

富国天盛灵活配置混合型证券投资基金

二〇一五年半年度报告

(摘要)

2015年06月30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

送出日期：2015年08月27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。本半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 8 月 25 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	富国天盛灵活配置混合
基金主代码	000634
交易代码	前端交易代码：000634 后端交易代码：000635
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年04月30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	401,370,576.13 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。

### 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	范伟隽	林葛
	联系电话	021-20361818	010-66060069
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tgxxpl@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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金半年度报告备置地点	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 楼 中国农业银行股份有限公司 北京复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 9 层

### § 3 主要财务指标、基金净值表现

#### 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	报告期(2015年01月01日至2015年06月30日)
本期已实现收益	281,710,625.12
本期利润	230,543,200.87
加权平均基金份额本期利润	0.4710
本期基金份额净值增长率	44.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.6052
期末基金资产净值	638,405,679.29
期末基金份额净值	1.591

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
过去一个月	-6.14%	2.99%	-4.64%	2.27%	-1.50%	0.72%
过去三个月	19.01%	2.31%	8.04%	1.70%	10.97%	0.61%
过去六个月	44.95%	2.06%	18.64%	1.47%	26.31%	0.59%
过去一年	65.67%	1.62%	65.98%	1.20%	-0.31%	0.42%
自基金合同生效日起至今	76.88%	1.54%	67.72%	1.12%	9.16%	0.42%

注：根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定，本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×65%+中债综合指数收益率×35%。

沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数，其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高、流通市值大的主流股票，能够反映A股市场总体价格走势。中债综合指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的

投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

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（ $benchmark_t$ ）按下列公式计算：

$benchmark_t = 65\% * [\text{沪深 300 指数 } t / (\text{沪深 300 指数 } t-1) - 1] + 35\% * [\text{中债综合指数 } t / (\text{中债综合指数 } t-1) - 1]$ ；

其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ， $T$ 表示时间截至日；

期间  $T$  日收益率（ $benchmark_T$ ）按下列公式计算：

$benchmark_T = [\prod_{t=1}^T (1 + benchmark_t)] - 1$

其中， $T=2, 3, 4, \dots$ ； $\prod_{t=1}^T (1 + benchmark_t)$ 表示  $t$  日至  $T$  日的  $(1 + benchmark_t)$  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 2015 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2014 年 4 月 30 日由原汉盛证券投资基金转型而成，建仓期 6 个月，从 2014 年 4 月 30 日至 2014 年 10 月 29 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 2015 年 6 月 30 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、富国天盈债券型证券投资基金（LOF）、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、富国纯债债券型发起式证券投资基金、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、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、富国目标齐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、富国中小盘精选混合型证券投资基金、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金、富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金、富国中证银行指数分级证券投资基金、富国文体健康股票型证券投资基金、富国国家安全主题混合型证券投资基金、富国改革动力混合型证券投资基金、富国新收益灵活配置混合型证券投资基金、富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金、富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金、富国中证煤炭指数分级证券投资基金、富国中证体育指数分级证券投资基金等六十四只证券投资基金。

#### 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		
袁宜	本基金基金经理兼任兼任权	2014-04-30	-	8 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

	益投资副 总监、富国 宏观策略 灵活配置 混合型证 券投资基 金基金经 理			策略分析师；2011年3月加入富国基金管理有限公司，任首席经济学家兼基金经理助理；2012年10月至2014年4月29日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，2014年4月30日起任富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理；兼任权益投资副总监。具有基金从业资格。
--	--	--	--	--

注：1、上述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；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、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合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国天盛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》、《富国天盛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，以为投资者减少和分散风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定收益为目标，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 19 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**

上半年，中国经济整体低迷，货币环境不断宽松。在高收益资产难觅，但股市呈现赚钱效应的激励下，居民财富向股市转移的趋势强劲，加之场内场外杠杆的提升，推动 A 股主板市场震荡上行，而创业板、中小板则一路高歌猛进。直至 6 月中旬，在清理场外配资等因素的作用下，A 股见顶下行。

本基金在报告期内基本保持了较高的仓位，在 6 月中下旬曾一度大幅减仓。配置上，一季度过于均衡，二季度初开始强化了对成长股的配置，在 6 月末逐步增加了对景气向好的航空、养殖板块的配置。

##### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至 2015 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.591 元，份额累计净值为 1.732 元；本报告期，本基金份额净值增长率为 44.95%，同期业绩比较基准收益率为 18.64%。

#### **4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

展望下半年，宏观经济依然亮点不多，而经历了暴涨暴跌后的 A 股市场，投资者的风险偏好显著下降。随着预期回报率的降低，投资者对稳定增长类的偏好会明显上升。看好偏消费的稳定增长公司，以及国企改革主题。

#### **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

本基金于 2015 年 1 月 8 日公告对 2014 年内利润进行第二次收益分配，每 10 份基金份额派发现金红利 0.36 元，共计派发红利 25076591.62 元。

本基金对本报告期内利润进行的收益分配如下：2015 年 4 月 7 日公告每 10 份基金份额派发红利 0.60 元；2015 年 7 月 7 日公告每 10 份基金份额派发红利 1.40 元。

本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

#### 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本报告期基金的投资运作，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 托管人对本半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半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 半年度财务报表(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：富国天盛灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 (2015 年 06 月 30 日)	上年度末 (2014 年 12 月 31 日)
----	---------------------------	----------------------------

<b>资产：</b>		
银行存款	192,035,682.77	52,651,651.85
结算备付金	6,344,432.62	14,202,339.28
存出保证金	1,584,853.90	2,438,330.09
交易性金融资产	537,421,136.28	921,901,406.76
其中：股票投资	507,292,136.28	871,836,406.76
基金投资	—	—
债券投资	30,129,000.00	50,065,000.00
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	—	10,634,462.97
应收利息	210,684.30	1,372,852.04
应收股利	—	—
应收申购款	100,066.30	74,627.89
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	737,696,856.17	1,003,275,670.88
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>(2015年06月30日)</b>	<b>(2014年12月31日)</b>
<b>负 债：</b>		
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	88,147,790.86	—
应付赎回款	4,515,844.41	7,896,891.01
应付管理人报酬	886,938.80	1,319,199.88
应付托管费	147,823.12	219,866.67
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	3,807,697.05	8,280,660.73
应交税费	1,478,558.72	1,478,558.72
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	306,523.92	429,548.48
负债合计	99,291,176.88	19,624,725.49
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	395,501,471.81	820,560,297.16
未分配利润	242,904,207.48	163,090,648.23
所有者权益合计	638,405,679.29	983,650,945.39
负债和所有者权益总计	737,696,856.17	1,003,275,670.88

注：报告截止日 2015 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.591 元，基金份额总额 401,370,576.13 份。

## 6.2 利润表

会计主体：富国天盛灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 01 月 01 日至 2015 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2015 年 01 月 01 日至 2015 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2014 年 4 月 30 日(基 金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日)
<b>一、收入</b>	249,490,100.38	105,755,274.35
1. 利息收入	1,019,034.57	2,268,032.57
其中：存款利息收入	304,323.70	546,687.10
债券利息收入	684,507.85	1,547,982.57
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	30,203.02	173,362.90
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	298,886,023.66	17,717,812.04
其中：股票投资收益	298,058,241.80	13,408,673.68
基金投资收益	—	—
债券投资收益	-1,280.00	-909,285.41
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	829,061.86	5,218,423.77
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-51,167,424.25	82,595,481.41
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	752,466.40	3,173,948.33
<b>减：二、费用</b>	18,946,899.51	10,243,453.87
1. 管理人报酬	4,981,255.22	4,701,492.52
2. 托管费	830,209.16	783,840.32
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	12,918,755.24	4,690,061.50
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 其他费用	216,679.89	68,059.53
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	230,543,200.87	95,511,820.48
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	230,543,200.87	95,511,820.48

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国天盛灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015年01月01日至2015年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (2015年01月01日至2015年06月30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）	820,560,297.16	163,090,648.23	983,650,945.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	230,543,200.87	230,543,200.87
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）	-425,058,825.35	-98,722,631.37	-523,781,456.72
其中：1. 基金申购款	24,568,417.14	10,806,785.04	35,375,202.18
2. 基金赎回款	-449,627,242.49	-109,529,416.41	-559,156,658.90
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）	—	-52,007,010.25	-52,007,010.25
五、期末所有者权益（基金净值）	395,501,471.81	242,904,207.48	638,405,679.29
项目	上年度可比期间(2014年4月30日(基金合同生效日) 至2014年6月30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）	2,000,000,000.00	16,141,643.57	2,016,141,643.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	95,511,820.48	95,511,820.48
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）	-370,348,881.63	-928,758.77	-371,277,640.40
其中：1. 基金申购款	111,481,134.99	1,728,441.19	113,209,576.18
2. 基金赎回款	-481,830,016.62	-2,657,199.96	-484,487,216.58
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）	1,629,651,118.37	110,724,705.28	1,740,375,823.65

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈戈

林志松

雷青松

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

根据汉盛证券投资基金（以下简称“基金汉盛”）基金份额持有人大会审议通过的《关于汉盛证券投资基金转型有关事项的议案》，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证券基金机构监管部部函[2014]67号《关于汉盛证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》及上海证券交易所自律监管决定书[2014]172号文《关于终止汉盛证券投资基金上市的决定》的同意，基金汉盛于2014年4月30日终止上市，原《汉盛证券投资基金基金合同》于终止上市日起失效，《富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2014年4月30日起生效，基金汉盛更名为“富国天盛混合型证券投资基金”（以下简称“本基金”），基金正式转型为契约型开放式，存续期限调整为不定。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《富国天盛混合型证券投资基金招募说明书》和《富国天盛混合型证券投资基金集中申购结果暨原汉盛证券投资基金基金份额折算结果的公告》的有关规定，基金管理人富国基金管理有限公司确定2014年6月4日为基金汉盛基金份额折算基准日。经本基金管理人计算并经基金托管人复核的折算前基金份额净值为1.015元，精确到小数点后第9位为1.014909401元（第10位舍去），本基金管理人按照1.014909401的折算比例对原汉盛证券投资基金进行了基金份额折算，折算后的基金份额净值为1.000元，折算后的基金份额为折算前的基金份额乘以折算比例，采用截尾法保留到整数位，所产生的误差归入基金财产。折算前原汉盛证券投资基金份额总额为2亿份，折算后基金份额总额为1,834,804,944.82份。富国基金管理有限公司已根据上述折算比例向登记结算机构中国证券登记结算有限责任公司提出基金份额的变更登记申请，登记结算机构中国证券登记结算有限责任公司已于2014年6月4日对各基金份额持有人持有的基金份额予以变更登记。

本基金于基金合同生效后自2014年5月12日至2014年5月30日止期间内开放集中申购，集中申购期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2014）验字第60467606\_B06号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。本基金集中申购期募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币108,841,235.65元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币7,914.39元，以上实收基金（本息）合计为人民币108,849,150.04元，折合108,849,150.04份基金份额。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65%+中债综合指数收益率×35%。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### **6.4.4 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**

除下文 6.4.5.2 会计估计变更的说明中的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期无会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》的规定，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外）采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

##### **6.4.5.3 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。

#### **6.4.6 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。

## 2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

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、中国证监会财税[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，证券投资基金从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。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 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

根据证监许可[2015]95号《关于核准设立申万宏源证券有限公司及其2家子公司的批复》的批准，中国证券监督管理委员会同意申银万国证券股份有限公司以吸收合并宏源证券股份有限公司后的全部证券类资产及负债出资设立全资证券子公司申万宏源证券有限公司。相应的，本公司的股东自2015年1月16日

起由申银万国证券股份有限公司变更为申万宏源证券有限公司。相关变更手续尚在办理当中。变更后，本公司的股东为海通证券股份有限公司，出资比例为 27.775%；申万宏源证券有限公司，出资比例为 27.775%；蒙特利尔银行，出资比例为 27.775%；山东省国际信托有限公司，出资比例为 16.675%。

#### 6.4.7.2 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
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、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。关联方申万宏源证券有限公司（简称“申万宏源”）是由原关联方申银万国证券股份有限公司与宏源证券股份有限公司于 2015 年 1 月 16 日合并组建而成。

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2015年01月01日至2015年06月30日)		上年度可比期间(2014年4月30日(基金合同生效日)至2014年6月30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	291,830,837.21	3.49	897,765,528.54	27.64
申万宏源	187,303,357.62	2.24	—	—

注：关联方申万宏源证券有限公司（简称“申万宏源”）是由原关联方申银万国证券股份有限公司与宏源证券股份有限公司于 2015 年 1 月 16 日合并组建而成。上表显示的本期申万宏源交易额为通过申万宏源证券席位交易的总额，申银万国交易额为上年度可比期间通过原关联方申银万国证券席位交易的总额。

##### 6.4.8.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.8.1.3 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 6.4.8.1.4 回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2015年01月01日至2015年06月30日)		上年度可比期间(2014年4月30日(基金合同生效日)至2014年6月30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 (%)
海通证券	26,000,000.00	19.12	60,000,000.00	12.24

##### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元



关联方名称	本期（2015年01月01日至2015年06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（%）
申万宏源	167,957.47	2.24	79,015.88	2.08
海通证券	260,960.78	3.49	163,834.52	4.30
关联方名称	上年度可比期间（2014年4月30日（基金合同生效日）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	804,648.36	23.51

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，扣除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、关联方申万宏源证券有限公司（简称“申万宏源”）是由原关联方申银万国证券股份有限公司与宏源证券股份有限公司于2015年1月16日合并组建而成。上表显示的本期申万宏源交易额为通过申万宏源证券席位交易的总额，申银万国交易额为上年度可比期间通过原关联方申银万国证券席位交易的总额。

#### 6.4.8.2 关联方报酬

##### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2015年01月01日至2015年06月30日）	上年度可比期间（2014年4月30日（基金合同生效日）至2014年6月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	4,981,255.22	4,701,492.52
其中：支付销售机构的客户维护费	329,571.34	50,834.18

注：本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：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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。

##### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2015年01月01日至2015年06月30日）	上年度可比期间（2014年4月30日（基金合同生效日）至2014年6月30日）
当期发生的基金应支付的托管费	830,209.16	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：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期(2015年01月01日至2015年06月30日)	上年度可比期间(2014年4月30日(基金合同生效日)至2014年6月30日)
基金合同生效日(2014年04月30日)持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期初持有的基金份额	10,149,094.02	10,000,000.00
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	10,149,094.02
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.53%	0.61%

##### 6.4.8.4.2 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(2015年06月30日)		上年度末(2014年12月31日)	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)
山东省国际信托有限公司	5,074,547.01	1.26	5,074,547.01	0.61
申银万国证券股份有限公司	10,149,094.03	2.53	10,149,094.03	1.22

##### 6.4.8.5 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(2015年01月01日至2015年06月30日)		上年度可比期间(2014年4月30日(基金合同生效日)至2014年6月30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	192,035,682.77	212,574.48	80,877,053.21	522,199.99

公司				
----	--	--	--	--

#### 6.4.8.6 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。

#### 6.4.8.7 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。

#### 6.4.9 期末（2015年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1.1 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
300147	香雪制药	2015-06-18	2015-07-02	配股	10.46	30.80	143,018	1,495,968.28	4,404,954.40	

##### 6.4.9.2 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
000008	神州高铁	2015-03-12	筹划重大事项	26.87	2015-07-02	29.56	109,040	2,645,187.00	2,929,904.80	
000024	招商地产	2015-04-03	筹划重大事项	31.64		—	217,884	6,264,392.40	6,893,849.76	
000566	海南海药	2015-06-18	筹划重大事项	49.97		—	165,845	7,753,688.30	8,287,274.65	
002044	江苏三友	2015-06-18	筹划重大事项	44.80	2015-07-01	49.50	227,512	11,828,892.60	10,192,537.60	
002080	中材科技	2015-04-21	筹划重大事项	22.79		—	104,700	2,742,400.00	2,386,113.00	
002170	芭田股份	2015-05-26	筹划重大事项	26.12	2015-07-28	23.51	488,306	7,366,529.66	12,754,552.72	
002191	劲嘉股份	2015-06-18	筹划重大事项	19.22		—	166,100	2,692,702.00	3,192,442.00	
002223	鱼跃医疗	2015-06-25	筹划重大事项	67.20	2015-07-13	60.48	20,250	1,290,597.00	1,360,800.00	
002268	卫士通	2015-05-08	筹划重大事项	84.80	2015-08-04	76.32	16,500	1,314,885.00	1,399,200.00	
002445	中南重工	2015-06-02	筹划重大事项	51.39		—	74,100	4,268,752.00	3,807,999.00	
002665	首航节能	2015-06-30	筹划重大事项	27.70	2015-07-01	30.00	122,632	3,418,171.14	3,396,906.40	
002741	光华科技	2015-06-02	筹划重大事项	70.04	2015-08-05	63.04	8,750	602,162.00	612,850.00	
300008	上海佳豪	2015-03-24	筹划重大事项	17.24		—	100,400	1,666,486.00	1,730,896.00	

300212	易华录	2015-06-30	筹划重大事项	59.94	2015-07-13	54.00	164,300	12,177,062.16	9,848,142.00
300291	华录百纳	2015-06-30	筹划重大事项	37.76	2015-07-13	34.65	1,105	46,894.60	41,724.80
600366	宁波韵升	2015-05-22	筹划重大事项	30.70	2015-08-12	31.58	205,451	6,558,847.03	6,307,345.70
600654	中安消	2015-06-29	筹划重大事项	30.91		—	64,960	2,220,523.41	2,007,913.60
601021	春秋航空	2015-06-26	筹划重大事项	126.09	2015-07-21	113.48	60,572	7,941,043.30	7,637,523.48

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2015 年 6 月 30 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金融资产款余额。

##### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 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金融资产款余额。

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 公允价值

###### 6.4.14.1.1 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。

###### 6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 30 日，本基金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中属于第一层次的余额为人民币 418,099,206.37 元，属于第二层次的余额为人民币 119,321,929.91 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元。

###### 6.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

###### 6.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

##### 6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 6.4.14.3 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。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

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	507,292,136.28	68.77
	其中：股票	507,292,136.28	68.77
2	固定收益投资	30,129,000.00	4.08
	其中：债券	30,129,000.00	4.08
	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	198,380,115.39	26.89
7	其他各项资产	1,895,604.50	0.26
8	合计	737,696,856.17	100.00

### 7.2 期末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	47,758,200.60	7.48
B	采矿业	8,659,130.00	1.36
C	制造业	272,824,722.00	42.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,451,570.00	0.38
E	建筑业	358,079.10	0.06
F	批发和零售业	5,021,074.00	0.79
G	交通运输、仓储和邮政业	26,377,475.48	4.13
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	49,675,860.58	7.78
J	金融业	55,602,098.87	8.71
K	房地产业	31,185,498.00	4.88
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	1,730,896.00	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	5,530,120.85	0.87
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	41,724.80	0.01
S	综合	75,686.00	0.01
	合计	507,292,136.28	79.46

### 7.3 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

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	002477	雏鹰农牧	1,217,700	23,379,840.00	3.66
2	600115	东方航空	1,521,100	18,739,952.00	2.94
3	002175	广陆数测	326,208	18,104,544.00	2.84
4	600048	保利地产	1,535,200	17,531,984.00	2.75
5	000333	美的集团	431,500	16,086,320.00	2.52
6	002458	益生股份	588,090	15,372,672.60	2.41
7	600016	民生银行	1,311,800	13,039,292.00	2.04
8	601998	中信银行	1,672,797	12,897,264.87	2.02
9	601398	工商银行	2,436,500	12,864,720.00	2.02
10	002170	芭田股份	488,306	12,754,552.72	2.00

注：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

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 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	601628	中国人寿	68,941,000.48	7.01
2	000002	万科 A	62,063,500.56	6.31
3	300253	卫宁软件	57,607,627.40	5.86
4	600048	保利地产	55,197,954.29	5.61
5	002477	雏鹰农牧	50,659,490.69	5.15
6	601318	中国平安	49,378,683.69	5.02
7	300085	银之杰	48,046,792.16	4.88
8	300212	易华录	45,182,445.68	4.59
9	600340	华夏幸福	44,444,871.39	4.52
10	600115	东方航空	41,342,252.15	4.20
11	002318	久立特材	40,516,070.41	4.12
12	002175	广陆数测	37,228,933.31	3.78
13	300287	飞利信	35,338,668.70	3.59
14	002366	丹甫股份	34,255,776.50	3.48
15	600036	招商银行	32,324,960.00	3.29
16	300226	上海钢联	32,229,000.06	3.28

17	600703	三安光电	31,198,413.09	3.17
18	000712	锦龙股份	31,107,961.87	3.16
19	002642	荣之联	30,660,028.79	3.12
20	300147	香雪制药	30,643,575.98	3.12
21	600446	金证股份	30,577,188.15	3.11
22	300295	三六五网	29,407,172.82	2.99
23	601377	兴业证券	29,211,715.00	2.97
24	000024	招商地产	28,705,263.76	2.92
25	601992	金隅股份	28,188,912.06	2.87
26	000401	冀东水泥	27,632,633.22	2.81
27	300333	兆日科技	27,489,255.00	2.79
28	000732	泰禾集团	27,268,844.90	2.77
29	002241	歌尔声学	27,183,871.88	2.76
30	600415	小商品城	26,963,788.00	2.74
31	600266	北京城建	26,941,297.50	2.74
32	600016	民生银行	26,685,066.46	2.71
33	601998	中信银行	26,085,330.78	2.65
34	600654	中安消	26,063,838.28	2.65
35	300352	北信源	25,326,891.31	2.57
36	601000	唐山港	25,249,481.96	2.57
37	600409	三友化工	24,298,289.70	2.47
38	601727	上海电气	24,070,952.72	2.45
39	600312	平高电气	24,024,019.64	2.44
40	300059	东方财富	23,805,703.34	2.42
41	002170	芭田股份	23,545,391.18	2.39
42	601818	光大银行	23,472,562.76	2.39
43	002153	石基信息	23,293,901.33	2.37
44	601169	北京银行	23,102,579.20	2.35
45	300178	腾邦国际	22,902,127.50	2.33
46	002048	宁波华翔	22,866,056.02	2.32
47	601021	春秋航空	22,793,126.70	2.32
48	300304	云意电气	22,506,913.09	2.29
49	000777	中核科技	21,900,460.48	2.23
50	300353	东土科技	21,576,027.52	2.19
51	002273	水晶光电	21,471,278.33	2.18
52	002280	联络互动	20,920,638.40	2.13
53	002266	浙富控股	20,698,888.00	2.10
54	600037	歌华有线	20,057,650.20	2.04
55	000776	广发证券	19,884,373.00	2.02
56	300257	开山股份	19,877,761.10	2.02
57	601688	华泰证券	19,804,635.90	2.01

58	601328	交通银行	19,782,505.00	2.01
----	--------	------	---------------	------

注：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。

#### 7.4.2 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	000002	万科 A	101,090,130.75	10.28
2	601318	中国平安	92,645,956.44	9.42
3	300253	卫宁软件	83,554,213.91	8.49
4	600048	保利地产	73,851,034.24	7.51
5	601628	中国人寿	71,816,961.00	7.30
6	000712	锦龙股份	65,053,198.17	6.61
7	600016	民生银行	59,270,984.52	6.03
8	600415	小商品城	50,857,878.44	5.17
9	601336	新华保险	49,074,248.82	4.99
10	600340	华夏幸福	47,203,932.28	4.80
11	300085	银之杰	46,501,559.95	4.73
12	601601	中国太保	45,463,300.82	4.62
13	002318	久立特材	43,972,063.75	4.47
14	000024	招商地产	40,649,984.42	4.13
15	600446	金证股份	40,376,720.62	4.10
16	300287	飞利信	38,940,388.71	3.96
17	002366	丹甫股份	38,847,027.12	3.95
18	000732	泰禾集团	37,969,993.79	3.86
19	300212	易华录	35,757,928.52	3.64
20	600754	锦江股份	35,289,170.39	3.59
21	600376	首开股份	34,813,550.76	3.54
22	300059	东方财富	34,408,149.89	3.50
23	601006	大秦铁路	33,373,689.98	3.39
24	601169	北京银行	33,021,712.62	3.36
25	601818	光大银行	32,968,453.38	3.35
26	600037	歌华有线	32,722,681.45	3.33
27	600383	金地集团	32,533,461.10	3.31
28	300226	上海钢联	32,505,408.02	3.30
29	002070	众和股份	31,755,804.81	3.23
30	601992	金隅股份	29,462,572.36	3.00
31	600703	三安光电	29,410,789.51	2.99
32	000401	冀东水泥	29,134,197.37	2.96
33	601377	兴业证券	28,651,565.98	2.91
34	300295	三六五网	27,768,409.93	2.82
35	601328	交通银行	27,718,950.29	2.82



36	600654	中安消	27,563,019.24	2.80
37	601166	兴业银行	27,193,968.26	2.76
38	002339	积成电子	26,825,528.87	2.73
39	002241	歌尔声学	26,777,547.05	2.72
40	002047	宝鹰股份	26,464,498.18	2.69
41	300178	腾邦国际	26,226,087.31	2.67
42	600312	平高电气	26,148,087.73	2.66
43	300352	北信源	25,781,564.49	2.62
44	600036	招商银行	25,779,546.82	2.62
45	600409	三友化工	25,664,300.51	2.61
46	002048	宁波华翔	25,435,759.83	2.59
47	300147	香雪制药	25,379,528.90	2.58
48	000651	格力电器	25,218,219.85	2.56
49	601727	上海电气	25,082,126.10	2.55
50	600266	北京城建	24,846,615.51	2.53
51	300213	佳讯飞鸿	24,825,481.51	2.52
52	002170	芭田股份	24,637,227.49	2.50
53	002477	雏鹰农牧	24,527,401.33	2.49
54	002153	石基信息	24,422,695.33	2.48
55	600115	东方航空	24,277,433.58	2.47
56	002363	隆基机械	24,135,065.51	2.45
57	300353	东土科技	23,756,414.03	2.42
58	000961	中南建设	23,642,667.01	2.40
59	601000	唐山港	23,382,836.40	2.38
60	600000	浦发银行	22,527,290.95	2.29
61	000777	中核科技	22,467,303.59	2.28
62	000090	天健集团	22,297,895.61	2.27
63	300038	梅泰诺	22,057,553.03	2.24
64	600352	浙江龙盛	22,006,109.87	2.24
65	300333	兆日科技	21,644,827.60	2.20
66	600570	恒生电子	21,465,237.55	2.18
67	000001	平安银行	20,916,919.91	2.13
68	000031	中粮地产	20,841,660.05	2.12
69	600835	上海机电	20,747,598.94	2.11
70	002642	荣之联	20,052,858.56	2.04
71	002375	亚厦股份	20,014,950.11	2.03

注：“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。

#### 7.4.3 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	3,879,149,546.48
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	4,490,641,934.51
--------------	------------------

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。

### 7.5 期末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	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	30,129,000.00	4.72
	其中：政策性金融债	30,129,000.00	4.72
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	30,129,000.00	4.72

### 7.6 期末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	150411	15农发11	300,000	30,129,000.00	4.72

### 7.7 期末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：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末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：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 7.9 期末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：本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 7.10.2 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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。

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 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	1,584,853.90
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	210,684.30
5	应收申购款	100,066.30
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,895,604.50

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
----	------	------	----------------	--------------	----------

1	002170	芭田股份	12,754,552.72	2.00	筹划重大事项
---	--------	------	---------------	------	--------

### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
6631	60,529.42	165,046,863.30	41.12	236,323,712.83	58.88

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理公司所有从业人员持有本基金	67,742.17	0.0169

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014年04月30日)基金份额总额	2,000,000,000.00
报告期期初基金份额总额	832,805,589.86
本报告期基金总申购份额	24,932,753.81
减：本报告期基金总赎回份额	456,367,767.54
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	401,370,576.13

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

本报告期本基金管理人于 2013 年 6 月 7 日在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站上做公告，窦玉明先生不再担任本公司总经理，由陈敏女士代行公司总经理职责。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	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 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
安信证券	2	—	0.00	—	0.00	—	0.00	—	0.00	—	0.00	
光大证券	2	1,222,270,231.12	14.61	—	0.00	—	0.00	—	0.00	1,087,569.64	14.52	
国海证券	2	4,619,364,746.17	55.21	—	0.00	50,000,000.00	36.76	—	0.00	4,127,713.70	55.12	
国金证券	2	139,263,735.04	1.66	—	0.00	—	0.00	—	0.00	124,571.89	1.66	
国泰君安	2	16,268,007.64	0.19	—	0.00	—	0.00	—	0.00	14,810.32	0.20	
国信证券	1	1,837,382.54	0.02	—	0.00	—	0.00	—	0.00	1,672.83	0.02	
海通证券	2	291,830,837.21	3.49	—	0.00	26,000,000.00	19.12	—	0.00	260,960.78	3.49	
华泰证券	1	330,245,742.33	3.95	—	0.00	—	0.00	—	0.00	292,234.44	3.90	
华信证券	2	—	0.00	—	0.00	—	0.00	—	0.00	—	0.00	
民族证券	2	—	0.00	—	0.00	—	0.00	—	0.00	—	0.00	
齐鲁证券	1	369,133,543.82	4.41	—	0.00	—	0.00	—	0.00	327,927.46	4.38	
申万宏源	2	187,303,357.62	2.24	—	0.00	—	0.00	—	0.00	167,957.47	2.24	
太平洋证券	1	—	0.00	—	0.00	—	0.00	—	0.00	—	0.00	
银河证券	1	—	0.00	—	0.00	—	0.00	—	0.00	—	0.00	
招商证券	2	1,189,167,122.43	14.21	—	0.00	60,000,000.00	44.12	—	0.00	1,082,614.65	14.46	

注：1. 我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。  
2. 本期内本基金租用的券商交易单元无变更。

