富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金

【2013】年度报告摘要

基金管理人：	富国基金管理有限公司
基金托管人：	中国建设银行股份有限公司
送出日期：	2014年03月29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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年3月27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2013年4月12日起至2013年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	富国宏观策略灵活配置混合
基金主代码	000029
交易代码	前端交易代码:000029 后端交易代码:000161
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年04月12日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	606,097,796.32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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	范伟隽	田青
	联系电话	021-20361818	010-67595096
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		95105686,4008880688	010-67595096
传真		021-20361616	010-66275853

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楼 中国建设银行股份有限公司 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

§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	2013年4月12日(基金合同生效日)至2013年12月31日
本期已实现收益	47,391,911.93
本期利润	68,086,923.25
加权平均基金份额本期利润	0.0676
本期基金份额净值增长率	7.20%
3.1.2 期末数据和指标	2013年12月31日
期末可供分配基金份额利润	0.0627
期末基金资产净值	648,377,827.78
期末基金份额净值	1.072

注:本基金合同生效日为2013年4月12日,截至报告期末本基金合同生效不满一年。

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,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。本期已实现收益是本期利息收入、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 基金份额净值表现

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	-3.51%	1.14%	-2.66%	0.74%	-0.85%	0.40%
过去六个月	4.28%	1.16%	3.02%	0.84%	1.26%	0.32%
自基金合同生效日起至今	7.20%	1.15%	-4.35%	0.89%	11.55%	0.26%

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%。

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,日收益率(benchmark)按下列公式计算:

benchmark1 = 65% * [沪深300指数t/沪深300指数t-1]-1] +35% * [中债综合指数t/中债综合指数t-1]-1];

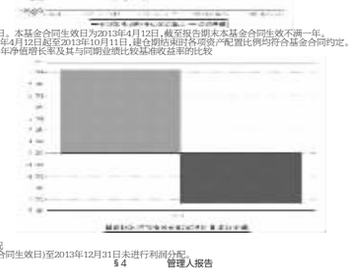
其中,t=1,2,3,…,T,T表示时间概念日;

期间日收益率(benchmark)按下列公式计算:

benchmarkT =∏[Πt=1(1+benchmark1)]-1

其中,T=2,3,4,…,T;Πt=1(1+benchmark1)表示日至T日的(1+benchmark1)数字连乘。

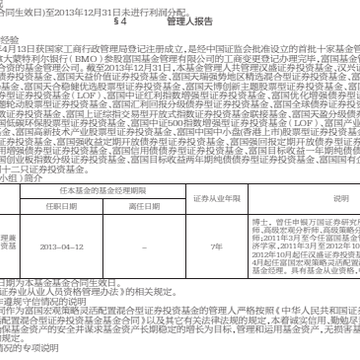
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.截止日期为2013年12月31日。本基金合同生效日为2013年4月12日,截至报告期末本基金合同生效不满一年。

2.本基金建仓期6个月,即从2013年4月12日起至2013年10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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:2013年按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:基金自2013年4月12日(基金合同生效日)至2013年12月31日止进行利润分配。

§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1998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月取得大额特别许可(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2013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、富国天惠证券投资基金、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、富国天添利货币市场基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、富国天合稳健债券型证券投资基金、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、富国信用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灵活配置证券投资基金、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、富国可转债债券证券投资基金、上证50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、富国天添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、富国新天鑫定期开放债券型证券投资基金、富国沪港深基础行业股票型证券投资基金、富国天利定期开放债券型证券投资基金、富国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、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金、富国目标收益三年期纯债债券型证券投资基金、富国信用利分级债券型证券投资基金、富国利利分级债券型证券投资基金中证500证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金投资总监)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		
袁宜	本基金基金经理兼任权益证券投资基金经理	2013-04-12	-	7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投资策略官,2011年3月至2012年10月任基金经理助理,2012年10月起任权益证券投资基金经理,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为本基金基金合同生效日。

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宏观策略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》、《富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及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,确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、投资执行、业绩评估等投资管理环节,以及信息披露、事后监督、事后评估及反馈的流程化管理,在制度、操作层面确保相关资产公平对待、公正分配、合理投资、独立决策、公平交易