而使投资者在承受相对较小风险的情况下，尽可能获得稳定的投资收益。
投资策略	采取自上而下主动性管理策略，资产配置实出两个层面的平衡，一、资产配置的平衡，通过主动调整基金资产中股票和债券的投资比例，以求基金资产在股票市场和债券市场的投资中达到风险和收益的最佳平衡；二、持股结构的平衡，即通过调整股票资产中成长型股票和价值型股票的投资比例实现持股结构的平衡。在投资于良好成长性上市公司的同时，兼顾收益稳定的价值型上市公司。
业绩比较基准	本基金采用"证券市场平均收益率*作为衡量本基金操作水平的比较基准。 证券市场平均收益率=中信标普300指数收益率×65%+中信国债指数收益率×30%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金为平衡型证券投资基金，属于证券投资基金中的中低风险品种，其长期平均的风险和预期收益低于积极成长型基金，高于债券和货币市场基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	范作狮	林蕊
	联系电话	021-20361818	010-66060069
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tgzxpl@abchina.com
客户服务电话		95105686，4008880688	95599
传真		021-20361616	010-68121816

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 中国农业银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9

§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	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	193,054,986.78	148,397,076.97	-70,611,731.26
本期利润	168,068,591.92	167,515,903.30	36,098,610.83
加权平均基金份额本期利润	0.1626	0.1766	0.0384
本期基金份额净值增长率	15.39%	20.17%	4.37%
3.1.2期末数据和指标	2014年12月31日	2013年12月31日	2012年12月31日
期末可供分配基金份额利润	0.1733	0.1030	-0.0821
期末基金资产净值	956,245,088.40	1,098,683,446.98	828,615,181.46
期末基金份额净值	1.1733	1.1030	0.9179

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 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	3.81%	1.34%	25.60%	1.03%	-21.79%	0.31%
过去六个月	14.47%	1.03%	36.59%	0.83%	-22.12%	0.20%
过去一年	15.39%	0.94%	32.42%	0.76%	-17.03%	0.18%
过去三年	44.71%	0.94%	36.70%	0.82%	8.01%	0.12%
过去五年	44.29%	0.96%	8.00%	0.87%	36.29%	0.09%
自基金合同生效日起至今	264.91%	1.07%	131.77%	1.10%	133.14%	-0.03%

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＝中信标普300指数×65%＋中信国债指数×30%＋同业存款利率×5%。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标普国债指数。中信标普300指数和中信标普国债指数具有较强的代表性。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股市场的总体趋势，是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。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（benchmark）按下列公式计算：

benchmark1 = 65% *[中信标普300指数t/中信标普300指数t-1]-1] +30% * [中信国债指数t/中信国债指数t-1]+ 5% * 同业存款利率 / 360；

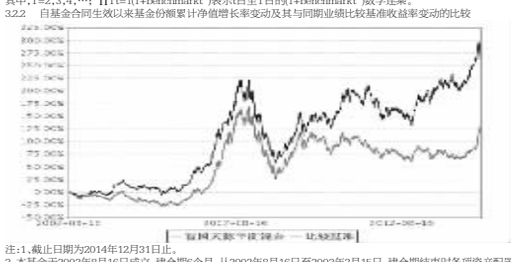
其中，t=1,2,3,…，T，T表示时间截至日；

期间T日收益率（benchmarkT）按下列公式计算：

benchmarkT =[∏Tt=1(1+benchmark1)]-1

其中，T=2,3,4,…；∏Tt=1(1+benchmark1)表示t日至T日的(1+benchmark1)数学连乘。

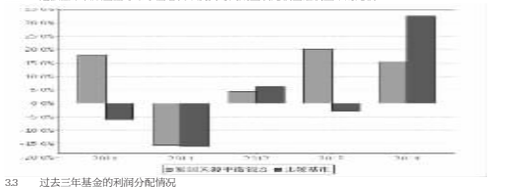
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2014年12月31日止。

2、本基金于2002年8月16日成立，建仓期6个月，从2002年8月16日至2003年2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。

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

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2014年	0.850	64,008,230.69	27,474,978.29	91,483,208.98	1次分红
2013年	-	-	-	-	-
2012年	-	-	-	-	-
合计	0.850	64,008,230.69	27,474,978.29	91,483,208.98	-

§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2014年12月31日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国消费主题混合型证券投资基金、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、富国潜能manager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、富国回报利分级债券型证券投资基金、富国城镇发展股票型证券投资基金、富国高端制造行业股票型证券投资基金、富国收益增强债券型证券投资基金、富国新回报灵活配置混合型证券投资基金、富国研究精选灵活配置混合型证券投资基金、富国中证军工指数分级证券投资基金、富国中证移动互联网指数分级证券投资基金、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金、富国目标养利一年期纯债债券型证券投资基金、富国富钱包货币市场基金、富国收益宝货币市场基金等五十三只证券投资基金。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
曹晋	本基金基金经理	2014-10-23	-	6年	硕士，曾任汇丰晋信基金管理有限公司助理研究员、研究员、基金经理助理、基金经理；2014年6月加入富国基金管理有限公司，2014年10月起任富国天源平衡混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。
李晓铭	本基金前任基金经理	2009-10-29	2014-10-23	10年	硕士，曾任华富基金管理有限公司行业研究员，2006年4月至2009年10月任富国基金管理有限公司行业研究部行业研究员，富国天博创新主题股票型证券投资基金基金经理助理，2009年10月至2014年10月任富国天源基金经理，2011年8月至2014年7月任富国低碳环保股票型证券投资基金基金经理，2014年4月起任富国天益价值证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

注：上述表格内基金经理的任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司决定确定的解聘日期。

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源平衡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》、《富国天源平衡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、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，管理和运用基金资产，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，对关联方承销、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，通过交易系统的投备选库、交易对于库及授权管理、对投资标的、交易对于利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，监察稽核部规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%置信水平下，对同向交易价差进行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14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

2014年，央行重启降息放水，适时托底经济，受益于信贷数据大增以及流动性持续宽松的预期，A股市场走出了一波蓝筹股上涨行情：在以券商为首的权重板块的带领下，沪深300在四季度强势上涨44%，券商、银行、建筑和地产板块表现强势。本基金在2014年根据流动性和经济状况的变化，适度调整了组合结构。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年12月31日，本基金份额净值为1.1733元，份额累计净值为2.7219元。报告期内，本基金份额净值增长率为15.39%，同期业绩比较基准收益率为32.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2015年，我们认为尽管流动性有望继续保持宽松，但是经济下行的压力仍在，流动性的宽松并没有完全改善实体经济的贷款需求。在全球量化宽松的大环境下，新兴国家的汇率大幅贬值，也适度压缩了中国货币政策继续放松的空间。我们认为在全球经济需求下降，流动性相对宽松，中国经济结构转型和企业谋求发展的背景下，企业的创新周期仍会持续。符合创新的企业和方向值得重点关注。本基金将密切关注事件性的冲击影响以及具备新的增长契机的行业，适度调整组合结构。

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、提供相评估估值技术、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

本基金于2014年01月20日公告对2013年报告期内利润进行收益分配，每10份基金份额派发红利0.85元，共计派发红利91483208.98元。

本基金于2015年01月15日公告对2013年报告期内利润进行收益分配，每10份基金份额派发红利1.64元，共计派发红利130855816.23元。

本基金本期分红已符合相关法律法规及《基金合同》约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期无需要说明的相关情形。

§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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—富国基金管理有限公司 2014年1月1日至2014年12月31日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，富国基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，富国基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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：富国天源平衡混合型证券投资基金

报告截止日：2014年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末（2014年12月31日）	上年度末（2013年12月31日）
资 产：		
银行存款	71,472,909.94	32,523,786.10
结算备付金	10,134,022.08	2,862,678.10
存出保证金	833,066.06	255,547.72
交易性金融资产	952,030,341.38	1,061,449,608.29
其中：股票投资	621,838,341.38	728,706,085.99
基金投资	-	-
债券投资	330,192,000.00	332,743,522.30
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	12,148,126.82	-
应收利息	4,489,341.88	4,701,490.33
应收股利	-	-
应收申购款	745,445.84	399,058.89
递延所得税资产	-	-
其他资产	547.03	547.03
资产总计	1,051,853,801.03	1,102,192,716.46
负债和所有者权益	本期末（2014年12月31日）	上年度末（2013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	43,243,435.59	-
应付赎回款	46,077,992.98	964,857.04
应付管理人报酬	1,350,820.26	1,423,904.05
应付托管费	225,136.71	237,317.33
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,300,936.72	646,907.75
应交税费	34,926.80	34,926.80
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	375,463.57	201,356.51
负债合计	95,608,712.63	3,509,269.48
所有者权益：		
实收基金	815,014,727.68	996,084,203.64
未分配利润	141,230,360.72	102,599,243.34
所有者权益合计	956,245,088.40	1,098,683,446.98
负债和所有者权益总计	1,051,853,801.03	1,102,192,716.46

注：报告截止日2014年12月31日，基金份额净值1.1733元，基金份额总额815,014,727.68份。

7.2 利润表

会计主体：富国天源平衡混合型证券投资基金

本报告期：2014年01月01日至2014年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期（2014年01月01日至2014年12月31日）	上年度可比期间（2013年01月01日至2013年12月31日）
一、收入	205,375,534.15	190,588,214.48
1.利息收入	14,737,511.02	12,297,723.18
其中：存款利息收入	444,880.04	417,340.88
债券利息收入	14,147,289.20	11,616,102.65
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	145,341.78	264,279.65
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	214,926,921.47	158,738,636.54
其中：股票投资收益	206,850,089.13	151,636,933.40
基金投资收益	-	-
债券投资收益	726,472.20	-350,514.57
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具投资收益	-	-
股利收益	7,350,360.14	7,452,217.71
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-24,986,394.86	19,118,826.33
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	697,496.52	433,028.43
减：二、费用	37,306,942.23	23,072,311.18
1.管理人报酬	16,511,284.47	14,607,751.81
2.托管费	2,751,880.74	2,434,625.31
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	17,715,600.47	5,836,192.31
5.利息支出	99,921.03	-
其中：卖出回购金融资产支出	99,921.03	-
6.其他费用	228,255.52	193,741.75
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	168,068,591.92	167,515,903.30
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	168,068,591.92	167,515,903.30

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国天源平衡混合型证券投资基金

本报告期：2014年01月01日至2014年12月31日

单位：人民币元

项目	本期（2014年01月01日至2014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)	996,084,203.64	102,599,243.34	1,098,683,446.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	168,068,591.92	168,068,591.92
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)	-181,069,475.96	-37,954,265.56	-219,023,741.52
其中：1.基金申购款	554,057,827.60	27,900,508.35	581,958,335.95
2.基金赎回款	-735,127,303.56	-65,854,773.91	-800,982,077.47
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)	-	-91,483,208.98	-91,483,208.98
五、期末所有者权益(基金净值)	815,014,727.68	141,230,360.72	956,245,088.40

项目	上年度可比期间（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)	902,700,876.06	-74,085,694.60	828,615,181.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	167,515,903.30	167,515,903.30
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)	93,383,327.58	9,169,034.64	102,552,362.22
其中：1.基金申购款	565,711,666.05	24,494,073.41	590,205,739.46
2.基金赎回款	-472,328,338.47	-15,325,038.77	-487,653,377.24
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)	996,084,203.64	102,599,243.34	1,098,683,446.98

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。

7.4.2 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 关联方关系

项目	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（现名：申万宏源证券有限公司）	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
中国农业银行股份有限公司("农业银行")	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。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2014年01月01日至2014年12月31日）		上年度可比期间（2013年01月01日至2013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	1,332,817,724.53	11.45	434,873,892.18	11.29
申银万国	1,634,530,703.15	14.05	407,557,792.34	10.58

7.4.4.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.4.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2014年01月01日至2014年12月31日）		上年度可比期间（2013年01月01日至2013年12月31日）	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)
申银万国	2,997,900.00	6.90	23,077,931.70	22.63

7.4.4.1.4 回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2014年01月01日至2014年12月31日）		上年度可比期间（2013年01月01日至2013年12月31日）	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期回购成交总额的比例(%)
申银万国	-	-	47,000,000.00	23.86

7.4.4.1.5 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01月01日至2014年12月31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(%)
申银万国	1,468,512.85	14.11	1,083,138.05	25.19
海通证券	1,179,411.58	11.33	731,190.26	17.00

关联方名称	上年度可比期间（2013年01月01日至2013年12月31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	384,819.89	11.14	3,248.86	0.51
申银万国	367,858.69	10.65	8,379.24	1.30

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司席位租用(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。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2014年01月01日至2014年12月31日）	上年度可比期间（2013年01月01日至2013年12月31日）
当期发生的基金应支付的管理费	16,511,284.47	14,607,751.81
其中：支付销售机构的客户维护费	1,272,877.16	1,530,906.21

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.50%/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

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。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2014年01月01日至2014年12月31日）	上年度可比期间（2013年01月01日至2013年12月31日）
当期发生的基金应支付的托管费	2,751,880.74	2,434,625.31

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.25%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

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。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

	本期（2014年01月01日至2014年12月31日）					
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	-	-	-	50,000,000.00	99,726.03
	上年度可比期间（2013年01月01日至2013年12月31日）					
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购			
	-	-	-	-	-	-

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.4.4.2 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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.4.5 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01月01日至2014年12月31日）		上年度可比期间（2013年01月01日至2013年12月31日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	71,472,909.94	358,120.09	32,523,786.10	356,530.38

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联方交易事项。

7.4.5 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.7 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.5.7.1 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
002466	天齐锂业	2014-03-12	2015-03-13	认购非公开发行证券	28.00	38.16	400,000	11,200,000.00	15,264,000.00
300133	华策影视	2014-03-27	2015-03-30	认购非公开发行证券	33.03	25.08	234,025	7,729,845.75	5,869,347.00
600703	三安光电	2014-01-30	2015-01-28	认购非公开发行证券	21.80	14.22	509,633	11,109,999.40	7,246,981.26
600703	三安光电	2014-07-04	2015-01-28	认购非公开发行证券-送股	-	14.22	254,816	-	3,623,483.52

注：1：华策影视可流通日系本基金根据上市公司公告暂估确定，最终日期以上市公司公告为准；

2：本基金持有的非公开发行股票三安光电，于2014年7月4日实施2013年度利润分配及资本公积金转增股本方案，以资本公积金向全体股东每10股转增5股

7.4.5.8 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
002018	华信国际	2014-12-19	筹划重大事项	13.99	2015-03-06	15.39	10	125.00	139.90	-
300168	万达信息	2014-12-31	筹划重大事项	46.20	2015-01-08	44.50	143,578	6,013,696.00	6,633,303.60	-
600754	锦江股份	2014-11-10	筹划重大事项	25.11	2015-01-19	27.00	486,928	10,876,124.24	12,226,762.08	-

7.4.5.9 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.9.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末2014年12月31日止，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。

7.4.5.9.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1公允价值

7.4.14.1.1不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1各层次金融工具公允价值

于2014年12月