富国强回报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：	中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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29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01月29日	
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	
报告期末基金份额总额	1,167,470,994.93份	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	富国强回报定期开放债券A/B	富国强回报定期开放债券C
下属两级基金的交易代码	100072	100073
报告期末下属两级基金的份额总额	488,217,801.55份	679,253,193.38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	本基金将采用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。在认真研判宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，根据整体资产配置策略动态调整大类金融资产的比例；在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上，根据类属资产配置策略对投资组合类属资产进行最优化配置和调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的两年期定期存款基准利率(税后)+1%。
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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	范伟隽	赵会军
	联系电话	021-20361818	010-66105799
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105686，40088080688	95588
传真		021-20361616	010-66105798

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层 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街55号

§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）富国强回报定期开放债券A/B

金额单位：人民币元

3.1.1期间数据和指标	2013年1月29日(基金合同生效日)至2013年12月31日
本期已实现收益	29,125,381.17
本期利润	1,164,404.79
加权平均基金份额本期利润	0.0023
本期基金份额净值增长率	0.00%
3.1.2期末数据和指标	2013年12月31日
期末可供分配基金份额利润	-0.0001
期末基金资产净值	488,172,114.49
期末基金份额净值	1.000

（2）富国强回报定期开放债券C

金额单位：人民币元

3.1.1期间数据和指标	2013年1月29日(基金合同生效日)至2013年12月31日
本期已实现收益	46,141,334.79
本期利润	7,074,452.74
加权平均基金份额本期利润	0.0081
本期基金份额净值增长率	-0.50%
3.1.2期末数据和指标	2013年12月31日
期末可供分配基金份额利润	-0.0049
期末基金资产净值	675,905,412.02
期末基金份额净值	0.995

注：本基金合同生效日为2013年1月29日，截至报告期末本基金合同生效不满一年。

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）富国强回报定期开放债券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	-3.29%	0.14%	1.21%	0.02%	-4.50%	0.12%
过去六个月	-3.29%	0.12%	2.43%	0.01%	-5.72%	0.11%
自基金合同生效日起至今	0.00%	0.11%	4.45%	0.02%	-4.45%	0.09%

（2）富国强回报定期开放债券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	-3.49%	0.14%	1.21%	0.02%	-4.70%	0.12%
过去六个月	-3.59%	0.11%	2.43%	0.01%	-6.02%	0.10%
自基金合同生效日起至今	-0.50%	0.11%	4.45%	0.02%	-4.95%	0.09%

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两年期定期存款基准利率(税后)+1%。

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（benchmark）按下列公式计算：

benchmark =同期中国人民银行公布的两年期定期存款基准利率（税后）/360+1%/360；

其中，t=1，2，3，…，T，T表示时间截至日；

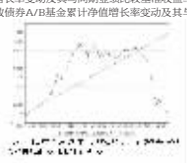
期间T日收益率（benchmarkT）按下列公式计算：

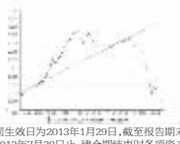
benchmarkT =[∏Tt=1(1+benchmark)]-1

其中，T=2，3，4，…；∏Tt=1(1+benchmark)表示t日至T日的(1+benchmark)数学连乘。

3.2.2日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



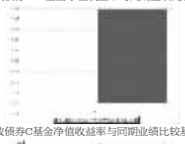


注：1.截止日期为2013年12月31日。本基金合同生效日为2013年1月29日，截至报告期末本基金合同生效不满一年。

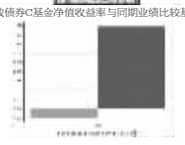
2.本基金建仓期6个月，即从2013年1月29日至2013年7月28日止，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

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回报定期开放债券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回报定期开放债券C基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2013年按实际存续期计算。

3.3过去三年基金的利润分配情况

（1）富国强回报定期开放债券A/B

注：基金自2013年1月29日(基金合同生效日)至2013年12月31日未进行利润分配。

（2）富国强回报定期开放债券C

注：基金自2013年1月29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月加拿大蒙特利尔银行（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、富国天博创新主题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、富国沪深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		
郑迎迎	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	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月起任富国7天理财宝债券型证券投资基金基金经理，2013年1月起任富国强回报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。
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月任富国基金管理有限公司债券研究员；2013年2月起任富国强回报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郑迎迎女士的任职日期为本基金基金合同生效日，黄纪亮先生的基金经理任职日期为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回报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》、《富国强回报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，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。

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t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价差方面未出现异常。

本报告期内公司旗下基金产品整体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，经济稳固始调结构促改革提供空间，货币稳向紧的步伐逐渐展开，债市先牛后熊，本基金上半年盈利在下半年基本回吐。

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A/B级份额净值为1.000元；本基金C级份额净值为0.995元，份额累计净值为0.995元。报告期内，本基金A/B级份额净值增长率为0.00%，同期业绩比较基准收益率为4.45%；本基金C级份额净值增长率为-0.50%，同期业绩比较基准收益率为4.45%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望展望

展望2014年，稳增长和调结构仍股着在一起，加之利率市场化推进，债券基金货币化操作是一种较为普遍的策略。本基金将秉承风险控制原则，择机加大利率品种和优质信用债品种占比，适度降低杠杆，力争为基金份额持有人带来投资回报。

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，必须列席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年报告期末本基金未满足收益分配条件，故不进行收益分配。

§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

本报告期内，本基金托管人在对富国强回报定期开放债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5)股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6)债券投资收益/(损失)于成交日确认债券投资收益/(损失)，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7)衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8)股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9)公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10费用的确认和计量

(1)基金管理费按前一日基金资产净值的0.6%的年费率逐日计提；

(2)基金托管费按前一日基金资产净值的0.18%的年费率逐日计提；

(3) 基金销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的0.4%年费率计提。

(4)卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5)其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11基金的收益分配政策

(1)在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的20%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4)同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6税项

1.营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

2.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

7.4.7由要财务报表项目的说明

7.4.7.1银行存款

单位：人民币元

项目	本期末(2013年12月31日)
活期存款	1,560,550.83
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计	1,560,550.83

7.4.7.2交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末(2013年12月31日)		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
债券	交易所市场	1,753,838,822.54	1,704,341,366.00	-49,497,456.54
	银行间市场	463,152,401.89	445,622,000.00	-17,530,401.89
	合计	2,216,991,224.43	2,149,963,366.00	-67,027,858.43
资产支持证券		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,216,991,224.43	2,149,963,366.00	-67,027,858.43

7.4.7.3衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4买入返售金融资产

7.4.7.4.1各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购中取得的债券。

7.4.7.5应收利息

单位：人民币元

项目	本期末(2013年12月31日)
应收活期存款利息	563.20
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	42,517.34
应收债券利息	65,679,684.13
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	96.00
合计	65,722,860.67

7.4.7.6其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末(2013年12月31日)
交易所市场应付交易费用	66,791.30
银行间市场应付交易费用	1,095.00
合计	67,886.30

7.4.7.8其他负债

单位：人民币元

项目	本期末(2013年12月31日)
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提审计费	80,000.00
预提信息披露费	100,000.00
合计	180,000.00

7.4.7.9实收基金

富国强回报定期开放债券A/B：

金额单位：人民币元

项目	本期2013年1月29日(基金合同生效日)至2013年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日2013年1月29日	522,943,264.78	522,943,264.78
本期申购	23,894,579.49	23,894,579.49
本期赎回(以"-"号填列)	-58,620,042.72	-58,620,042.72
本期末	488,217,801.55	488,217,801.55

富国强回报定期开放债券C：

金额单位：人民币元

项目	本期2013年1月29日(基金合同生效日)至2013年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日2013年1月29日	1,078,659,509.62	1,078,659,509.62
本期申购	37,515,823.48	37,515,823.48
本期赎回(以"-"号填列)	-436,922,139.72	-436,922,139.72
本期末	679,253,193.38	679,253,193.38

注：(1)申购含红利再投资、转换入份额；赎回含转换出份额。

(2)本基金合同于2013年1月29日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币1,601,261,525.58元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币341,248.82元，以上实收基金（本息）合计为人民币1,601,602,774.40元，折合1,601,602,774.40份基金份额。

7.4.7.10未分配利润

富国强回报定期开放债券A/B：

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日2013年1月29日	-	-	-
本期利润	29,125,381.17	-27,960,976.38	1,164,404.79
本期基金份额交易产生的变动数	-1,767,390.67	557,298.82	-1,210,091.85
其中：基金申购款	563,729.56	63,185.21	626,914.77
基金赎回款	-2,331,120.23	494,113.61	-1,837,006.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,357,990.50	-27,403,677.56	-45,687.06

富国强回报定期开放债券C：

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日2013年1月29日	-	-	-
本期利润	46,141,334.79	-39,066,882.05	7,074,452.74
本期基金份额交易产生的变动数	-11,520,361.38	1,098,127.28	-10,422,234.10
其中：基金申购款	629,383.28	210,956.24	840,339.52
基金赎回款	-12,149,744.66	887,171.04	-11,262,573.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	34,620,973.41	-37,968,754.77	-3,347,781.36

7.4.7.11存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2013年1月29日(基金合同生效日)至2013年12月31日
活期存款利息收入	356,462.93
定期存款利息收入	1,050,555.56
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	886,739.72
其他	4,588.48
合计	2,298,346.69

7.4.7.12股票投资收益

注：本基金本报告期无股票投资收益。

7.4.7.13债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期2013年1月29日(基金合同生效日)至2013年12月31日
卖出债券（、含债转股及债券到期兑付）成交总额	3,636,568,891.69
减：卖出债券（、含债转股及债券到期兑付）成本总额	3,507,942,226.30
减：应收利息总额	110,236,865.75
债券投资收益	18,389,799.64

7.4.7.14资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15衍生工具收益

7.4.7.15.1衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无权证投资收益。

7.4.7.15.2衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无其他衍生工具收益。

7.4.7.16股利收益

注：本基金本报告期无股利收益。

7.4.7.17公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期2013年1月29日(基金合同生效日)至2013年12月31日
1.交易性金融资产	-67,027,858.43
股票投资	-
债券投资	-67,027,858.43
资产支持证券投资	-
基金投资	-
2.衍生工具	-
权证投资	-
3.其他	-
合计	-67,027,858.43

7.4.7.18其他收入

单位：人民币元

项目	本期2013年1月29日(基金合同生效日)至2013年12月31日
基金赎回费收入	604,265.90
合计	604,265.90

7.4.7.19交易费用

单位：人民币元

项目	本期2013年1月29日(基金合同生效日)至2013年12月31日
交易所市场交易费用	665,896.96
银行间市场交易费用	16,850.00
合计	682,746.96

7.4.7.20其他费用

单位：人民币元

项目	本期2013年1月29日(基金合同生效日)至2013年12月31日
审计费用	80,000.00
信息披露费	200,000.00
银行费用	18,686.16
债券账户维护费	21,000.00
其他	900.00
合计	320,586.16

7.4.8关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
海通证券股份有限公司（"海通证券"）	基金管理人的股东、基金代销机构
中银万国证券股份有限公司（"中银万国"）	基金管理人的股东、基金代销机构
山东省国际信托有限公司	基金管理人的股东
蒙特利尔银行	基金管理人的股东
中国工商银行股份有限公司（"工商银行"）	基金托管人、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.9本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.9.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.9.12.1股票交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.9.12.2权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.9.12.3债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2013年1月29日(基金合同生效日)至2013年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)
海通证券	4,602,488,470.17	71.03
申银万国	1,877,374,659.40	28.97

7.4.9.12.4回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2013年1月29日(基金合同生效日)至2013年12月31日	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例(%)
海通证券	96,435,291,000.00	66.28
申银万国	49,061,469,000.00	33.72

7.4.9.12.5应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2013年1月29日(基金合同生效日)至2013年12月31日			
	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
海通证券	462,550.44	72.01	48,137.52	72.07
申银万国	179,822.95	27.99	18,653.78	27.93

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.9.13关联方报酬

7.4.9.13.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期2013年1月29日(基金合同生效日)至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,875,631.51
其中：支付销售机构的客户维护费	4,672,357.98

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.6%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.9.13.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期2013年1月29日(基金合同生效日)至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,362,689.45

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.18%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E× 0.18%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.9.13.3销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期2013年1月29日(基金合同生效日)至2013年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	A/B级	C级	合计
富国基金管理有限公司	-	3,302,873.27	3,302,873.27
合计	-	3,302,873.27	3,302,873.27

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费将专门用于本基金C类基金份额的销售与基金份额持有人服务。在通常情况下，销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.4%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年销售服务费率÷当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，按月支付。

7.4.9.14与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.9.15各关联方投资本基金的情况

7.4.9.15.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.9.15.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.9.16由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期2013年1月29日(基金合同生效日)至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	1,560,550.83	356,462.93

7.4.9.17本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.9.18其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联方交易事项。

7.4.10期末（2013年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.10.12因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.10.13期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌的股票。

7.4.10.14期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.10.14.1银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末2013年12月31日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.10.14.2交易所市场债券正回购

至本报告期末2013年12月31日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币1,144,151,558.00元，分别于2014年1月2日、2014年1月3日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.11有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	2,149,963,366.00	92.27
	其中：债券	2,149,963,366.00	92.27
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金