

---

富国天盛灵活配置混合型证券投资基金  
(原汉盛证券投资基金转型)  
二〇一四年年度报告

2014年12月31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。

自 2014 年 4 月 30 日汉盛证券投资基金终止上市日起，原汉盛证券投资基金转型为富国天盛灵活配置混合型证券投资基金。原汉盛证券投资基金报告期为 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 29 日，富国天盛灵活配置混合型证券投资基金报告期为 2014 年 4 月 30 日至 2014 年 12 月 31 日。

## 1.2 目录

§1	重要提示及目录.....	1
1.1	重要提示.....	1
1.2	目录.....	2
§2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	6
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
§3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	转型前基金汉盛证券投资基金净值表现.....	8
3.3	转型后基金富国天盛灵活配置混合型证券投资基金净值表现.....	9
3.4	过去三年基金的利润分配情况.....	11
§4	管理人报告.....	11
4.1	基金管理人及基金经理.....	12
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	15
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核报告.....	16
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.9	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.....	17
§5	托管人报告.....	17
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	18
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.....	18
§6	审计报告.....	18
6.1	审计报告基本信息.....	18
6.2	审计报告的基本内容.....	18
§7	转型前基金（汉盛证券投资基金）年度财务报表.....	20
7.1	资产负债表.....	20
7.2	利润表.....	21
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4	报表附注.....	23
§8	转型后基金（富国天盛灵活配置混合型证券投资基金）年度财务报表.....	40
8.1	资产负债表.....	40
8.2	利润表.....	41
8.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	42
8.4	报表附注.....	43

§9	转型前基金（原汉盛证券投资基金）投资组合报告 .....	63
9.1	转型前最后一日基金资产组合情况 .....	63
9.2	转型前最后一日按行业分类的股票投资组合 .....	63
9.3	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所有股票投资明 细	64
9.4	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 .....	65
9.5	转型前最后一日按债券品种分类的债券投资组合 .....	67
9.6	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	67
9.7	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所有资产支持证 券投资明细 .....	67
9.8	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	67
9.9	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	68
9.10	转型前最后一日本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	68
9.11	转型前最后一日本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	68
9.12	投资组合报告附注 .....	68
§10	转型后基金富国天盛灵活配置混合型证券投资基金投资组合报告 .....	69
10.1	2014年12月31日基金资产组合情况 .....	69
10.2	2014年12月31日按行业分类的股票投资组合 .....	70
10.3	2014年12月31日按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资 明细	70
10.4	转型日至报告期末（2014年4月30日至2014年12月31日）股票投资组 合的重大变动 .....	72
10.5	2014年12月31日按债券品种分类的债券投资组合 .....	80
10.6	2014年12月31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	81
10.7	2014年12月31日按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持 证券投资明细 .....	81
10.8	2014年12月31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 .....	81
10.9	2014年12月31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	81
10.10	2014年12月31日本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	81
10.11	2014年12月31日本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	81
10.12	投资组合报告附注 .....	82
§11	转型后基金富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人信息 .....	82
11.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	82
11.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	83
11.3	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情况 .....	83
§12	转型后基金富国天盛灵活配置混合型证券投资基金开放式基金份额变动 .....	83
§13	重大事件揭示 .....	83

---

13.1	基金份额持有人大会决议.....	83
13.2	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.....	84
13.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	84
13.4	基金投资策略的改变.....	84
13.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	84
13.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	84
13.7	转型前本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	85
13.8	转型后本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	86
13.9	其他重大事件.....	88
§14	备查文件目录.....	91

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

#### 2.1.1 转型前基金（原汉盛证券投资基金）基本情况

基金名称	汉盛证券投资基金
基金简称	富国汉盛封闭
场内简称	基金汉盛
基金主代码	500005
交易代码	500005
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年05月10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	2,000,000,000.00份
基金合同存续期	15年
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	1999年5月18日

#### 2.1.2 转型后基金（富国天盛灵活配置混合型证券投资基金）基本情况

基金名称	富国天盛灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	富国天盛灵活配置混合
场内简称	—
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	832,805,589.86份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

#### 2.2.1 转型前基金（原汉盛证券投资基金）产品说明

投资目标	为投资者减少和分散投资风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。
投资策略	“精选品种、组合投资、长线持有、波段操作”，通过研究和发掘具有良好发展前景的上市公司进行组合投资。以长期投资为主轴，同时依据“顺势而为”的原则进行一些短线操作。
业绩比较基准	无
风险收益特征	无

## 2.2.2 转型后基金（富国天盛灵活配置混合型证券投资基金）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		95105686、4008880688	010—63201816
注册地址		上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 楼	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		陈敏	刘士余

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
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 楼 中国农业银行 北京市海淀区西三环北路 100 号金玉大厦

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼

转型前注册登记机构	—	—
转型后注册登记机构	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

### § 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	转型前(2014年1月1日至2014年4月29日)	2014年4月30日(基金合同生效日)至2014年12月31日	2013年	2012年
本期已实现收益	-28,946,619.18	228,820,105.27	450,050,124.31	633,418.54
本期利润	-69,784,396.96	264,351,027.69	398,014,185.79	167,710,600.95
加权平均基金份额本期利润	-0.0349	0.1978	0.1990	0.0839
本期加权平均净值利润率	-2.93%	18.37%	16.40%	7.87%
本期基金份额净值增长率	-3.35%	22.03%	18.57%	8.13%
3.1.2 期末数据和指标	转型前(2014年4月29日)	2014年12月31日	2013年12月31日	2012年12月31日
期末可供分配利润	16,141,643.57	149,748,799.51	457,239,473.41	83,189,349.69
期末可供分配基金份额利润	0.0081	0.1798	0.2286	0.0416
期末基金资产净值	2,016,141,643.57	983,650,945.39	2,497,926,041.59	2,175,911,856.39
期末基金份额净值	1.0081	1.181	1.2490	1.0880
3.1.3 累计期末指标	转型前(2014年4月29日)	2014年12月31日	2013年12月31日	2012年12月31日
基金份额累计净值增长率	551.46%	22.03%	574.07%	468.49%

注：本基金于2014年4月30日转型，新基金合同生效日为2014年4月30日，



截至报告期末新基金合同生效不足一年。

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 转型前基金汉盛证券投资基金净值表现

#### 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
过去一年	-3.35%	2.07%	—	—	—	—
过去三年	23.91%	2.03%	—	—	—	—
过去五年	8.65%	1.94%	—	—	—	—
自基金合同生效日起至今	551.46%	2.55%	—	—	—	—

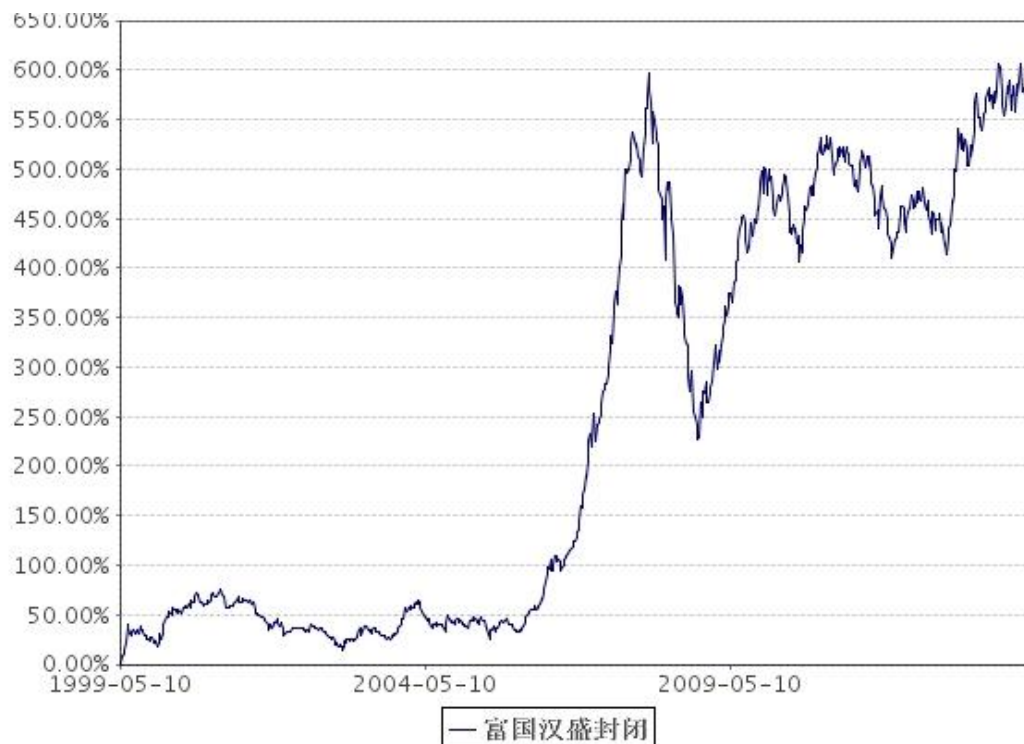
注：由于基金汉盛在其基金合同和招募说明书中没有业绩比较基准，此表只列示基金的净值表现。

过去一年为2014年1月1日至2014年4月29日。

过去三年为2012年1月1日至2014年4月29日。

过去五年为2010年1月1日至2014年4月29日。

#### 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

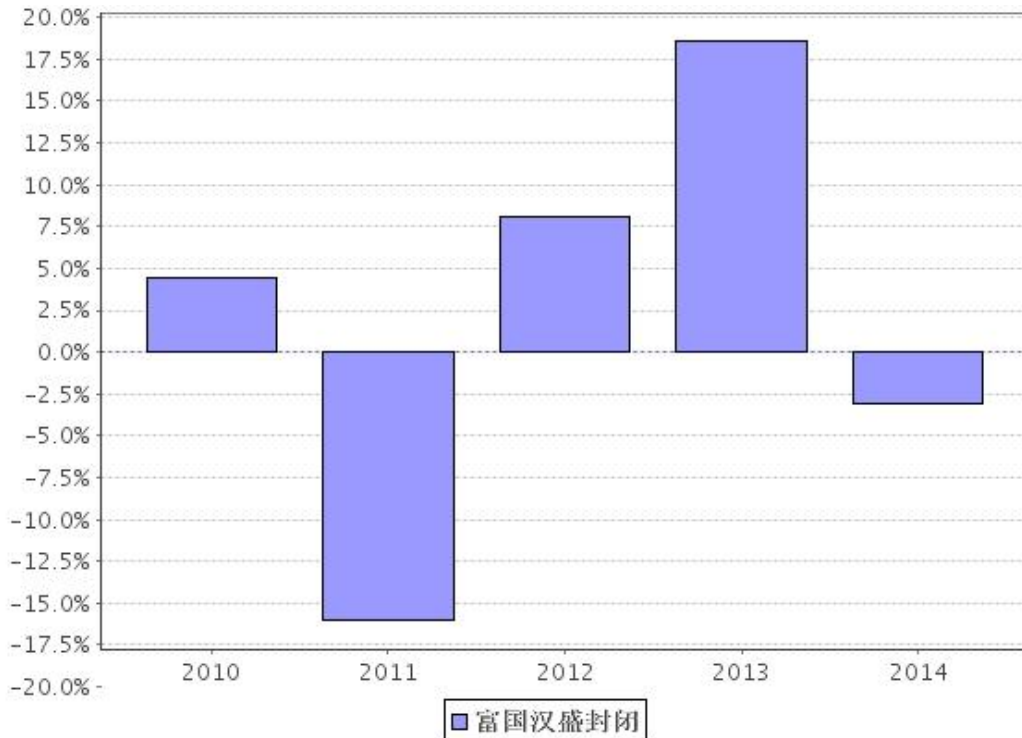


注：本图中所示时间区间为1999年5月10日至2014年4月29日。

由于本基金在其基金合同和招募说明书中没有业绩比较基准，此图只列示基金的净值表现。

本基金于 1999 年 5 月 10 日成立，建仓期 6 个月，从 1999 年 5 月 10 日至 1999 年 11 月 9 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 自基金合同生效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



注：2014 年按实际存续期计算。由于汉盛证券投资基金在其基金合同和招募说明书中没有业绩比较基准，此图只列示基金的净值表现。

### 3.3 转型后基金富国天盛灵活配置混合型证券投资基金净值表现

#### 3.3.1 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	6.78%	1.37%	28.25%	1.07%	-21.47%	0.30%
过去六个月	14.29%	1.05%	39.89%	0.86%	-25.60%	0.19%
自基金合同生效日起至今	22.03%	1.02%	41.36%	0.80%	-19.33%	0.22%

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（benchmarkt）按下列公式计算：

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

其中，t=1, 2, 3, ..., T, T表示时间截至日；

期间T日收益率（benchmarkT）按下列公式计算：

$$\text{benchmarkT} = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmarkt})] - 1$$

其中，T=2, 3, 4, ...； $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmarkt})$ 表示t日至T日的(1+benchmarkt)数学连乘。

### 3.3.2 自基金转型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，本基金自基金转型日至图表截止日不足一年。

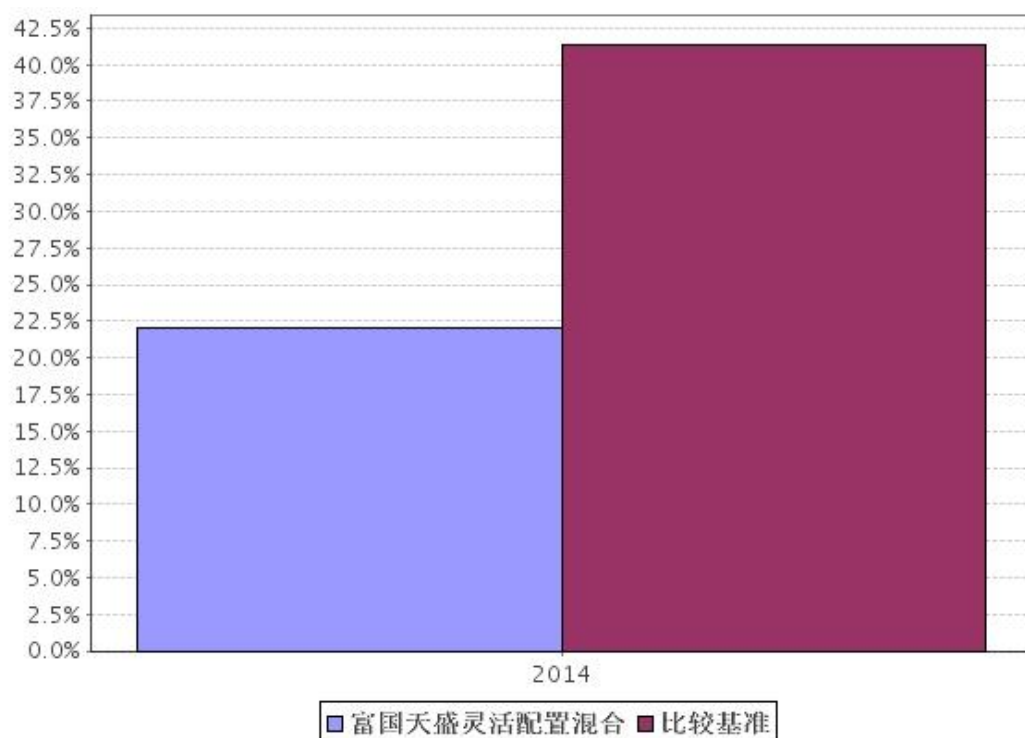
2、富国天盛灵活配置混合型证券投资基金由汉盛证券投资基金转型而成。基金转型经2014年3月6日至2014年4月8日汉盛证券投资基金基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会备案（证券基金机构监管部部函[2014]67号）。自2014年4月30日起，汉盛证券投资基金在上海证券交易所终止上市，其由《汉盛证券投资基金基金合同》修订而成的《富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金合同》正式生效。

3、富国基金管理有限公司以2014年6月4日为份额折算基准日对投资者持有的原汉盛证券投资基金进行了基金份额折算操作。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，采用循环进位法保留到小数点后两位，折算后基金份额总额为1,834,804,944.82份。

4、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。

### 3.3.3 自基金转型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



注：2014年按实际存续期计算。

### 3.4 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	2.260	429,075,576.86	3,677,076.36	432,752,653.22	2次分红
2013年	0.380	76,000,000.59	—	76,000,000.59	1次分红
2012年	0.370	74,000,001.02	—	74,000,001.02	1次分红
合计	3.010	579,075,578.47	3,677,076.36	582,752,654.83	—

## § 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

原汉盛证券投资基金：

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		
戴益强	本基金前任基金经理	2012-10-12	2014-01-13	8年	硕士，曾任易方达基金管理有限公司行业研究员；2008年9月至2012年10月任富国基金管理有限

					公司行业研究员，2012年10月至2014年1月任汉盛证券投资基金基金经理，2013年8月起任富国医疗保健行业股票型证券投资基金基金经理，2014年1月起任汉兴证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。
贺轶	本基金前任基金经理	2010-01-13	2014-01-29	13年	硕士，曾任中国银行云南省分行国际业务部银行职员；菲利普证券公司分析员；中银国际证券有限责任公司资产管理部分析员；中银基金管理有限公司投资部助理副总裁；汇丰晋信基金管理公司投资管理部投资经理、基金经理；富国基金管理有限公司营销策划与产品部高级营销策划经理、权益投资部策略分析师；2010年1月至2014年1月任汉盛证券投资基金基金经理，2012年9月起任富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金基金经理，兼任富国基金管理有限公司权益投资副总监。具有基金从业资格。
袁宜	本基金基金经理兼任富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2012-10-12	—	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、首席策略分析师；2011年3月至今任富国基金管理有限公司首席经济学家，2011年3月至2012年10月任基金经理助理，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。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。

**富国天盛灵活配置混合型证券投资基金：**

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富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理	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。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。

袁宜先生自2012年10月12日起担任汉盛证券投资基金基金经理；2014年4月30日汉盛证券投资基金转型为富国天盛灵活配置混合型证券投资基金，袁宜先生继续担任富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

#### 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。

#### **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%的置信水平下，对同向交易价差进行t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**

（1）自2014年1月1日至2014年4月29日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，报告期内汉盛证券投资基金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。

（2）自2014年4月30日至2014年6月30日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，报告期内富国天盛灵活配置混合型证券投资基金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4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。

（3）自2014年7月1日至2014年9月30日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26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）自2014年10月1日至2014年12月31日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27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，中国经济波澜不惊，全年各季的经济增速保持在7.4%上下0.1个百分点的狭窄区间之内。A股市场在经历了上半年的窄幅波动后，于7月开始大幅上涨。在政府主动压低无风险利率以及A股市场赚钱效应的双重影响下，场外



---

资金大举入市，场内投资者纷纷增加杠杆，由此导致股指上行势头凌厉，期间每次回调都很浅。11月下旬以后，主板市场加速上行，并表现出明显的二八分化，大盘蓝筹股涨势迅猛。

本基金自4月底成立以后，在多数时间则维持了较高的仓位，但在8月有过一次并不成功的减仓，在四季度的配置相对均衡，跑输业绩基准。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年4月29日，汉盛证券投资基金份额净值为1.0081元。自2014年1月1日至2014年4月29日，汉盛证券投资基金份额净值增长率为-3.35%。

截至2014年12月31日，富国天盛灵活配置混合型证券投资基金份额净值为1.181元，份额累计净值为1.219元。自2014年4月30日至2014年12月31日，富国天盛灵活配置混合型证券投资基金份额净值增长率为22.03%，同期业绩比较基准收益率为41.36%。

#### 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，中国经济面临较大的下行压力，对通货紧缩的担忧可能升温，因而预计流动性环境将保持相对宽松，对房地产等行业的限制性政策有望继续放松。二季度以后，美联储加息的预期可能进一步引发全球资金从新兴市场的流出，并对中国的经济金融环境构成压力。

对A股市场而言，依旧将处于流动性主导的格局中。一方面，宽松的宏观政策环境以及居民资产的再配置将对股指构成支撑，国企改革、京津冀协同、一带一路、海西等主题热点有望轮番表现；另一方面，上市公司的利润或将表现平平，而股票供给的增加、对杠杆融资的规范以及美联储加息带动的资本外流，则会带来阶段性的剧烈震荡。相对看好金融、地产、白马成长。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告

本基金管理人一贯坚持“风险管理是公司发展的生命线”的理念，并把维护持有人利益作为己任。在监察稽核基础性工作基础上，2014年本基金管理人着重开展了如下与监察稽核有关的工作：

##### 1、着力推进制度建设，加强制度的可操作性

根据法律法规的要求，监察稽核部结合公司运作情况，协同相关业务部门对现有制度和流程进行了持续修订和完善。2014年度共制定或修订了18项制度，如：修订了《富国基金管理有限公司投资管理制度》，以更契合公司投资管理的需要；制定了《富国基金管理有限公司量化投资业务管理办法》，以更有效管理公司量化及海外投资业务。

##### 2、以合规风控为抓手，提升风控管理的效率

在“事前防范为主、事中监控为辅、事后稽核为补”工作原则的指导下，监察稽核部主动梳理了投资组合的合规指标、规范了交易系统权限设置。此外，将股指期货风控模块纳入公司整体风控体系，在系统风控相关模块有效性测试的基础上，还开展了后续跟踪评估，减少新系统可能带来的不兼容风险，提高了运行效率。

##### 3、积极开展合规培训，提升全员业务合规意识

为提高业务部门一线风控水平，在各业务部门自学、公司内部培训以及参加基金业协会组织的培训的基础上，监察稽核部门还邀请外部律师开展专题讲座培训。

---

以深入浅出的培训内容和形式，及时、有效地传达了《基金管理公司风险管理指引》及《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规，既提升了员工的风险合规意识，又使公司及业务的内部控制和风险管理得到夯实和优化。

#### 4、全面加强合规管理，深化业务开展的合规性

立足于“及时掌握监管动态，熟练知晓法律要求、全面提高服务水平”，监察稽核部通过主动与业务部门沟通，协助规范业务流程、制度制订，以保障业务开展的合规性。结合常规的季度监察稽核工作，有针对性地开展了六次专项审计，规范基金运作和公司经营所涉及的业务流程，提高了内部控制的有效性。

#### 4.7 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投资基金行业从业经验。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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

2014年1月1日至2014年4月29日，汉盛证券投资基金于2014年3月19日公告对2013年报告期内利润进行收益分配，每10份基金份额派发现金红利2.06元，共计派发现金红利412,000,001.06元。汉盛证券投资基金在本报告期内的利润分配符合相关法律法规及《基金合同》约定。

2014年4月30日至2014年12月31日，富国天盛灵活配置混合型证券投资基金共进行了两次收益分配，分别于2014年10月13日公告每10份基金份额派发现金红利0.20元，共计派发红利20752652.16元；2015年1月8日公告每10份基金份额派发现金红利0.36元，共计派发红利25076591.62元。

本基金本期分红已符合相关法律法规及《基金合同》约定。

#### 4.9 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合规守信、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，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2015）审字第 60467606_B30 号 安永华明（2015）审字第 60467606_B01 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	富国天盛灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人(原汉盛证券投资基金全体基金份额持有人)
引言段	我们审计了后附的 1. 汉盛证券投资基金财务报表，包括 2014 年 4 月 29 日的资产负债表和 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 29 日（基金合同失效日）止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。2. 富国天盛灵活配置混合型证券投资基金财务报表，包括 2014 年 12 月 31 日的资产负债表和 2014 年 4 月 30 日至 2014 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人富国基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部

	控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了汉盛证券投资基金 2014 年 4 月 29 日（基金合同失效日）的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 29 日（基金合同失效日）止期间的经营成果和净值变动情况；公允反映了富国天盛灵活配置混合型证券投资基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年 4 月 30 日至 2014 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。
注册会计师的姓名	边卓群   蒋燕华
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
审计报告日期	2015 年 03 月 26 日

## § 7 转型前基金（汉盛证券投资基金）年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：汉盛证券投资基金

报告截止日：2014年4月29日

单位：人民币元

资 产	本期末 2014年4月29日	上年度末 (2013年12月31日)
<b>资 产：</b>		
银行存款	180,315,651.58	43,030,384.32
结算备付金	12,459,802.02	27,355,569.61
存出保证金	1,972,773.43	3,123,524.39
交易性金融资产	1,818,273,790.43	2,229,595,717.79
其中：股票投资	1,007,692,357.13	1,587,339,546.39
基金投资	—	—
债券投资	810,581,433.30	642,256,171.40
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	—	175,600,000.00
应收证券清算款	3,055,795.96	23,565,225.76
应收利息	15,973,458.90	8,573,880.13
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	24.36
资产总计	2,032,051,272.32	2,510,844,326.36
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2014年4月29日</b>	<b>(2013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	10,528,810.69	—
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	2,463,791.05	3,186,064.30
应付托管费	410,631.85	531,010.73
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	527,426.72	7,130,651.02
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	500,409.72	592,000.00
负债合计	15,909,628.75	12,918,284.77
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未分配利润	16,141,643.57	497,926,041.59
所有者权益合计	2,016,141,643.57	2,497,926,041.59
负债和所有者权益总计	2,032,051,272.32	2,510,844,326.36

注：1.报告截止日 2014 年 04 月 29 日(基金合同失效日)，基金份额净值 1.0081 元，基金份额总额 2,000,000,000.00 份。

2.自 2014 年 4 月 30 日起，由《汉盛证券投资基金基金合同》修订而成的《富国天盛混合型证券投资基金基金合同》生效。

## 7.2 利润表

会计主体：汉盛证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 29 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 29 日)	上年度可比期间 (2013 年 01 月 01 日至 2013 年 12 月 31 日)
<b>一、收入</b>	-47,191,291.73	489,441,805.78
1. 利息收入	10,654,209.60	28,350,256.57
其中：存款利息收入	277,367.52	1,320,796.12
债券利息收入	9,893,456.45	23,228,959.59
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	483,385.63	3,800,500.86
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-17,007,723.55	512,992,498.67
其中：股票投资收益	-18,602,445.55	500,700,102.87
基金投资收益	—	—
债券投资收益	741,995.05	-2,561,419.14
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	852,726.95	14,853,814.94
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-40,837,777.78	-52,035,938.52
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	—	134,989.06
<b>减：二、费用</b>	22,593,105.23	91,427,619.99
1. 管理人报酬	11,682,183.28	36,478,280.20

2. 托管费	1,947,091.25	6,079,713.32
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	7,508,878.05	48,140,690.25
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 其他费用	1,454,952.65	728,936.22
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-69,784,396.96</b>	<b>398,014,185.79</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-69,784,396.96</b>	<b>398,014,185.79</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汉盛证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年4月29日

单位：人民币元

项目	本期 (2014年1月1日至2014年4月29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	497,926,041.59	2,497,926,041.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-69,784,396.96	-69,784,396.96
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）	—	—	—
其中：1. 基金申购款	—	—	—
2. 基金赎回款	—	—	—
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）	—	-412,000,001.06	-412,000,001.06
五、期末所有者权益（基金净值）	2,000,000,000.00	16,141,643.57	2,016,141,643.57
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）	2,000,000,000.00	175,911,856.39	2,175,911,856.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	398,014,185.79	398,014,185.79
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）	—	—	—
其中：1. 基金申购款	—	—	—
2. 基金赎回款	—	—	—
四、本期向基金份额持有人分配利润	—	-76,000,000.59	-76,000,000.59

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)	2,000,000,000.00	497,926,041.59	2,497,926,041.59

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
基金管理人负责人	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 基金基本情况

汉盛证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[1999]13 号文《关于同意设立汉盛证券投资基金的批复》的核准，由富国基金管理有限公司、海通证券股份有限公司（原名为海通证券有限公司）、申银万国证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司（原名为江苏证券有限责任公司）、山东省国际信托有限公司（原名为山东省国际信托投资公司）、福建省投资开发集团有限责任公司（原名为福建国际信托投资公司）于 1999 年 5 月 10 日共同发起并向社会募集设立。本基金为契约型封闭式，存续期为 15 年，发行规模为 20 亿份基金份额。本基金经上海证券交易所（以下简称“上交所”）上证上字[99]27 号文审核同意，于 1999 年 5 月 18 日在上交所挂牌交易。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。

根据本基金基金份额持有人大会审议通过的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，本基金于 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，本基金更名为“富国天盛混合型证券投资基金”，基金正式转型为契约型开放式，存续期限调整为不定。

本基金的投资范围为中国境内上市的股票，债券及中国证监会批准的其他金融工具。本基金投资目标是为投资者减少和分散投资风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。本基金资产总值 80%以上投资于股票、债券市场，其中投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的 20%

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、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 2 号《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。

根据《汉盛证券投资基金基金合同》的规定，本基金存续期至2014年4月13日终止。本基金的基金管理人富国基金管理有限公司正计划将本基金于存续期结束前改制为开放式基金并相应延长存续期至不定期，因此本基金本报告期财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

#### **7.4.3 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2014年4月29日的财务状况以及2014年1月1日至2014年4月29日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### **7.4.4 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**

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。

#### **7.4.5 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。

#### **7.4.6 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；

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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 (2014年4月29日)	上年度末(2013年12月31日)
活期存款	180,315,651.58	43,030,384.32
定期存款	—	—
其中：存款期限1-3个月	—	—
其他存款	—	—
合计	180,315,651.58	43,030,384.32

注：本基金本报告期内及上年度可比期内未投资于定期存款。

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 (2014年4月29日)		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,003,282,685.00	1,007,692,357.13	4,409,672.13
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	27,476,869.53	26,675,433.30
	银行间市场	787,665,445.50	783,906,000.00
	合计	815,142,315.03	810,581,433.30
资产支持证券	—	—	—
其他	—	—	—
合计	1,818,425,000.03	1,818,273,790.43	-151,209.60
项目	上年度末(2013年12月31日)		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,536,427,719.63	1,587,339,546.39	50,911,826.76
贵金属投资-金交所	—	—	—

黄金合约			
债券	交易所市场	34,462,434.53	33,450,171.40
	银行间市场	618,018,995.45	608,806,000.00
	合计	652,481,429.98	642,256,171.40
资产支持证券	—	—	—
其他	—	—	—
合计	2,188,909,149.61	2,229,595,717.79	40,686,568.18

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

金额单位：人民币元

项目	上年度末（2013年12月31日）	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	175,600,000.00	0.00
合计	175,600,000.00	0.00

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 (2014年4月29日)	上年度末（2013年12月31日）
应收活期存款利息	63,317.63	30,050.72
应收定期存款利息	—	—
应收其他存款利息	—	—
应收结算备付金利息	20,243.32	12,310.00
应收债券利息	15,886,324.77	8,381,705.34
应收买入返售证券利息	—	148,408.47
应收申购款利息	—	—
应收黄金合约拆借孳息	—	—
其他	3,573.18	1,405.60
合计	15,973,458.90	8,573,880.13

#### 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 (2014年4月29日)	上年度末（2013年12月31日）
其他应收款	—	24.36
待摊费用	—	—
合计	—	24.36

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 (2014年4月29日)	上年度末(2013年12月31日)
交易所市场应付交易费用	526,601.72	7,120,139.77
银行间市场应付交易费用	825.00	10,511.25
合计	527,426.72	7,130,651.02

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 (2014年4月29日)	上年度末(2013年12月31日)
应付券商交易单元保证金	250,000.00	250,000.00
应付赎回费	—	—
预提审计费	132,602.43	100,000.00
预提信息披露费	97,807.29	200,000.00
预提上市费	20,000.00	—
其他	—	42,000.00
合计	500,409.72	592,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 (2014年1月1日至2014年4月29日)	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
本期申购	—	—
本期赎回(以“-”号填列)	—	—
本期末	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00

注：于2014年4月29日，本基金的发起人海通证券股份有限公司持有500万份，占比0.25%，申银万国证券股份有限公司持有1,000万份、占比0.50%，富国基金管理有限公司持有1,000万份、占比0.50%，华泰证券股份有限公司持有500万份、占比0.25%，山东省国际信托有限公司持有500万份、占比0.25%。福建省投资开发集团有限责任公司持有500万份、占比0.25%。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	457,239,473.41	40,686,568.18	497,926,041.59
本期利润	-28,946,619.18	-40,837,777.78	-69,784,396.96
本期基金份额交易产生的变动	—	—	—

数			
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	-412,000,001.06	—	-412,000,001.06
本期末	16,292,853.17	-151,209.60	16,141,643.57

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 (2014年1月1日至2014年4月29日)	上年度可比期间(2013年01月01日至2013年12月31日)
活期存款利息收入	202,667.75	951,197.69
定期存款利息收入	—	—
其他存款利息收入	—	—
结算备付金利息收入	61,339.14	332,709.62
其他	13,360.63	36,888.81
合计	277,367.52	1,320,796.12

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 (2014年1月1日至2014年4月29日)	上年度可比期间(2013年01月01日至2013年12月31日)
卖出股票成交总额	2,657,542,608.90	16,008,780,436.05
减：卖出股票成本总额	2,676,145,054.45	15,508,080,333.18
买卖股票差价收入	-18,602,445.55	500,700,102.87

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 (2014年1月1日至2014年4月29日)	上年度可比期间 (2013年01月01日至2013年12月31日)
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	425,477,883.92	3,465,312,267.38
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	415,793,094.95	3,412,780,509.98
减：应收利息总额	8,942,793.92	55,093,176.54
买卖债券差价收入	741,995.05	-2,561,419.14

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

##### 7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 (2014年1月1日至2014年4月29日)	上年度可比期间(2013年01月01日至2013年12月31日)
股票投资产生的股利收益	852,726.95	14,853,814.94
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	852,726.95	14,853,814.94

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 (2014年1月1日至2014年4月29日)	上年度可比期间(2013年01月01日至2013年12月31日)
1. 交易性金融资产	-40,837,777.78	-52,035,938.52
股票投资	-46,502,154.63	-42,956,549.50
债券投资	5,664,376.85	-9,079,389.02
资产支持证券投资	—	—
基金投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他	—	—
2. 衍生工具	—	—
权证投资	—	—
3. 其他	—	—
合计	-40,837,777.78	-52,035,938.52

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 (2014年1月1日至2014年4月29日)	上年度可比期间(2013年01月01日至2013年12月31日)
基金赎回费收入	—	—
其他	—	134,989.06
合计	—	134,989.06

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 (2014年1月1日至2014年4月29日)	上年度可比期间(2013年01月01日至2013年12月31日)
交易所市场交易费用	7,503,128.05	48,104,890.25
银行间市场交易费用	5,750.00	35,800.00
合计	7,508,878.05	48,140,690.25

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 (2014年1月1日至2014年4月29日)	上年度可比期间(2013年01月01日至2013年12月31日)
审计费用	32,602.43	100,000.00
信息披露费	97,807.29	300,000.00
银行费用	6,542.93	21,436.22
上市费	20,000.00	60,000.00
债券账户维护费	9,000.00	18,000.00
分红手续费	1,236,000.00	228,000.00
其他	53,000.00	1,500.00
合计	1,454,952.65	728,936.22

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

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
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东
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
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（“中国农业银行”）	基金托管人

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 (2014年1月1日至2014年4月29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	735,819,898.22	15.34	4,949,638,203.56	15.62
申银万国	138,457,431.54	2.89	3,697,868,309.76	11.67

#### 7.4.10.1.2 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。

#### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 (2014年1月1日至2014年4月29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(%)
海通证券	—	—	79,133,005.14	17.46
申银万国	—	—	67,563,201.71	14.91

#### 7.4.10.1.4 回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 (2014年1月1日至2014年4月29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(%)
海通证券	135,000,000.00	4.57	1,828,100,000.00	11.64
申银万国	340,000,000.00	11.52	2,393,000,000.00	15.24

#### 7.4.10.1.5 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1月1日至2014年4月29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	662,906.60	15.45	5,826.10	1.11
申银万国	123,469.30	2.88	12,619.34	2.40
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	4,438,775.20	15.62	368,060.45	5.17
申银万国	3,327,798.86	11.71	1,570,284.75	22.05

注：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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 (2014年1月1日至2014年4月29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	11,682,183.28	36,478,280.20
其中：支付销售机构的客户维护费	—	—

注：该项费用按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提，基金成立三个月后如持有现金比例高于基金资产净值的20%，超出部分不计提管理费。计算方法如下：

$$H=E*1.50\%/当年天数$$

H 为每日应计提的管理人管理费

E 为前一日的基金资产净值(扣除超过规定比例现金后的资产净值)

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 (2014年1月1日至2014年4月29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	1,947,091.25	6,079,713.32

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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本报告期内及上年度可比期间内本基金均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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1月1日至2014年4月29日)	上年度可比期间(2013年01月01日至2013年12月31日)
基金合同生效日1999年05月10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	—	—

期间申购/买入总份额	—	—
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.50%	0.50%

#### 7.4.10.4.2 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4月29日)		上期末(2013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(%)
申银万国证券股份有限公司	10,000,000.00	0.50	10,000,000.00	0.50
海通证券股份有限公司	5,000,000.00	0.25	5,000,000.00	0.25
山东省国际信托有限公司	5,000,000.00	0.25	5,000,000.00	0.25

#### 7.4.10.5 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1月1日至2014年4月29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	180,315,651.58	202,667.75	43,030,384.32	951,197.69

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本报告期内及上年度可比期间内本基金均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间内本基金均无其他关联方交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放	再投资形式发放	利润分配合计
1	2014-03-24	2014-03-25	2.060	412,000,001.06	—	412,000,001.06
合计			2.060	412,000,001.06	—	412,000,001.06

#### 7.4.12 期末（2014年4月29日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 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
000712	锦龙股份	2014-03-31	待发布澄清公告	26.79	2014-05-14	24.21	2,839,429	82,698,795.25	76,068,302.91	—
000748	长城信息	2014-04-21	筹划重大事项	23.36	2014-05-13	24.60	747,867	14,714,640.02	17,470,173.12	—
000801	四川九洲	2014-04-14	筹划重大事项	15.30	2014-05-30	16.83	40,726	595,185.15	623,107.80	—
002405	四维图新	2014-02-28	筹划重大事项	15.43	2014-05-22	16.92	2,546,738	39,653,449.14	39,296,167.34	—
002520	日发精机	2014-03-18	筹划重大事项	26.44	2014-05-12	23.80	2,082,214	45,991,698.47	55,053,738.16	—
300085	银之杰	2014-01-23	筹划重大事项	14.75	2014-05-23	13.30	5,065,222	43,807,264.59	74,712,024.50	—
300088	长信科技	2014-03-13	筹划重大事项	19.59	2014-07-01	18.00	366,450	8,026,990.26	7,178,755.50	—
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	—
600089	特变电工	2014-04-28	筹划重大事项	8.87	2014-04-30	9.02	1,418,860	13,758,829.20	12,585,288.20	—

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末2014年4月29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。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年4月29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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、

---

监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

#### **7.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### **7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险主要来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### **7.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括其他价格风险、利率风险和外汇风险。

##### **7.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### **7.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

本期末 (2014年4月29日)	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	180,315,651.58	—	—	—	—	—	180,315,651.58
结算备付金	12,459,802.02	—	—	—	—	—	12,459,802.02
存出保证金	1,972,773.43	—	—	—	—	—	1,972,773.43
交易性金融资产	168,236,993.60	227,697,457.80	329,314,781.90	48,230,000.00	37,102,200.00	1,007,692,357.13	1,818,273,790.43
应收证券清算款	—	—	—	—	—	3,055,795.96	3,055,795.96
应收利息	—	—	—	—	—	15,973,458.90	15,973,458.90
资产总计	362,985,220.63	227,697,457.80	329,314,781.90	48,230,000.00	37,102,200.00	1,026,721,611.99	2,032,051,272.32
负债							
卖出回购金融资产款	—	—	—	—	—	—	—
应付证券清算款	—	—	—	—	—	10,528,810.69	10,528,810.69
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	2,463,791.05	2,463,791.05
应付托管费	—	—	—	—	—	410,631.85	410,631.85
应付交易费用	—	—	—	—	—	527,426.72	527,426.72
应付税费	—	—	—	—	—	1,478,558.72	1,478,558.72
其他负债	—	—	—	—	—	500,409.72	500,409.72
负债总计	—	—	—	—	—	15,909,628.75	15,909,628.75
利率敏感度缺口	362,985,220.63	227,697,457.80	329,314,781.90	48,230,000.00	37,102,200.00	1,010,811,983.24	2,016,141,643.57
上年度末(2013年12月31日)	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							

银行存款	43,030,384.32	—	—	—	—	—	43,030,384.32
结算备付金	27,355,569.61	—	—	—	—	—	27,355,569.61
存出保证金	3,123,524.39	—	—	—	—	—	3,123,524.39
交易性金融资产	26,940,100.00	117,128,860.80	414,976,410.60	47,080,000.00	36,130,800.00	1,587,339,546.39	2,229,595,717.79
买入返售金融资产	175,600,000.00	—	—	—	—	—	175,600,000.00
应收证券清算款	—	—	—	—	—	23,565,225.76	23,565,225.76
应收利息	—	—	—	—	—	8,573,880.13	8,573,880.13
其他应收款	—	—	—	—	—	24.36	24.36
资产总计	276,049,578.32	117,128,860.80	414,976,410.60	47,080,000.00	36,130,800.00	1,619,478,676.64	2,510,844,326.36
负债							
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	3,186,064.30	3,186,064.30
应付托管费	—	—	—	—	—	531,010.73	531,010.73
应付交易费用	—	—	—	—	—	7,130,651.02	7,130,651.02
应付税费	—	—	—	—	—	1,478,558.72	1,478,558.72
其他负债	—	—	—	—	—	592,000.00	592,000.00
负债总计	—	—	—	—	—	12,918,284.77	12,918,284.77
利率敏感度缺口	276,049,578.32	117,128,860.80	414,976,410.60	47,080,000.00	36,130,800.00	1,606,560,391.87	2,497,926,041.59

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

假设	1. 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动； 2. 利率变动范围合理。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末(2014年4月29日)	上年度末（2013年12月31日）
	1. 基准点利率增加0.1%	-643,808.92	-668,196.18
	2. 基准点利率减少0.1%	643,808.92	668,196.18

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金投资组合中资产总值80%以上投资于股票、债券市场，其中投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的20%。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末 (2014年4月29日)		上年度末(2013年12月31日)	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	1,007,692,357.13	49.98	1,587,339,546.39	63.55
交易性金融资产—债券投资	810,581,433.30	40.20	642,256,171.40	25.71
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—

合计	1,818,273,790.43	90.19	2,229,595,717.79	89.26
----	------------------	-------	------------------	-------

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

本基金合同没有规定业绩比较基准，本基金根据基金长期运作的资产组合比例，拟定将 80%的沪深 300 指数加上 20%中国债券总指数作为基准进行敏感性分析。

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关； 2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2014年4月 29日）	上年度末（2013年12月 31日）
	1.80%* 沪深 300 指数 +20%*中国债券总指数增 加 1%	17,199,292.03	17,480,525.09
	2.80%* 沪深 300 指数 +20%*中国债券总指数减 少 1%	-17,199,292.03	-17,480,525.09

#### 7.4.14 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 4 月 29 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 743,492,472.14 元，属于第二层次的余额为人民币 1,074,781,318.29 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元（于 2013 年 12 月 31 日，第一层次的余额为人民币 1,620,763,767.79 元，属于第二层次的余额为人民币 608,831,950.00 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元）。

##### 7.4.14.1.2.2 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。

#### 7.4.14.1.2.3 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。

#### 7.4.14.2 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。

#### 7.4.14.3 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。

### §8 转型后基金（富国天盛灵活配置混合型证券投资基金）年度财务报表

#### 8.1 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：2014年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 (2014年12月31日)
<b>资产：</b>	
银行存款	52,651,651.85
结算备付金	14,202,339.28
存出保证金	2,438,330.09
交易性金融资产	921,901,406.76
其中：股票投资	871,836,406.76
基金投资	—
债券投资	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	1,372,852.04
应收股利	—
应收申购款	74,627.89
递延所得税资产	—
其他资产	—
资产总计	1,003,275,670.88
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>

	(2014年12月31日)
<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	—
应付赎回款	7,896,891.01
应付管理人报酬	1,319,199.88
应付托管费	219,866.67
应付销售服务费	—
应付交易费用	8,280,660.73
应交税费	1,478,558.72
应付利息	—
应付利润	—
递延所得税负债	—
其他负债	429,548.48
负债合计	19,624,725.49
<b>所有者权益:</b>	
实收基金	820,560,297.16
未分配利润	163,090,648.23
所有者权益合计	983,650,945.39
负债和所有者权益总计	1,003,275,670.88

注：1.报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.181 元，基金份额总额 832,805,589.86 份。

2.自 2014 年 4 月 30 日起，由《汉盛证券投资基金基金合同》修订而成的《富国天盛混合型证券投资基金基金合同》生效。

## 8.2 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：2014 年 04 月 30 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2014 年 4 月 30 日(基金转型日)至 2014 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	310,082,791.62
1. 利息收入	6,759,841.08
其中：存款利息收入	1,959,765.47
债券利息收入	3,199,553.35
资产支持证券利息收入	—
买入返售金融资产收入	1,600,522.26

其他利息收入	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	262,322,227.43
其中：股票投资收益	259,462,204.41
基金投资收益	—
债券投资收益	-3,519,037.89
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	6,379,060.91
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	35,530,922.42
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	5,469,800.69
<b>减：二、费用</b>	<b>45,731,763.93</b>
1. 管理人报酬	14,603,386.70
2. 托管费	2,434,156.05
3. 销售服务费	—
4. 交易费用	28,225,562.51
5. 利息支出	179,055.26
其中：卖出回购金融资产支出	179,055.26
6. 其他费用	289,603.41
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>264,351,027.69</b>
减：所得税费用	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>264,351,027.69</b>

### 8.3 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：2014年04月30日至2014年12月31日

单位：人民币元

项目	本期2014年4月30日(基金转型日)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）	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）	—	264,351,027.69	264,351,027.69
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）	-1,179,439,702.84	-96,649,370.87	-1,276,089,073.71
其中：1. 基金申购款	127,970,729.11	3,885,359.33	131,856,088.44
2. 基金赎回款	-1,307,410,431.95	-100,534,730.20	-1,407,945,162.15
四、本期向基金份额持有人分配利	—	-20,752,652.16	-20,752,652.16

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）	820,560,297.16	163,090,648.23	983,650,945.39

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
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 8.4 报表附注

### 8.4.1 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%。

#### **8.4.2 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 2 号《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。

采用若干修订后/新会计准则

2014 年 1 至 3 月，财政部制定了《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》和《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》；修订了《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》和《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》；上述 7 项会计准则均自 2014 年 7 月 1 日起施行。2014 年 6 月，财政部修订了《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，在 2014 年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本基金的财务报表无重大影响。

#### **8.4.3 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 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### **8.4.4 重要会计政策和会计估计**

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。

#### 8.4.4.1 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（基金合同生效日）至2014年12月31日止。

#### 8.4.4.2 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。

#### 8.4.4.3 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。

#### 8.4.4.4 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，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。

### 8.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

#### (1) 存在活跃市场的金融工具

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；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，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。估值日无交易且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，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

#### (2) 不存在活跃市场的金融工具

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入

值。

#### 8.4.4.6 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。

#### 8.4.4.7 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。

#### 8.4.4.8 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收益/(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)”。

#### 8.4.4.9 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，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。

#### **8.4.4.10 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 1.5%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) 卖出回购金融资产支出，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。

#### **8.4.4.11 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。

### **8.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **8.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期会计政策变更的说明在 7.4.2 会计报表的编制基础中披露。

#### **8.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无会计估计变更。

#### **8.4.5.3 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。

### **8.4.6 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。

## 8.4.7 重要财务报表项目的说明

### 8.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2014年12月31日）
活期存款	52,651,651.85
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	52,651,651.85

注：本基金本报告期内未投资于定期存款。

### 8.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2014年12月31日）
----	------------------

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	836,489,993.94	871,836,406.76	35,346,412.82
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	50,031,700.00	33,300.00
	合计	50,031,700.00	33,300.00
资产支持证券	—	—	—
其他	—	—	—
合计	886,521,693.94	921,901,406.76	35,379,712.82

#### 8.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 8.4.7.4 买入返售金融资产

##### 8.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 8.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购中取得的债券。

#### 8.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末（2014年12月31日）
应收活期存款利息	85,226.65
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	6,391.10
应收债券利息	1,280,136.99
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	1,097.30
合计	1,372,852.04

#### 8.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 8.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末（2014年12月31日）
交易所市场应付交易费用	8,280,240.73
银行间市场应付交易费用	420.00
合计	8,280,660.73

#### 8.4.7.8其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2014年12月31日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	29,548.48
预提审计费	100,000.00
预提信息披露费	300,000.00
合计	429,548.48

#### 8.4.7.9实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金转型日2014年4月30日	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
2014年06月04日基金份额折算调整	25,354,940.83	—
2014年06月04日未领取红利份额折算调整	556,229.95	556,229.95
2014年06月04日集中申购募集资金本金及利息	108,849,150.04	107,250,115.02
2014年06月04日基金拆分和集中申购完成后	2,134,760,320.82	2,107,806,344.97
本期申购	20,463,891.14	20,164,384.14
本期赎回(以“-”号填列)	-1,322,418,622.10	-1,307,410,431.95
本期末	832,805,589.86	820,560,297.16

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 8.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日2014年4月30日	16,292,853.17	-151,209.60	16,141,643.57
本期利润	228,820,105.27	35,530,922.42	264,351,027.69
本期基金份额交易产生的变动数	-74,611,506.77	-22,037,864.10	-96,649,370.87
其中：基金申购款	2,939,389.51	945,969.82	3,885,359.33
基金赎回款	-77,550,896.28	-22,983,833.92	-100,534,730.20
本期已分配利润	-20,752,652.16	—	-20,752,652.16
本期末	149,748,799.51	13,341,848.72	163,090,648.23

#### 8.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年12月31
----	--------------------------------

	日
活期存款利息收入	1,800,760.67
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	137,450.02
其他	21,554.78
合计	1,959,765.47

#### 8.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年12月31日
卖出股票成交总额	9,490,564,407.81
减：卖出股票成本总额	9,231,102,203.40
买卖股票差价收入	259,462,204.41

#### 8.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	859,036,184.05
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	845,161,995.03
减：应收利息总额	17,393,226.91
买卖债券差价收入	-3,519,037.89

#### 8.4.7.14 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 8.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 8.4.7.16 衍生工具收益

##### 8.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 8.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 8.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年12月31日
----	---------------------------------

股票投资产生的股利收益	6,379,060.91
基金投资产生的股利收益	—
合计	6,379,060.91

#### 8.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年12月31日
1. 交易性金融资产	35,530,922.42
股票投资	30,936,740.69
债券投资	4,594,181.73
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
合计	35,530,922.42

#### 8.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年12月31日
基金赎回费收入	5,456,528.55
转换费收入	13,272.14
合计	5,469,800.69

#### 8.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年12月31日
交易所市场交易费用	28,220,012.51
银行间市场交易费用	5,550.00
合计	28,225,562.51

#### 8.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期2014年4月30日(基金转型日)至2014年12月31日
审计费用	67,397.57
信息披露费	202,192.71

银行费用	11,013.13
债券账户维护费	9,000.00
合计	289,603.41

#### 8.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 8.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 8.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于资产负债表日之后、年度报告批准报出日之前批准、公告或实施的利润分配的情况如下：

2015年1月13日登记日、1月14日除息日对本基金份额持有人按每10份基金份额分配人民币0.36元进行分红，实际分配收益为人民币25,076,591.62元，其中现金19,627,375.86元，红利再投资5,449,215.76元。

除以上情况之外，无其他需要说明的资产负债表日后事项。

#### 8.4.9 关联方关系

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。

#### 8.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 8.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 8.4.10.1.1 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12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
海通证券	1,551,246,285.90	8.36
申银万国	262,500,351.49	1.41

##### 8.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 8.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 8.4.10.1.4 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 12 月 31 日	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例 (%)
海通证券	500,000,000.00	7.80

#### 8.4.10.1.5 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	1,384,013.27	8.36	457,266.91	5.52
申银万国	234,835.26	1.42	0.00	0.00

注：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。

#### 8.4.10.2 关联方报酬

##### 8.4.10.2.1 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 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	14,603,386.70
其中：支付销售机构的客户维护费	336,697.97

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。

##### 8.4.10.2.2 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 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,434,156.05

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。

#### 8.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本报告期内本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 8.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 8.4.10.4.1 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 12 月 31 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
期初持有的基金份额	10,149,094.02
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	10,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.22%

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。

##### 8.4.10.4.2 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 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(%)
申银万国证券股份有限公司	10,149,094.03	1.22
山东省国际信托有限公司	5,074,547.01	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。

#### 8.4.10.5 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 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	52,651,651.85	1,800,760.67

公司		
----	--	--

#### 8.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2014 年 4 月 30 日(基金转型日)至 2014 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
海通证券	603009	北特科技	网下发行	13,103	91,852.03

#### 8.4.10.7 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。

#### 8.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放	再投资形式发放	利润分配合计
1	2014-10-15	2014-10-16	0.200	17,075,575.80	3,677,076.36	20,752,652.16
合计			0.200	17,075,575.80	3,677,076.36	20,752,652.16

注：本基金于资产负债表日之后、财务报表批准报出日之前批准、公告或实施的利润分配情况请参见资产负债表日后事项(附注 8.4.8.2)。

#### 8.4.12 期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

##### 8.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 8.4.12.2 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
002070	众和股份	2014-09-05	筹划重大事项	9.49	2015-03-11	10.00	2,262,692	22,649,185.63	21,472,947.08	—
002329	皇氏集团	2014-12-01	筹划重大事项	27.85	2015-01-30	27.61	174,054	3,976,306.71	4,847,403.90	—
002507	涪陵榨菜	2014-12-22	筹划重大事项	28.80	2015-03-23	31.68	261,457	7,371,242.59	7,529,961.60	—
600754	锦江股份	2014-11-10	筹划重大事项	25.11	2015-01-19	27.00	837,344	18,807,505.27	21,025,707.84	—

---

### 8.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 8.4.12.3.1 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。

#### 8.4.12.3.2 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。

### 8.4.13 金融工具风险及管理

#### 8.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

#### 8.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 8.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险主要来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在 8.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 8.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括其他价格风险、利率风险和外汇风险。

##### 8.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

---

#### 8.4.13.4.1.1 利率风险敞口

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

本期末（2014年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	52,651,651.85	—	—	—	—	—	52,651,651.85
结算备付金	14,202,339.28	—	—	—	—	—	14,202,339.28
存出保证金	2,438,330.09	—	—	—	—	—	2,438,330.09
交易性金融资产	—	—	50,065,000.00	—	—	871,836,406.76	921,901,406.76
应收证券清算款	—	—	—	—	—	10,634,462.97	10,634,462.97
应收利息	—	—	—	—	—	1,372,852.04	1,372,852.04
应收申购款	—	—	—	—	—	74,627.89	74,627.89
资产总计	69,292,321.22	—	50,065,000.00	—	—	883,918,349.66	1,003,275,670.88
负债							
卖出回购金融资产款	—	—	—	—	—	—	—
应付赎回款	—	—	—	—	—	7,896,891.01	7,896,891.01
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	1,319,199.88	1,319,199.88
应付托管费	—	—	—	—	—	219,866.67	219,866.67
应付交易费用	—	—	—	—	—	8,280,660.73	8,280,660.73
应付税费	—	—	—	—	—	1,478,558.72	1,478,558.72
其他负债	—	—	—	—	—	429,548.48	429,548.48
负债总计	—	—	—	—	—	19,624,725.49	19,624,725.49
利率敏感度缺口	69,292,321.22	—	50,065,000.00	—	—	864,293,624.17	983,650,945.39

#### 8.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

假设	1. 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动； 2. 利率变动范围合理。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2014年12月31日）
	1. 基准点利率增加0.1%	-21,032.31
	2. 基准点利率减少0.1%	21,032.31

#### 8.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 8.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 8.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

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%。

金额单位：人民币元

项目	本期末（2014年12月31日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	871,836,406.76	88.63
交易性金融资产—债券投资	50,065,000.00	5.09
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	921,901,406.76	93.72

#### 8.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关； 2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）  本期末（2014年12月31日）
	1. 业绩比较基准增加 1%	8,803,808.18
	2. 业绩比较基准减少 1%	-8,803,808.18

#### 8.4.14 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31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816,960,386.34元，属于第二层次的余额为人民币104,941,020.42元，属于第三层次余额为人民币0.00元

##### 7.4.14.1.2.2 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。

##### 7.4.14.1.2.3 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。

#### 7.4.14.2 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。

#### 7.4.14.3 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。

### §9 转型前基金（原汉盛证券投资基金）投资组合报告

#### 9.1 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。

#### 9.2 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	—	—



0	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。

### 9.3 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所有股票投资明细

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
11	600887	伊利股份	829,997	29,464,893.50	1.46
12	002440	闰土股份	1,275,523	24,681,370.05	1.22
13	000671	阳光城	2,792,174	23,035,435.50	1.14
14	002382	蓝帆股份	1,485,477	20,856,097.08	1.03
15	600563	法拉电子	716,575	20,257,575.25	1.00
16	000748	长城信息	747,867	17,470,173.12	0.87
17	300266	兴源过滤	550,138	16,009,015.80	0.79
18	002133	广宇集团	4,329,119	15,584,828.40	0.77
19	000333	美的集团	297,100	13,960,729.00	0.69
20	002049	同方国芯	324,323	12,775,082.97	0.63
21	600089	特变电工	1,418,860	12,585,288.20	0.62
22	600352	浙江龙盛	765,831	12,544,311.78	0.62
23	300183	东软载波	343,099	11,414,903.73	0.57
24	000401	冀东水泥	1,337,573	10,633,705.35	0.53
25	600894	广日股份	805,412	9,632,727.52	0.48
26	002475	立讯精密	231,147	9,167,290.02	0.45
27	000963	华东医药	203,754	9,120,029.04	0.45
28	000525	红太阳	650,142	9,075,982.32	0.45
29	300323	华灿光电	422,257	7,887,760.76	0.39
30	601992	金隅股份	1,327,214	7,671,296.92	0.38

31	002140	东华科技	457,724	7,557,023.24	0.37
32	600312	平高电气	602,132	7,520,628.68	0.37
33	300088	长信科技	366,450	7,178,755.50	0.36
34	000024	招商地产	419,863	6,898,349.09	0.34
35	300115	长盈精密	194,000	6,842,380.00	0.34
36	600266	北京城建	803,455	6,050,016.15	0.30
37	600171	上海贝岭	604,091	5,618,046.30	0.28
38	000002	万科A	689,200	5,472,248.00	0.27
39	002236	大华股份	195,700	5,467,858.00	0.27
40	600048	保利地产	715,200	5,378,304.00	0.27
41	600661	新南洋	212,480	3,956,377.60	0.20
42	000592	中福实业	450,900	3,746,979.00	0.19
43	002223	鱼跃医疗	149,953	3,558,384.69	0.18
44	002206	海利得	551,149	3,461,215.72	0.17
45	600104	上汽集团	227,712	3,301,824.00	0.16
46	600261	阳光照明	181,900	3,024,997.00	0.15
47	600028	中国石化	547,040	2,746,140.80	0.14
48	002421	达实智能	122,176	2,667,102.08	0.13
49	002586	围海股份	191,478	2,140,724.04	0.11
50	002693	双成药业	120,784	1,608,842.88	0.08
51	600482	风帆股份	151,974	1,512,141.30	0.08
52	600519	贵州茅台	8,857	1,448,916.63	0.07
53	600649	城投控股	213,640	1,397,205.60	0.07
54	300303	聚飞光电	58,397	1,257,287.41	0.06
55	600967	北方创业	49,900	911,174.00	0.05
56	000801	四川九洲	40,726	623,107.80	0.03
57	000732	泰禾集团	49,127	424,948.55	0.02
58	002157	正邦科技	30,711	190,715.31	0.01
59	600859	王府井	6,800	114,172.00	0.01

注：转型前最后一日为2014年4月29日。

#### 9.4 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

##### 9.4.1 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。

#### 9.4.2 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。

### 9.4.3 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。

### 9.5 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。

### 9.6 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。

### 9.7 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所有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。

### 9.8 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。

## 9.9 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。

## 9.10 转型前最后一日本基金投资的股指期货交易情况说明

### 9.10.1 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。

### 9.10.2 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。

## 9.11 转型前最后一日本基金投资的国债期货交易情况说明

### 9.11.1 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。

### 9.11.2 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。

### 9.11.3 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。

## 9.12 投资组合报告附注

### 9.12.1 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。

### 9.12.2 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。

### 9.12.3 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。

#### 9.12.4 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2014年4月29日。

#### 9.12.5 转型前最后一日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	000712	锦龙股份	76,068,302.91	3.77	问题核查
2	300085	银之杰	74,712,024.50	3.71	筹划重大事项
3	002520	日发精机	55,053,738.16	2.73	筹划重大事项
4	002405	四维图新	39,296,167.34	1.95	筹划重大事项

注：转型前最后一日为2014年4月29日。

#### 9.12.6 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。

### § 10 转型后基金富国天盛灵活配置混合型证券投资基金投资组合报告

#### 10.1 2014年12月31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 (%)
9	权益投资	871,836,406.76	86.90
	其中：股票	871,836,406.76	86.90
10	固定收益投资	50,065,000.00	4.99
	其中：债券	50,065,000.00	4.99

	资产支持证券	—	—
11	贵金属投资	—	—
12	金融衍生品投资	—	—
13	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
14	银行存款和结算备付金合计	66,853,991.13	6.66
15	其他各项资产	14,520,272.99	1.45
16	合计	1,003,275,670.88	100.00

注：基金转型日为 2014 年 4 月 30 日。

### 10.2 2014 年 12 月 31 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	—	—
B	采矿业	14,494,379.84	1.47
C	制造业	210,587,548.65	21.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,234,397.25	1.04
E	建筑业	38,923,445.80	3.96
F	批发和零售业	12,346,356.10	1.26
G	交通运输、仓储和邮政业	24,651,250.00	2.51
H	住宿和餐饮业	21,025,707.84	2.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	37,702,163.63	3.83
J	金融业	301,163,222.84	30.62
K	房地产业	178,092,656.40	18.11
L	租赁和商务服务业	22,603,288.41	2.30
M	科学研究和技术服务业	11,990.00	0.00
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	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	871,836,406.76	88.63

注：基金转型日为 2014 年 4 月 30 日。

### 10.3 2014 年 12 月 31 日按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601318	中国平安	678,900	50,720,619.00	5.16
2	600016	民生银行	4,229,700	46,019,136.00	4.68

3	601336	新华保险	868,700	43,052,772.00	4.38
4	000002	万科A	3,082,361	42,844,817.90	4.36
5	600048	保利地产	3,519,000	38,075,580.00	3.87
6	601601	中国太保	894,300	28,885,890.00	2.94
7	000712	锦龙股份	981,731	26,703,083.20	2.71
8	600383	金地集团	2,165,000	24,702,650.00	2.51
9	601006	大秦铁路	2,312,500	24,651,250.00	2.51
10	600415	小商品城	1,781,189	22,603,288.41	2.30
11	000402	金融街	1,761,610	21,720,651.30	2.21
12	002070	众和股份	2,262,692	21,472,947.08	2.18
13	600754	锦江股份	837,344	21,025,707.84	2.14
14	600352	浙江龙盛	1,038,952	20,446,575.36	2.08
15	600019	宝钢股份	2,900,801	20,334,615.01	2.07
16	000024	招商地产	717,400	18,932,186.00	1.92
17	600199	金种子酒	1,528,600	17,838,762.00	1.81
18	000709	河北钢铁	4,594,822	17,598,168.26	1.79
19	000783	长江证券	1,033,500	17,383,470.00	1.77
20	600376	首开股份	1,721,200	17,349,696.00	1.76
21	600118	中国卫星	604,800	17,224,704.00	1.75
22	000651	格力电器	462,500	17,168,000.00	1.75
23	600000	浦发银行	937,000	14,701,530.00	1.49
24	300253	卫宁软件	191,125	13,373,016.25	1.36
25	000623	吉林敖东	372,200	12,956,282.00	1.32
26	600685	广船国际	357,193	12,723,214.66	1.29
27	000001	平安银行	800,546	12,680,648.64	1.29
28	601166	兴业银行	728,900	12,026,850.00	1.22
29	601186	中国铁建	752,500	11,483,150.00	1.17
30	002366	丹甫股份	379,033	11,465,748.25	1.17
31	600694	大商股份	227,279	10,893,482.47	1.11
32	601668	中国建筑	1,410,400	10,267,712.00	1.04
33	600900	长江电力	959,175	10,234,397.25	1.04
34	601818	光大银行	2,092,500	10,211,400.00	1.04
35	601857	中国石油	940,300	10,164,643.00	1.03
36	601169	北京银行	924,800	10,108,064.00	1.03
37	600015	华夏银行	744,800	10,025,008.00	1.02
38	601800	中国交建	673,000	9,347,970.00	0.95
39	601328	交通银行	1,282,200	8,718,960.00	0.89
40	600104	上汽集团	358,971	7,707,107.37	0.78
41	002507	涪陵榨菜	261,457	7,529,961.60	0.77
42	600208	新湖中宝	1,022,600	7,485,432.00	0.76
43	601555	东吴证券	316,600	7,098,172.00	0.72



44	000732	泰禾集团	424,416	6,981,643.20	0.71
45	300059	东方财富	246,000	6,878,160.00	0.70
46	600570	恒生电子	123,918	6,785,749.68	0.69
47	600037	歌华有线	418,854	6,069,194.46	0.62
48	000786	北新建材	228,467	5,775,645.76	0.59
49	002465	海格通信	263,300	5,086,956.00	0.52
50	002329	皇氏集团	174,054	4,847,403.90	0.49
51	600528	中铁二局	297,500	4,477,375.00	0.46
52	601918	国投新集	756,947	4,329,736.84	0.44
53	000858	五粮液	159,410	3,427,315.00	0.35
54	000997	新大陆	121,666	3,423,681.24	0.35
55	000961	中南建设	244,324	3,347,238.80	0.34
56	601628	中国人寿	82,800	2,827,620.00	0.29
57	300213	佳讯飞鸿	105,149	2,576,150.50	0.26
58	601933	永辉超市	140,133	1,220,558.43	0.12
59	002642	荣之联	41,900	1,172,362.00	0.12
60	600114	东睦股份	82,088	1,094,233.04	0.11
61	000063	中兴通讯	54,600	986,076.00	0.10
62	000401	冀东水泥	72,039	941,549.73	0.10
63	300285	国瓷材料	24,893	725,879.88	0.07
64	002223	鱼跃医疗	9,860	246,105.60	0.03
65	600120	浙江东方	12,410	232,315.20	0.02
66	300353	东土科技	8,469	138,637.53	0.01
67	300211	亿通科技	6,504	126,828.00	0.01
68	002358	森源电气	2,221	77,735.00	0.01
69	002737	葵花药业	500	28,930.00	0.00
70	002488	金固股份	676	15,777.84	0.00
71	002738	中矿资源	1,000	11,990.00	0.00
72	300412	迦南科技	500	9,790.00	0.00
73	300147	香雪制药	496	8,273.28	0.00
74	300004	南风股份	200	8,176.00	0.00

注：基金转型日为2014年4月30日。

#### 10.4 转型日至报告期末（2014年4月30日至2014年12月31日）股票投资组合的重大变动

##### 10.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	000002	万科A	143,477,927.25	14.59
2	000402	金融街	120,523,874.54	12.25
3	600048	保利地产	117,529,414.29	11.95

4	601601	中国太保	106,026,005.42	10.78
5	601336	新华保险	104,451,969.01	10.62
6	601318	中国平安	99,297,048.04	10.09
7	300170	汉得信息	94,905,997.65	9.65
8	002421	达实智能	94,107,676.95	9.57
9	000592	平潭发展	91,675,275.07	9.32
10	000656	金科股份	89,329,384.19	9.08
11	000712	锦龙股份	88,950,418.72	9.04
12	000671	阳光城	88,221,363.09	8.97
13	002366	丹甫股份	86,111,955.42	8.75
14	600340	华夏幸福	85,950,531.29	8.74
15	600210	紫江企业	85,837,033.36	8.73
16	601628	中国人寿	82,377,400.90	8.37
17	600016	民生银行	77,414,704.28	7.87
18	600755	厦门国贸	76,622,773.10	7.79
19	300059	东方财富	74,929,658.60	7.62
20	002153	石基信息	74,856,896.03	7.61
21	300226	上海钢联	74,144,482.97	7.54
22	300150	世纪瑞尔	68,514,390.05	6.97
23	002642	荣之联	68,127,063.55	6.93
24	000024	招商地产	67,950,082.78	6.91
25	601800	中国交建	66,117,495.90	6.72
26	600153	建发股份	65,505,258.34	6.66
27	300129	泰胜风能	63,935,422.94	6.50
28	600104	上汽集团	63,037,003.17	6.41
29	601668	中国建筑	62,201,003.68	6.32
30	600212	江泉实业	60,418,475.66	6.14
31	600030	中信证券	58,768,910.42	5.97
32	600887	伊利股份	57,806,957.52	5.88
33	600021	上海电力	57,708,455.20	5.87
34	000732	泰禾集团	57,429,934.72	5.84
35	300253	卫宁软件	56,387,016.55	5.73
36	000997	新大陆	56,360,182.88	5.73
37	601166	兴业银行	54,974,811.68	5.59
38	600352	浙江龙盛	54,540,294.36	5.54
39	600089	特变电工	52,340,946.82	5.32
40	601555	东吴证券	51,679,637.71	5.25
41	600802	福建水泥	50,854,295.58	5.17
42	300037	新宙邦	50,025,835.04	5.09
43	000961	中南建设	49,105,170.92	4.99
44	300257	开山股份	48,784,982.79	4.96

45	601818	光大银行	48,323,828.00	4.91
46	600835	上海机电	48,213,879.64	4.90
47	300254	仟源医药	47,542,738.54	4.83
48	002176	江特电机	47,211,880.82	4.80
49	601788	光大证券	47,106,913.61	4.79
50	601006	大秦铁路	46,517,159.49	4.73
51	601688	华泰证券	46,177,193.90	4.69
52	600019	宝钢股份	45,590,969.15	4.63
53	300203	聚光科技	45,472,254.81	4.62
54	600114	东睦股份	44,600,879.54	4.53
55	002030	达安基因	44,387,581.39	4.51
56	600415	小商品城	43,698,069.03	4.44
57	600000	浦发银行	43,213,760.39	4.39
58	300356	光一科技	43,051,776.30	4.38
59	600057	象屿股份	41,915,811.30	4.26
60	600066	宇通客车	41,058,624.82	4.17
61	002008	大族激光	41,018,540.97	4.17
62	002488	金固股份	41,015,963.49	4.17
63	600199	金种子酒	40,795,353.42	4.15
64	000651	格力电器	40,687,742.73	4.14
65	300287	飞利信	40,504,571.06	4.12
66	601933	永辉超市	39,969,586.53	4.06
67	000776	广发证券	38,883,461.66	3.95
68	000783	长江证券	37,900,741.21	3.85
69	300121	阳谷华泰	37,649,010.59	3.83
70	000559	万向钱潮	36,634,149.34	3.72
71	600015	华夏银行	36,625,451.36	3.72
72	000685	中山公用	36,549,208.15	3.72
73	300115	长盈精密	36,493,042.13	3.71
74	600521	华海药业	36,326,067.01	3.69
75	002085	万丰奥威	35,523,976.26	3.61
76	000709	河北钢铁	35,416,231.62	3.60
77	300010	立思辰	35,373,800.55	3.60
78	300133	华策影视	34,786,960.88	3.54
79	600570	恒生电子	34,770,514.13	3.53
80	002051	中工国际	34,636,084.48	3.52
81	300212	易华录	33,881,406.38	3.44
82	002594	比亚迪	33,136,577.71	3.37
83	600309	万华化学	32,740,977.42	3.33
84	002310	东方园林	32,696,992.55	3.32
85	600699	均胜电子	32,666,604.53	3.32

86	600685	广船国际	32,408,293.14	3.29
87	300058	蓝色光标	32,267,652.38	3.28
88	002410	广联达	31,816,216.62	3.23
89	002357	富临运业	31,511,919.20	3.20
90	601333	广深铁路	31,157,258.61	3.17
91	002108	沧州明珠	31,067,882.18	3.16
92	000861	海印股份	30,926,122.99	3.14
93	300032	金龙机电	30,922,289.68	3.14
94	000977	浪潮信息	30,499,879.84	3.10
95	300024	机器人	29,432,825.38	2.99
96	600115	东方航空	29,394,117.47	2.99
97	000937	冀中能源	29,244,564.72	2.97
98	000400	许继电气	28,968,404.59	2.94
99	600900	长江电力	28,909,671.96	2.94
100	600158	中体产业	28,861,887.52	2.93
101	601231	环旭电子	28,842,374.60	2.93
102	300038	梅泰诺	28,614,536.22	2.91
103	002559	亚威股份	28,483,808.71	2.90
104	002049	同方国芯	28,482,807.87	2.90
105	002454	松芝股份	28,468,085.13	2.89
106	601918	国投新集	27,974,431.88	2.84
107	002475	立讯精密	26,411,189.06	2.69
108	600999	招商证券	26,379,191.02	2.68
109	600446	金证股份	26,174,631.55	2.66
110	300090	盛运股份	26,151,947.82	2.66
111	300085	银之杰	26,139,967.85	2.66
112	600208	新湖中宝	26,029,090.55	2.65
113	600036	招商银行	25,909,012.14	2.63
114	300207	欣旺达	25,287,078.43	2.57
115	002368	太极股份	25,286,167.91	2.57
116	600518	康美药业	25,215,279.80	2.56
117	002568	百润股份	25,014,975.10	2.54
118	600280	中央商场	24,348,439.35	2.48
119	603005	晶方科技	24,336,865.59	2.47
120	600694	大商股份	24,263,206.29	2.47
121	601377	兴业证券	24,177,899.00	2.46
122	002358	森源电气	23,595,936.85	2.40
123	000639	西王食品	23,536,572.90	2.39
124	600287	江苏舜天	23,353,439.37	2.37
125	002170	芭田股份	23,181,221.42	2.36
126	000778	新兴铸管	23,176,187.98	2.36

127	002520	日发精机	23,090,269.30	2.35
128	002303	美盈森	23,020,878.75	2.34
129	300020	银江股份	22,916,797.18	2.33
130	600383	金地集团	22,913,511.00	2.33
131	002070	众和股份	22,649,185.63	2.30
132	600739	辽宁成大	22,565,007.28	2.29
133	002541	鸿路钢构	22,518,509.02	2.29
134	600376	首开股份	22,484,304.94	2.29
135	300205	天喻信息	22,420,165.25	2.28
136	300157	恒泰艾普	22,235,662.12	2.26
137	300300	汉鼎股份	22,222,117.24	2.26
138	600397	安源煤业	21,889,563.85	2.23
139	002407	多氟多	21,725,428.11	2.21
140	300223	北京君正	21,706,433.48	2.21
141	600884	杉杉股份	21,404,580.26	2.18
142	000858	五粮液	21,143,162.00	2.15
143	000623	吉林敖东	20,952,753.74	2.13
144	002037	久联发展	20,922,733.49	2.13
145	000547	闽福发 A	20,915,169.42	2.13
146	002329	皇氏集团	20,101,770.10	2.04
147	300183	东软载波	20,087,834.63	2.04
148	002111	威海广泰	20,053,936.06	2.04
149	300351	永贵电器	19,936,850.34	2.03
150	002223	鱼跃医疗	19,799,253.03	2.01

注：基金转型日为 2014 年 4 月 30 日。

#### 10.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600703	三安光电	175,885,541.49	17.88
2	000712	锦龙股份	150,266,290.23	15.28
3	000671	阳光城	136,079,098.04	13.83
4	600340	华夏幸福	126,830,516.83	12.89
5	300085	银之杰	114,736,265.12	11.66
6	000002	万科 A	109,951,030.86	11.18
7	000592	平潭发展	108,276,414.04	11.01
8	000402	金融街	101,062,590.20	10.27
9	300170	汉得信息	99,015,619.17	10.07
10	002421	达实智能	97,485,476.90	9.91
11	000656	金科股份	94,618,119.28	9.62
12	002153	石基信息	93,127,218.10	9.47
13	600210	紫江企业	91,898,067.46	9.34

14	300129	泰胜风能	90,555,645.65	9.21
15	600048	保利地产	89,684,014.60	9.12
16	600887	伊利股份	88,868,733.30	9.03
17	300226	上海钢联	82,638,049.88	8.40
18	600755	厦门国贸	80,423,877.99	8.18
19	601601	中国太保	78,498,608.11	7.98
20	601628	中国人寿	78,447,195.44	7.98
21	000961	中南建设	77,214,900.99	7.85
22	002366	丹甫股份	77,043,872.90	7.83
23	600153	建发股份	69,785,079.55	7.09
24	002642	荣之联	69,510,988.17	7.07
25	601800	中国交建	68,513,881.20	6.97
26	300150	世纪瑞尔	67,704,549.10	6.88
27	600030	中信证券	67,248,041.86	6.84
28	300059	东方财富	66,016,510.79	6.71
29	600089	特变电工	64,526,257.21	6.56
30	600584	长电科技	63,353,025.84	6.44
31	000024	招商地产	63,213,083.98	6.43
32	601336	新华保险	62,053,399.41	6.31
33	002520	日发精机	59,847,110.62	6.08
34	000997	新大陆	58,269,018.48	5.92
35	600212	江泉实业	57,109,268.83	5.81
36	600104	上汽集团	56,863,909.19	5.78
37	002405	四维图新	55,873,660.63	5.68
38	601555	东吴证券	54,983,565.44	5.59
39	600021	上海电力	54,982,346.39	5.59
40	601788	光大证券	54,639,705.29	5.55
41	601668	中国建筑	54,576,462.39	5.55
42	601318	中国平安	54,363,254.45	5.53
43	002176	江特电机	51,970,222.65	5.28
44	000732	泰禾集团	51,362,214.50	5.22
45	600802	福建水泥	51,043,700.00	5.19
46	300037	新宙邦	50,272,655.11	5.11
47	300253	卫宁软件	50,173,554.31	5.10
48	601688	华泰证券	48,462,577.53	4.93
49	300257	开山股份	48,099,235.89	4.89
50	000559	万向钱潮	47,913,051.99	4.87
51	300203	聚光科技	47,334,575.06	4.81
52	600352	浙江龙盛	46,973,762.96	4.78
53	002415	海康威视	46,638,794.20	4.74
54	002049	同方国芯	46,383,603.90	4.72

55	600114	东睦股份	45,958,803.50	4.67
56	000776	广发证券	45,809,320.48	4.66
57	002382	蓝帆医疗	45,672,695.81	4.64
58	300115	长盈精密	45,349,027.27	4.61
59	002030	达安基因	44,809,202.81	4.56
60	600835	上海机电	43,687,880.39	4.44
61	601166	兴业银行	43,447,507.96	4.42
62	600057	象屿股份	43,283,500.51	4.40
63	300287	飞利信	42,991,478.36	4.37
64	600066	宇通客车	42,724,530.05	4.34
65	300121	阳谷华泰	42,666,108.87	4.34
66	002008	大族激光	41,812,007.58	4.25
67	300356	光一科技	41,436,502.05	4.21
68	601933	永辉超市	41,257,855.28	4.19
69	000685	中山公用	40,833,170.28	4.15
70	300254	仟源医药	38,815,109.53	3.95
71	002488	金固股份	38,463,482.61	3.91
72	002085	万丰奥威	38,253,680.69	3.89
73	300133	华策影视	37,756,708.20	3.84
74	300010	立思辰	36,941,371.74	3.76
75	600521	华海药业	36,830,717.72	3.74
76	600563	法拉电子	36,599,519.87	3.72
77	002051	中工国际	36,159,001.44	3.68
78	600115	东方航空	35,933,078.50	3.65
79	601818	光大银行	35,724,483.28	3.63
80	002475	立讯精密	35,670,822.02	3.63
81	300183	东软载波	34,262,529.27	3.48
82	300024	机器人	34,184,841.48	3.48
83	600570	恒生电子	34,057,254.12	3.46
84	002594	比亚迪	33,726,456.30	3.43
85	002410	广联达	33,190,910.19	3.37
86	300212	易华录	32,900,276.95	3.34
87	600699	均胜电子	32,826,106.80	3.34
88	000977	浪潮信息	32,520,935.74	3.31
89	600309	万华化学	32,402,043.57	3.29
90	601333	广深铁路	32,039,330.05	3.26
91	002454	松芝股份	32,003,780.93	3.25
92	000861	海印股份	31,879,620.63	3.24
93	002310	东方园林	31,738,163.61	3.23
94	601231	环旭电子	30,799,019.98	3.13
95	300058	蓝色光标	30,551,525.29	3.11

96	002108	沧州明珠	30,277,389.77	3.08
97	002357	富临运业	30,169,802.09	3.07
98	000748	长城信息	29,605,110.93	3.01
99	000333	美的集团	29,423,406.20	2.99
100	300038	梅泰诺	29,376,826.83	2.99
101	002368	太极股份	29,346,919.60	2.98
102	000400	许继电气	29,077,936.09	2.96
103	000937	冀中能源	28,902,245.09	2.94
104	300032	金龙机电	28,495,329.55	2.90
105	600000	浦发银行	28,431,591.71	2.89
106	600158	中体产业	28,417,572.07	2.89
107	600016	民生银行	28,335,780.43	2.88
108	002559	亚威股份	28,197,728.67	2.87
109	600015	华夏银行	27,102,365.91	2.76
110	000783	长江证券	26,704,974.20	2.71
111	600312	平高电气	26,626,065.88	2.71
112	600446	金证股份	26,355,961.89	2.68
113	600999	招商证券	26,292,141.81	2.67
114	300090	盛运股份	25,717,453.71	2.61
115	603005	晶方科技	25,624,106.51	2.60
116	600518	康美药业	25,599,257.29	2.60
117	601377	兴业证券	25,569,368.79	2.60
118	002223	鱼跃医疗	25,433,572.84	2.59
119	002568	百润股份	25,123,968.52	2.55
120	600661	新南洋	25,108,901.00	2.55
121	002358	森源电气	25,031,795.56	2.54
122	600415	小商品城	25,019,083.11	2.54
123	600280	中央商场	24,879,760.00	2.53
124	600036	招商银行	24,877,464.07	2.53
125	601992	金隅股份	24,690,859.18	2.51
126	000639	西王食品	24,300,784.80	2.47
127	002303	美盈森	24,150,814.48	2.46
128	600199	金种子酒	24,125,383.03	2.45
129	002440	闰土股份	24,083,197.30	2.45
130	300223	北京君正	24,073,848.26	2.45
131	300157	恒泰艾普	23,980,051.88	2.44
132	002170	芭田股份	23,953,280.32	2.44
133	300207	欣旺达	23,912,740.74	2.43
134	000651	格力电器	23,807,613.23	2.42
135	601918	国投新集	23,708,263.45	2.41
136	300205	天喻信息	23,654,491.08	2.40



137	600019	宝钢股份	23,265,952.33	2.37
138	600397	安源煤业	23,151,380.90	2.35
139	600028	中国石化	23,130,791.36	2.35
140	002236	大华股份	22,427,964.50	2.28
141	300020	银江股份	22,122,463.95	2.25
142	002541	鸿路钢构	21,959,303.97	2.23
143	600287	江苏舜天	21,937,371.23	2.23
144	600739	辽宁成大	21,636,577.55	2.20
145	000778	新兴铸管	21,387,593.31	2.17
146	300300	汉鼎股份	21,061,618.20	2.14
147	600009	上海机场	21,058,638.52	2.14
148	000666	经纬纺机	20,718,860.38	2.11
149	600884	杉杉股份	20,666,571.23	2.10
150	002037	久联发展	20,640,654.88	2.10
151	000905	厦门港务	20,634,587.25	2.10
152	002111	威海广泰	20,360,102.28	2.07
153	002444	巨星科技	20,256,256.88	2.06
154	300070	碧水源	20,018,114.30	2.04
155	002407	多氟多	19,951,132.95	2.03
156	601018	宁波港	19,695,234.53	2.00

注：基金转型日为2014年4月30日。

#### 10.4.3 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	9,064,309,512.34
卖出股票收入（成交）总额	9,490,564,407.81

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。

#### 10.5 2014年12月31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	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	50,065,000.00	5.09
	其中：政策性金融债	50,065,000.00	5.09
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	50,065,000.00	5.09

注：基金转型日为2014年4月30日。

**10.6 2014 年 12 月 31 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	140436	14 农发 36	500,000	50,065,000.00	5.09

注：基金转型日为 2014 年 4 月 30 日。

**10.7 2014 年 12 月 31 日按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

注：基金转型日为 2014 年 4 月 30 日。本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**10.8 2014 年 12 月 31 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：基金转型日为 2014 年 4 月 30 日。本基金本报告期末未持有贵金属。

**10.9 2014 年 12 月 31 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：基金转型日为 2014 年 4 月 30 日。本基金本报告期末未持有权证。

**10.10 2014 年 12 月 31 日本基金投资的股指期货交易情况说明**

**10.10.1 2014 年 12 月 31 日本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：基金转型日为 2014 年 4 月 30 日。本基金本报告期末未投资股指期货。

**10.10.2 转型日至报告期末（2014 年 4 月 30 日至 2014 年 12 月 31 日）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。

**10.11 2014 年 12 月 31 日本基金投资的国债期货交易情况说明**

**10.11.1 转型日至报告期末（2014 年 4 月 30 日至 2014 年 12 月 31 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。

**10.11.2 2014 年 12 月 31 日本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

注：基金转型日为 2014 年 4 月 30 日。本基金本报告期末未投资国债期货。

**10.11.3 转型日至报告期末（2014 年 4 月 30 日至 2014 年 12 月 31 日）国债期货投资评价**

基金转型日为 2014 年 4 月 30 日。本基金本报告期末未投资国债期货。

## 10.12 投资组合报告附注

### 10.12.1 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。

### 10.12.2 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。

### 10.12.3 2014 年 12 月 31 日其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,438,330.09
2	应收证券清算款	10,634,462.97
3	应收股利	—
4	应收利息	1,372,852.04
5	应收申购款	74,627.89
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	14,520,272.99

注：基金转型日为 2014 年 4 月 30 日。

### 10.12.4 2014 年 12 月 31 日持有的处于转股期的可转换债券明细

注：基金转型日为 2014 年 4 月 30 日。本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 10.12.5 2014 年 12 月 31 日前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：基金转型日为 2014 年 4 月 30 日。本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 10.12.6 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。

## § 11 转型后基金富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人信息

### 11.1 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(%)
6324	131,689.69	515,056,587.70	61.85	317,749,002.16	38.15

注：基金转型日为 2014 年 4 月 30 日

### 11.2 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	42,949.83	0.0052

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。  
2、本基金的基金经理未持有本基金。

### 11.3 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

## § 12 转型后基金富国天盛灵活配置混合型证券投资基金开放式基金份额变动

单位：份

基金转型日 2014 年 4 月 30 日基金份额总额	2,000,000,000.00
基金转型日 2014 年 4 月 30 日起至报告期期末基金总申购份额	129,869,271.13
减：基金转型日 2014 年 4 月 30 日起至报告期期末基金总赎回份额	1,322,418,622.10
基金转型日 2014 年 4 月 30 日起至报告期期末基金拆分变动份额	25,354,940.83
本报告期期末基金份额总额	832,805,589.86

注：基金转型日为 2014 年 4 月 30 日。总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 13 重大事件揭示

### 13.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，汉盛证券投资基金自 2014 年 3 月 6 日至 2014 年 4 月 8 日以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议并通过了《关于汉盛证券投资基金转型有关事项的议案》。本次会议结果已经中国证券监督管理委员会备案（证券基金机构监管部部函[2014]67 号），会议决议已生效。

自 2014 年 4 月 30 日（汉盛证券投资基金终止上市之日）起，由《汉盛证券投资基金基金合同》修订而成的《富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金

---

合同》生效，原《汉盛证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

### **13.2 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，本基金管理人已于 2014 年 1 月 29 日和 2014 年 1 月 30 日发布公告，陈戈先生自 2014 年 1 月 29 日起由公司副总经理转任公司总经理。

本基金管理人已于 2014 年 5 月 13 日发布公告，孟朝霞女士自 2014 年 5 月 12 日起不再担任公司副总经理。

本基金管理人已于 2014 年 6 月 20 日发布公告，陆文佳女士自 2014 年 6 月 19 日起担任公司副总经理。

本基金管理人已于 2014 年 12 月 24 日发布公告，陈敏女士自 2014 年 12 月 21 日起不再担任公司董事长。

本基金管理人已于 2015 年 1 月 10 日发布公告，李笑薇女士、朱少醒先生自 2015 年 1 月 9 日起担任公司副总经理。

本基金管理人已于 2015 年 1 月 31 日发布公告，薛爱东先生自 2015 年 1 月 30 日起担任公司董事长。

本报告期内，本基金托管人中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）已于 2014 年 1 月 7 日发布公告，因工作需要，任命余晓晨先生主持中国农业银行托管业务部/养老金管理中心工作。余晓晨先生的基金行业高级管理人员任职资格已在中国基金业协会备案。

### **13.3 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。

### **13.4 基金投资策略的改变**

本报告期本基金投资策略无改变。

### **13.5 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，本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所的报酬为 10 万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 12 年。

### **13.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

2014 年 6 月 23 日，中国证券监督管理委员会上海监管局向我司下发了《关于对富国基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，要求我司于 2014 年 7 月 8 日前予以改正，并对相关责任人采取了行政监管措施。对此我司高度重视，成立了整改工作小组，梳理相关制度流程，排查现行内控漏洞，针对性的制定了整改执行方案，完善了公司内部控制措施，并已向中国证券监督管理委员会上海监管局提交了整改报告。

除上述情况外，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。

### 13.7 转型前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 (%)	
银河证券	1	157,925,602.81	3.29	—	—	224,000,000.00	7.59	—	—	143,774.54	3.35	—
国海证券	2	908,849,722.16	18.94	—	—	670,000,000.00	22.70	—	—	814,943.39	18.99	—
齐鲁证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国信证券	1	73,250,742.35	1.53	—	—	56,000,000.00	1.90	—	—	66,687.18	1.55	—
招商证券	2	98,678,689.22	2.06	—	—	—	—	—	—	88,824.25	2.07	—
国金证券	2	736,719,756.50	15.36	—	—	402,000,000.00	13.62	—	—	651,723.92	15.19	—
海通证券	2	735,819,898.22	15.34	—	—	135,000,000.00	4.57	—	—	662,906.60	15.45	—
申银万国	2	138,457,431.54	2.89	—	—	340,000,000.00	11.52	—	—	123,469.30	2.88	—
光大证券	1	229,290,315.84	4.78	—	—	810,000,000.00	27.44	—	—	208,743.40	4.86	—
华信证券	2	950,235,106.57	19.81	—	—	145,000,000.00	4.91	—	—	844,410.56	19.68	—
国泰君安	2	360,031,737.72	7.50	—	—	170,000,000.00	5.76	—	—	324,424.67	7.56	—
华泰证券	1	408,356,082.29	8.51	—	—	—	—	—	—	361,354.35	8.42	—
安信证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
太平洋证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

注：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。本报告期本基金租用券商交易单元未发生变更。

动。

### 13.8 转型后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 (%)	
申银万国	2	262,500,351.49	1.41	—	—	—	—	—	—	234,835.26	1.42	—
国海证券	2	4,832,124,031.11	26.05	437,325.63	1.63	2,166,000,000.00	33.78	—	—	4,345,686.15	26.23	—
银河证券	1	549,957,079.66	2.96	—	—	330,000,000.00	5.15	—	—	500,680.18	3.02	—
民族证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
华泰证券	1	4,644,460,710.55	25.04	—	—	—	—	—	—	4,109,889.78	24.81	—
齐鲁证券	1	282,333,520.02	1.52	2,640,456.74	9.87	150,000,000.00	2.34	—	—	257,039.25	1.55	—
国泰君安	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国信证券	1	164,133,682.47	0.88	—	—	200,000,000.00	3.12	—	—	149,426.67	0.90	—
招商证券	2	920,109,779.40	4.96	—	—	500,000,000.00	7.80	—	—	829,317.45	5.01	—
安信证券	2	1,530,137,956.95	8.25	23,521,707.94	87.89	1,009,000,000.00	15.74	—	—	1,354,811.64	8.18	—
华信证券	2	904,724,834.90	4.88	—	—	—	—	—	—	801,754.58	4.84	—
国金证券	2	1,989,375,842.34	10.72	163,397.10	0.61	1,027,000,000.00	16.02	—	—	1,759,314.68	10.62	—
海通证券	2	1,551,246,285.90	8.36	—	—	500,000,000.00	7.80	—	—	1,384,013.27	8.36	—

光大证券	1	920,699,238.18	4.96	—	—	530,000,000.00	8.27	—	—	838,203.73	5.06	—
太平洋证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

注：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。本报告期本基金新增券商交易单元：民族证券 28815；民族证券 394615；光大证券 394859。其余租用券商交易单元未发生变动。



### 13.9 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国基金管理有限公司关于汉盛证券投资基金基金经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年01月13日
2	富国基金管理有限公司关于汉盛证券投资基金基金经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年01月29日
3	富国基金管理有限公司关于高管人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2014年01月29日
4	富国基金管理有限公司关于高管人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年01月30日
5	富国基金管理有限公司关于以通讯开会方式召开汉盛证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年02月28日
6	富国基金管理有限公司关于以通讯开会方式召开汉盛证券投资基金基金份额持有人大会第一次提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年03月03日
7	汉盛证券投资基金停牌提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年03月05日
8	汉盛证券投资基金 2013 年度收益分配公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年03月19日
9	关于汉盛证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年04月10日
10	富国基金管理有限公司关于汉盛证券投资基金复牌的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年04月24日
11	关于汉盛证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年04月24日
12	富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金合同	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年04月25日

13	富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金合同内容摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年04月25日
14	富国天盛灵活配置混合型证券投资基金托管协议	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年04月25日
15	富国基金管理有限公司关于汉盛证券投资基金终止上市的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年04月26日
16	富国基金管理有限公司关于汉盛证券投资基金终止上市的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年04月28日
17	富国天盛灵活配置混合型证券投资基金招募说明书	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年04月29日
18	富国天盛灵活配置混合型证券投资基金集中申购期基金份额发售公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年04月29日
19	富国天盛灵活配置混合型证券投资基金（原基金汉盛）基金份额“确权”登记指引	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年05月08日
20	富国天盛灵活配置混合型证券投资基金开放赎回业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年05月08日
21	关于富国天盛灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年05月09日
22	富国基金管理有限公司关于高管人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2014年05月13日
23	关于汉盛证券投资基金转型所得富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金份额折算的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年05月30日
24	关于富国天盛灵活配置混合型证券投资基金暂停赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年05月30日
25	富国天盛灵活配置混合型证券投资基金开放申购、赎回业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年06月06日

26	富国天盛灵活配置混合型证券投资基金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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年06月10日
27	富国基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2014年06月20日
28	关于富国天盛灵活配置混合型证券投资基金短期恢复大额申购、定投及转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年06月27日
29	富国基金管理有限公司关于旗下富国天盛灵活配置混合型证券投资基金2014年第2季度报告的更正公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年07月19日
30	富国基金管理有限公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼任职务及领薪情况的公告	中国证券报	2014年08月09日
31	关于富国天盛灵活配置混合型证券投资基金交易代码的补充公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年08月27日
32	关于扩大养老金客户范围的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2014年09月02日
33	关于新增旗下部分开放式基金实施特定申购费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年09月04日
34	关于富国天盛灵活配置混合型证券投资基金短期恢复大额申购、定投及转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年10月08日
35	富国天盛灵活配置混合型证券投资基金二〇一四年第一次收益分配公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年10月13日
36	富国基金管理有限公司关于提请投资者及时更新、提交身份证件或身份证明	中国证券报、上海证券报、证券时报、证	2014年11月08日

	文件的公告	券日报	
37	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金定投最低申购金额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2014年12月01日
38	富国基金管理有限公司关于高管人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2014年12月24日

#### § 14 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立汉盛证券投资基金的文件	上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。 咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费） 公司网址： <a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a>
2、汉盛证券投资基金基金合同		
3、汉盛证券投资基金托管协议		
4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件		
5、汉盛证券投资基金财务报表及报表附注		
6、中国证监会《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》		
7、富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金合同		
8、富国天盛灵活配置混合型证券投资基金托管协议		
9、富国天盛灵活配置混		

---

合型证券投资基金财务 报表及报表附注 10、报告期内在指定报刊 上披露的各项公告		
---	--	--