富国强收益定期开放债券型证券投资基金

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1月1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	富国强收益定期开放债券	
基金主代码	100070	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年12月18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	138,993,730.82份	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	富国强收益A/B	富国强收益C
下属两级基金的交易代码	100070	100071
报告期末下属两级基金的份额总额	76,687,254.01份	62,306,476.81份

2.2基金产品说明

投资目标	本基金投资目标是在追求本金长期安全的基础上，力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金在普通债券的投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，采用久期控制下的主动性投资策略，主要包括：久期控制、期限结构配置、信用风险控制、跨市场套利和相对价值判断等管理手段，对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率(税后)+0.5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	范伟男	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

（1）富国强收益A/B

金额单位：人民币元

3.1.1期间数据和指标	2013年	2012年12月18日(基金合同生效日)至2012年12月31日
本期已实现收益	13,441,836.31	471,610.48
本期利润	9,746,659.30	344,060.98
加权平均基金份额本期利润	0.0258	0.0009
本期基金份额净值增长率	2.30%	0.10%
3.1.2期末数据和指标	2013年12月31日	2012年12月31日
期末可供分配基金份额利润	0.0240	0.0009
期末基金资产净值	78,525,993.77	376,607,608.26
期末基金份额净值	1.024	1.001

（2）富国强收益C

金额单位：人民币元

3.1.1期间数据和指标	2013年	2012年12月18日(基金合同生效日)至2012年12月31日
本期已实现收益	13,880,615.24	553,718.22
本期利润	11,785,696.02	384,795.90
加权平均基金份额本期利润	0.0311	0.0008
本期基金份额净值增长率	1.80%	0.10%
3.1.2期末数据和指标	2013年12月31日	2012年12月31日
期末可供分配基金份额利润	0.0188	0.0008
期末基金资产净值	63,480,188.88	498,678,203.06
期末基金份额净值	1.019	1.001

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。

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

（1）富国强收益A/B

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	-1.35%	0.17%	0.89%	0.01%	-2.24%	0.16%
过去六个月	-1.44%	0.13%	1.79%	0.01%	-3.23%	0.12%
过去一年	2.30%	0.12%	3.55%	0.01%	-1.25%	0.11%
自基金合同生效日起至今	2.40%	0.12%	3.68%	0.01%	-1.28%	0.11%

（2）富国强收益C

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	-1.45%	0.18%	0.89%	0.01%	-2.34%	0.17%
过去六个月	-1.64%	0.13%	1.79%	0.01%	-3.43%	0.12%
过去一年	1.80%	0.12%	3.55%	0.01%	-1.75%	0.11%
自基金合同生效日起至今	1.90%	0.12%	3.68%	0.01%	-1.78%	0.11%

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同期中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率（税后）+0.5%。

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=（benchmarkt）按下列公式计算：

benchmarkt =同期中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率（税后）/360+0.5%/360；

其中，t=1，2，3，…，T，T表示时间截至日；

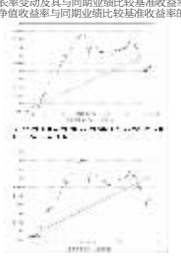
期间T日收益率=（benchmarkT）按下列公式计算：

benchmarkT =[∏Tt=1(1+benchmarkt)]-1

其中，T=2，3，4，…，∏Tt=1(1+benchmarkt)表示1至T日的(1+benchmarkt)数字连乘。

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

（1）自基金合同生效以来富国强收益A/B基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图

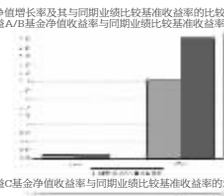


注：截止日期为2013年12月31日。

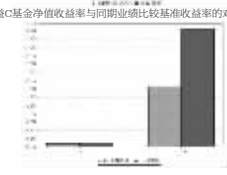
本基金于2012年12月18日成立，建仓期6个月，即从2012年12月18日起至2013年6月17日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

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

（1）自基金合同生效以来富国强收益A/B基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



（2）自基金合同生效以来富国强收益C基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3过去三年基金的利润分配情况

（1）富国强收益A/B

注：基金自2012年12月18日(基金合同生效日)至2013年12月31日未进行利润分配。

（2）富国强收益C

注：基金自2012年12月18日(基金合同生效日)至2013年12月31日未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1基金管理人及基金经理

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月加拿大骏利亚银行（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、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、富国天添盈债券型证券投资基金、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、富国保证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、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四十二只证券投资基金。

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		
冯彬	本基金基金经理兼任富国7天理财宝债券型证券投资基金基金经理、富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理、富国信用增强债券型证券投资基金基金经理、富国国有企业债债券型证券投资基金基金经理	2012-12-18	-	6年	硕士，曾任平安证券有限责任公司债券交易员；光大证券股份有限公司债券投资经理；2012年7月至2012年11月任富国基金管理有限公司基金经理助理；2012年11月起任富国7天理财宝债券型证券投资基金基金经理，2012年12月起任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基金经理，2013年5月起任富国信用增强债券型证券投资基金基金经理，2013年9月起任富国国有企业债债券型证券投资基金基金经理，具有基金从业资格，中国国籍。
邹卉	本基金基金经理兼任富国天时货币市场基金基金经理、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金基金经理、富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理、富国信用债债券型证券投资基金基金经理、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金基金经理、富国恒利分级债券型证券投资基金四十二只证券投资基金。	2013-12-23	-	8年	硕士，曾任上海国泰人寿保险有限公司投资部投资助理，东方基金管理有限公司债券研究员，自2008年9月至2011年7月任富国基金管理有限公司债券研究员，自2011年8月起任富国天时货币市场基金基金经理，2012年5月起任富国新天锋定期开放债券型证券投资基金基金经理，2012年11月起任富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理，2013年6月起任富国信用增强债券型证券投资基金基金经理，2013年12月起任富国强收益定期开放债券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为断先生的任职日期为本基金基金合同生效日，邹卉女士的任职日期为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强收益定期开放债券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》、《富国强收益定期开放债券型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，以尽可能减少利分散投资风险，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、授权、交易执行、业绩评估等投资管理活动环节，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。

事中监控主要包括实时监控交易方向、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强制行为，非经特别授权流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统组合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，程序现异常交易行为，监察稽核部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报基区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资决策委员会签字，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（1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的差方面未出现异常。

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

2013年国内经济季度之间波动较大，全年仍在较高位置徘徊，通胀压力总体可控，CPI仍在较低水平，央行在今年的调控上风格发生较大转变，一方面更具独立性，调控思路偏强硬和稳健，在操作工具上，央票和公开市场操作等手段被正逆回购代替，同时采用了SLO等工具进行短期流动性调节。一季度，由于外汇占款的持续流入，银行间资金面十分宽裕，但进入二季度后，由于外汇套利资金的监管，加上央行的强硬监管，资金面趋紧，并在二季末演变为“钱荒”状态，受此影响，债券出现持续性下跌，直到年末才有所缓解。

本年度，基金管理人坚持严格按照基金合同进行投资管理，根据债券市场环境，在年初建仓时期采取了积极快速建仓的策略，主体仓位以一年期附近品种为主，并配置了一定仓位长期限品种，以博取债券净价上涨的收益。二季末时，进行了一定幅度的减仓，减仓标的以长期限债券为主，缩短了组合久期。三季度大部分时期以谨慎操作为主，四季度时由于组合临近一年期的开放日，操作上以持续减仓为主。建仓时期的短久期策略和下半年的谨慎操作较好的控制了债券净价大幅下跌的冲击，全年为投资人获取了正收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2013年12月31日，本基金富国强收益A/B份额净值为1.024元，份额累计净值为1.024元，本基金富国强收益C份额净值为1.019元，份额累计净值为1.019元。报告期内，本基金富国强收益A/B份额净值增长率为2.30%，同期业绩比较基准收益率为3.55%，本基金富国强收益C份额净值增长率为1.80%，同期业绩比较基准收益率为3.55%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年宏观经济环境不确定性加大，通胀压力有所上升，货币政策预计灵活稳

中趋紧。但整体流动性环境将好于去年。债券市场上，信用风险有局部爆发的可能性。

今年的操作将坚持控制信用风险和久期风险，精选个券，提高整体信用资质，久期大致匹配，同时灵活运用杠杆进行套利操作的策略。

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，必须向估值委员会提供交易记录，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，2013年报告期内本基金未进行收益分配。

§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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

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。

§6 审计报告

7.1资产负债表

会计主体：富国强收益定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2013年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 (2013年12月31日)	上年度末 (2012年12月31日)
资 产：		
银行存款	43,449.10	4,200,195.90
结算备付金	11,435,719.18	-
存出保证金	55,172.65	-
交易性金融资产	300,430,530.00	608,343,396.16
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	300,430,530.00	579,333,226.30
资产支持证券投资	-	29,010,169.86
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	247,701,371.55
应收证券清算款	192,476.70	32,733,898.35
应收利息	5,381,863.67	10,597,899.19
应收股利	-	-
应收申购款	10,009,000.00	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	327,548,211.30	903,576,761.15
负债和所有者权益	本期末 (2013年12月31日)	上年度末 (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	184,199,963.30	-
应付证券清算款	98,016.47	27,943,414.56
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	255,470.56	186,395.66
应付托管费	76,641.16	55,918.69
应付销售服务费	76,532.46	70,799.37
应付交易费用	3,904.70	4,421.55
应交税费	571,500.00	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	260,000.00	30,000.00
负债合计	185,542,028.65	28,290,949.83
所有者权益：		
实收基金	138,993,730.82	874,556,954.44
未分配利润	3,012,451.83	728,856.88
所有者权益合计	142,006,182.65	875,285,811.32
负债和所有者权益总计	327,548,211.30	903,576,761.15

注：报告截止日2013年12月31日，基金份额净值1.022元，基金份额总额138,993,730.82份，其中A/B类基金份额净值1.024元，份额总额76,687,254.01份；C类基金份额净值1.019元，份额总额62,306,476.81份。

7.2利润表

会计主体：富国强收益定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2013年01月01日至2013年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 (2013年01月01日至2013年12月31日)	上年度可比期间(2012年12月18日(基金合同生效日)至2012年12月31日)
一、收入	51,549,018.29	1,076,147.24
1.利息收入	60,723,199.38	1,352,937.24
其中：存款利息收入	529,021.56	40,725.99
债券利息收入	57,820,628.30	384,758.49
资产支持证券利息收入	1,178,115.07	38,454.79
买入返售金融资产收入	1,195,434.45	888,997.97
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-3,752,722.62	19,681.82
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-4,061,552.76	19,681.82
资产支持证券投资收益	308,830.14	-
衍生工具投资收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-5,790,096.23	-296,471.82
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	368,637.76	-
减：二、费用	30,016,662.97	347,290.36
1.管理人报酬	4,691,251.74	186,395.66
2.托管费	1,407,375.49	55,918.69
3.销售服务费	1,568,392.29	70,799.37
4.交易费用	24,373.54	3,976.14
5.利息支出	21,917,642.70	-
其中：卖出回购金融资产支出	21,917,642.70	-
6.其他费用	407,627.21	30,200.50
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	21,532,355.32	728,856.88
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	21,532,355.32	728,856.88

7.3所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国强收益定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2013年01月01日至2013年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 (2013年01月01日至2013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)	874,556,954.44	728,856.88	875,285,811.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	21,532,355.32	21,532,355.32
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)	-735,563,223.62	-19,248,760.37	-754,811,983.99
其中：1.基金申购款	124,170,124.87	4,711,662.24	128,881,787.11
2.基金赎回款	-859,733,348.49	-23,960,422.61	-883,693,771.10
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)	138,993,730.82	3,012,451.83	142,006,182.65

项目	上年度可比期间(2012年12月18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)	874,556,954.44	-	874,556,954.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	728,856.88	728,856.88
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)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	874,556,954.44	728,856.88	875,285,811.32

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：

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

7.4报表附注

7.4.1基金基本情况

富国强收益定期开放债券型证券投资基金（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]1476号文《关于核准富国强收益定期开放债券型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司自2012年11月26日至2012年12月14日止期间向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2012）验字第60467606_B16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12月18日正式生效，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874,430,779.25元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币126,175.19元，以上实收基金（本息）合计为人民币874,556,954.44元，折合874,556,954.44份基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分、质押及买断式回购、协议存款、定期存款、通知存款、资产支持证券等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场的新股申购或增发新股。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%，在每个受限开放期的前10个工作日和后10个工作日，自由开放期的3个月和后3个月以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在开放期本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

本基金的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率（税后）+0.5%。

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，对于在本报告期内所从事的证券投资业务，根据中国证监会证券业协会制定的《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2013年12月31日的财务状况以及2013年度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

本基金财务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。

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）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

（2）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；

（3）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；

（4）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，以该报价为依据确定公允价值；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）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该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。

(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，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；

(2) 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，按照国家最新规定估值

7.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵