富国汇利回报分级债券型证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013年12月31日

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。

基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定,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	富国汇利回报分级债券 (场内简称:富国汇利)
基金主代码	161014
基金运作方式	契约型开放式。本基金以定期开放的方式运作。自每一个开放期结束之日后的第一个工作日起(含该日)两年(含两年)的期间内,本基金采取封闭运作模式,期间基金份额总额保持不变,基金份额持有人不得申请申购、赎回本基金。
基金合同生效日	2013年09月09日
报告期末基金份额总额 单位:份)	2,373,631,687.43
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高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金按照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。一方面根据整体资产配置要求通过积极的投资策略主动寻找风险中蕴藏的投资机会,发掘价格被低估的且符合流动性要求的合适投资品种;另一方面通过风险预算管理、平均剩余期限控制和个券信用等级限定等方式有效控制投资风险,从而在一定的风险限制范围内达到风险收益最佳配比。
业绩比较基准	中央国债登记结算有限责任公司编制并发布的中债综合指数。
风险收益特征	从基金资产整体运作来看,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,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
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

下属三级基金的基金简称	汇利A	汇利B	富国汇利回报分级债券 (场内简称:富国汇利)
下属三级基金的交易代码	150020	150021	161014
报告期末下属三级基金的份额总额 单位:份)	391,562,374.00	167,812,447.00	1,814,256,866.43
下属三级基金的风险收益特征	汇利A份额将表现出低风险、收益相对稳定的特征	汇利B份额则表现出较高风险、收益相对较高的特征	从基金资产整体运作来看,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,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

§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)
1.本期已实现收益	32,449,623.42
2.本期利润	-12,105,771.11
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0052
4.期末基金资产净值	2,354,373,724.30
5.期末基金份额净值	0.992

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。

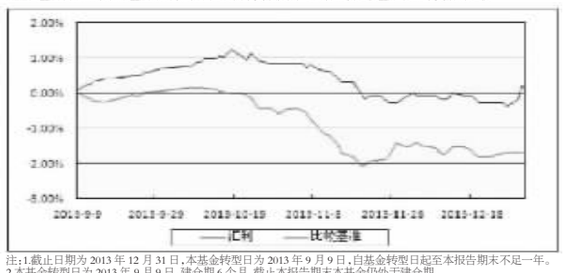
3.2 基金净值表现

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	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	-0.46%	0.11%	-1.74%	0.10%	1.28%	0.01%

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:1.截止日期为2013年12月31日,本基金转型日为2013年9月9日,自基金转型日起至本报告期末不足一年。
2.本基金转型日为2013年9月9日,建仓期6个月,截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

3.3 其他指标

其他指标	报告期末(2013年12月31日)
富国汇利A与富国汇利B基金份额配比	7:3
期末富国汇利A份额参考净值	1.010
期末富国汇利A份额累计参考净值	1.010
期末富国汇利B份额参考净值	0.950
期末富国汇利B份额累计参考净值	0.950
富国汇利A的预计年收益率	4.75%

§4 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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
饶刚	本基金基金经理兼任公司总经理助理、固定收益部总经理,富国天利增长债券投资基金基金经理,富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金经理,富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金,富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金基金经理	2010-09-09	-	15年	硕士,曾任职兴业证券股份有限公司研究部职员,投资银行部职员;2003年7月任富国基金管理有限公司债券研究员,2006年1月至今任富国天利基金经理,2008年10月起兼任富国天丰基金经理,2010年9月起兼任富国汇利分级债券基金经理,2013年6月起任富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金基金经理,2013年9月起任富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金基金经理,兼任富国基金公司总经理助理、固定收益部总经理。具有基金从业资格,中国国籍。
刁羽	本基金基金经理兼任固定收益总监助理,富国天盈分级债券型证券投资基金基金经理、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金、富国恒利分级债券型证券投资基金基金经理	2010-11-18	-	7年	博士,曾任国泰君安证券股份有限公司固定收益部研究员、交易员,浦银安盛基金管理有限公司基金经理助理,2009年6月至2010年6月任富国基金管理有限公司富国天时货币市场基金基金经理助理,2010年6月至2013年3月任富国天时货币市场基金基金经理,2010年11月起兼任富国汇利分级债券型证券投资基金基金经理,2011年5月起兼任富国天盈分级债券型证券投资基金基金经理,2013年6月起任富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金基金经理,2013年9月起任富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金基金经理,2013年12月起任富国恒利分级债券型证券投资基金基金经理;兼任固定收益总监助理。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汇利分级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》、《富国汇利分级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,以为投资者减少和分散风险,确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定收益为目标,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规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

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长期稳定收益为目标,管理和运用基金资产,以为投资者减少和分散风险,确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定收益为目标,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规定。

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。

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。

4.3.2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调查。

4.4 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

企业债收益率在四季度在6月下旬资金收紧收益率大幅上行后维持高位。四季度本基金按照基金的投资风格,仍然主要集中于信用债的投资,基金在仓位和券种选择上加强筛选力度。2014年一季度我们预期CPI维持低位以及经济增速尚在预期范围内,基本面对债市的支撑尚在,但是供给需求的力量对比还有不确定性以及各项经济稳增长政策的推出,一季度将在继续维持基本仓位的基础上,做好组合结构调整。本基金一季度在保持本基金长期投资风格基础上,将继续着力于在市场混沌俱下的环境下,以"信用优先"为前提,通过更深入的研究和实地调研挖掘市场个券品种的投资机会,力争为投资者带来稳定的长期回报。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期,本基金份额净值增长率为-0.46%,同期业绩比较基准收益率为-1.74%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	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	3,619,868,504.94	93.46
	其中:债券	3,616,868,504.94	93.38
	资产支持证券	3,000,000.00	0.08
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合计	138,638,350.04	3.58
6	其他资产	114,735,424.55	2.96
7	合计	3,873,242,279.53	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
注:本基金本报告期未持有股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
注:本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	313,562,000.00	13.32
	其中:政策性金融债	29,424,000.00	1.25
4	企业债券	3,185,289,504.94	135.29
5	企业短期融资券	49,981,000.00	2.12
6	中期票据	68,036,000.00	2.89
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	3,616,868,504.94	153.62

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	092103	09重庆农商债	1,700,000	166,685,000.00	7.08
2	124232	13苏海发	1,000,000	108,000,000.00	4.59
3	1180092	11泰医高债	800,000	79,272,000.00	3.37
4	1080100	10金阳债	800,000	77,160,000.00	3.28
5	122932	09宜城债	700,000	71,666,000.00	3.04

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1387012	13进元1B	30,000	3,000,000.00	0.13

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
注:本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未投资股指期货。

5.8.2本基金投资股指期货的投资政策
本基金根据基金合同的约定,不允许投资股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1本期国债期货投资政策
本基金根据基金合同的约定,不允许投资国债期货。

5.9.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.9.3本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.10.2申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。
本基金本报告期末未持有股票。

5.10.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	186,827.79
2	应收证券清算款	36,799,940.01
3	应收股利	-
4	应收利息	77,748,656.75
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	114,735,424.55

5.10.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6投资组合报告附注的其他文字描述部分。
因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,978,288,448.54
报告期期间基金总申购份额	257,609,489.69
减:报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	137,733,749.20
报告期末基金份额总额	2,373,631,687.43

注:本基金转型日为2013年9月9日。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1、中国证监会批准设立富国汇利分级债券型证券投资基金的文件
2、富国汇利分级债券型证券投资基金基金合同
3、富国汇利分级债券型证券投资基金托管协议
4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件
5、富国汇利分级债券型证券投资基金财务报表及报表附注
6、富国汇利回报分级债券型证券投资基金基金合同
7、富国汇利回报分级债券型证券投资基金托管协议
8、富国汇利回报分级债券型证券投资基金财务报表及报表附注
9、中国证券监督管理委员会《关于富国汇利分级债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》
10、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

8.2 存放地点
上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层

8.3 查阅方式
投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。
咨询电话:95105686、4008880688(全国统一,免长途话费)
公司网址:http://www.fullgoal.com.cn

富国基金管理有限公司
2014年01月22日

富国天丰强化收益债券型证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013年12月31日

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,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。

§2 基金产品概况

基金简称	富国天丰强化债券(LOF)(场内简称:富国天丰)
基金主代码	161010
交易代码	前端交易代码:161010 后端交易代码:161018
基金运作方式	契约型,本基金合同生效后三年内封闭运作,在交易所上市交易,基金合同生效满三年后转为上市开放式。
基金合同生效日	2008年10月24日
报告期末基金份额总额 单位:份)	3,003,244,436.44
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较高的当期收益。
投资策略	本基金按照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。一方面根据整体资产配置要求通过积极的投资策略主动寻找风险中蕴藏的投资机会,发掘价格被低估的且符合流动性要求的合适投资品种;另一方面通过风险预算管理、平均剩余期限控制和个券信用等级限定等方式有效控制投资风险,从而在一定的风险限制范围内达到风险收益最佳配比。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中央国债登记结算有限责任公司编制并发布的中债综合指数。
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低风险品种,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

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)
1.本期已实现收益	-5,621,316.98
2.本期利润	-162,737,602.19
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0456
4.期末基金资产净值	2,914,069,573.75
5.期末基金份额净值	0.970

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	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	-4.62%	0.21%	-1.74%	0.10%	-2.88%	0.11%

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。

本基金合同生效日为2008年10月24日,建仓期6个月,即从2008年10月24日起至2009年4月23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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
饶刚	本基金基金经理兼任公司总经理助理、固定收益部总经理,富国天利增长债券投资基金基金经理,富国汇利分级债券型证券投资基金基金经理、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金基金经理,富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金基金经理	2008-10-24	-	15年	硕士,曾任职兴业证券股份有限公司研究部职员,投资银行部职员;2003年7月任富国基金管理有限公司债券研究员,2006年1月至今任富国天利基金经理,2008年10月起兼任富国天丰基金经理,2010年9月起兼任富国汇利分级债券基金经理,2013年6月起任富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金基金经理,2013年9月起任富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金基金经理。兼任富国基金公司总经理助理、固定收益部总经理。具有基金从业资格,中国国籍。
钟智伦	本基金基金经理兼任富国产业债债券型证券投资基金基金经理、固定收益投资副总监	2008-10-24	-	20年	硕士,曾任平安证券有限责任公司部门经理;上海新世纪投资服务有限公司研究员;海通证券股份有限公司投资经理;2005年5月任富国基金管理有限公司债券研究员;2006年6月至2009年3月任富国天时基金经理;2008年10月至今任富国天丰基金经理;2009年6月至2012年12月任富国优化增强债券基金基金经理;2011年12月至今任富国产业债债券型证券投资基金基金经理;兼任固定收益投资副总监。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丰强化收益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》、《富国天丰强化收益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,以为投资者减少和分散风险,确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定收益为目标,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规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

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、操作层面确保基金资产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。

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。

4.3.2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调查。

4.4 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

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调查。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期,本基金份额净值增长率为-4.62%,同期业绩比较基准收益率为-1.74%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	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	5,349,541,612.93	94.28
	其中:债券	5,349,541,612.93	94.28
	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合计	188,632,587.86	3.32
6	其他资产	135,788,577.61	2.39
7	合计	5,673,962,778.40	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
注:本基金本报告期未持有股票资产。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
注:本基金本报告期未持有股票资产。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	34,072,500.00	1.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,415,000.00	1.70
	其中:政策性金融债	49,415,000.00	1.70
4	企业债券	4,205,530,321.93	144.32
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	96,867,000.00	3.32
7	可转债	963,656,791.00	33.07
8	其他	-	-
9	合计	5,349,541,612.93	183.58

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	3,570,000	344,612,100.00	11.83
2	113001	中行转债	2,923,200	281,591,856.00	9.66
3	113002	工行转债	2,202,800	223,253,780.00	7.66
4	122200	12晋兰花	1,999,980	193,598,064.00	6.64
5	1280405	12豫铁投债	1,500,000	142,185,000.00	4.88

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
注:本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未投资股指期货。

5.8.2本基金投资股指期货的投资政策
本基金根据基金合同的约定,不允许投资股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1本期国债期货投资政策
本基金根据基金合同的约定,不允许投资国债期货。

5.9.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.9.3本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.10.2申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。
本基金本报告期末未持有股票资产。

5.10.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	271,427.12
2	应收证券清算款	43,732,581.52
3	应收股利	-
4	应收利息	91,594,357.58
5	应收申购款	190,211.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	135,788,577.61

5.10.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	344,612,100.00	11.83
2	113001	中行转债	281,591,856.00	9.66
3	113002	工行转债	223,253,780.00	7.66
4	110015	石化转债	85,824,000.00	2.95
5	113003	重工转债	28,375,055.00	0.97

5.10.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末未持有股票资产。

5.10.6投资组合报告附注的其他文字描述部分。
因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	3,952,043,499.81
报告期期间基金总申购份额	44,987,559.15
减:报告期期间基金总赎回份额	993,786,622.52
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期末基金份额总额	3,003,244,436.44

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

基金托管人2013年12月5日发布任免通知,聘任黄莺海为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1、中国证监会批准设立富国天丰强化收益债券型证券投资基金的文件
2、富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金合同
3、富国天丰强化收益债券型证券投资基金托管协议
4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件
5、富国天丰强化收益债券型证券投资基金财务报表及报表附注
6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点
上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层

9.3 查阅方式
投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。
咨询电话:95105686、4008880688(全国统一,免长途话费)
公司网址:http://www.fullgoal.com.cn

富国基金管理有限公司
2014年01月22日

富国中证红利指数增强型证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013年12月31日

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	富国中证红利指数增强
基金主代码	100032
交易代码	前端交易代码:100032 后端交易代码:100033
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年11月20日
报告期末基金份额总额 单位:份)	607,771,826.02
投资目标	本基金为股票指数增强型基金,其在遵循"指数化投资为主、主动性投资为辅"的投资策略,在完全复制目标指数的基础上有限度地调整个股,从而最大限度降低由于交易成本造成的股票投资组合相对于目标指数的偏离,并力求投资收益能够有效跟踪并适度超越目标指数。
投资策略	本基金将采用"指数化投资为主、主动性投资为辅"的投资策略,在完全复制目标指数的基础上有限度地调整个股,从而最大限度降低由于交易成本造成的股票投资组合相对于目标指数的偏离,并力求投资收益能够有效跟踪并适度超越目标指数。
业绩比较基准	90%×中证红利指数收益率+10%×一年期银行储蓄存款利率(税后)
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金,属于较高预期风险、较高预期收益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	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

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)
1.本期已实现收益	-6,211,858.66
2.本期利润	-17,346,249.95
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0282
4.