

富国强回报定期开放债券型证券投资基金

[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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年01月22日

5.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会有董事声明,并保证本报告不存在虚假记载、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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本报告书的内容,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。

本报告期自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

5.2 基金产品概况

基金简称:富国强回报定期开放债券

基金主代码:100072

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2013年10月29日

报告期末基金份额总额:1,167,470,994.93

本基金投资目标是在追求本基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。

本基金将采用自上而下的方法对基金资产进行动态的资产配置,调整资产的配置比例,并在充分分析组合的股票型、混合型、债券型之间,不同时间以及同一基金经理管理的不同组合的股票型等,主动地选择组合的同向反向交易为判断标准,进行特别的流程审核把关,不得进行同向交易向市场,通过交易系统的投资决策向同向交易的公平性进行特别处理,2,同一基金经理管理的不同组合,对同一标的的投资的相同投资策略,必须通过交易系统采取同向时间下达投资指令,确保公平对待其持有的组合。

事后评估及反馈主要指各组合同一投资标的在临近交易日的同向和反向交易的合理性分析评估,以及不同时间窗口(1日,3日,5日)的季度公平性交易分析评估等。通过公平性交易事后分析评估系统,对涉及公平性交易的事件进行分析评估,分析对象涵盖股票、基金、社保及专户产品,并重新分析组合的股票型、混合型、债券型之间,不同时间以及同一基金经理管理的不同组合的股票型等,主动地选择组合的同向反向交易为判断标准,进行特别的流程审核把关,不得进行同向交易向市场,通过交易系统的投资决策向同向交易的公平性进行特别处理。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本报告书的内容,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。

本报告期自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

5.3 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(2013年10月01日-2013年12月31日) C级

1.本期已实现收益 5,961,821.41 7,330,153.26

2.本期利润 -16,935,872.75 -24,771,431.99

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0342 -0.0380

4.期末基金资产净值 488,172,114.49 675,905,412.02

5.期末基金份额净值 1.000 0.995

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),计算费用后实际收益可能低于单独列示。

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。

3.2.1 本期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

(1) A/B级

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%)

① 3.29% 0.14%

② 1.21% 0.02%

③ 4.50% -4.50%

④ 0.12%

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

(1) 自基金合同生效以来富国强回报定期开放债券A/B基金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

3.3.1 基金净值表现

3.3.2 本期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

(1) A/B级

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%)

① 3.29% 0.14%

② 1.21% 0.02%

③ 4.50% -4.50%

④ 0.12%

注:过去三个月指2013年10月1日-2013年12月31日

3.3.3 本期报告期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

3.4.1 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

郑迎迎 本基金基金经理兼理财总监 2013-01-29 - 6年 硕士,曾任农银汇理基金管理有限公司行业研究员,2011年8月至2012年10月任富国基金管理有限公司债券研究员,2012年10月起任本基金7天理财债券型证券投资基金基金经理,2013年1月起任本基金债券基金经理,2013年3月起任本基金债券基金经理,2013年6月起任本基金债券基金经理,2013年12月起任本基金债券基金经理,2014年1月起任本基金债券基金经理,2014年6月起任本基金基金经理兼理财总监。

黄纪亮 本基金基金经理 2013-02-26 - 6年 硕士,曾任国泰君安证券股份有限公司助理研究员,2012年11月至2013年2月任国泰君安证券股份有限公司助理研究员,2013年2月起任本基金债券基金经理,2013年3月起任本基金债券基金经理,2013年6月起任本基金债券基金经理,2013年12月起任本基金债券基金经理,2014年1月起任本基金债券基金经理,2014年6月起任本基金基金经理兼理财总监。

4.2 报告期内本基金运作合规情况说明

本基金管理人严格按照相关法律法规要求,结合实际情况,制定了内部的《公平交易管理方法》,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,实行事前审批、事中监控、事后评估及反馈的全流程管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等知情权,均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

4.3 前期控制主要包括: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

价公允性进行审核;2、二级市场,通过交易系统的投资决策向同向交易的公平性进行特别处理。

4.4 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照相关法律法规要求,结合实际情况,制定了内部的《公平交易管理方法》,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,实行事前审批、事中监控、事后评估及反馈的全流程管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等知情权,均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

4.5 前期控制主要包括: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

价公允性进行审核;2、二级市场,通过交易系统的投资决策向同向交易的公平性进行特别处理。

4.6 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照相关法律法规要求,结合实际情况,制定了内部的《公平交易管理方法》,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,实行事前审批、事中监控、事后评估及反馈的全流程管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等知情权,均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

4.7 前期控制主要包括: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

价公允性进行审核;2、二级市场,通过交易系统的投资决策向同向交易的公平性进行特别处理。

4.8 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照相关法律法规要求,结合实际情况,制定了内部的《公平交易管理方法》,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,实行事前审批、事中监控、事后评估及反馈的全流程管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等知情权,均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

4.9 前期控制主要包括: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

价公允性进行审核;2、二级市场,通过交易系统的投资决策向同向交易的公平性进行特别处理。

4.10 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照相关法律法规要求,结合实际情况,制定了内部的《公平交易管理方法》,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,实行事前审批、事中监控、事后评估及反馈的全流程管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等知情权,均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

4.11 前期控制主要包括: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

价公允性进行审核;2、二级市场,通过交易系统的投资决策向同向交易的公平性进行特别处理。

4.12 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照相关法律法规要求,结合实际情况,制定了内部的《公平交易管理方法》,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,实行事前审批、事中监控、事后评估及反馈的全流程管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等知情权,均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

4.13 前期控制主要包括: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

价公允性进行审核;2、二级市场,通过交易系统的投资决策向同向交易的公平性进行特别处理。

4.14 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照相关法律法规要求,结合实际情况,制定了内部的《公平交易管理方法》,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,实行事前审批、事中监控、事后评估及反馈的全流程管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等知情权,均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

4.15 前期控制主要包括: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

价公允性进行审核;2、二级市场,通过交易系统的投资决策向同向交易的公平性进行特别处理。

4.16 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照相关法律法规要求,结合实际情况,制定了内部的《公平交易管理方法》,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,实行事前审批、事中监控、事后评估及反馈的全流程管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等知情权,均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

4.17 前期控制主要包括: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

价公允性进行审核;2、二级市场,通过交易系统的投资决策向同向交易的公平性进行特别处理。

4.18 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照相关法律法规要求,结合实际情况,制定了内部的《公平交易管理方法》,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,实行事前审批、事中监控、事后评估及反馈的全流程管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等知情权,均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

4.19 前期控制主要包括: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

价公允性进行审核;2、二级市场,通过交易系统的投资决策向同向交易的公平性进行特别处理。

4.20 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照相关法律法规要求,结合实际情况,制定了内部的《公平交易管理方法》,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,实行事前审批、事中监控、事后评估及反馈的全流程管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等知情权,均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

4.21 前期控制主要包括: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

价公允性进行审核;2、二级市场,通过交易系统的投资决策向同向交易的公平性进行特别处理。

4.22 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照相关法律法规要求,结合实际情况,制定了内部的《公平交易管理方法》,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,实行事前审批、事中监控、事后评估及反馈的全流程管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等知情权,均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

4.23 前期控制主要包括: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

价公允性进行审核;2、二级市场,通过交易系统的投资决策向同向交易的公平性进行特别处理。

4.24 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照相关法律法规要求,结合实际情况,制定了内部的《公平交易管理方法》,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,实行事前审批、事中监控、事后评估及反馈的全流程管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等知情权,均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

4.25 前期控制主要包括: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

价公允性进行审核;2、二级市场,通过交易系统的投资决策向同向交易的公平性进行特别处理。

4.26 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照相关法律法规要求,结合实际情况,制定了内部的《公平交易管理方法》,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,实行事前审批、事中监控、事后评估及反馈的全流程管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等知情权,均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

4.27 前期控制主要包括: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

价公允性进行审核;2、二级市场,通过交易系统的投资决策向同向交易的公平性进行特别处理。

4.28 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照相关法律法规要求,结合实际情况,制定了内部的《公平交易管理方法》,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,实行事前审批、事中监控、事后评估及反馈的全流程管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等知情权,均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

4.29 前期控制主要包括:1