

富国天源平衡混合型证券投资基金

[2013]第二季度报告

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
报告送出日期:2013年07月18日

§ 1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会及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责任。

基金托管人:中国农业银行股份有限公司，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。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至2013年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:富国天源平衡混合

基金主代码:100016

交易代码:前端交易代码:100016

后端交易代码:100017

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2002年08月16日

报告期末基金份额总额(单位:份):977,446,502.32

投资目标:尽可能减少和控制投资风险，力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长。本基金为平衡型证券投资基金，将是基金资产按比例投资于股票和债券，在股票投资中主要投资于成长型股票和债券，从而获得稳定的资本收益和风险的情况下，尽可能地获得稳定的资本收益。

投资策略:采取自上而下的主动性管理策略，资产配置突出两个层面的平衡：一、资产配置的层面，通过主动调整基金资产在股票和债券的投资比例，寻求基金资产在股票市场和债券市场的投资机会，从而达到风险和收益的平衡；二、股票投资的层面，即通过调整股票资产中成长型股票和价值型股票的投资比例实现持续均衡的平衡。在投资于良好成长类上市公司的同时，兼顾收益稳定的定价价值型上市公司。

业绩比较基准:本基金采用“沪深300指数收益率”作为衡量本基金的业绩基准，即中证指数公司编制的沪深300指数收益率×65%+中债国债指数收益率×30%+同业存款利率×5%。

风险收益特征:本基金为混合型证券投资基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，其预期平均收益和预期风险均高于货币型基金，低于股票和货币市场基金。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年04月01日-2013年06月30日)

1.本期已实现收益 64,136,155.58

2.本期利润 3,617,210.13

3.加权平均基金份额本期利润 0.0037

4.期末基金份额净值 953,212,483.95

5.期末基金份额净值 0.9752

注:1.本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用、基金转换费用、基金定投费用等),计入费用后实际收益水平可能低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(减去必要的费用)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。

2.基金的过往业绩从2002年6月16日至2003年2月15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 基金经理(或基金经理助理)简介

姓名 职务 在本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

李晓铭 本基金基金经理兼富国环保型股票型证券投资基金基金经理 2009-10-29 - 9年 硕士,曾任华富基金管理有限公司行业研究员,2006年4月至2009年10月任富国基金管理有限公司行业研究员,2009年10月至今任富国天源平衡主题股票型证券投资基金基金经理,2011年4月起任富国环保型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。

4.2 报告期内本基金运作合规情况说明

本基金的业绩指标未持有股票,本公司的内部控制制度、操作流程及投资管理、风险控制等符合相关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度和执行情况

本基金管理人根据相关法律法规、结合公司实际情况,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、投资决策、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、事后评估及反馈的全流程管理。在操作层面确保各组合享有同等信息知情权,均等交易机会,从而保证各组合公平对待。

本基金管理人通过建立科学的投资决策流程,对投资决策、交易执行、业绩评估等环节进行事前控制,对交易对手、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事前控制。

4.3.2 公平交易制度执行情况

本基金管理人对同一投资组合的交易行为,在市场地位、市场影响力、交易频率、交易量等方面进行控制,对同一投资组合的交易行为,在交易时机、交易价格等方面进行控制,对同一投资组合的交易行为,在交易对手、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事前控制。

4.3.3 公平交易制度执行的说明

本基金报告期内未发现违反公平交易制度的情况。

4.4 报告期内本基金的交易执行情况

本基金管理人对同一投资组合的交易行为,在交易时机、交易价格等方面进行控制,对同一投资组合的交易行为,在交易对手、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事前控制。

4.5 公平交易制度执行的说明

本基金报告期内未发现违反公平交易制度的情况。

4.6 报告期内本基金的异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发现异常交易行为。

4.7 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.8 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.9 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.10 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.11 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.12 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.13 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.14 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.15 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.16 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.17 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.18 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.19 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.20 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.21 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.22 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.23 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.24 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.25 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.26 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.27 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.28 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.29 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.30 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.31 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.32 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.33 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.34 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.35 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.36 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.37 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.38 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.39 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.40 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.41 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.42 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.43 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.44 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.45 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.46 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.47 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.48 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.49 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.50 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.51 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.52 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.53 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.54 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.55 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.56 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.57 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.58 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.59 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.60 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.61 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.62 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.63 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.64 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.65 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.66 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.67 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.68 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.69 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.70 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.71 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.72 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.73 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.74 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.75 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.76 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.77 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.78 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.79 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.80 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.81 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.82 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.83 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.84 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.85 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.86 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.87 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.88 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.89 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.90 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.91 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.92 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.93 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.94 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.95 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.96 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.97 报告期内本基金的公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。