

富国基金管理有限公司企业年金基金投资管理情况

2014年1季度

一、2014年1季度投资管理基本情况

| 期末组合数 (个) | 期末组合资产净值 (万元) | 本季投资收益 (万元) | 本年累计投资收益 (万元) |
|--------------|------------------|----------------|------------------|
| 34 | 1,355,004.20 | 19,182.35 | 19,182.35 |

注：1. 该表所取样本为期末管理的全部投资组合。

2. 投资收益为所有组合投资收益合计数。投资收益=当期投资资产利息收入+投资处置收益+公允价值变动损益+其他收入-受托费-托管费-投资管理费-交易费用-利息支出-其他费用。本季投资收益以本季度为期间，本年累计投资收益以年初到本季度末为期间。

二、2014年1季度投资管理收益率

| 机构名称 | 计划类型 | 组合类型 | 满期组合数 (个) | 满期组合期末 资产规模(万元) | 加权平均 收益率 (%) |
|----------------|----------|-------|--------------|--------------------|--------------------|
| 富国基金管 理有限公司 | 单一 计划 | 固定收益类 | 1 | 87,389.51 | 1.89 |
| | | 含权益类 | 29 | 1,128,664.68 | 1.50 |
| | 集合 计划 | 固定收益类 | | - | - |
| | | 含权益类 | 1 | 112,911.15 | 1.21 |
| | 其他 | 固定收益类 | | - | - |
| | | 含权益类 | | - | - |

注：1. 组合类型按是否含权益类投资标的分为固定收益类和含权益类，以期初合同或备忘录为准，明确约定不能投资权益类的组合为固定收益类；没有明确约定或期间发生类别变动的，都为含权益类。

2. 其他计划包括过渡计划和准集合计划。

3. 计算样本为2014年1月1日以前正式运作的投资组合，包括含有按委托人指定的投资方向、投资品种进行被动投资资产的组合。

4. 加权平均收益率为本年累计收益率，计算方法为本公司管理的符合条件

样本组合收益率的规模加权，以期初和各季度末平均资产规模为权重；组合收益率为上一年底到本季度末的单位净值增长率。

三、2014年1季度投资组合收益率分布情况

| 收益率 (R) 区间 | 组合数 (个) | 期末资产规模 (万元) |
|----------------|---------|--------------|
| $R \geq 4$ | | |
| $4 > R \geq 3$ | | |
| $3 > R \geq 2$ | 2 | 109,827.27 |
| $2 > R \geq 1$ | 26 | 1,092,026.99 |
| $1 > R \geq 0$ | 3 | 127,111.07 |
| $R < 0$ | | |
| 合计 | 31 | 1,328,965.33 |

注：1. 样本为2014年1月1日以前正式运作的投资组合，包括含有按委托人指定的投资方向、投资品种进行被动投资资产的组合。

2. 组合数和期末资产规模是指收益率在该区间的组合个数和这些组合期末资产之和。组合收益率为上一年底到本季度末的单位净值增长率。

3. 收益率区间以人社部基金监督司提供的每个季度组合收益率分布表为准，收益区间不固化，根据当期全国企业年金组合收益整体分布情况进行划分，一般分为5-6档。每个季度上报数据时，此表暂不填报。