

富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)

二〇一四年半年度报告

2014 年 06 月 30 日

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 中国农业银行股份有限公司

送出日期： 2014 年 08 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 2014 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
§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.....	5
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.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	7
§4	管理人报告.....	8
4.1	基金管理人及基金经理.....	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
§5	托管人报告.....	12
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
§6	半年度财务报表(未经审计).....	13
6.1	资产负债表.....	13
6.2	利润表.....	14
6.3	所有者权益(基金净值)变动表.....	15
6.4	报表附注.....	16
§7	投资组合报告.....	31
7.1	期末基金资产组合情况.....	31
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	32
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....	33
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	43
7.7	期末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.....	43
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	44
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	44
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44

7.12	投资组合报告附注.....	44
§8	基金份额持有人信息.....	45
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	45
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	46
§9	开放式基金份额变动.....	46
§10	重大事件揭示.....	46
10.1	基金份额持有人大会决议.....	46
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	46
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4	基金投资策略的改变.....	47
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	47
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8	其他重大事件.....	49
§11	备查文件目录.....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)
基金简称	富国中证 500 指数增强 (LOF)
场内简称	富国 500
基金主代码	161017
交易代码	前端交易代码: 161017 后端交易代码: 161021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 10 月 12 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	146,292,770.74 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011 年 10 月 12 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以“指数化投资为主、主动性投资为辅”，在复制目标指数的基础上一定程度地调整个股，力求投资收益能够跟踪并适度超越目标指数。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准 = 95% × 中证 500 指数收益率 + 1% (指年收益率，评价时按期间折算)。
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	范伟隽	李芳菲
	联系电话	021-20361818	010-66060069
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95599
传真		021-20361616	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 号

	楼	
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层	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	蒋超良

## 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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金半年度报告备置地点	富国基金管理有限公司上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层 中国农业银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## §3 主要财务指标、基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014年01月01日至2014年06月30日)
本期已实现收益	9,621,881.92
本期利润	8,441,835.72
加权平均基金份额本期利润	0.0557
本期加权平均净值利润率	5.14%
本期基金份额净值增长率	3.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年06月30日)
期末可供分配利润	9,054,069.55
期末可供分配基金份额利润	0.0619
期末基金资产净值	161,822,236.23
期末基金份额净值	1.106

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014年06月30日)
基金份额累计净值增长率	10.60%

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.17%	0.93%	2.46%	0.94%	0.71%	-0.01%
过去三个月	2.88%	1.03%	2.36%	1.01%	0.52%	0.02%
过去六个月	3.66%	1.18%	2.93%	1.19%	0.73%	-0.01%
过去一年	22.08%	1.25%	21.45%	1.26%	0.63%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	10.60%	1.37%	5.85%	1.40%	4.75%	-0.03%

注：根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定，本基金业绩比较基准=95%×中证500指数收益率+1%（指年收益率，评价时按期间折算）。中证500指数全称“中证小盘500指数”，它的样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了500只沪深300指数成份股之外的A股市场中流动性好、代表性强的小市值股票，综合反映了沪深证券市场内小市值公司的整体状况。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，1日收益率（benchmark<sub>t</sub>）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_t = 95\% * [\text{中证500指数}_t / (\text{中证500指数}_{t-1}) - 1] + [(1+0.01)^{(1/250)} - 1];$$

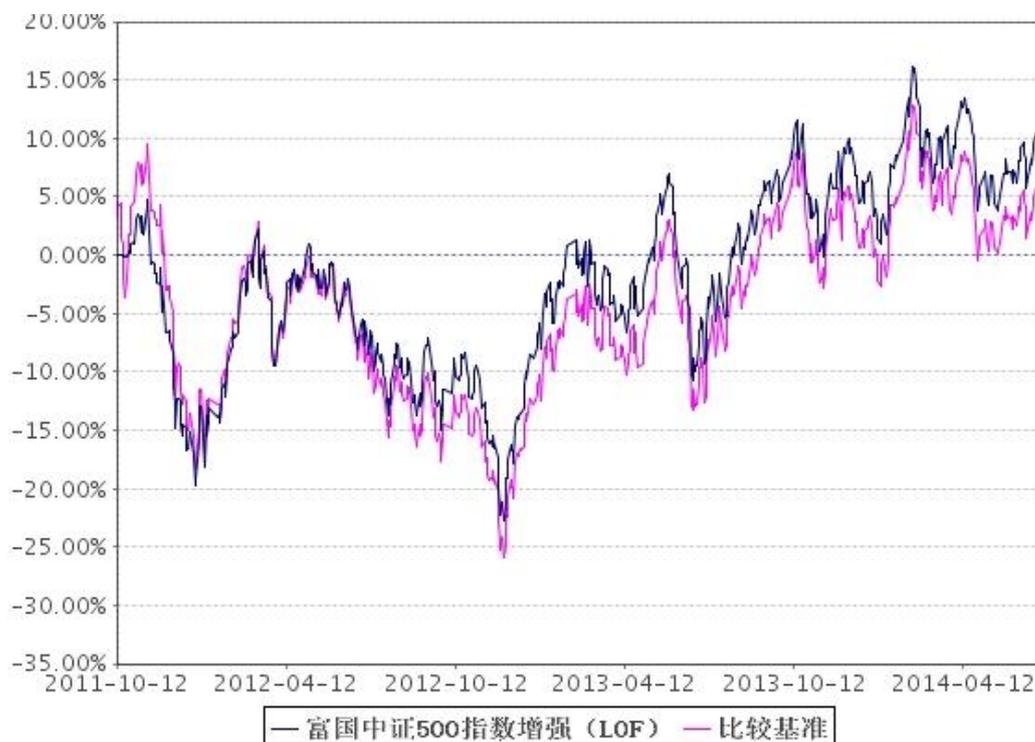
其中，t=1, 2, 3, ……，T，T表示时间截至日；

期间T日收益率（benchmark<sub>T</sub>）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_T = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)] - 1$$

其中，T=2, 3, 4, ……； $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)$ 表示t日至T日的(1+benchmark<sub>t</sub>)数学连乘。

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



注：截止日期为 2014 年 6 月 30 日。

本基金建仓期 6 个月，即从 2011 年 10 月 12 日起至 2012 年 4 月 11 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富国基金管理有限公司于 1999 年 4 月 13 日获国家工商行政管理局登记注册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一，公司于 2001 年 3 月从北京迁址上海。2003 年 9 月加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。截至 2014 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理汉兴证券投资基金、富国天源平衡混合型证券投资基金、富国天利增长债券投资基金、富国天益价值证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国天时货币市场基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、富国天博创新主题股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、富国天丰强化收益债券型证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国优化增强债券型证券投资基金、富国沪深 300 增强证券投资基金、富国通胀通缩主题轮动股票型证券投资基金、富国汇利回报分级债券型证券投资基金、富国

全球债券证券投资基金、富国可转换债券证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国天盈债券型证券投资基金（LOF）、富国全球顶级消费品股票型证券投资基金、富国低碳环保股票型证券投资基金、富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）、富国产业债债券型证券投资基金、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金、富国高新技术产业股票型证券投资基金、富国中国中小盘（香港上市）股票型证券投资基金、富国 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、富国中证军工指数分级证券投资基金、富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国富钱包货币市场基金、富国收益宝货币市场基金、富国高端制造行业股票型证券投资基金四十七只证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李笑薇	本基金基金经理兼任量化与海外投资部总经理、富国沪深 300 增强证券投资基金基金经理	2011-10-12	—	12 年	博士，曾任摩根士丹利资本国际 Barra 公司 (MSCIBARRA)，BARRA 股票风险评估部高级研究员；巴克莱国际投资管理公司 (BarclaysGlobal Investors)，大中华主动股票投资总监、高级基金经理及高级研究员；2009 年 6 月加入富国基金管理有限公司，2011 年 1 月至 2012 年 5 月任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基金经理，2009 年 12 月至今任富国沪深 300 增强证券投资基金基金经理，2011 年 10 月至今任富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理；兼任量化与海外投资部总经理；具有中国基金从业资格。
徐幼华	本基金基金经理兼任富国中证红利指数增强型证券投资	2011-10-12	—	10 年	硕士，曾任上海京华创业投资有限公司投资经理助理；2006 年 7 月至 2008 年 12 月任富国基金管理有限公司金融工程部数量研究员，2009 年 1 月至 2011 年 5 月任富国基金管理有限公司另类投资

	基金基金 经理				部数量研究员、基金经理助理，2011年5月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理，2011年10月起任富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理。具有基金从业资格。
方旻	本基金基金 经理助理兼 任富国中证 红利指数增 强型证券投 资基金基金 经理助理、 富国沪深30 0增强证券 投资基金基 金经理助理	2014-04-23	—	5年	硕士，曾任航天信息有限公司软件工程师、硕康万国软件有限公司高级软件工程师等；2010年2月至2014年4月任富国基金管理有限公司定量研究员；2014年4月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金、富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理助理。

注：上述表格内基金经理李笑薇女士和徐幼华女士的任职日期为本基金基金合同生效日，基金经理助理方旻先生的任职日期为根据公司决定确定的聘任日期。证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)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》、《富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)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，无损害基金持有人利益的行为，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易

系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。

事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，监察稽核部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

#### **4.3.2 异常交易行为的专项说明**

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间未出现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**

回顾 2014 年上半年，伴随着‘定向降准’等微刺激政策出台，国内经济开始企稳回暖。6 月官方制造业 PMI 指数升至 51，连续 4 月上升，出口、消费、工业等数据也有明显回升。政府微刺激政策的效果已经开始显现，稳增长的效应也更加明显。在经历了一季度的下跌之后，二季度资本市场开始表现先扬后抑，之后经历了震荡盘整，并在 6 月下旬开始稳步回升。市场情绪仍然以谨慎为主，但已逐渐显现出看多趋势，中证 500 指数上半年整体上涨 2.50%。

在本报告期内，本基金在投资中遇到了较多申购赎回，较大地增加了本基金的交易成本。

在投资管理上，我们坚持采取量化策略进行指数增强和风险管理，量化增强策略获得了较好的表现，报告期内，本基金的超额收益为 1.28%（相对于 95%\* 中证 500 指数）。

##### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至 2014 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.106 元，份额累计净值为 1.106 元；报告期内，本基金份额净值增长率为 3.66%，同期业绩比较基准收益率为 2.93%。

#### **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 2014 年下半年，随着微刺激政策的进一步落实，经济将继续企稳回暖。二级市场投资者的情绪将在边际获得较大改善。预计三季度市场整体走势将明显好于上半年，改革的逐渐兑现将使得投资者对于经济的信心有系统性的回升，同时仍然需要注意市场的系统性信用风险的变化。

#### **4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

本公司按照相关法律法规的规定成立了估值委员会，并制订了《富国基金管理有限公司估值委员会运作管理办法》。估值委员会是公司基金估值的主要决策机关，由主管运营副总经理负责，成员包括基金清算、监察稽核、金融工程方面的业务骨干以及相关基金经理，所有相关成员均具有丰富的证券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。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期末未进行利润分配。

本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

### **§ 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 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### **5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明**

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

#### **5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见**

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

## § 6 半年度财务报表(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2014 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 (2014 年 06 月 30 日)	上年度末 (2013 年 12 月 31 日)
<b>资 产：</b>		
银行存款	10,686,914.69	9,777,620.33
结算备付金	323,691.11	208,999.49
存出保证金	79,226.73	58,057.36
交易性金融资产	151,531,515.53	144,735,738.81
其中：股票投资	151,531,515.53	144,735,738.81
基金投资	—	—
债券投资	—	—
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	—	—
应收利息	1,860.68	2,070.70
应收股利	—	—
应收申购款	38,750.29	130,291.85
递延所得税资产	—	—
其他资产	30,247.11	—
资产总计	162,692,206.14	154,912,778.54
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b> (2014 年 06 月 30 日)	<b>上年度末</b> (2013 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	254,455.50	272,699.10
应付管理人报酬	130,009.13	125,477.43
应付托管费	19,501.37	18,821.62
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	278,413.96	142,370.64
应交税费	—	—

应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	187,589.95	363,027.67
负债合计	869,969.91	922,396.46
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	146,292,770.74	144,267,912.77
未分配利润	15,529,465.49	9,722,469.31
所有者权益合计	161,822,236.23	153,990,382.08
负债和所有者权益总计	162,692,206.14	154,912,778.54

注：报告截止日 2014 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.106 元，基金份额总额 146,292,770.74 份。

## 6.2 利润表

会计主体：富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)

本报告期：2014 年 01 月 01 日至 2014 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2014 年 01 月 01 日至 2014 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2013 年 01 月 01 日至 2013 年 06 月 30 日)
<b>一、收入</b>	10,609,405.61	17,932,700.15
1. 利息收入	49,557.81	96,790.91
其中：存款利息收入	49,557.81	96,787.54
债券利息收入	—	3.37
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	—
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	11,526,035.26	28,586,194.63
其中：股票投资收益	10,229,238.35	26,647,036.32
基金投资收益	—	—
债券投资收益	—	—
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	1,296,796.91	1,939,158.31
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-1,180,046.20	-11,218,642.94
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	213,858.74	468,357.55
<b>减：二、费用</b>	2,167,569.89	4,044,157.30
1. 管理人报酬	822,975.18	1,786,859.84
2. 托管费	123,446.28	268,029.03

3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	954,285.96	1,708,881.53
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 其他费用	266,862.47	280,386.90
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>8,441,835.72</b>	<b>13,888,542.85</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>8,441,835.72</b>	<b>13,888,542.85</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)

本报告期：2014 年 01 月 01 日至 2014 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 (2014 年 01 月 01 日至 2014 年 06 月 30 日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	144,267,912.77	9,722,469.31	153,990,382.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	8,441,835.72	8,441,835.72
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）	2,024,857.97	-2,634,839.54	-609,981.57
其中：1. 基金申购款	159,246,246.89	11,049,496.07	170,295,742.96
2. 基金赎回款	-157,221,388.92	-13,684,335.61	-170,905,724.53
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	146,292,770.74	15,529,465.49	161,822,236.23
项目	上年度可比期间 (2013 年 01 月 01 日至 2013 年 06 月 30 日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	396,283,949.51	-33,683,915.19	362,600,034.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	13,888,542.85	13,888,542.85
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）	-192,090,249.27	554,778.11	-191,535,471.16
其中：1. 基金申购款	184,748,955.47	-4,882,374.66	179,866,580.81
2. 基金赎回款	-376,839,204.74	5,437,152.77	-371,402,051.97
四、本期向基金份额持有人分配利	—	—	—

润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	204,193,700.24	-19,240,594.23	184,953,106.01

注：所附附注为本会计报表的组成部分

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈戈	林志松	雷青松
_____	_____	_____
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF) (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”)证监许可[2011]1095 号《关于核准富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)募集的批复》的核准, 由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行募集, 基金合同于 2011 年 10 月 12 日正式生效, 首次设立募集规模为 455,487,249.88 份基金份额。本基金为契约型开放式, 存续期限不定。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司, 注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司, 基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票(包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具, 但须符合中国证监会的相关规定。其中, 股票资产投资比例不低于基金资产的 90%, 投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 80%; 保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

本基金业绩比较基准=95%×中证 500 指数收益率+1%(指年收益率, 评价时按期间折算)。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 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, 也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报告相一致。

#### **6.4.5 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。

#### **6.4.6 税项**

##### **1. 印花税**

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

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

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

##### **2. 营业税、企业所得税**

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

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

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

##### **3. 个人所得税**

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，对于证券投资基金通过公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式

向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2014年06月30日）
活期存款	10,686,914.69
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	10,686,914.69

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2014年06月30日）		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	145,539,557.41	151,531,515.53	5,991,958.12
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
其他	—	—	—
合计	145,539,557.41	151,531,515.53	5,991,958.12

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.4 买入返售金融资产

###### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本报告期末本基金未持有买入返售金融资产。

###### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本报告期末本基金未持有买断式逆回购中取得的债券。

##### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末（2014年06月30日）
----	------------------

应收活期存款利息	1,697.42
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	131.13
应收债券利息	—
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	32.13
合计	1,860.68

#### 6.4.7.6其他资产

单位：人民币元

项目	本期末（2014年06月30日）
其他应收款	—
待摊费用	30,247.11
合计	30,247.11

#### 6.4.7.7应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末（2014年06月30日）
交易所市场应付交易费用	278,413.96
银行间市场应付交易费用	—
合计	278,413.96

#### 6.4.7.8其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2014年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	958.87
预提审计费	24,795.19
预提信息披露费	111,835.89
应付指数使用费	50,000.00
合计	187,589.95

#### 6.4.7.9实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2014年01月01日至2014年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	144,267,912.77	144,267,912.77
本期申购	159,246,246.89	159,246,246.89
本期赎回（以“-”号填列）	-157,221,388.92	-157,221,388.92
本期末	146,292,770.74	146,292,770.74

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 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	-26,102.92	9,748,572.23	9,722,469.31
本期利润	9,621,881.92	-1,180,046.20	8,441,835.72
本期基金份额交易产生的变动数	-541,709.45	-2,093,130.09	-2,634,839.54
其中：基金申购款	4,424,044.22	6,625,451.85	11,049,496.07
基金赎回款	-4,965,753.67	-8,718,581.94	-13,684,335.61
本期已分配利润	—	—	—
本期末	9,054,069.55	6,475,395.94	15,529,465.49

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2014年01月01日至2014年06月30日）
活期存款利息收入	39,002.98
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	3,295.35
其他	7,259.48
合计	49,557.81

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2014年01月01日至2014年06月30日）
卖出股票成交总额	314,286,242.94
减：卖出股票成本总额	304,057,004.59
买卖股票差价收入	10,229,238.35

#### 6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.14 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。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

##### 6.4.7.16.1 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。

##### 6.4.7.16.2 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。

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2014年01月01日至2014年06月30日）
股票投资产生的股利收益	1,296,796.91
基金投资产生的股利收益	—
合计	1,296,796.91

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2014年01月01日至2014年06月30日）
1. 交易性金融资产	-1,180,046.20
股票投资	-1,180,046.20
债券投资	—
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	-1,180,046.20

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2014年01月01日至2014年06月30日）
基金赎回费收入	213,762.88
基金转换费收入	95.86
合计	213,858.74

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期（2014年01月01日至2014年06月30日）
交易所市场交易费用	954,285.96
银行间市场交易费用	—
合计	954,285.96

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2014年01月01日至2014年06月30日）
审计费用	24,795.19
信息披露费	111,835.89
银行费用	478.50
上市费	29,752.89
指数使用费	100,000.00
合计	266,862.47

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需做披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
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（“申银万国”）	基金管理人的股东、基金代销机构
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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2014年01月01日至2014年06月30日)		上年度可比期间(2013年01月01日至2013年06月30日)	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
海通证券	6,908,305.86	1.10	27,618,996.20	2.60
申银万国	63,178,970.30	10.09	139,584,136.99	13.15

###### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.4 回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行回购交易。

###### 6.4.10.1.5 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01月01日至2014年06月30日)
-------	-----------------------------

	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
申银万国	56,838.28	10.11	136.27	0.05
海通证券	6,113.25	1.09	0.00	0.00
关联方名称	上年度可比期间 (2013年01月01日至2013年06月30日)			
	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
海通证券	24,440.04	2.56	0.00	0.00
申银万国	126,031.70	13.21	32,541.76	7.01

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。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 (2014年01月01日至2014年06月30日)	上年度可比期间 (2013年01月01日至2013年06月30日)
当期发生的基金应支付的管理费	822,975.18	1,786,859.84
其中：支付销售机构的客户维护费	213,661.02	356,215.60

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.00%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 (2014年01月01日至2014年06月30日)	上年度可比期间 (2013年01月01日至2013年06月30日)
当期发生的基金应支付的托管费	123,446.28	268,029.03

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$

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

基金托管费每日计提，按月支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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01月01日至2014年06月30日)	上年度可比期间(2013年01月01日至2013年06月30日)
基金合同生效日(2011年10月12日)持有的基金份额	20,003,333.00	20,003,333.00
期初持有的基金份额	3,333.00	3,333.00
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	3,333.00	3,333.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

注: 本基金管理人认购/申购本基金份额的费率按照本基金发售公告的条款执行, 不存在费率优惠的情况。本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行, 不存在费率优惠的情况。

#### 6.4.10.4.2 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

注: 本报告期末及上年度可比期间末本基金除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

#### 6.4.10.5 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01月01日至2014年06月30日)		上年度可比期间(2013年01月01日至2013年06月30日)	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	10,686,914.69	39,002.98	9,936,777.65	84,891.82

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.10.7 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。

#### 6.4.11 利润分配情况

注: 本基金本报告期末进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(2014年06月30日)本基金持有的流通受限证券

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

注: 截至本报告期末, 本基金未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

##### 6.4.12.2 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
000562	宏源证券	2013-10-30	筹划重大事项	8.22	2014-07-28	8.93	16,900	147,893.80	138,918.00	—
000612	焦作万方	2014-04-03	筹划重大事项	6.08	2014-08-18	6.69	14,600	80,362.00	88,768.00	—
000751	*ST 锌业	2013-03-12	筹划重大事项	3.88	2014-08-06	8.03	6,257	29,341.42	24,277.16	—
000852	江钻股份	2014-05-28	筹划重大事项	15.80	—	—	800	13,190.72	12,640.00	注1
000893	东凌粮油	2014-03-26	筹划重大事项	10.64	2014-08-26	11.70	492	4,489.39	5,234.88	—
002100	天康生物	2014-05-27	筹划重大事项	9.82	2014-08-25	10.80	6,720	69,237.24	65,990.40	—
002167	东方锆业	2014-01-02	筹划重大事项	11.39	2014-07-01	11.10	2,100	23,609.48	23,919.00	—
002340	格林美	2014-06-26	筹划重大事项	11.19	2014-07-24	11.77	43,900	496,218.92	491,241.00	—
002466	天齐锂业	2014-04-29	筹划重大事项	43.16	2014-08-25	47.48	600	22,648.10	25,896.00	—
002565	上海绿新	2014-06-16	筹划重大事项	8.64	2014-07-07	9.10	8,400	70,796.80	72,576.00	—
300284	苏交科	2014-06-25	重大事项待审核	8.75	2014-07-04	9.18	175,200	1,499,745.47	1,533,000.00	—
300381	溢多利	2014-05-22	筹划重大事项	42.19	2014-08-18	46.41	1,700	68,448.00	71,723.00	—
600260	凯乐科技	2014-06-09	筹划重大事项	6.59	—	—	100	683.91	659.00	注1
600418	江淮汽车	2014-04-14	筹划重大事项	10.20	2014-07-11	11.22	9,800	72,850.98	99,960.00	—
600507	方大特钢	2014-06-30	传闻核查	3.16	2014-07-02	3.03	43,100	141,181.99	136,196.00	—
600685	广船国际	2014-04-08	筹划重大事项	17.13	—	—	27,400	460,095.21	469,362.00	注1
600757	长江传媒	2014-06-17	筹划重大事项	8.85	—	—	4,200	33,231.34	37,170.00	注1
600864	哈投股份	2014-04-11	筹划重大事项	8.68	2014-07-15	8.30	522	3,728.97	4,530.96	—
601012	隆基股份	2014-06-19	筹划重大事项	15.50	2014-07-01	15.60	95,400	1,284,159.98	1,478,700.00	—
601777	力帆股份	2014-06-24	筹划重大事项	6.39	2014-07-08	6.70	6,800	46,515.89	43,452.00	—

注：1)因股票未恢复交易，复牌日期及复牌开盘单价未知。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 6 月 30 日止，本基金无证券交易所债券正回购，未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 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。

#### 6.4.13.2 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。本基金投资于一家公司发行的证券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。

#### 6.4.13.3 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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面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，除在附注 6.4.12 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。

#### 6.4.13.4 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，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 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。

#### **6.4.13.4.1.1 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06月30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	10,686,914.69	—	—	—	—	—	10,686,914.69
结算备付金	323,691.11	—	—	—	—	—	323,691.11
存出保证金	79,226.73	—	—	—	—	—	79,226.73
交易性金融资产	—	—	—	—	—	151,531,515.53	151,531,515.53
应收利息	—	—	—	—	—	1,860.68	1,860.68
应收申购款	9,556.78	—	—	—	—	29,193.51	38,750.29
待摊费用	—	—	—	—	—	30,247.11	30,247.11
资产总计	11,099,389.31	—	—	—	—	151,592,816.83	162,692,206.14
负债							
卖出回购金融资产款	—	—	—	—	—	—	—
应付赎回款	—	—	—	—	—	254,455.50	254,455.50
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	130,009.13	130,009.13
应付托管费	—	—	—	—	—	19,501.37	19,501.37
应付交易费用	—	—	—	—	—	278,413.96	278,413.96
其他负债	—	—	—	—	—	187,589.95	187,589.95
负债总计	—	—	—	—	—	869,969.91	869,969.91
利率敏感度缺口	11,099,389.31	—	—	—	—	150,722,846.92	161,822,236.23
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	9,777,620.33	—	—	—	—	—	9,777,620.33
结算备付金	208,999.49	—	—	—	—	—	208,999.49
存出保证金	58,057.36	—	—	—	—	—	58,057.36
交易性金融资产	—	—	—	—	—	144,735,738.81	144,735,738.81
应收利息	—	—	—	—	—	2,070.70	2,070.70
应收申购款	61,943.56	—	—	—	—	68,348.29	130,291.85
资产总计	10,106,620.74	—	—	—	—	144,806,157.80	154,912,778.54
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	272,699.10	272,699.10
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	125,477.43	125,477.43
应付托管费	—	—	—	—	—	18,821.62	18,821.62
应付交易费用	—	—	—	—	—	142,370.64	142,370.64
其他负债	—	—	—	—	—	363,027.67	363,027.67
负债总计	—	—	—	—	—	922,396.46	922,396.46
利率敏感度缺口	10,106,620.74	—	—	—	—	143,883,761.34	153,990,382.08

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有债券资产，且持有的银行存款均为活期存款，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

假设	1. 影响生息资产的其他变量不变，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：元）	
		本期末（2014年06月30日）	上年度末（2013年12月31日）
	—	—	—

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 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。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金投资组合中股票资产投资比例不低于基金资产的90%，投资于中证500指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的80%；保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。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06月30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	151,531,515.53	93.64	144,735,738.81	93.99
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	151,531,515.53	93.64	144,735,738.81	93.99

##### 6.4.13.4.3.2 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：元）	
		本期末（2014年06月30日）	上年度末（2013年12月31日）
	1. 业绩比较基准增加 1%	1,591,526.33	1,530,069.74
	2. 业绩比较基准减少 1%	-1,591,526.33	-1,530,069.74

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	151,531,515.53	93.14
	其中：股票	151,531,515.53	93.14
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	11,010,605.80	6.77
7	其他各项资产	150,084.81	0.09
8	合计	162,692,206.14	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 积极投资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	49,527.12	0.03
C	制造业	20,013,364.24	12.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	437,111.42	0.27
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	128,826.25	0.08
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,276,845.88	2.02
J	金融业	138,918.00	0.09
K	房地产业	1,922,201.03	1.19
L	租赁和商务服务业	971,684.16	0.60
M	科学研究和技术服务业	1,533,000.00	0.95
N	水利、环境和公共设施管理业	236,562.00	0.15
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	354,537.00	0.22
R	文化、体育和娱乐业	11,382.40	0.01
S	综合	—	—
	合计	29,073,959.50	17.97

### 7.2.2 指数投资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	1,155,000.00	0.71
B	采矿业	3,819,944.00	2.36
C	制造业	80,503,455.73	49.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,094,537.86	1.29
E	建筑业	1,810,999.14	1.12
F	批发和零售业	7,446,252.50	4.60
G	交通运输、仓储和邮政业	4,304,568.00	2.66
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,097,734.00	2.53
J	金融业	1,820,851.00	1.13
K	房地产业	9,747,742.00	6.02
L	租赁和商务服务业	2,445,990.00	1.51
M	科学研究和技术服务业	1,207,125.00	0.75

N	水利、环境和公共设施管理业	30,464.00	0.02
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	40,022.00	0.02
S	综合	1,932,870.80	1.19
	合计	122,457,556.03	75.67

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002092	中泰化学	476,100	2,942,298.00	1.82
2	002437	誉衡药业	42,003	2,163,154.50	1.34
3	600790	轻纺城	228,700	2,053,726.00	1.27
4	600201	金宇集团	64,800	2,016,576.00	1.25
5	600805	悦达投资	201,320	1,850,130.80	1.14
6	603766	隆鑫通用	206,000	1,821,040.00	1.13
7	600120	浙江东方	157,000	1,774,100.00	1.10
8	600720	祁连山	275,937	1,730,124.99	1.07
9	000050	深天马A	136,000	1,700,000.00	1.05
10	000926	福星股份	250,000	1,630,000.00	1.01
11	600401	海润光伏	202,768	1,618,088.64	1.00
12	600183	生益科技	259,200	1,596,672.00	0.99
13	002482	广田股份	133,300	1,595,601.00	0.99
14	002572	索菲亚	96,700	1,589,748.00	0.98
15	600438	通威股份	163,600	1,552,564.00	0.96
16	600416	湘电股份	162,100	1,551,297.00	0.96
17	002190	成飞集成	26,100	1,539,900.00	0.95
18	000525	红太阳	109,900	1,539,699.00	0.95
19	002574	明牌珠宝	60,400	1,539,596.00	0.95
20	600801	华新水泥	230,100	1,534,767.00	0.95
21	000848	承德露露	75,350	1,497,204.50	0.93
22	600026	中海发展	368,100	1,487,124.00	0.92
23	000540	中天城投	290,000	1,479,000.00	0.91
24	601012	隆基股份	95,400	1,478,700.00	0.91
25	002690	美亚光电	41,870	1,476,754.90	0.91
26	600481	双良节能	150,500	1,470,385.00	0.91
27	600761	安徽合力	147,008	1,446,558.72	0.89
28	000786	北新建材	104,800	1,437,856.00	0.89
29	002440	闰土股份	77,158	1,427,423.00	0.88

30	600869	远东电缆	166,700	1,358,605.00	0.84
31	600398	海澜之家	146,100	1,344,120.00	0.83
32	600978	宜华木业	266,980	1,302,862.40	0.81
33	002233	塔牌集团	214,300	1,298,658.00	0.80
34	600067	冠城大通	252,000	1,262,520.00	0.78
35	600426	华鲁恒升	170,700	1,229,040.00	0.76
36	002701	奥瑞金	60,600	1,222,302.00	0.76
37	600312	平高电气	86,900	1,211,386.00	0.75
38	600645	中源协和	43,500	1,207,125.00	0.75
39	002064	华峰氨纶	135,500	1,159,880.00	0.72
40	600511	国药股份	51,000	1,157,700.00	0.72
41	600320	振华重工	359,000	1,145,210.00	0.71
42	600428	中远航运	388,500	1,138,305.00	0.70
43	000636	风华高科	181,600	1,133,184.00	0.70
44	600872	中炬高新	106,000	1,131,020.00	0.70
45	002041	登海种业	40,500	1,127,520.00	0.70
46	002342	巨力索具	209,300	1,126,034.00	0.70
47	000518	四环生物	331,000	1,062,510.00	0.66
48	600266	北京城建	136,700	1,021,149.00	0.63
49	600587	新华医疗	13,400	998,970.00	0.62
50	002063	远光软件	48,700	995,915.00	0.62
51	000726	鲁泰A	109,600	963,384.00	0.60
52	600037	歌华有线	90,500	952,060.00	0.59
53	000501	鄂武商A	78,800	921,960.00	0.57
54	002480	新筑股份	127,600	917,444.00	0.57
55	000030	富奥股份	142,200	917,190.00	0.57
56	000860	顺鑫农业	65,100	914,004.00	0.56
57	603366	日出东方	67,500	911,925.00	0.56
58	000099	中信海直	99,400	880,684.00	0.54
59	600335	国机汽车	54,900	862,479.00	0.53
60	600879	航天电子	72,270	851,340.60	0.53
61	002153	石基信息	16,500	846,450.00	0.52
62	002179	中航光电	46,400	814,320.00	0.50
63	600460	士兰微	124,120	734,790.40	0.45
64	600239	云南城投	165,300	712,443.00	0.44
65	002244	滨江集团	117,200	664,524.00	0.41
66	600240	华业地产	134,300	655,384.00	0.41
67	000028	国药一致	16,288	650,705.60	0.40
68	600780	通宝能源	150,200	647,362.00	0.40
69	000511	烯碳新材	94,900	639,626.00	0.40
70	600835	上海机电	41,000	638,780.00	0.39

71	002254	泰和新材	73,200	618,540.00	0.38
72	600570	恒生电子	20,600	605,640.00	0.37
73	600289	亿阳信通	66,100	591,595.00	0.37
74	600643	爱建股份	61,300	563,347.00	0.35
75	600122	宏图高科	107,805	536,868.90	0.33
76	601099	太平洋	83,400	531,258.00	0.33
77	002048	宁波华翔	35,200	524,480.00	0.32
78	002028	思源电气	55,742	523,974.80	0.32
79	002662	京威股份	64,500	517,935.00	0.32
80	601311	骆驼股份	48,300	517,776.00	0.32
81	600038	哈飞股份	18,506	515,021.98	0.32
82	002309	中利科技	28,500	495,615.00	0.31
83	002340	格林美	43,900	491,241.00	0.30
84	600685	广船国际	27,400	469,362.00	0.29
85	000939	凯迪电力	62,100	459,540.00	0.28
86	002428	云南锗业	37,584	455,893.92	0.28
87	000829	天音控股	53,400	451,764.00	0.28
88	600851	海欣股份	68,300	443,267.00	0.27
89	600537	亿晶光电	42,500	438,600.00	0.27
90	002152	广电运通	25,728	438,405.12	0.27
91	600657	信达地产	137,200	434,924.00	0.27
92	600139	西部资源	31,400	433,320.00	0.27
93	600737	中粮屯河	88,700	423,986.00	0.26
94	600366	宁波韵升	28,500	422,940.00	0.26
95	002444	巨星科技	44,200	419,900.00	0.26
96	600596	新安股份	42,900	392,535.00	0.24
97	600387	海越股份	25,500	384,540.00	0.24
98	000572	海马汽车	102,000	377,400.00	0.23
99	000969	安泰科技	40,900	376,280.00	0.23
100	600635	大众公用	78,100	374,099.00	0.23
101	600816	安信信托	25,200	362,880.00	0.22
102	600270	外运发展	29,600	357,568.00	0.22
103	600654	飞乐股份	38,700	350,235.00	0.22
104	600162	香江控股	75,000	348,000.00	0.22
105	600963	岳阳林纸	115,300	347,053.00	0.21
106	600432	吉恩镍业	24,000	346,560.00	0.21
107	000415	渤海租赁	43,800	336,384.00	0.21
108	600311	荣华实业	68,900	332,098.00	0.21
109	600584	长电科技	37,500	331,125.00	0.20
110	600673	东阳光科	27,000	330,750.00	0.20
111	002056	横店东磁	16,900	328,874.00	0.20

112	000697	炼石有色	23,100	319,473.00	0.20
113	600198	大唐电信	21,200	315,880.00	0.20
114	600300	维维股份	77,300	312,292.00	0.19
115	002155	辰州矿业	41,200	308,176.00	0.19
116	600509	天富热电	36,800	296,976.00	0.18
117	000979	中弘股份	97,200	288,684.00	0.18
118	600187	国中水务	62,500	286,250.00	0.18
119	000587	金叶珠宝	26,600	276,108.00	0.17
120	000975	银泰资源	34,400	274,168.00	0.17
121	000631	顺发恒业	58,100	262,612.00	0.16
122	000669	金鸿能源	14,850	255,123.00	0.16
123	600456	宝钛股份	17,000	252,280.00	0.16
124	000563	陕国投 A	38,400	246,912.00	0.15
125	000418	小天鹅 A	23,900	244,019.00	0.15
126	600171	上海贝岭	29,500	240,720.00	0.15
127	000426	兴业矿业	24,600	235,176.00	0.15
128	000933	神火股份	67,300	232,858.00	0.14
129	002237	恒邦股份	18,100	231,137.00	0.14
130	600894	广日股份	20,900	230,527.00	0.14
131	600611	大众交通	35,000	229,950.00	0.14
132	000685	中山公用	22,570	229,536.90	0.14
133	000921	海信科龙	25,600	222,720.00	0.14
134	600392	盛和资源	12,000	215,760.00	0.13
135	600175	美都控股	37,400	215,050.00	0.13
136	600740	山西焦化	41,100	214,542.00	0.13
137	601000	唐山港	48,100	210,678.00	0.13
138	002221	东华能源	18,500	207,015.00	0.13
139	002203	海亮股份	18,650	205,336.50	0.13
140	600180	瑞茂通	19,200	202,560.00	0.13
141	000962	东方钨业	20,900	199,386.00	0.12
142	002052	同洲电子	21,600	194,184.00	0.12
143	600325	华发股份	29,500	183,195.00	0.11
144	002392	北京利尔	19,800	181,962.00	0.11
145	600508	上海能源	22,900	180,452.00	0.11
146	600566	洪城股份	7,600	175,560.00	0.11
147	000506	中润资源	44,900	173,314.00	0.11
148	600888	新疆众和	30,400	165,984.00	0.10
149	600683	京投银泰	32,900	163,513.00	0.10
150	600823	世茂股份	19,000	162,260.00	0.10
151	000655	金岭矿业	23,500	161,445.00	0.10
152	002595	豪迈科技	3,400	160,310.00	0.10

153	601101	昊华能源	28,300	159,329.00	0.10
154	600997	开滦股份	36,500	159,140.00	0.10
155	601011	宝泰隆	12,200	158,722.00	0.10
156	600971	恒源煤电	29,500	157,530.00	0.10
157	600337	美克股份	26,800	153,832.00	0.10
158	002128	露天煤业	23,500	152,750.00	0.09
159	000090	天健集团	19,634	151,378.14	0.09
160	000693	华泽钴镍	6,300	149,184.00	0.09
161	600422	昆明制药	6,900	144,969.00	0.09
162	600333	长春燃气	20,900	144,419.00	0.09
163	002075	沙钢股份	37,300	143,605.00	0.09
164	000688	建新矿业	27,000	140,670.00	0.09
165	601388	怡球资源	12,900	139,191.00	0.09
166	600380	健康元	27,600	139,104.00	0.09
167	600056	中国医药	13,000	138,190.00	0.09
168	000552	靖远煤电	17,000	138,040.00	0.09
169	600507	方大特钢	43,100	136,196.00	0.08
170	000409	山东地矿	14,900	135,590.00	0.08
171	600351	亚宝药业	14,100	129,720.00	0.08
172	000780	平庄能源	32,000	126,080.00	0.08
173	002378	章源钨业	6,700	117,786.00	0.07
174	000712	锦龙股份	7,800	116,454.00	0.07
175	002490	山东墨龙	12,800	108,800.00	0.07
176	600397	安源煤业	31,300	106,107.00	0.07
177	600418	江淮汽车	9,800	99,960.00	0.06
178	002498	汉缆股份	13,400	96,212.00	0.06
179	600724	宁波富达	23,300	91,802.00	0.06
180	000612	焦作万方	14,600	88,768.00	0.05
181	600200	江苏吴中	7,900	82,081.00	0.05
182	600694	大商股份	3,100	79,143.00	0.05
183	002122	天马股份	14,600	68,620.00	0.04
184	002004	华邦颖泰	3,600	66,960.00	0.04
185	600510	黑牡丹	12,700	66,040.00	0.04
186	000816	江淮动力	14,900	64,368.00	0.04
187	600820	隧道股份	13,200	64,020.00	0.04
188	002271	东方雨虹	2,500	62,125.00	0.04
189	600743	华远地产	22,100	61,438.00	0.04
190	000680	山推股份	21,300	60,705.00	0.04
191	600161	天坛生物	3,300	60,654.00	0.04
192	000650	仁和药业	12,700	60,325.00	0.04
193	002250	联化科技	4,200	59,640.00	0.04

194	002308	威创股份	8,900	59,452.00	0.04
195	000559	万向钱潮	5,520	56,745.60	0.04
196	002022	科华生物	2,400	55,320.00	0.03
197	002219	恒康医疗	2,420	53,191.60	0.03
198	600521	华海药业	4,762	52,620.10	0.03
199	600557	康缘药业	1,800	51,660.00	0.03
200	002118	紫鑫药业	3,400	48,110.00	0.03
201	600770	综艺股份	4,900	45,374.00	0.03
202	000671	阳光城	5,000	43,950.00	0.03
203	600479	千金药业	3,800	43,814.00	0.03
204	601777	力帆股份	6,800	43,452.00	0.03
205	000513	丽珠集团	912	43,073.76	0.03
206	002648	卫星石化	3,000	42,930.00	0.03
207	000006	深振业A	9,200	42,136.00	0.03
208	600517	置信电气	3,960	40,233.60	0.02
209	600525	长园集团	3,499	38,628.96	0.02
210	600429	三元股份	5,300	38,319.00	0.02
211	603077	和邦股份	2,885	37,505.00	0.02
212	600757	长江传媒	4,200	37,170.00	0.02
213	002368	太极股份	1,100	36,839.00	0.02
214	600292	中电远达	1,600	30,464.00	0.02
215	002181	粤传媒	1,900	30,020.00	0.02
216	600500	中化国际	4,500	28,980.00	0.02
217	002281	光迅科技	800	27,512.00	0.02
218	000998	隆平高科	1,000	27,480.00	0.02
219	600640	号百控股	1,500	25,860.00	0.02
220	002249	大洋电机	1,700	23,630.00	0.01
221	000997	新大陆	1,200	20,832.00	0.01
222	002293	罗莱家纺	1,000	20,100.00	0.01
223	600251	冠农股份	900	13,455.00	0.01
224	600389	江山股份	400	13,044.00	0.01
225	000852	江钻股份	800	12,640.00	0.01
226	002327	富安娜	1,028	11,441.64	0.01
227	600864	哈投股份	522	4,530.96	0.00
228	000977	浪潮信息	100	3,518.00	0.00
229	600563	法拉电子	100	3,325.00	0.00
230	002393	力生制药	100	2,919.00	0.00
231	002424	贵州百灵	100	2,466.00	0.00
232	601515	东风股份	200	2,376.00	0.00
233	600551	时代出版	100	1,667.00	0.00
234	002275	桂林三金	100	1,518.00	0.00

235	601126	四方股份	100	1,420.00	0.00
236	002508	老板电器	50	1,413.50	0.00
237	600522	中天科技	100	1,309.00	0.00
238	600195	中牧股份	100	1,301.00	0.00
239	002238	天威视讯	100	1,253.00	0.00
240	000823	超声电子	100	1,213.00	0.00
241	600410	华胜天成	100	1,189.00	0.00
242	000719	大地传媒	100	1,185.00	0.00
243	000951	中国重汽	100	1,177.00	0.00
244	000566	海南海药	100	1,088.00	0.00
245	600759	正和股份	100	1,022.00	0.00
246	600197	伊力特	100	904.00	0.00
247	000732	泰禾集团	100	854.00	0.00
248	600704	物产中大	100	828.00	0.00
249	601339	百隆东方	100	809.00	0.00
250	002161	远望谷	100	770.00	0.00
251	600487	亨通光电	50	719.00	0.00
252	000543	皖能电力	100	660.00	0.00
253	600260	凯乐科技	100	659.00	0.00
254	002276	万马股份	100	631.00	0.00
255	601519	大智慧	100	587.00	0.00
256	000417	合肥百货	100	517.00	0.00
257	601616	广电电气	100	357.00	0.00
258	600601	方正科技	100	319.00	0.00
259	600651	飞乐音响	40	296.00	0.00
260	600017	日照港	100	259.00	0.00
261	601718	际华集团	100	246.00	0.00

**7.3.2 期末积极投资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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300284	苏交科	175,200	1,533,000.00	0.95
2	600252	中恒集团	124,700	1,462,731.00	0.90
3	000789	江西水泥	164,700	1,439,478.00	0.89
4	601929	吉视传媒	108,500	1,241,240.00	0.77
5	002481	双塔食品	73,900	990,260.00	0.61
6	300147	香雪制药	35,666	962,982.00	0.60
7	002415	海康威视	53,900	913,066.00	0.56
8	600063	皖维高新	369,200	904,540.00	0.56
9	002583	海能达	32,600	888,676.00	0.55

10	002563	森马服饰	30,000	814,500.00	0.50
11	000553	沙隆达A	68,700	796,920.00	0.49
12	600887	伊利股份	22,200	735,264.00	0.45
13	002230	科大讯飞	24,535	652,631.00	0.40
14	600376	首开股份	150,100	648,432.00	0.40
15	600352	浙江龙盛	38,829	627,088.35	0.39
16	300326	凯利泰	15,600	584,688.00	0.36
17	000656	金科股份	83,300	573,937.00	0.35
18	002610	爱康科技	43,600	568,544.00	0.35
19	300202	聚龙股份	19,980	558,640.80	0.35
20	600486	扬农化工	26,820	547,396.20	0.34
21	601313	江南嘉捷	71,700	528,429.00	0.33
22	002367	康力电梯	70,200	515,970.00	0.32
23	002400	省广股份	20,852	512,542.16	0.32
24	000716	南方食品	43,100	505,994.00	0.31
25	300017	网宿科技	7,893	503,573.40	0.31
26	300146	汤臣倍健	19,600	483,140.00	0.30
27	002456	欧菲光	22,500	482,175.00	0.30
28	300058	蓝色光标	17,300	459,142.00	0.28
29	002410	广联达	17,277	456,803.88	0.28
30	000961	中南建设	66,700	435,551.00	0.27
31	002465	海格通信	27,050	430,906.50	0.27
32	002202	金风科技	44,700	424,203.00	0.26
33	000024	招商地产	38,250	398,565.00	0.25
34	300244	迪安诊断	8,100	354,537.00	0.22
35	000413	东旭光电	46,300	347,250.00	0.21
36	600308	华泰股份	118,300	324,142.00	0.20
37	600594	益佰制药	6,803	279,807.39	0.17
38	300118	东方日升	34,900	272,220.00	0.17
39	002214	大立科技	14,900	267,902.00	0.17
40	600469	风神股份	27,900	260,586.00	0.16
41	300059	东方财富	21,300	256,239.00	0.16
42	600060	海信电器	25,300	244,145.00	0.15
43	300144	宋城演艺	8,900	236,562.00	0.15
44	300228	富瑞特装	3,700	189,292.00	0.12
45	600048	保利地产	37,000	183,520.00	0.11
46	000915	山大华特	6,200	165,664.00	0.10
47	000333	美的集团	8,500	164,220.00	0.10
48	002294	信立泰	4,891	146,827.82	0.09
49	000562	宏源证券	16,900	138,918.00	0.09
50	600548	深高速	35,100	128,466.00	0.08

51	000811	烟台冰轮	11,100	118,437.00	0.07
52	002390	信邦制药	4,400	93,588.00	0.06
53	002261	拓维信息	4,100	77,244.00	0.05
54	002565	上海绿新	8,400	72,576.00	0.04
55	300381	溢多利	1,700	71,723.00	0.04
56	002623	亚玛顿	3,500	70,000.00	0.04
57	002146	荣盛发展	7,349	69,595.03	0.04
58	600408	安泰集团	26,700	67,017.00	0.04
59	002100	天康生物	6,720	65,990.40	0.04
60	600531	豫光金铅	6,800	64,940.00	0.04
61	600581	八一钢铁	14,600	53,144.00	0.03
62	600117	西宁特钢	16,900	53,066.00	0.03
63	600121	郑州煤电	12,139	49,527.12	0.03
64	000517	荣安地产	10,400	48,152.00	0.03
65	300274	阳光电源	2,600	42,926.00	0.03
66	600595	中孚实业	11,300	40,906.00	0.03
67	600315	上海家化	900	32,985.00	0.02
68	000661	长春高新	400	32,520.00	0.02
69	600446	金证股份	1,047	32,184.78	0.02
70	600519	贵州茅台	220	31,235.60	0.02
71	002304	洋河股份	600	30,450.00	0.02
72	002466	天齐锂业	600	25,896.00	0.02
73	600436	片仔癀	331	25,662.43	0.02
74	300315	掌趣科技	1,400	25,004.00	0.02
75	000751	*ST 锌业	6,257	24,277.16	0.02
76	002167	东方锆业	2,100	23,919.00	0.01
77	002303	美盈森	2,000	21,960.00	0.01
78	600118	中国卫星	1,040	19,219.20	0.01
79	002129	中环股份	1,000	19,070.00	0.01
80	002450	康得新	780	17,745.00	0.01
81	002439	启明星辰	800	17,112.00	0.01
82	603000	人民网	378	14,813.82	0.01
83	002653	海思科	720	13,824.00	0.01
84	000063	中兴通讯	1,000	13,120.00	0.01
85	002587	奥拓电子	800	10,464.00	0.01
86	600373	中文传媒	720	10,080.00	0.01
87	002460	赣锋锂业	200	7,200.00	0.00
88	000893	东凌粮油	492	5,234.88	0.00
89	002008	大族激光	132	2,288.88	0.00
90	002292	奥飞动漫	62	2,275.40	0.00
91	300065	海兰信	118	1,998.92	0.00

92	002023	海特高新	98	1,871.80	0.00
93	002402	和而泰	100	1,862.00	0.00
94	600741	华域汽车	137	1,339.86	0.00
95	601668	中国建筑	471	1,328.22	0.00
96	600880	博瑞传播	110	1,302.40	0.00
97	000625	长安汽车	100	1,231.00	0.00
98	000876	新希望	100	1,129.00	0.00
99	300186	大华农	100	794.00	0.00
100	000521	美菱电器	149	722.65	0.00
101	600829	三精制药	100	653.00	0.00
102	601299	中国北车	100	454.00	0.00
103	600269	赣粤高速	131	360.25	0.00
104	601390	中国中铁	90	232.20	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600428	中远航运	3,627,587.39	2.36
2	000415	渤海租赁	3,562,840.94	2.31
3	000939	凯迪电力	3,251,923.10	2.11
4	000090	天健集团	2,877,541.70	1.87
5	600790	轻纺城	2,822,522.12	1.83
6	002437	誉衡药业	2,740,414.22	1.78
7	600801	华新水泥	2,621,807.57	1.70
8	600120	浙江东方	2,608,706.30	1.69
9	600312	平高电气	2,584,755.10	1.68
10	600720	祁连山	2,528,685.45	1.64
11	000860	顺鑫农业	2,401,303.56	1.56
12	600426	华鲁恒升	2,321,367.63	1.51
13	002440	闰土股份	2,245,471.57	1.46
14	601718	际华集团	2,241,986.71	1.46
15	601000	唐山港	2,229,316.53	1.45
16	600805	悦达投资	2,163,066.36	1.40
17	603766	隆鑫通用	2,111,435.46	1.37
18	000786	北新建材	2,100,725.19	1.36
19	002233	塔牌集团	2,082,406.66	1.35
20	000540	中天城投	2,064,780.19	1.34

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601000	唐山港	5,059,269.05	3.29
2	002392	北京利尔	3,898,318.67	2.53
3	000543	皖能电力	3,749,490.44	2.43
4	000415	渤海租赁	3,438,897.49	2.23
5	002219	恒康医疗	3,399,675.76	2.21
6	600522	中天科技	3,064,862.98	1.99
7	600737	中粮屯河	2,982,980.35	1.94
8	600161	天坛生物	2,976,153.43	1.93
9	000090	天健集团	2,952,021.64	1.92
10	002440	闰土股份	2,846,637.40	1.85
11	000939	凯迪电力	2,798,130.81	1.82
12	002410	广联达	2,658,411.43	1.73
13	600151	航天机电	2,576,396.01	1.67
14	601718	际华集团	2,513,054.57	1.63
15	600583	海油工程	2,464,047.23	1.60
16	600755	厦门国贸	2,410,591.49	1.57
17	601088	中国神华	2,392,012.11	1.55
18	600428	中远航运	2,312,118.52	1.50
19	600219	南山铝业	2,283,974.68	1.48
20	000860	顺鑫农业	2,223,475.08	1.44

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	312,032,827.51
卖出股票收入（成交）总额	314,286,242.94

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券资产。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券资产。

#### 7.7 期末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：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本报告期本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.12.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

本报告期本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	79,226.73
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	1,860.68

5	应收申购款	38,750.29
6	其他应收款	—
7	待摊费用	30,247.11
8	其他	—
9	合计	150,084.81

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五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	300284	苏交科	1,533,000.00	0.95	筹划重大事项

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
4967	29,452.94	44,210,051.22	30.22	102,082,719.52	69.78

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	计珏	256,357	0.18
2	张志慧	199,350	0.14
3	金鸿章	148,026	0.10
4	程秀英	90,221	0.06
5	董雅萍	74,169	0.05
6	陈颖杰	45,901	0.03

7	吴树勇	44,300	0.03
8	孙慧昌	30,000	0.02
9	刘运华	20,200	0.01
10	张柏林	20,003	0.01

### 8.3 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	82,478.10	0.0564

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年10月12日)基金份额总额	455,487,249.88
报告期期初基金份额总额	144,267,912.77
本报告期基金总申购份额	159,246,246.89
减：本报告期基金总赎回份额	157,221,388.92
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	146,292,770.74

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

本基金管理人已于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日起任公司副总经理。

---

### **10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

### **10.4 基金投资策略的改变**

本报告期本基金投资策略无改变。

### **10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

### **10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

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。

### 10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东方证券	2	51,903,735.94	8.29	—	—	—	—	—	—	46,373.10	8.25	—
宏源证券	2	57,143,484.18	9.12	—	—	—	—	—	—	51,115.41	9.09	—
国联证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
海通证券	1	6,908,305.86	1.10	—	—	—	—	—	—	6,113.25	1.09	—
齐鲁证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国海证券	2	154,545,869.58	24.68	—	—	—	—	—	—	138,528.59	24.64	—
华鑫证券	1	44,629,526.47	7.13	—	—	—	—	—	—	40,631.15	7.23	—
申银万国	2	63,178,970.30	10.09	—	—	—	—	—	—	56,838.28	10.11	—
国泰君安	2	8,170,461.61	1.30	—	—	—	—	—	—	7,355.69	1.31	—
兴业证券	2	239,770,121.60	38.29	—	—	—	—	—	—	215,311.08	38.29	—

注：1. 我公司对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。

2. 本期内本基金租用的券商交易单元无变更。

## 10.8 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、公司网站	2014年01月29日
2	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、公司网站	2014年01月30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、公司网站	2014年05月13日
4	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、公司网站	2014年06月20日

## § 11 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富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）的文件 2、富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同 3、富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）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、富国中证 500 指数增	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>

---

强型证券投资基金（LOF） 财务报表及报表附注 6、报告期内在指定报刊 上披露的各项公告		
---	--	--