富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金

【2014】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：	2014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根据本基金合同规定，于2014年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2014年4月1日起至2014年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国天成红利混合
基金主代码	100029
交易代码	前端交易代码：100029 后端交易代码：100030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年05月28日
报告期末基金份额总额(单位:份)	3,268,219,514.06
投资目标	本基金主要投资于红利型股票与稳健成长型股票，兼顾红利收益与资本增值；力争通过灵活合理的大类资产配置与专业的个券精选，在精细化风险管理的基础上构建优化组合，谋求基金资产的长期稳定增值。
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	中信标普300指数×55%+中信标普国债指数×45%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金，风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金，保本型基金与货币市场基金，属于中高风险的证券投资基金品种。
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(2014年04月01日-2014年06月30日)
1.本期已实现收益	32,421,838.28
2.本期利润	132,697,415.87
3.加权平均基金份额本期利润	0.0406
4.期末基金资产净值	4,350,774,610.41
5.期末基金份额净值	1.3312

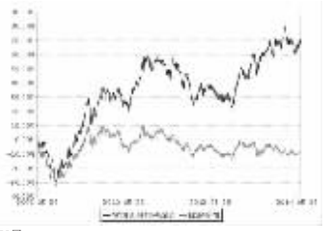
注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	3.04%	0.77%	1.16%	0.48%	1.88%	0.29%

注：过去三个月指2014年4月1日－2014年6月30日

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计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2014年6月30日。
2.本基金于2008年5月28日成立，建仓期6个月，从2008年5月28日至2008年11月27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		
于江勇	本基金基金经理兼任总经理助理和权益专户投资部总经理	2008-05-28	-	18年	硕士，曾任华夏证券研究所研究员；2001年4月任富国基金管理有限公司行业研究员、高级行业研究员，2008年5月至今任富国天成基金经理，兼任总经理助理和权益专户投资部总经理。具有基金从业资格。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明
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不同组合间的交易行为，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。
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。
4.3.2 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成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况，亦未受到监管机构的相关调查。
4.4 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
二季度债券市场在宽松的资金面背景下继续上涨，定向刺激政策逐步推出使得市场对国内经济企稳的预期增强，同时非标投资受到限制，推动信用债的配置需求上升，收益率水平继续下行，信用利差收窄。可转债的估值也得到修复，整体上涨。
报告期内本基金坚持以信用产品为主要标的的投资策略，在收益率下行伴随信用利差收窄的过程中适度降低了对信用债券的投资比例并优化持仓结构，同时在可转债的上涨中也逐步降低了对可转债的投资比例。信用债券的投资收益为本季度基金收益的主要来源，可转债的投资收益增强了基金的投资业绩。
4.4.2 报告期内基金的业绩表现
本报告期，本基金份额净值增长率为5.68%，同期业绩比较基准收益率为3.28%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,027,962,644.27	69.43
	其中：股票	3,027,962,644.27	69.43
2	固定收益投资	697,099,579.50	15.98
	其中：债券	596,169,579.50	13.67
	资产支持证券	100,930,000.00	2.31
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	206,856,750.28	4.74
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	208,684,500.71	4.79
7	其他资产	220,580,909.48	5.06
8	合计	4,361,184,384.24	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	18,209,817.30	0.42
B	采矿业	75,320,716.43	1.73
C	制造业	1,902,831,351.98	43.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,602,294.20	0.27
F	批发和零售业	200,306,581.67	4.60
G	交通运输、仓储和邮政业	49,050,667.62	1.13
H	住宿和餐饮业	36,114,373.14	0.83
I	信息传输、软件和信息技术服务业	265,812,601.48	6.11
J	金融业	257,966,751.49	5.93
K	房地产业	80,764,310.29	1.86
L	租赁和商务服务业	3,986,308.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	31,242,658.28	0.72
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	11,464,541.92	0.26
R	文化、体育和娱乐业	61,570,110.15	1.42
S	综合	21,719,560.32	0.50
	合计	3,027,962,644.27	69.60

5.3 报告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

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	601166	兴业银行	18,857,110	189,136,813.30	4.35
2	002176	江特电机	5,498,573	68,897,119.69	1.58
3	600150	中国船舶	3,127,094	65,856,599.64	1.51
4	300133	华策影视	1,927,077	61,570,110.15	1.42
5	002466	天齐锂业	1,800,000	58,716,000.00	1.35
6	600309	万华化学	3,770,645	57,162,978.20	1.31
7	300217	东方电热	2,740,698	55,882,832.22	1.28
8	002085	万丰奥威	2,574,734	54,738,844.84	1.26
9	002271	东方雨虹	2,144,917	53,301,187.45	1.23
10	002421	达实智能	1,837,471	46,818,761.08	1.08

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	10,080,000.00	0.23
2	央行票据	-	-
3	金融债券	119,830,000.00	2.75
	其中：政策性金融债	89,920,000.00	2.07
4	企业债券	212,119,413.50	4.88
5	企业短期融资券	150,905,000.00	3.47
6	中期票据	40,255,000.00	0.93
7	可转债	62,980,166.00	1.45
8	其他	-	-
9	合计	596,169,579.50	13.70

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	500,000	50,895,000.00	1.17
2	041360061	13润华CP001	500,000	50,575,000.00	1.16
3	011456001	14中交建SCP001	500,000	50,240,000.00	1.15
4	071406002	14安信CP002	500,000	50,090,000.00	1.15
5	122023	09万业债	471,670	47,261,334.00	1.09

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1489014	14开元1A	1,000,000	100,930,000.00	2.32

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
注：本基金本报告期末未持有贵金属。
5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
注：本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 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。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 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。
5.10.2 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。
5.10.3 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。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1 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。
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。
5.11.2 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。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	818,799.03
2	应收证券清算款	200,106,927.24
3	应收股利	-
4	应收利息	17,974,302.20
5	应收申购款	1,680,881.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	220,580,909.48

5.11.4 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	113001	中行转债	50,895,000.00	1.17
2	127002	徐工转债	6,875,554.60	0.16
3	113005	平安转债	5,209,611.40	0.12

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002466	天齐锂业	58,716,000.00	1.35	非公开发行股票
2	300133	华策影视	8,545,251.15	0.20	非公开发行股票

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	3,370,737,740.02
报告期期间基金总申购份额	168,161,942.50
减：报告期期间基金总赎回份额	270,680,168.46
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	3,268,219,514.06

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	-
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
注：本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

§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天成红利灵活配置混合型证券投资基金的文件
2、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金基金合同
3、富国天成红利灵活配置混合型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、富国天成红利灵活配置混合型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

富国基金管理有限公司
2014年07月18日

富国天丰强化收益债券型证券投资基金

【2014】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：	中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：	2014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。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2014年4月1日起至2014年6月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	富国天丰强化债券(LOF)(场内简称:富国天丰)
基金主代码	161010
交易代码	前端交易代码：161010 后端交易代码：161018
基金运作方式	契约型，本基金合同生效后三年内封闭运作，在交易所上市交易，基金合同生效满三年后转为上市开放式。
基金合同生效日	2008年10月24日
报告期末基金份额总额(单位:份)	2,515,584,660.95
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较高的当期收益。
投资策略	本基金按照自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置。一方面根据整体资产配置要求通过积极的投资策略主动寻找风险中蕴藏的投资机会，发掘价格被低估的且符合流动性要求的合适投资品种；另一方面通过风险预算管理、平均剩余期限控制和个券信用等级限定等方式有效控制投资风险，从而在一定的风险限制范围内达到风险收益最佳配比。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中央国债登记结算有限责任公司编制并发布的中债综合指数。
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低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。
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

§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(2014年04月01日-2014年06月30日)
1.本期已实现收益	19,100,320.46
2.本期利润	134,026,686.63
3.加权平均基金份额本期利润	0.0544
4.期末基金资产净值	2,576,746,063.78
5.期末基金份额净值	1.024

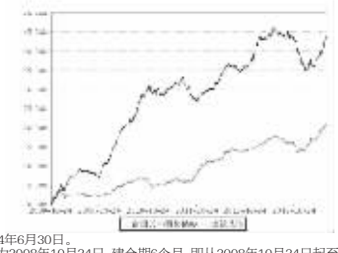
注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	5.68%	0.15%	3.28%	0.08%	2.40%	0.07%

注：过去三个月指2014年4月1日－2014年6月30日

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计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：截止日期为2014年6月30日。
本基金合同生效日为2008年10月24日，建仓期6个月，即从2008年10月24日起至2009年4月23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		
饶刚	本基金基金经理兼任固定收益投资部总经理，富国资产管理(上海)有限公司总经理，富国天利增长债券投资基金基金经理，富国汇利回报分级债券型证券投资基金基金经理，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，富国天盈债券型证券投资基金(LOF)基金经理，富国产业债债券型证券投资基金基金经理	2008-10-24	-	16年	硕士，曾任职兴业证券股份有限公司研究部职员、投资银行部职员；2003年7月任富国基金管理有限公司债券研究员，2006年1月至今任富国天利基金经理，2008年10月起兼任富国天丰基金经理，2010年9月至2013年9月兼任富国汇利分级债券基金经理，2013年9月起兼任富国汇利回报分级债券型证券投资基金基金经理，2013年6月起任富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金基金经理，2013年9月起任富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金基金经理，2014年3月起任富国天盈分级债券型证券投资基金(2014年5月更名为富国天盈债券型证券投资基金(LOF))基金经理，2014年6月起任富国产业债债券型证券投资基金基金经理，兼任固定收益投资部总经理和富国资产管理(上海)有限公司总经理。具有基金从业资格。
钟智伦	本基金基金经理兼任固定收益投资副总监	2008-10-24	-	21年	硕士，曾任平安证券有限责任公司部门经理；上海新世纪投资服务有限公司研究员；海通证券股份有限公司投资经理；2005年5月任富国基金管理有限公司债券研究员；2006年6月至2009年3月任富国天时基金经理；2008年10月至今任富国天丰基金经理；2009年6月至2012年12月任富国优化增强债券基金基金经理；2011年12月至2014年6月任富国产业债债券型证券投资基金基金经理；兼任固定收益投资副总监。具有基金从业资格。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明
本报告期，富国基金管理有限公司作为富国天丰强化收益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》、《富国天丰强化收益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，以为投资者减少和分散风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定收益为目标，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 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
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不同组合间的交易行为，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。
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。
4.3.2 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 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
二季度消费增速下滑，经济下行压力加大，货币政策有所放松。上证综指上涨0.74%，创业板综指数上涨11.27%。基金股票投资维持高仓位，重仓投资品种变化不大。由于市场结构分化显著，部分重仓品种阶段性表现低于预期，基金将加大投资品种的覆盖广度，积极应对市场的变化。
展望下半年，宏观经济微刺激政策频出，改革和转型是经济长期的主线，随着政府改革政策逐步推出和落实，具有核心竞争力和产业整合能力的企业占得先机，同时创新驱动以及直面产业格局变化积极变革的优秀企业迎来新的增长点。
A股市场整体估值处于低位，下跌的风险主要来自高估值股票的长期估值中枢下移。在经济增长方式转变过程中，基金的投资策略也是稳中求进，谨慎选择投资标的。
我们感谢并将继续努力回报基金持有人的信任！
4.4.2 报告期内基金的业绩表现
本报告期，本基金份额净值增长率为5.03%，同期业绩比较基准收益率为1.04%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,611,568,778.41	94.16
	其中：股票	2,611,568,778.41	94.16
2	固定收益投资	150,058,000.00	5.41
	其中：债券	150,058,000.00	5.41
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,044,109.93	0.04
7	其他资产	10,927,826.74	0.39
8	合计	2,773,598,715.08	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	68,524,595.16	2.48
B	采矿业	1,620.60	0.00
C	制造业	1,802,924,294.96	65.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	156.57	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	245,490,976.28	8.88
G	交通运输、仓储和邮政业	4,762.02	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	270,831,450.63	9.80
J	金融业	202,338,829.39	7.32
K	房地产业	83,272.79	0.00
L	租赁和商务服务业	4,153.50	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	21,364,666.51	0.77
S	综合	-	-
	合计	2,611,568,778.41	94.46

5.3 报告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

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	600570	恒生电子	9,211,891	270,829,595.40	9.80
2	600887	伊利股份	7,710,887	255,384,577.44	9.24
3	002215	诺普信	30,096,599	225,122,560.52	8.14
4	002293	罗莱家纺	10,538,180	211,817,418.00	7.66
5	000712	锦龙股份	13,552,422	202,337,660.46	7.32
6	600060	海信电器	18,650,151	179,973,957.15	6.51
7	600563	法拉电子	5,220,072	173,567,394.00	6.28
8	002223	鱼跃医疗	7,075,294	171,575,879.50	6.21
9	000581	威孚高科	6,354,813	171,389,306.61	6.20
10	002024	苏宁云商	24,670,954	161,841,458.24	5.85

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	10,001,000.00	0.36
2	央行票据	-	-
3	金融债券	140,057,000.00	5.07
	其中：政策性金融债	140,057,000.00	5.07
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	150,058,000.00	5.43

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130236	13国开36	500,000	50,010,000.00	1.81
2	130227	13国开27	400,000	40,000,000.00	1.45
3	130243	13国开43	300,000	30,033,000.00	1.09
4	130322	13进出22	200,000	20,014,000.00	0.72
5	130014	13附息国债14	100,000	10,001,000.00	0.36

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
注：本基金本报告期末未持有贵金属。
5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
注：本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 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。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 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。
5.10.2 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。
5.10.3 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。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1 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。
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。
5.11.2 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。
本基金本报告期末未持有股票资产。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	151,710.88
2	应收证券清算款	1,953,710.53
3	应收股利	-
4	应收利息	82,001,054.25
5	应收申购款	20,084,532.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	104,191,007.82

5.11.4 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	113001	中行转债	223,938,000.00	8.69
2	113002	工行转债	183,396,000.00	7.12
3	110023	民生转债	174,464,000.00	6.77
4	110015	石化转债	43,188,000.00	1.68
5	113005	平安转债	39,309,760.00	1.53
6	113003	重工转债	26,686,600.00	1.04
7	110020	南山转债	13,816,915.20	0.54

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注：本基金本报告期末未持有股票资产。
5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	2,907,917,117.08
报告期期间基金总申购份额	55,819,967.71
减：报告期期间基金总赎回份额	183,468,462.14
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	2,780,268,622.65

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	-
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
注：本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

§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天丰强化收益债券型证券投资基金的文件
2、富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金合同
3、富国天丰强化收益债券型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、富国天丰强化收益债券型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