富国高新技术产业股票型证券投资基金

2012 年度 报告摘要

2012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:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2013年03月26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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年3月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2012年6月27日起至2012年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	富国高新技术产业股票
基金主代码	100060
交易代码	前端交易代码:100060 后端交易代码:-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年06月27日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	155,126,950.25份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于高新技术产业相关上市公司,通过精选个股和风险控制,力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金采取"自上而下"的方式进行大类资产配置,根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究,确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。
业绩比较基准	中证800指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的股票型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与预期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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	范伟隽	赵会军
	联系电话	021-20361818	010—66105799
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105686,4008880688	95588
传真		021-20361616	010—66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街55号

§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	2012年06月27日(基金合同生效日)至2012年12月31日
本期已实现收益	-18,039,584.65
本期利润	-5,713,248.80
加权平均基金份额本期利润	-0.0268
本期基金份额净值增长率	-2.00%
3.1.2期末数据和指标	2012年12月31日
期末可供分配基金份额利润	-0.0987
期末基金资产净值	152,083,463.73
期末基金份额净值	0.980

注:上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.11%	1.05%	6.73%	1.04%	-7.84%	0.01%
过去六个月	-2.00%	0.86%	0.70%	1.02%	-2.70%	-0.16%
自基金合同生效日起至今	-2.00%	0.84%	0.78%	1.01%	-2.78%	-0.17%

注:

本基金业绩比较基准:中证800 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。中证800 指数是由中证指数有限公司编制的综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况的指数。中证800 指数的成份股由中证500 指数和沪深300指数成份股一起构成。

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

benchmarkt=[中证800指数(t)/中证800指数(t-1)-1]*80%+[中债综合指数(t)/中债综合指数(t-1)-1]*20%;

其中,t=1,2,3,…,T,T表示时间截至日;

期间T日收益率(benchmarkT)按下列公式计算:

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

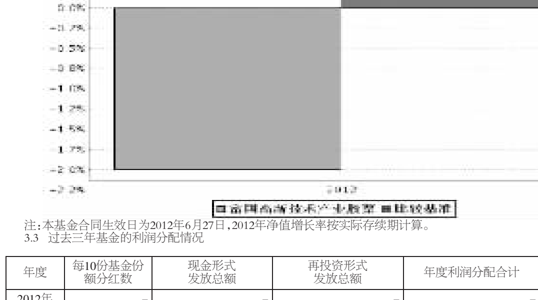
其中,T=2,3,4,…;$\prod_{t=1}^{T}(1+benchmarkt)$表示t日至T日的(1+benchmarkt)数学连乘。

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2012年12月31日。本基金于2012年6月27日成立,自合同生效日起至本报告期末不足一年。

本基金建仓期6个月,即从2012年6月27日起至2012年12月26日止,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:本基金合同生效日为2012年6月27日,2012年净值增长率按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2012年	-	-	-	-	-
2011年	-	-	-	-	-
2010年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注:本基金本报告期内未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

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。截止2012年12月31日,本基金管理人共管理汉盛证券投资基金、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、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三十二只证券投资基金。

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		
王海军	本基金基金经理	2012-06-27	-	6年	硕士,曾任厦门三安电子有限公司工程师;中国建银投资证券有限公司高级分析师;2010年3月至2012年6月任富国基金管理有限公司高级行业研究员,2012年6月起任富国高新技术产业股票型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格,中国国籍。

注:上述表格内基金经理的任职日期、离任日期均指公司作出决定并公告披露之日。

证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期,富国基金管理有限公司作为富国高新技术产业股票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》、《汉盛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,无损害基金份额持有人利益的行为,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的不同组合间,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(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

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面,报告期内本组合与其他投资组合之间,因组合流动性管理或投资策略调整需要,出现3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

本基金于2012年6月27日正式成立和运作。其中第三季度内基金仓位平均维持在60%以下,三季度期间中证800指数下跌7.1%,本基金下跌0.9%,相对收益为6.2%,低仓位取得较高相对收益。进入第四季度开始,基金仓位逐渐增加。

在投资策略方面,考虑第四季度国内宏观经济有可能走出第三季度的低迷状态而适当增加了股票仓位。

虽然10月、11月份包括PMI等的宏观数据整体有所转好,但市场依然担心以上是下降趋势下的暂时反弹而继续下探。从12月初开始,市场开始对宏观经济转好有了共同的认识而大幅度反弹,整个第四季度期间本基金仓位没有大幅度变动。

在股票配置方面,本基金依然坚持基金契约规定主要投资高新技术产业标的。个股选择方面,一直坚持选择公司产品具有明显竞争优势、需求端行业持续增长、管理好对优秀、行业进入壁垒较高、盈利水平突出的企业,主要的考虑因素是:我们认为此类企业才有可能在未来较长时间里取得持续增长,而投资这些企业是科技成长型基金取得长期较高投资收益/风险比的可取途径。

本基金的运作中,高新技术产业投资主题始终体现在组合的构建和调整过程中,以分享未来经济转型过程中的红利。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2012年12月31日,本基金份额净值为0.980元,份额累计净值为0.980元。报告期内,本基金份额净值增长率为-2.00%,同期业绩比较基准收益率为0.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,本基金继续把握经济从劳动密集型向技术密集型转型过程中的投资机会,高新技术产业投资主题始终体现在组合的构建之中。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司按照相关法律法规的规定成立了估值委员会,并制订了《富国基金管理有限公司估值委员会运作管理办法》。估值委员会是公司基金估值的主要决策机关,由主管运营副总经理负责,成员包括基金清算、监察稽核、金融工程方面的业务骨干以及相关基金经理,所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会负责提出估值意见、提供和评估估值技术、执行估值决策和程序,对外信息披露等工作,保证基金估值的公允性和合理性,维护基金持有人的利益。基金经理是估值委员会的重要成员,必须列席估值委员会的定期会议,提出基金估值流程及估值技术中存在的潜在问题,参与估值程序和估值技术的决策。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况,2012年报告期末本基金未满足收益分配条件,故不进行收益分配。

§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

2012年,本基金托管人在对富国高新技术产业股票型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

2012年,富国高新技术产业股票型证券投资基金的管理人——富国基金管理有限公司在富国高新技术产业股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,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

本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露的富国高新技术产业股票型证券投资基金2012年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

2013年3月22日

§6 审计报告

本基金审计的注册会计师出具的是无保留意见的审计报告。

投资者可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:富国高新技术产业股票型证券投资基金

报告截止日:2012年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末(2012年12月31日)
资 产:	
银行存款	18,974,152.37
结算备付金	811,481.88
存出保证金	869,871.06
交易性金融资产	132,661,927.67
其中:股票投资	132,661,927.67
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
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	4,138.59
应收股利	-
应收申购款	5,933.34
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	153,327,504.91
负债和所有者权益	本期末(2012年12月31日)
负 债:	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	346,988.73
应付管理人报酬	186,676.11
应付托管费	31,112.69
应付销售服务费	-
应付交易费用	457,955.94
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	221,307.71
负债合计	1,244,041.18
所有者权益:	
实收基金	155,126,950.25
未分配利润	-3,043,486.52
所有者权益合计	152,083,463.73
负债和所有者权益总计	153,327,504.91

注:①报告截止日2012年12月31日,基金份额净值0.980元,基金份额总额155,126,950.25份。

②本基金合同于2012年6月27日生效。

7.2 利润表

会计主体:富国高新技术产业股票型证券投资基金

本报告期:2012年06月27日(基金合同生效日)至2012年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2012年06月27日(基金合同生效日)至2012年12月31日
一、收入	-1,819,750.03
1.利息收入	564,015.03
其中:存款利息收入	329,330.07
债券利息收入	525.56
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	234,159.40
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-14,942,131.91
其中:股票投资收益	-15,256,956.38
基金投资收益	-
债券投资收益	-3,709.26
资产支持证券投资收益	-
衍生工具投资收益	-
股利收益	318,533.73
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	12,326,335.85
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	232,031.00
减:二、费用	3,893,498.77
1.管理人报酬	1,584,342.77
2.托管费	264,057.14
3.销售服务费	-
4.交易费用	1,823,921.86
5.利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6.其他费用	221,177.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-5,713,248.80
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-5,713,248.80

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:富国高新技术产业股票型证券投资基金

本报告期:2012年06月27日(基金合同生效日)至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2012年06月27日(基金合同生效日)至2012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)	341,209,752.24	-	341,209,752.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-5,713,248.80	-5,713,248.80
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)	-186,082,801.99	2,669,762.28	-183,413,039.71
其中:1.基金申购款	2,272,004.49	-63,093.44	2,208,911.05
2.基金赎回款	-188,354,806.48	2,732,855.72	-185,621,950.76
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)	155,126,950.25	-3,043,486.52	152,083,463.73

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:

窦玉明 林志松 雷青松

基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1基金基本情况

富国高新技术产业股票型证券投资基金(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")证监许可[2012]85号《关于核准富国高新技术产业股票型证券投资基金募集的批复》的核准,由管理人富国基金管理有限公司于2012年6月4日至2012年6月25日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2012)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。基金合同于2012年6月27日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币341,179,685.68元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币30,066.56元,以上实收基金(本息)合计为人民币341,209,752.24元,折合341,209,752.24份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为富国基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括依法公开发行上市的股票(包括创业板、中小板以及其他经中国证监会批准上市的股票)、债券、银行存款、货币市场工具、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金为股票型基金,投资于股票类资产的比例占基金资产的 60%—95%,其中投资于高新技术产业相关股票的比例不低于股票类资产的 80%;投资于债券、银行存款、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种的比例占基金资产的 5%—40%,其中,权证资产的投资比例占基金资产净值的 0%—3%,现金或到期日在 一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金业绩比较基准为:中证800指数收益率×80%+中债综合指数收益率×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。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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2012年12月31日的财务状况以及2012年6月27日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4重要会计政策和会计估计

本基金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。

7.4.4.1 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2012年6月27日(基金合同生效日)起至2012年12月31日止。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 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。

7.4.4.4 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,起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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次,第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的,以该报价为依据确定公允价值;第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价,或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的,以该报价为依据做必要调整确定公允价值;第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的,以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下:

1) 股票投资

(1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。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,按最近交易日的收盘价估值;如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的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值;如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值,调整最近交易市价,确定公允价值;

(2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票,以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值;

B. 首次公开发行的股票,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按其成本价计算;首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值;

C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值:

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票的初始取得成本时,应采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值;

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的初始取得成本时,应按中国证监会相关规定处理。

2) 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。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,按最近交易日的收盘价估值;如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的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值,调整最近交易市价,确定公允价值;

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。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,按最近交易日的收盘净价估值;如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的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值,调整最近交易市价,确定公允价值;

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本进行后续计量;

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,采用估值技术确定公允价值;

3) 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。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,按最近交易日的收盘价估值;如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的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值,调整最近交易市价,确定公允价值;

(2) 未上市流通的权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本计量;

(3) 因持有股票而享有的配股权证,采用估值技术确定公允价值进行估值;

4) 分离交易可转债

分离交易可转债,上市日前,采用估值技术分别对债券和权证进行估值;自上市日起,上市流通的债券和权证分别按上述2)、3)中的相关原则进行估值;

5) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值;

(2) 如有新增事项,按国家最新规定估值。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)"。

7.4.4.9 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)于成交日确认债券投资收益/(损失),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。

7.4.4.10 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1.50%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。

7.4.4.11 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,每次收益分配比例不得低于截至收益分配基准日可供分配利润的10%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

(2) 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;

(3) 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;

(4) 每一基金份额享有同等分配权;

(5) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本期末发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本期末发生重大会计差错,无需更正。

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]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定,自2005年6月13日起,对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得,按照财税[2005]102号文规定,扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时,减按50%计算应纳税所得额;

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[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。

7.4.7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、注册登记机构、基金销售机构
海通证券股份有限公司("海通证券")	基金管理人的股东、基金代销机构
申银万国证券股份有限公司("申银万国")	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
中国工商银行股份有限公司("工商银行")	基金托管人、基金代销机构

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年06月27日(基金合同生效日)至2012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	121,993,166.90	9.76
申银万国	53,487,780.93	4.28

7.4.8.1.2 权证交易

注:本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

注:本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.4 回购交易

注:本基金本报告期末通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年06月27日(基金合同生效日)至2012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	106,567.88	9.67	40,407.21	8.82
申银万国	48,306.32	4.38	39,226.43	8.57

注:上述佣金按市场佣金率计算,扣除由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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年06月27日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,584,342.77
其中:支付销售机构的客户维护费	929,996.29

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

H=E×1.50%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年06月27日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	264,057.14

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。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年06月27日(基金合同生效日)至2012年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	18,974,152.37	318,181.64

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

7.4.9期末(2012年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	
300315	掌趣科技	2012-12-04	筹划重大事项	22.86	2013-02-05	25.15	139,300	3,659,799.12	3,184,398.00	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注:截至本报告期末2012年12月31日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2012年12月31日止,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.10 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	132,661,927.67	86.52
	其中:股票	132,661,927.67	86.52
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	19,785,634.25	12.90
6	其他各项资产	879,942.99	0.57
7	合计	153,327,504.91	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	6,227,026.84	4.09
C	制造业	68,392,256.09	44.97
C0	食品、饮料	1,463,140.00	0.96
C1	纺织、服装、皮毛	1,596,963.00	1.05
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	3,159,423.50	2.08
C5	电子	17,736,389.23	11.66
C6	金属、非金属	3,065,962.02	2.02
C7	机械、设备、仪表	25,986,505.11	17.09
C8	医药、生物制品	15,383,873.23	10.12
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	50,240,903.91	33.04
H	批发和零售贸易	4,690,608.00	3.08
I	金融、保险业	3,111,132.83	2.05
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	132,661,927.67	87.23

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000423	东阿阿胶	185,547	7,497,954.27	4.93
2	300124	汇川技术	227,143	5,440,074.85	3.58
3	300188	美亚柏科	197,408	4,737,792.00	3.12
4	000581	威孚高科	143,900	4,590,410.00	3.02
5	600703	三安光电	331,131	4,529,872.08	2.98
6	002230	科大讯飞	140,326	4,251,877.80	2.80
7	600498	烽火通信	169,527	3,858,434.52	2.54
8	002465	海格通信	131,800	3,802,430.00	2.50
9	002153	石基信息	174,081	3,781,039.32	2.49
10	300352	北信源	118,005	3,620,393.40	2.38

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于富国基金管理有限公司网站的年度报告正文

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1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	600271	航天信息	17,765,881.66	11.68
2	600060	海信电器	16,274,341.23	10.70
3	000800	一汽轿车	16,167,732.19	10.63
4	000063	中兴通讯	15,845,540.52	10.42
5	002073	软控股份	14,571,664.52	9.58
6	601717	郑煤机	14,378,003.96	9.45
7	600050	中国联通	13,386,582.40	8.80
8	002153	石基信息	13,311,504.85	8.75
9	600703	三安光电	12,492,353.26	8.21
10	002106	莱宝高科	11,544,289.24	7.59
11	002065	东华软件	11,074,583.70	7.28
12	000581	威孚高科	10,536,120.96	6.93
13	000423	东阿阿胶	9,723,306.12	6.39
14	600104	上汽集团	9,634,356.34	6.33
15	002583	海能达	9,516,971.70	6.26
16	000869	张裕A	9,226,543.61	6.07
17	600498	烽火通信	8,947,424.36	5.88
18	000157	中联重科	8,876,424.49	5.84
19	600406	国电南瑞	8,850,043.86	5.82
20	601699	潞安环能	8,567,983.00	5.63
21	600519	贵州茅台	8,466,782.68	5.57
22	601989	中国重工	8,426,541.49	5.54
23	002405	四维图新	7,922,109.84	5.21
24	002422	科伦药业	7,903,716.36	5.20
25	600570	恒生电子	7,600,455.63	5.00
26	601166	兴业银行	7,300,049.99	4.80
27	002007	华兰生物	7,174,380.02	4.72
28	002465	海格通信	7,128,705.91	4.69
29	300199	翰宇药业	7,096,690.91	4.67
30	600563	法拉电子	6,855,325.43	4.51
31	600031	三一重工	6,575,203.75	4.32
32	002028	思源电气	6,435,465.80	4.23
33	600970	中材国际	6,304,726.78	4.15
34	300102	乾照光电	6,233,324.13	4.10
35	603000	人民网	6,178,432.01	4.06
36	300188	美亚柏科	5,998,151.82	3.94
37	000538	云南白药	5,806,892.49	3.82
38	002436	兴森科技	5,748,525.53	3.78
39	600547	山东黄金	5,733,546.68	3.77
40	300096	易联众	5,616,166.12	3.69
41	600976	武汉健民	5,583,816.20	3.67
42	002024	苏宁电器	5,504,085.71	3.62
43	002161	远望谷	5,463,509.09	3.59
44	600183	生益科技	5,372,197.07	3.53
45	002308	威创股份	5,341,510.77	3.51
46	600528	中铁二局	5,255,518.31	3.46
47	300168	万达信息	5,247,637.36	3.45
48	002376	新北洋	5,167,308.52	3.40
49	300039	上海凯宝	5,151,436.09	3.39
50	000858	五粮液	5,145,255.40	3.38
51	600176	中国玻纤	5,125,623.36	3.37
52	600288	大恒科技	4,985,611.90	3.28
53	600309	烟台万华	4,978,193.12	3.27
54	600694	大商股份	4,819,825.82	3.17
55	002672	东江环保	4,698,026.86	3.09
56	300124	汇川技术	4,651,152.01	3.06
57	300101	国腾电子	4,603,458.64	3.03
58	000650	仁和药业	4,522,465.63	2.97
59	600546	山煤国际	4,242,997.44	2.79
60	600495	晋西车轴	4,150,670.92	2.73
61	300182	捷成股份	4,130,859.00	2.72
62	300219	鸿利光电	4,093,019.63	2.69
63	002250	联化科技	3,886,236.02	2.56
64	002013	中航精机	3,872,411.70	2.55
65	000826	桑德环境	3,823,924.45	2.51
66	600267	海正药业	3,800,365.51	2.50
67	600118	中国卫星	3,792,559.69	2.49
68	600990	四创电子	3,708,065.60	2.44
69	002017	东信和平	3,684,481.30	2.42
70	002063	远光软件	3,667,356.00	2.41
71	300315	掌趣科技	3,659,799.12	2.41
72	000100	TCL集团	3,656,381.99	2.40
73	600276	恒瑞医药	3,633,944.57	2.39
74	601633	长城汽车	3,507,587.12	2.31
75	600436	片仔癀	3,452,132.52	2.27
76	300352	北信源	3,440,513.38	2.26
77	000679	大连友谊	3,436,721.25	2.26
78	002069	獐子岛	3,434,422.26	2.26
79	002230	科大讯飞	3,387,045.02	2.23
80	300312	邦讯技术	3,377,864.80	2.22
81	000522	白云山A	3,350,704.03	2.20
82	300050	世纪鼎利	3,260,275.99	2.14
83	600518	康美药业	3,245,921.34	2.13
84	002638	勤上光电	3,220,324.76	2.12
85	002293	罗莱家纺	3,209,179.76	2.11
86	600718	东软集团	3,193,178.25	2.10
87	300024	机器人	3,134,750.80	2.06
88	600511	国药股份	3,129,750.71	2.06
89	000651	格力电器	3,120,447.15	2.05
90	000786	北新建材	3,091,247.10	2.03
91	300083	劲胜股份	3,088,425.76	2.03
92	002271	东方雨虹	3,052,617.51	2.01
92	002271	东方雨虹	3,052,617.51	2.01

8.4.2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	000800	一汽轿车	15,611,524.68	10.27
2	600271	航天信息	14,036,845.68	9.23
3	601717	郑煤机	13,934,246.96	9.16
4	600060	海信电器	13,865,029.21	9.12
5	000063	中兴通讯	12,396,107.98	8.15
6	600050	中国联通	11,960,461.38	7.86
7	002065	东华软件	10,598,364.86	6.97
8	002073	软控股份	10,587,248.43	6.96
9	002583	海能达	8,856,214.32	5.82
10	600406	国电南瑞	8,855,263.97	5.82
11	002153	石基信息	8,698,617.51	5.72
12	000869	张裕A	8,531,129.37	5.61
13	601989	中国重工	8,049,963.99	5.29
14	600703	三安光电	7,853,212.78	5.16
15	600104	上汽集团	7,852,003.04	5.16
16	002106	莱宝高科	7,609,177.74	5.00
17	000157	中联重科	7,284,117.34	4.79
18	300199	翰宇药业	7,237,049.23	4.76
19	600519	贵州茅台	7,204,661.36	4.74
20	002007	华兰生物	6,736,563.43	4.43
21	002405	四维图新	6,730,846.01	4.43
22	002422	科伦药业	6,567,617.71	4.32
23	000581	威孚高科	6,249,366.44	4.11
24	600970	中材国际	6,097,170.54	4.01
25	603000	人民网	6,032,493.16	3.97
26	600570	恒生电子	5,928,177.50	3.90
27	600547	山东黄金	5,899,272.91	3.88
28	300096	易联众	5,706,446.05	3.75
29	601699	潞安环能	5,703,901.41	3.75
30	002436	兴森科技	5,516,136.08	3.63
31	600976	武汉健民	5,491,897.11	3.61
32	600183	生益科技	5,233,033.35	3.44
33	002161	远望谷	5,217,068.36	3.43
34	002376	新北洋	5,169,595.47	3.40
35	300102	乾照光电	5,145,798.88	3.38
36	300039	上海凯宝	5,062,673.64	3.33
37	002308	威创股份	5,058,088.04	3.33
38	000858	五粮液	5,038,070.02	3.31
39	600031	三一重工	5,017,657.02	3.30
40	600498	烽火通信	5,005,495.98	3.29
41	601166	兴业银行	4,939,831.92	3.25
42	600528	中铁二局	4,888,089.40	3.21
43	600176	中国玻纤	4,750,805.42	3.12
44	000650	仁和药业	4,475,484.29	2.94
45	000522	白云山A	4,418,062.86	2.91
46	002672	东江环保	4,393,876.29	2.89
47	600495	晋西车轴	4,353,772.71	2.86
48	300219	鸿利光电	4,297,438.76	2.83
49	600288	大恒科技	4,232,753.60	2.78
50	600563	法拉电子	4,195,237.40	2.76
51	002013	中航精机	4,191,465.06	2.76
52	600546	山煤国际	4,155,133.71	2.73
53	002017	东信和平	4,110,151.28	2.70
54	300182	捷成股份	4,075,369.93	2.68
55	002465	海格通信	4,050,238.68	2.66
56	000538	云南白药	4,015,233.54	2.64
57	300101	国腾电子	3,968,816.06	2.61
58	002024	苏宁电器	3,914,250.28	2.57
59	000826	桑德环境	3,851,133.40	2.53
60	601633	长城汽车	3,829,283.58	2.52
61	300168	万达信息	3,796,630.14	2.50
62	600990	四创电子	3,729,335.45	2.45
63	600118	中国卫星	3,681,393.35	2.42
64	002028	思源电气	3,665,027.79	2.41
65	002069	獐子岛	3,638,260.47	2.39
66	600267	海正药业	3,587,180.58	2.36
67	300312	邦讯技术	3,539,484.84	2.33
68	600436	片仔癀	3,535,559.63	2.32
69	600276	恒瑞医药	3,439,536.33	2.26
70	000100	TCL集团	3,431,697.00	2.26
71	000679	大连友谊	3,409,578.74	2.24
72	600309	烟台万华	3,372,928.89	2.22
73	002638	勤上光电	3,299,732.51	2.17
74	600694	大商股份	3,270,129.23	2.15
75	000024	招商地产	3,210,450.60	2.11
76	300083	劲胜股份	3,188,440.14	2.10
77	600518	康美药业	3,157,258.90	2.08
78	002271	东方雨虹	3,062,552.35	2.01

8.4.3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	692,936,605.90
卖出股票收入(成交)总额	557,344,057.70

8.5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。

8.6期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

8.9投资组合报告附注

8.9.1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。

8.9.2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。

8.9.3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	869,871.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,138.59
5	应收申购款	5,933.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	879,942.99

8.9.4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。

8.9.5期末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。

8.9.6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。

§9 基金份额持有人信息

9.1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(%)
3202	48,446.89	19,770.45	0.01	155,107,179.80	99.99

9.2期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

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开放式基金	0.00	0.0000

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。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2012年06月27日)基金份额总额	341,209,752.24
本报告期(2012年06月27日(基金合同生效日)至2012年12月31日)基金总申购份额	2,272,004.49
减:本报告期(2012年06月27日(基金合同生效日)至2012年12月31日)基金总赎回份额	188,354,806.48
本报告期(2012年06月27日(基金合同生效日)至2012年12月31日)基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	155,126,950.25

注: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。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

本报告期,基金管理人经中国证监会核准聘任范伟隽先生担任公司督察长,李长伟先生不再担任公司督察长。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

11.5 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本基金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审计报酬为5万元人民币,其已为本公司提供审计服务的连续年限为10年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.1

11.7 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	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
安信证券	2	202,290,664.70	16.18	-	-	205,000,000.00	46.07	-	-	177,136.28	16.07	-
东兴证券	2	84,399,100.16	6.75	-	-	120,000,000.00	26.97	-	-	74,036.07	6.72	-
广发证券	2	136,519,472.73	10.92	-	-	120,000,000.00	26.97	-	-	120,555.92	10.94	-
国开证券	1	47,095,039.14	3.77	-	-	-	-	-	-	40,876.76	3.71	-
国信证券	2	1,170,209.59	0.09	-	-	-	-	-	-	991.79	0.09	-
海通证券	2	121,993,166.90	9.76	-	-	-	-	-	-	106,567.88	9.67	-
宏源证券	2	183,414,712.80	14.67	399,816.30	100.00	-	-	-	-	163,884.73	14.87	-
红塔证券	2	64,492,784.41	5.16	-	-	-	-	-	-	56,825.86	5.16	-
华创证券	2	3,385,121.50	0.27	-	-	-	-	-	-	2,868.93	0.26	-
华西证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	2	295,587,458.80	23.64	-	-	-	-	-	-	260,272.77	23.61	-
申银万国	1	53,487,780.93	4.28	-	-	-	-	-	-	48,306.32	4.38	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	1	40,168,141.57	3.21	-	-	-	-	-	-	35,035.71	3.18	-
中投证券	1	16,277,010.37	1.30	-	-	-	-	-	-	14,818.45	1.34	-
中信证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注: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。本基金于2012年6月27日成立,本表中所列券商交易单元均为本报告期新增。