

富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金

【2012】年度报告摘要

证券从业的涵义遵照行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

2. 本公司于2012年9月8日、9月26日在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站上做公告，聘任贺斌先生担任本基金基金经理，宋小龙先生不再担任本基金基金经理。

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《富国天瑞强势地区精选混合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，以尽可能减少和分散投资风险，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约定。

4.3 管理人对于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系统

本基金管理人根据相关法律法规，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、事后评估及反馈的精细化管理。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，并维持各组合的独立投资决策权。事中控制包括：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价格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。事后监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲占的控制、银行间市场交易价格的公允性评估等。3、将主投资组合的同一时间反向交易行为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同一时间、同一投资标的采用相同投资策略的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理不同组合的，交易对手和操作流程进行自动化控制。

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）的季节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控制，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）、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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期，在同向交易分析方面，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）的同向交易行为，在假同向交易行为差率为95%的置信水平下，同向交易行为差分分布假设检验并对检验结果进行解读分析。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行为方面未出现异常。

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。

公司旗下管理的投资组合在交易所公开竞价同向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，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现3次同向反向交易成交额较少的单边交易量超过该组合当日成交额5%的情况。

4.4 管理人对于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业绩表现说明
回顾2012年A股市场，年初政策放松预期和流动性压力有所改善等因素推动市场企稳回升，但随后在国内经济和企业盈利增速下滑、海外避险危机冲击等负面因素的影响下，市场调整回落。年末在国内经济和企业盈利增速逐步回升、政策预期改善等因素的影响下，市场强势回升。

2012年，本基金行业配置以经济先行行业为主，其次对景气改善和受益于中长期发展主题的行业也进行了积极配置和操作。

4.4.2 报告期内基金的投资表现
截至2012年12月31日，本基金份额净值为0.7819元，份额累计净值为3.2864元。报告期内，本基金份额净值增长率为13.01%，同期业绩比较基准收益率为3.37%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望未来，随着对经济基本面和企业盈利预期的改善，A股市场仍有坚实基础。本基金将积极关注受益于经济复苏和经济增长结构转型的行业的投资机会。

本基金感谢投资者的信任和支持，我们将勤勉尽责，坚持价值投资理念，努力把握行业、公司和市场机会，争取为投资者创造更大的收益。

4.6 管理人对于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建立了估值委员会，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构，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、提供并评估估值技术、执行估值政策和程序、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。基金估值是估值委员会的重要职责，必须严格依照估值委员会的定期会议，提出基金估值流程及估值技术中存在的潜在问题，参与估值程序和技术决策。估值委员会各方不存在任何利益冲突。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
根据相关法律法规及基金合同的约定以及基金的实际运作情况，2012年报告期末本基金未满足收益分配条件，故不进行收益分配。

5.1 基金管理人对于报告期内基金投资表现说明

在托管富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金的过程中，本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金基金合同》、《富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金托管协议》的约定，对富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金管理人—富国基金管理有限公司2012年1月1日至2012年12月31日基金的投资运作进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 管理人对于报告期内基金投资运作遵信情况、净值计算、利润分配等情况的说明
本托管人认为，富国基金管理有限公司在富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金净值申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见
本托管人认为，富国基金管理有限公司编制的富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

6. 审计报告

本基金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。

7. 年度财务报表

7.1 资产负债表
会计主体：富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金
报告截止日：2012年12月31日
单位：人民币元

资产	本期末 (2012年12月31日)	上年度末 (2011年12月31日)
银行存款	176,124,984.65	27,815,399.26
结算备付金	3,339,406.20	2,832,035.43
存出保证金	2,534,911.89	2,471,407.54
交易性金融资产	4,969,456,993.90	4,910,658,499.21
其中：股票投资	4,919,431,993.90	4,610,458,491.71
基金投资	—	—
债券投资	50,025,000.00	300,200,000.00
资产支持证券投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	536,522,205.08	—
应收证券清算款	81,537,856.59	—
应收利息	1,569,249.43	5,014,232.37
应收股利	—	—
应收申购款	2,384,044.26	394,089.05
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	5,773,469,652.00	4,949,185,655.36

负债和所有者权益	本期末 (2012年12月31日)	上年度末 (2011年12月31日)
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	—	—
应付证券清算款	2,258,416.08	—
应付赎回款	6,759,421.97	1,016,303.03
应付管理人报酬	6,740,949.24	6,210,859.08
应付托管费	1,123,491.54	1,035,143.17
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	3,677,215.48	1,636,337.49
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	2,430,914.75	2,490,413.45
负债合计	22,990,409.06	12,389,056.22

所有者权益	本期末 (2012年12月31日)	上年度末 (2011年12月31日)
实收基金	3,099,211,424.85	3,006,855,788.20
未分配利润	2,651,267,818.09	1,929,940,810.94
所有者权益合计	5,750,479,242.94	4,936,796,599.14
负债和所有者权益总计	5,773,469,652.00	4,949,185,655.36

注：报告截止日2012年12月31日，基金份额净值0.7819元，基金份额总额7,354,326,021.90份。

7.2 利润表
会计主体：富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金
报告截止日：2012年12月31日
单位：人民币元

项目	本期 (2012年01月01日至2012年12月31日)	上年度可比期间 (2011年01月01日至2011年12月31日)
一、收入	732,922,429.07	-523,082,054.66
1.利息收入	13,905,945.01	11,321,755.43
其中：存款利息收入	2,151,809.18	733,192.03
债券利息收入	8,931,764.89	10,588,563.60
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	2,840,290.87	—
其他利息收入	—	—
2.投资收益(损失以“-”填列)	-645,552,392.49	-61,593,195.59
其中：股票投资收益	-705,981,101.84	-102,835,283.94
基金投资收益	189,400.00	-2,251,074.91
资产支持证券投资收益	—	—
衍生工具投资收益	—	—
股利收益	60,239,309.35	43,493,163.26
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	1,362,423,556.31	-475,055,969.01
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	—	—
5.其他收入(损失以“-”号填列)	2,145,319.34	2,245,354.51
其中：—费用	124,531,002.24	121,190,184.50
1.管理人报酬	83,463,740.88	84,268,422.20
2.托管费	13,910,623.41	14,044,737.05
3.销售服务费	—	—
4.交易费用	26,703,441.25	22,065,342.35
利息支出	—	388,375.05
其他费用	435,226.70	423,307.85
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	608,409,426.83	-644,272,238.96
减：所得税费用	—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	608,409,426.83	-644,272,238.96

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体：富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金
报告截止日：2012年12月31日
单位：人民币元

项目	本期 (2012年01月01日至2012年12月31日)	上年度可比期间 (2011年01月01日至2011年12月31日)
一、收入	732,922,429.07	-523,082,054.66
1.利息收入	13,905,945.01	11,321,755.43
其中：存款利息收入	2,151,809.18	733,192.03
债券利息收入	8,931,764.89	10,588,563.60
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	2,840,290.87	—
其他利息收入	—	—
2.投资收益(损失以“-”填列)	-645,552,392.49	-61,593,195.59
其中：股票投资收益	-705,981,101.84	-102,835,283.94
基金投资收益	189,400.00	-2,251,074.91
资产支持证券投资收益	—	—
衍生工具投资收益	—	—
股利收益	60,239,309.35	43,493,163.26
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	1,362,423,556.31	-475,055,969.01
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	—	—
5.其他收入(损失以“-”号填列)	2,145,319.34	2,245,354.51
其中：—费用	124,531,002.24	121,190,184.50
1.管理人报酬	83,463,740.88	84,268,422.20
2.托管费	13,910,623.41	14,044,737.05
3.销售服务费	—	—
4.交易费用	26,703,441.25	22,065,342.35
利息支出	—	388,375.05
其他费用	435,226.70	423,307.85
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	608,409,426.83	-644,272,238.96
减：所得税费用	—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	608,409,426.83	-644,272,238.96

7.4 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体：富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金
报告截止日：2012年12月31日
单位：人民币元

项目	本期 (2012年01月01日至2012年12月31日)	上年度可比期间 (2011年01月01日至2011年12月31日)
一、收入	732,922,429.07	-523,082,054.66
1.利息收入	13,905,945.01	11,321,755.43
其中：存款利息收入	2,151,809.18	733,192.03
债券利息收入	8,931,764.89	10,588,563.60
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	2,840,290.87	—
其他利息收入	—	—
2.投资收益(损失以“-”填列)	-645,552,392.49	-61,593,195.59
其中：股票投资收益	-705,981,101.84	-102,835,283.94
基金投资收益	189,400.00	-2,251,074.91
资产支持证券投资收益	—	—
衍生工具投资收益	—	—
股利收益	60,239,309.35	43,493,163.26
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	1,362,423,556.31	-475,055,969.01
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	—	—
5.其他收入(损失以“-”号填列)	2,145,319.34	2,245,354.51
其中：—费用	124,531,002.24	121,190,184.50
1.管理人报酬	83,463,740.88	84,268,422.20
2.托管费	13,910,623.41	14,044,737.05
3.销售服务费	—	—
4.交易费用	26,703,441.25	22,065,342.35
利息支出	—	388,375.05
其他费用	435,226.70	423,307.85
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	608,409,426.83	-644,272,238.96
减：所得税费用	—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	608,409,426.83	-644,272,238.96

7.5 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体：富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金
报告截止日：2012年12月31日
单位：人民币元

项目	本期 (2012年01月01日至2012年12月31日)	上年度可比期间 (2011年01月01日至2011年12月31日)
一、收入	732,922,429.07	-523,082,054.66
1.利息收入	13,905,945.01	11,321,755.43
其中：存款利息收入	2,151,809.18	733,192.03
债券利息收入	8,931,764.89	10,588,563.60
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	2,840,290.87	—
其他利息收入	—	—
2.投资收益(损失以“-”填列)	-645,552,392.49	-61,593,195.59
其中：股票投资收益	-705,981,101.84	-102,835,283.94
基金投资收益	189,400.00	-2,251,074.91
资产支持证券投资收益	—	—
衍生工具投资收益	—	—
股利收益	60,239,309.35	43,493,163.26
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	1,362,423,556.31	-475,055,969.01
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	—	—
5.其他收入(损失以“-”号填列)	2,145,319.34	2,245,354.51
其中：—费用	124,531,002.24	121,190,184.50
1.管理人报酬	83,463,740.88	84,268,422.20
2.托管费	13,910,623.41	14,044,737.05
3.销售服务费	—	—
4.交易费用	26,703,441.25	22,065,342.35
利息支出	—	388,375.05
其他费用	435,226.70	423,307.85
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	608,409,426.83	-644,272,238.96
减：所得税费用	—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	608,409,426.83	-644,272,238.96

7.6 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体：富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金
报告截止日：2012年12月31日
单位：人民币元

项目	本期 (2012年01月01日至2012年12月31日)	上年度可比期间 (2011年01月01日至2011年12月31日)
一、收入	732,922,429.07	-523,082,054.66
1.利息收入	13,905,945.01	11,321,755.43
其中：存款利息收入	2,151,809.18	733,192.03
债券利息收入	8,931,764.89	10,588,563.60
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	2,840,290.87	—
其他利息收入	—	—
2.投资收益(损失以“-”填列)	-645,552,392.49	-61,593,195.59
其中：股票投资收益	-705,981,101.84	-102,835,283.94
基金投资收益	189,400.00	-2,251,074.91
资产支持证券投资收益	—	—
衍生工具投资收益	—	—
股利收益	60,239,309.35	43,493,163.26
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	1,362,423,556.31	-475,055,969.01
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	—	—
5.其他收入(损失以“-”号填列)	2,145,319.34	2,245,354.51
其中：—费用	124,531,002.24	121,190,184.50
1.管理人报酬	83,463,740.88	84,268,422.20
2.托管费	13,910,623.41	14,044,737.05
3.销售服务费	—	—
4.交易费用	26,703,441.25	22,065,342.35
利息支出	—	388,375.05
其他费用	435,226.70	423,307.85
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	608,409,426.83	-644,272,238.96
减：所得税费用	—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	608,409,426.83	-644,272,238.96

7.7 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体：富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金
报告截止日：2012年12月31日
单位：人民币元

2.投资收益(损失以“-”填列)	-645,552,392.49	-61,593,195.59
其中：股票投资收益	-705,981,101.84	-102,835,283.94
基金投资收益	-	-
债券投资收益	189,400.00	-2,251,074.91
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具投资收益	-	-
股利收益	60,239,309.35	43,493,163.26
3.公允价值变动收益(损失以“-”填列)	1,362,423,556.31	-475,055,969.01
4.汇兑收益(损失以“-”填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”填列)	2,145,319.34	2,245,354.51