

富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金

【2013】第四季度报告

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01月22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。
基金管理人富国基金管理有限公司根据本基金合同约定,于2014年1月20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。投资者有风险,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2013年10月1日起至2013年12月31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
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)	3,047,505,637.61

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;力争通过灵活运用的大类资产配置与专业的个股精选,在控制化风险的前提下,构建优化组合,谋求基金资产的长期稳定增值。

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。

业绩比较基准
中信标普300指数x55%+中信标普国债指数x45%

本基金是一只主动投资的混合型基金,风格稳健,追求长期资本增值。本基金以沪深300指数为业绩比较基准,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

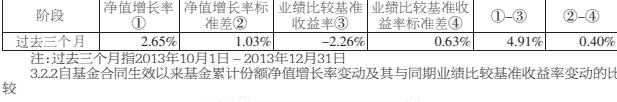
主要财务指标	报告期(2013年10月01日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	35,926,252.91
2.本期利润	86,692,173.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.0374
4.期末基金资产净值	4,097,109,964.13
5.期末基金份额净值	1.3444

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),计入费用后实际收益水平低于所列数字。本期已实现收益收益本期利息收入、投资收益和其他收入(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	业绩比较基准②	收益差③	基准差率④
过去三个月	2.65%	1.03%	-2.26%	0.63%
过去六个月	4.91%	2.40%	-2.49%	0.40%

注:过去三个月指2013年10月1日-2013年12月31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2013年12月31日。
2.本基金成立于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 基金管理人(或基金基金经理)简介

姓名	职务	在本基金的基金经理年限	证券从业年限	说明
干江勇	本基金基金经理、兼任权益投资总监	2008-05-28	17年	硕士,曾任华夏证券研究所研究员,2001年5月加入富国基金管理有限公司,2008年5月至今任富国天成红利基金经理,兼任权益投资总监。具有基金从业资格,中国国籍。

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成红利灵活配置混合型证券投资基金的基金管理人,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》、《富国天成红利灵活配置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,确保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增值为目标,管理和运用基金资产,无损害基金份额持有人利益的行为,基金投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易制度的执行情况
本基金管理人根据相关法律法规要求,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交易知情权、均等交易机会,并持续保持各组合的独立投资决策能力。

事前控制主要控制: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、交易对手和交易权限进行自动化控制。

事中监控主要控制: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、交易对手和交易权限进行自动化控制。

事后评估及反馈主要控制:1.一级市场,通过交易系统的交易对手库、交易对手库及授权管理的合理性分析评估,以及不同时间窗口(1日、3日、5日)的季度公平交易分析评估等。2.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,并重点分析不同类型(股票型、混合型、债券型)间、不同产品间以及同一基金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,监察稽核部情况要求相关当事人做出合理解释,并按法规要求上报监管部门;2.季度公平性交易分析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,以备备查。

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	业绩比较基准②	收益差③	基准差率④
过去三个月	0.39%	1.41%	-0.99%	0.91%
过去六个月	2.30%	2.40%	-0.10%	0.50%

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),计入费用后实际收益水平低于所列数字。本期已实现收益收益本期利息收入、投资收益和其他收入(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	业绩比较基准②	收益差③	基准差率④
过去三个月	0.39%	1.41%	-0.99%	0.91%
过去六个月	2.30%	2.40%	-0.10%	0.50%

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),计入费用后实际收益水平低于所列数字。本期已实现收益收益本期利息收入、投资收益和其他收入(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	业绩比较基准②	收益差③	基准差率④
过去三个月	0.39%	1.41%	-0.99%	0.91%
过去六个月	2.30%	2.40%	-0.10%	0.50%

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),计入费用后实际收益水平低于所列数字。本期已实现收益收益本期利息收入、投资收益和其他收入(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	业绩比较基准②	收益差③	基准差率④
过去三个月	0.39%	1.41%	-0.99%	0.91%
过去六个月	2.30%	2.40%	-0.10%	0.50%

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),计入费用后实际收益水平低于所列数字。本期已实现收益收益本期利息收入、投资收益和其他收入(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	业绩比较基准②	收益差③	基准差率④
过去三个月	0.39%	1.41%	-0.99%	0.91%
过去六个月	2.30%	2.40%	-0.10%	0.50%

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),计入费用后实际收益水平低于所列数字。本期已实现收益收益本期利息收入、投资收益和其他收入(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	业绩比较基准②	收益差③	基准差率④
过去三个月	0.39%	1.41%	-0.99%	0.91%
过去六个月	2.30%	2.40%	-0.10%	0.50%

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),计入费用后实际收益水平低于所列数字。本期已实现收益收益本期利息收入、投资收益和其他收入(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	业绩比较基准②	收益差③	基准差率④
过去三个月	0.39%	1.41%	-0.99%	0.91%
过去六个月	2.30%	2.40%	-0.10%	0.50%

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),计入费用后实际收益水平低于所列数字。本期已实现收益收益本期利息收入、投资收益和其他收入(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	业绩比较基准②	收益差③	基准差率④
过去三个月	0.39%	1.41%	-0.99%	0.91%
过去六个月	2.30%	2.40%	-0.10%	0.50%

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),计入费用后实际收益水平低于所列数字。本期已实现收益收益本期利息收入、投资收益和其他收入(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	业绩比较基准②	收益差③	基准差率④
过去三个月	0.39%	1.41%	-0.99%	0.91%
过去六个月	2.30%	2.40%	-0.10%	0.50%

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),计入费用后实际收益水平低于所列数字。本期已实现收益收益本期利息收入、投资收益和其他收入(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	业绩比较基准②	收益差③	基准差率④
过去三个月	0.39%	1.41%	-0.99%	0.91%
过去六个月	2.30%	2.40%	-0.10%	0.50%

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),计入费用后实际收益水平低于所列数字。本期已实现收益收益本期利息收入、投资收益和其他收入(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	业绩比较基准②	收益差③	基准差率④
过去三个月	0.39%	1.41%	-0.99%	0.91%
过去六个月	2.30%	2.40%	-0.10%	0.50%

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),计入费用后实际收益水平低于所列数字。本期已实现收益收益本期利息收入、投资收益和其他收入(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	业绩比较基准②	收益差③	基准差率④
过去三个月	0.39%	1.41%	-0.99%	0.91%
过去六个月	2.30%	2.40%	-0.10%	0.50%

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),计入费用后实际收益水平低于所列数字。本期已实现收益收益本期利息收入、投资收益和其他收入(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	业绩比较基准②	收益差③	基准差率④
过去三个月	0.39%	1.41%	-0.99%	0.91%
过去六个月	2.30%	2.40%	-0.10%	0.50%

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),计入费用后实际收益水平低于所列数字。本期已实现收益收益本期利息收入、投资收益和其他收入(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	业绩比较基准②	收益差③	基准差率④
过去三个月	0.39%	1.41%	-0.99%	0.91%
过去六个月	2.30%	2.40%	-0.10%	0.50%

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),计入费用后实际收益水平低于所列数字。本期已实现收益收益本期利息收入、投资收益和其他收入(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	业绩比较基准②	收益差③	基准差率④
过去三个月	0.39%	1.41%	-0.99%	0.91%
过去六个月	2.30%	2.40%	-0.10%	0.50%

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),计入费用后实际收益水平低于所列数字。本期已实现收益收益本期利息收入、投资收益和其他收入(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	业绩比较基准②	收益差③	基准差率④
过去三个月	0.39%	1.41%	-0.99%	0.91%
过去六个月	2.30%	2.40%	-0.10%	0.50%

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),计入费用后实际收益水平低于所列数字。本期已实现收益收益本期利息收入、投资收益和其他收入(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	业绩比较基准②	收益差③	基准差率④
过去三个月	0.39%	1.41%	-0.99%	0.91%
过去六个月	2.30%	2.40%	-0.10%	0.50%

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),计入费用后实际收益水平低于所列数字。本期已实现收益收益本期利息收入、投资收益和其他收入(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	业绩比较基准②	收益差③	基准差率④
过去三个月	0.39%	1.41%	-0.99%	0.91%
过去六个月	2.30%	2.40%	-0.10%	0.50%

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),计入费用后实际收益水平低于所列数字。本期已实现收益收益本期利息收入、投资收益和其他收入(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	业绩比较基准②	收益差③	基准差率④
过去三个月	0.39%	1.41%	-0.99%	0.91%
过去六个月	2.30%	2.40%	-0.10%	0.50%

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),计入费用后实际收益水平低于所列数字。本期已实现收益收益本期利息收入、投资收益和其他收入(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	业绩比较基准②	收益差③	基准差率④
过去三个月	0.39%	1.41%	-0.99%	0.91%
过去六个月	2.30%	2.40%	-0.10%	0.50%

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),计入费用后实际收益水平低于所列数字。本期已实现收益收益本期利息收入、投资收益和其他收入(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	业绩比较基准②	收益差③	基准差率④
过去三个月	0.39%	1.41%	-0.99%	0.91%
过去六个月	2.30%	2.40%	-0.10%	0.50%

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),计入费用后实际收益水平低于所列数字。本期已实现收益收益本期利息收入、投资收益和其他收入(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	业绩比较基准②	收益差③	基准差率④
过去三个月	0.39%	1.41%	-0.99%	0.91%
过去六个月	2.30%	2.40%	-0.10%	0.50%

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),计入费用后实际收益水平低于所列数字。本期已实现收益收益本期利息收入、投资收益和其他收入(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	业绩比较基准②	收益差③	基准差率④
过去三个月	0.39%	1.41%	-0.99%	0.91%
过去六个月	2.30%	2.40%	-0.10%	0.50%

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),计入费用后实际收益水平低于所列数字。本期已实现收益收益本期利息收入、投资收益和其他收入(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	业绩比较基准②	收益差③	基准差率④
过去三个月	0.39%	1.41%	-0.99%	0.91%
过去六个月	2.30%	2.40%	-0.10%	0.50%

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),计入费用后实际收益水平低于所列数字。本期已实现收益收益本期利息收入、投资收益和其他收入(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	业绩比较基准②	收益差③	基准差率④
过去三个月	0.39%	1.41%	-0.99%	0.91%
过去六个月	2.30%	2.40%	-0.10%	0.50%

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),计入费用后实际收益水平低于所列数字。本期已实现收益收益本期利息收入、投资收益和其他收入(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	业绩比较基准②	收益差③	基准差率④
过去三个月	0.39%	1.41%	-0.99%	0.91%
过去六个月	2.30%	2.40%	-0.10%	0.50%

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),计入费用后实际收益水平低于所列数字。本期已实现收益收益本期利息收入、投资收益和其他收入(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	业绩比较基准②	收益差③	基准差率④
过去三个月	0.39%	1.41%	-0.99%	0.91%
过去六个月	2.30%	2.40%	-0.10%	0.50%

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