

上证综指交易型开放式指数证券投资基金

2013 第四季度 报告

013年 12 月 31 日

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	3,150,780.00	1.12
B	采矿业	45,784,560.38	16.32
C	制造业	79,409,973.48	28.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,895,700.72	3.53
E	建筑业	8,022,780.76	2.86
F	批发和零售业	9,214,585.50	3.29
G	交通运输、仓储和邮政业	12,594,983.00	4.49

J	信息技术、软件和信息科技服务业		6,098,937.70	2.17
J	金融业		87,061,939.99	31.04
K	房地产业		7,972,676.75	2.84
L	租赁和商务服务业		1,563,431.00	0.56
M	科学研究和技术服务业		-	-
N	水利、环境和公共设施管理业		1,872,669.26	0.67
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		3,746,249.00	1.34
S	综合		2,561,144.10	0.91
合计			278,090,414.64	99.45

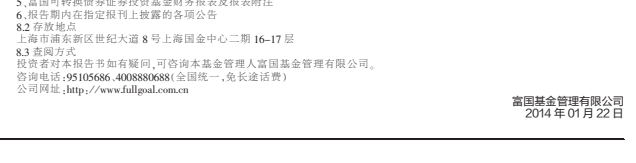
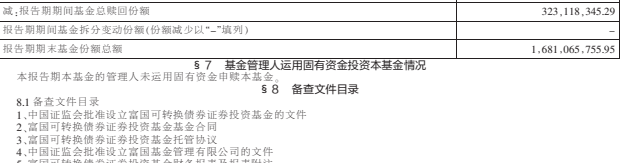
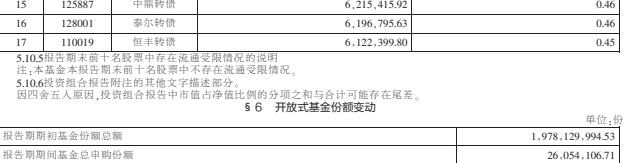
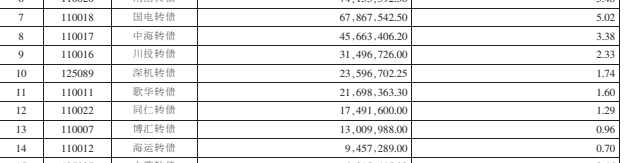
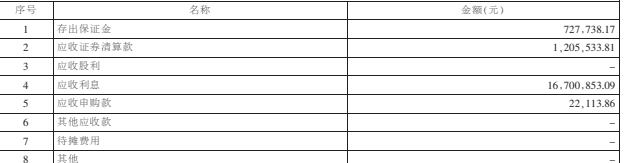
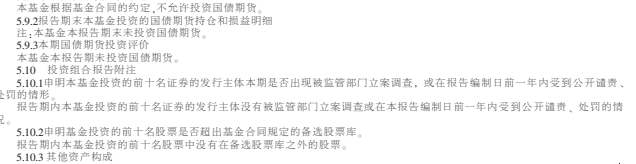
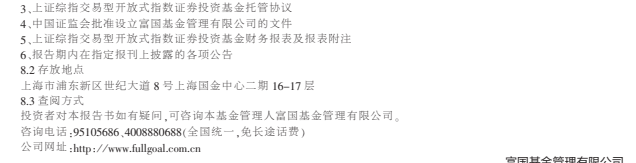
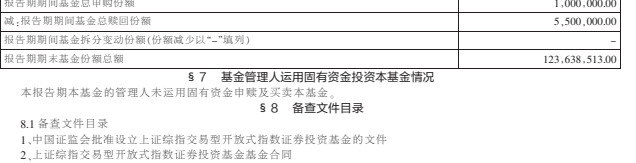
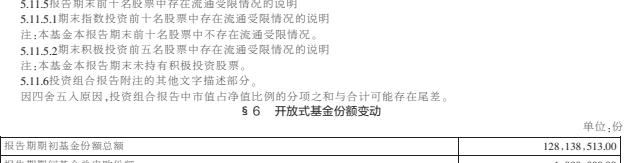
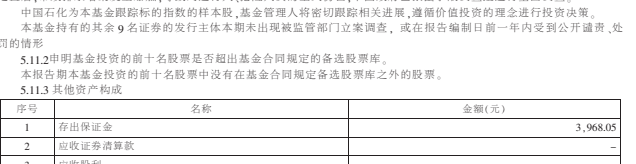
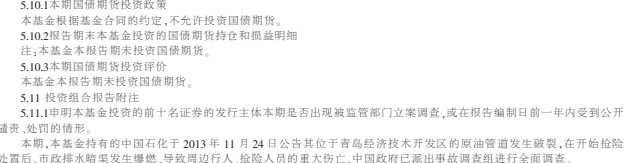
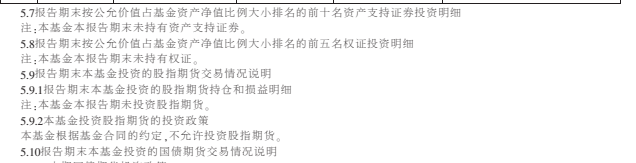
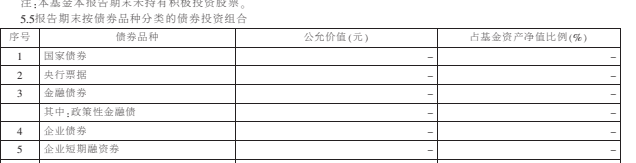
5.41 各期末按公允价值计量基金资产净值前两大排序的股票投资明细

5.4.1 报告期末按公允价值计量基金资产净值前两大排序的股票投资前五名股票投资明细

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	601857	中国石油	2,966,000	22,367,860.00	8.15
2	601288	农业银行	6,019,700	14,928,856.00	5.32
3	601988	中国国航	4,240,400	11,109,448.00	3.96
4	600028	中国石化	1,624,388	7,727,258.24	2.59
5	601628	中国人寿	384,400	5,815,972.00	2.07

4 报告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

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	601857	中国石化	2,966,000	22,867,860.00	8.15
2	601288	农业银行	6,019,700	14,928,856.00	5.32
3	601988	中国广核	4,240,400	11,709,488.00	4.36
4	600828	中国神华	1,622,800	10,769,824.00	3.90
5	601623	兴业银行	384,400	5,415,972.00	1.97
6	600036	招商银行	414,391	4,512,717.70	1.61
7	601088	中国神华	281,300	4,054,166.00	1.50
8	600000	浦发银行	465,400	4,385,327.20	1.56
9	601166	兴业银行	428,670	4,346,713.80	1.55
10	601328	交通银行	1,035,932	3,977,932.80	1.42



单位:份	
报告期期初基金份额总额	128,138,513.00
报告期期间基金总申购份额	1,000,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	5,500,000.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	123,638,513.00

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立上证综指交易型开放式指数证券投资基金的文件

2、上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金合同

3、上证综指交易型开放式指数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

6. 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

8.2 存放地点

上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 层

8.3 查阅方式

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: <http://www.fullgoal.com.cn>

2014年01月22日

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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。

本基金根据基金合同的约定,不允许投资股指期货。
5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.9.1 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。
5.9.2 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。
5.9.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未投资国债期货。
5.10 投资组合报告附注

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。

5.10.2 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。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	727,738.17

2	应收证劵清算款	1,205,533.81
3	应收股利	-
4	应收利息	16,700,853.09
5	应收申购款	22,113.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
e	合计	

9	合计		18,656,238.91	
5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细				
序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	419,717,266.50	31.03
2	113001	中行转债	411,931,162.50	30.45
3	113002	工行转债	337,873,535.50	24.98

5	113003	重工铸钢	117,602,076.00	8.69
6	110020	南山铸钢	74,153,392.30	5.48
7	110018	国电铸钢	67,867,542.50	5.02
8	110017	中钢铸钢	45,663,406.20	3.38
9	110016	川投铸钢	31,496,726.00	2.33
10	125089	深机铸钢	23,596,702.25	1.74

11	110011	歌华转债	21,698,363.30	1.60
12	110022	同仁转债	17,491,600.00	1.29
13	110007	博汇转债	13,009,988.00	0.96
14	110012	海富转债	9,457,289.00	0.70
15	125887	中鼎转债	6,215,415.92	0.46
16	128001	泰尔转债	6,196,795.63	0.46
17	144000A.D	苏宁转债	5,139,320.00	0.38

		单位:份
报告期期初基金份额总额		1,978,129,994.53
报告期期末基金份额总额		26,054,106.71

报告期内期间基金总份额	323,118,345.29
报告期期末基金份额变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,681,065,755.95

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期末本基金的基金管理人未运用固有资金申购本基金

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立富国可转换债券证券投资基金的文件

3. 富国可转换债券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. 富国可转换债券证券投资基金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

8.2 存放地点

上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 层

8.3 查阅方式

投资者对本节所有文件如有疑问,可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。

咨询电话: 95105686, 4008880888(全国统一, 免长话费)

富国基金管理有限公司
2014年01月22日