

信息披露 Disclosure

富国强收益定期开放债券型证券投资基金

2014 半年度报告摘要

基金合同》以及其他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,以尽可能减少并分散投资风险,确保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标,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规及基金合同的约定。

4.3 管理人对于报告期内基金投资情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况
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、事后评估及反馈的闭环化管理。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策略。

事前控制主要包括:1、一级市场,通过标准化的业务流程,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选库、交易对手库及授权管理,对投资标的,通过事前操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括:1、一级市场,通过标准化的业务流程,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选库、交易对手库及授权管理,对投资标的,通过事前操作权限进行自动化控制。

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,以及不同时间段(1日、3日、5日)的券息交易相关性分析评估等。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交易行为进行分析评估,分析对策略公募、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的交易行为,若发现异常交易行为,监督稽核部门要求相关当事人做出合理性解释,并投投要求上报交易所监管机构;2、季度公平性交易分析报告按照基金经理或投资经理签字,并经督察长、总经理审阅签字后,归档备查,以备查。

报告期内因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

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约束。

4.4 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩偏离说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
2014年上半年,实体经济在宏观托底政策和宽松货币环境下,从年初的下滑趋势开始呈现逐步企稳的格局。尤其是近两年来对债券市场影响较大的货币政策,在半年以来开始出现扭转,央行利用SL0和PSL等一系列创新工具对市场流动性进行调节,资金面总体维持了较宽松的格局。
本报告期,基金管理人坚持严格按照基金合同进行投资管理。在年度之初,根据宏观环境有利于债市的判断,采取了积极加仓的配置策略上,增加组合持仓,同时适当拉长久期的操作。加仓品种上,以3到2年左评级为AA和AAA+的城投债和优质公司债为主,同时交易配置了部分长久期城投债。上半年取得了较好的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日,本基金A/B级份额净值为1.062元,份额累计净值为1.062元;本基金C级份额净值为1.06元,份额累计净值为1.06元。报告期内,本基金A/B级份额净值增长率为3.71%,同期业绩比较基准收益率为1.76%;本基金C级份额净值增长率为3.43%,同期业绩比较基准收益率为1.76%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的展望

展望2014下半年,预计债券市场走势将趋于平稳,投资上仍以精选个券,适当降低杠杆水平以锁定部分收益,组合以获取稳定票息收益为主。

4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等问题的说明

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《富国强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,由主运营副经理领导,成员包括基金运营、监督稽核、金融工程方面的业务骨干及相关基金估值,所有相关人员均具有丰富的证券基金行业从业经验。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,保证估值委员会的公允性和合理性,维护基金份额持有人的利益。基金估值是估值委员会的重要成员,必须向估值委员会及时定期会议,提出基金估值流程及估值技术中存在的潜在问题,参与估值程序和改进技术的完善。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期无进行利润分配。
本基金严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

5 报告期末本基金托管人遵守情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的投资过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议以及其他有关规定,不存在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守情况、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的资金资产净值计算、基金利润分配等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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,保证报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:富国强收益定期开放债券型证券投资基金
报告截止日:2014年06月30日

资产	本报告 (2014年06月30日)	上年度末 (2013年12月31日)
货币资金	20,919,071.43	43,449.91
结算备付金	2,617,893.08	11,435,719.18
存出保证金	36,981.00	55,172.65
交易性金融资产	291,933,698.31	300,430,330.00
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	291,933,698.31	300,430,330.00
资产支持证券	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	192,476.70
应收利息	7,265,274.60	5,381,663.67
应收股利	-	-
其他应收款	-	10,009,000.00
预付款项	-	-
应收款项	-	-
其他资产	-	-
资产总计	322,732,918.42	327,548,211.30

负债和所有者权益	本报告 (2014年06月30日)	上年度末 (2013年12月31日)
负债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
应付短期融资款	-	-
应付票据	-	-
应付账款	-	-
应付管理人报酬	97,278.26	255,470.56
应付托管费	29,183.48	76,641.16
应付销售服务费	22,621.42	76,532.46
应付交易费用	-	3,094.70
应交税费	571,500.00	571,500.00
应付利息	-	-
应付股利	-	-
其他应付款	-	-
其他负债	-	-
负债合计	149,898.27	260,000.00
所有者权益:	-	-
实收基金	187,110,287.84	138,993,730.82
资本公积	11,000,174.65	3,012,451.83
所有者权益合计	198,170,462.49	142,066,182.65
负债和所有者权益总计	322,732,918.42	327,548,211.30

注:报告截止日2014年06月30日,基金份额净值1.059元,基金份额总额187,110,287.84份。其中:富国强收益A/B基金份额净值1.062元,基金份额总额121,513,729.23份;富国强收益C基金份额净值1.054元,基金份额总额65,596,558.61份。

6.2 利润表

会计主体:富国强收益定期开放债券型证券投资基金
本报告期:2014年01月01日至2014年06月30日

项目	本期 (2014年01月01日至2014年06月30日)	上年度可比期间 (2013年01月01日至2013年06月30日)
一、收入	12,976,266.96	47,264,474.48
1.利息收入	10,065,907.40	32,892,389.31
其中:存款利息收入	1,200,444.75	27,538,114.14
债券利息收入	9,316,887.16	31,796,442.64
资产支持证券利息收入	-	632,726.16
买入返售金融资产收入	88,575.49	192,627.37
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-3,874,349.40	9,273,140.25
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-3,874,349.40	9,273,140.25
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具投资收益	-	-
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6,084,460.37	4,915,177.34
其他收入	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-10,671,332.12	-23,122,228.18
4.其他业务收入(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他利得(损失以“-”号填列)	154,282.66	185,767.58
二、费用	-	-
1.销售费用	4,044,902.41	16,441,105.21
2.管理费用	143,890.02	233,774.70
3.销售费用	150,799.36	898,289.36
4.其他费用	1,874.55	161,097.05
5.利息支出	3,284,292.99	12,055,791.98
其中:卖出回购金融资产支出	3,284,292.99	12,055,791.98
6.其他费用	171,078.59	204,469.51
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	8,585,362.62	30,825,369.27
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	8,585,362.62	30,825,369.27

注:报告截止日2014年06月30日,基金份额净值1.059元,基金份额总额187,110,287.84份。其中:富国强收益A/B基金份额净值1.062元,基金份额总额121,513,729.23份;富国强收益C基金份额净值1.054元,基金份额总额65,596,558.61份。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:富国强收益定期开放债券型证券投资基金
本报告期:2014年01月01日至2014年06月30日

项目	本期 (2014年01月01日至2014年06月30日)	上年度可比期间 (2013年01月01日至2013年06月30日)
一、期初所有者权益(基金净值)	138,993,730.82	3,012,451.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	8,585,362.62	8,585,362.62
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(本期申购、赎回、转换、转入、转出)	48,116,537.02	-517,439.80
其中:1.基金申购款	81,180,924.58	379,689.77
2.基金赎回款	-33,022,357.54	-897,329.57
四、本期所有者权益(基金净值)	197,110,287.84	11,000,174.65
五、期末所有者权益(基金净值)	198,170,462.49	142,066,182.65

注:报告截止日2014年06月30日,基金份额净值1.059元,基金份额总额187,110,287.84份。其中:富国强收益A/B基金份额净值1.062元,基金份额总额121,513,729.23份;富国强收益C基金份额净值1.054元,基金份额总额65,596,558.61份。

6.4 现金流量表

会计主体:富国强收益定期开放债券型证券投资基金
本报告期:2014年01月01日至2014年06月30日

项目	本期 (2014年01月01日至2014年06月30日)	上年度可比期间 (2013年01月01日至2013年06月30日)
一、经营活动产生的现金流量	12,976,266.96	47,264,474.48
1.销售商品、提供劳务收到的现金	10,065,907.40	32,892,389.31
2.收到的税费返还	-	-
3.收到其他与经营活动有关的现金	1,200,444.75	27,538,114.14
其中:收到其他与经营活动有关的现金	1,200,444.75	27,538,114.14
二、投资活动产生的现金流量	-3,874,349.40	9,273,140.25
1.收回投资收到的现金	-	-
2.取得投资收益收到的现金	-	-
3.处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额	-	-
4.处置子公司及其他营业单位收到的现金净额	-	-
5.收到其他与投资活动有关的现金	-	-
其中:收到其他与投资活动有关的现金	-	-
三、筹资活动产生的现金流量	-	-
1.吸收投资收到的现金	-	-
2.发行债券收到的现金	-	-
3.取得借款收到的现金	-	-
4.收到其他与筹资活动有关的现金	-	-
五、现金及现金等价物净增加额	6,084,460.37	4,915,177.34
六、期初现金及现金等价物余额	20,919,071.43	43,449.91
七、期末现金及现金等价物余额	27,003,531.80	47,865,127.25

注:报告截止日2014年06月30日,基金份额净值1.059元,基金份额总额187,110,287.84份。其中:富国强收益A/B基金份额净值1.062元,基金份额总额121,513,729.23份;富国强收益C基金份额净值1.054元,基金份额总额65,596,558.61份。

6.5 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:富国强收益定期开放债券型证券投资基金
本报告期:2014年01月01日至2014年06月30日

项目	本期 (2014年01月01日至2014年06月30日)	上年度可比期间 (2013年01月01日至2013年06月30日)
一、期初所有者权益(基金净值)	138,993,730.82	3,012,451.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	8,585,362.62	8,585,362.62
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(本期申购、赎回、转换、转入、转出)	48,116,537.02	-517,439.80
其中:1.基金申购款	81,180,924.58	379,689.77
2.基金赎回款	-33,022,357.54	-897,329.57
四、本期所有者权益(基金净值)	197,110,287.84	11,000,174.65
五、期末所有者权益(基金净值)	198,170,462.49	142,066,182.65

注:报告截止日2014年06月30日,基金份额净值1.059元,基金份额总额187,110,287.84份。其中:富国强收益A/B基金份额净值1.062元,基金份额总额121,513,729.23份;富国强收益C基金份额净值1.054元,基金份额总额65,596,558.61份。

6.6 现金流量表

会计主体:富国强收益定期开放债券型证券投资基金
本报告期:2014年01月01日至2014年06月30日

项目	本期 (2014年01月01日至2014年06月30日)	上年度可比期间 (2013年01月01日至2013年06月30日)
一、经营活动产生的现金流量	12,976,266.96	47,264,474.48
1.销售商品、提供劳务收到的现金	10,065,907.40	32,892,389.31
2.收到的税费返还	-	-
3.收到其他与经营活动有关的现金	1,200,444.75	27,538,114.14
其中:收到其他与经营活动有关的现金	1,200,444.75	27,538,114.14
二、投资活动产生的现金流量	-3,874,349.40	9,273,140.25
1.收回投资收到的现金	-	-
2.取得投资收益收到的现金	-	-
3.处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额	-	-
4.处置子公司及其他营业单位收到的现金净额	-	-
5.收到其他与投资活动有关的现金	-	-
其中:收到其他与投资活动有关的现金	-	-
三、筹资活动产生的现金流量	-	-
1.吸收投资收到的现金	-	-
2.发行债券收到的现金	-	-
3.取得借款收到的现金	-	-
4.收到其他与筹资活动有关的现金	-	-
五、现金及现金等价物净增加额	6,084,460.37	4,915,177.34
六、期初现金及现金等价物余额	20,919,071.43	43,449.91
七、期末现金及现金等价物余额	27,003,531.80	47,865,127.25

注:报告截止日2014年06月30日,基金份额净值1.059元,基金份额总额187,110,287.84份。其中:富国强收益A/B基金份额净值1.062元,基金份额总额121,513,729.23份;富国强收益C基金份额净值1.054元,基金份额总额65,596,558.61份。

6.7 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:富国强收益定期开放债券型证券投资基金
本报告期:2014年01月01日至2014年06月30日

项目	本期 (2014年01月01日至2014年06月30日)	上年度可比期间 (2013年01月01日至2013年06月30日)
一、期初所有者权益(基金净值)	138,993,730.82	3,012,451.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	8,585,362.62	8,585,362.62
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(本期申购、赎回、转换、转入、转出)	48,116,537.02	-517,439.80
其中:1.基金申购款	81,180,924.58	379,689.77
2.基金赎回款	-33,022,357.54	-897,329.57
四、本期所有者权益(基金净值)	197,110,287.84	11,000,174.65
五、期末所有者权益(基金净值)	198,170,462.49	142,066,182.65

注:报告截止日2014年06月30日,基金份额净值1.059元,基金份额总额187,110,287.84份。其中:富国强收益A/B基金份额净值1.062元,基金份额总额121,513,729.23份;富国强收益C基金份额净值1.054元,基金份额总额65,596,558.61份。

6.8 现金流量表

会计主体:富国强收益定期开放债券型证券投资基金
本报告期:2014年01月01日至2014年06月30日

项目	本期 (2014年01月01日至2014年06月30日)	上年度可比期间 (2013年01月01日至2013年06月30日)
一、经营活动产生的现金流量	12,976,266.96	47,264,474.48
1.销售商品、提供劳务收到的现金	10,065,907.40	32,892,389.31
2.收到的税费返还	-	-
3.收到其他与经营活动有关的现金	1,200,444.75	27,538,114.14
其中:收到其他与经营活动有关的现金	1,200,444.75	27,538,114.14
二、投资活动产生的现金流量	-3,874,349.40	9,273,140.25
1.收回投资收到的现金	-	-
2.取得投资收益收到的现金	-	-
3.处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额	-	-
4.处置子公司及其他营业单位收到的现金净额	-	-
5.收到其他与投资活动有关的现金	-	-
其中:收到其他与投资活动有关的现金	-	-
三、筹资活动产生的现金流量	-	-
1.吸收投资收到的现金	-	-
2.发行债券收到的现金	-	-
3.取得借款收到的现金	-	-
4.收到其他与筹资活动有关的现金	-	-
五、现金及现金等价物净增加额	6,084,460.37	4,915,177.34
六、期初现金及现金等价物余额	20,919,071.43	43,449.91
七、期末现金及现金等价物余额	27,003,531.80	47,865,127.25

注:报告截止日2014年06月30日,基金份额净值1.059元,基金份额总额187,110,287.84份。其中:富国强收益A/B基金份额净值1.062元,基金份额总额121,513,729.23份;富国强收益C基金份额净值1.054元,基金份额总额65,596,558.61份。

6.9 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:富国强收益定期开放债券型证券投资基金
本报告期:2014年01月01日至2014年06月30日

项目	本期 (2014年01月01日至2014年06月30日)	上年度可比期间 (2013年01月01日至2013年06月30日)
一、期初所有者权益(基金净值)	138,993,730.82	3,012,451.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	8,585,362.62	8,585,362.62
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(本期申购、赎回、转换、转入、转出)	48,116,537.02	-517,439.80
其中:1.基金申购款	81,180,924.58	379,689.77
2.基金赎回款	-33,022,357.54	-897,329.57
四、本期所有者权益(基金净值)	197,110,287.84	11,000,174.65
五、期末所有者权益(基金净值)	198,170,462.49	142,066,182.65

注:报告截止日2014年06月30日,基金份额净值1.059元,基金份额总额187,110,287.84份。其中:富国强收益A/B基金份额净值1.062元,基金份额总额12