

## 富国天博创新主题股票型证券投资基金

## 2013 第四季度 报告

2013年12月31日

<p><b>基金管理人:富国基金管理有限公司</b>  <b>基金托管人:交通银行股份有限公司</b>  <b>报告送出日期:2014年01月22日</b></p>	<p><b>§1 重要提示</b></p> <p>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法律责任。  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,保证其中不存在虚假记载、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,也不保证基金份额持有人本金不受损失或者本金不受其他实质性损失,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。  本报告自2014年1月20日起生效,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。  本报告日期2013年10月1日起至2013年12月31日。</p>
--	---

§2 基金产品概况	
基金名称	富国天博创新股票
基金代码	510035
交易代码	前缩交易代码:510035 后缩交易代码:510036
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2007年04月21日
报告期末基金份额总额(单位:份)	6,734,200,001.55
投资目标	本基金主要投资于具有良好成长性的创新主题上市公司,在有效控制投资组合风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主主动投资管理策略,并综合运用行业轮动、主题轮动、个股轮动、行业分散、个股分散以及投资组合风险管理等策略。
业绩比较基准	中债综合净指数×80%+中债国债指数×15%+恒生红利指数×5%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的股票型基金,属于较高预期收益、较高预期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	中国建设银行股份有限公司

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	195,691,588.37					
2.本期净利润	-11,417,324.79					
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0017					
4.期末基金资产净值	5,352,337,882.99					
5.期末基金份额净值	0.986					

注: 上述基金净值增长率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、基金销售费), 以及不同时间赎回导致的收益水平低于相应于所收资产。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。

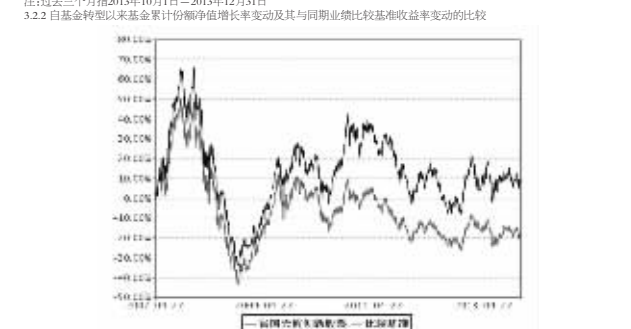
3.2 基金净值表现

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	-0.26%	1.31%	-2.69%	0.91%	2.43%	0.40%

注: 过去三个月指2013年10月1日至2013年12月31日

3.2.2 本基金持债部分本基金资产净值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.本基金于2007年4月27日由以中证500指数为跟踪标的基金合同变更,建仓期6个月,从2007年4月27日至2007年10月26日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介			9.4	管理人报告	
姓名	职务	任本基金基金经理期限	证券从业年限	说明	
毕天宇	本基金基金经理兼 权益投资部副总监	2005-11-26	14年	硕士,曾任中国民生银行汽车信贷经营管理部副经理,2007年加入富国基金管理有限公司,曾任富国天益价值证券投资基金副经理,2009年2月加入富国基金管理有限公司权益投资部,现任权益投资部副总监,具有基金从业资格,中国国籍。	
4.2 报告期末本基金基金经理情况说明					
本报告期内,富国基金管理有限公司作为富国天博创新主题股票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》、《富国天博创新主题股票型证券投资基金基金合同》及《富国天博创新主题股票型证券投资基金托管协议》及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,确保基金资产的公平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律法规及基金合同的约定。					
4.3 公平交易制度的执行情况					
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、二级市场交易等相关的研究分析、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、操作层面确保各投资组合享有同等的交易机会,确保各投资组合的公平交易。所有投资组合的独立投资决策机制。					
事前控制主要包括:一、一级市场,通过标准化的办公流程,对相关方审核,价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制;二、二级市场,通过交易系统的投资准备库、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:投资组合的交叉交易,市场冲击的监控,执行指令的交叉分析,公平性分析;1.将主动投资组合的同一只股票交易方向限制为:非严格控制流程审核同意,不得进行;对于同日同向交易,通过交易系统配对组合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同投资策略的,必须通过交易系统配对组合,同价下下达投资指令,确保公平对待其管理的组合。					
事后评估及反馈主要包括: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)的买卖价差分析评估;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,并重点分析基金资产、基金、社保及专户产品,并重点分析不同类别组合(股票型、混合型、债券型)组合、不同产品类型以及同一基金经理管理的不同组合的交易行为,若发现异常交易行为,及时提醒和纠正,并出具书面报告,并报送监管机构和上级监管部门;2.分析公平性交易分析报告,由基金经理或合规风控部进行审核,并报告督察、总经理和合规部,并留存存查,以备后查。					
4.3.2 公平交易执行的说明					
本报告期末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,因组合流动性管理或投资策略调整需要,出现大额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 报告期末本基金投资组合的行业分布情况					
4.4.1 报告期末本基金投资组合的行业分布情况					
四季度资产30天内波动率下降3.26%,资金成本,利率偏高是市场下跌的直接原因,回购利率下降0.26%。 四季度本基金净值增长率高于同期业绩比较基准,且资产配置较为合理,其中公允价值变动收益,占净值增长四个百分点,来看,对于2013年投资组合管理,以上重点关注的个股为主,行业方面,主要维持了银行行业的持仓。 在结构上整体趋势的下滑下,市场持续低迷,结构分化严重的是导致我们目前的行情,资金趋紧,而股指期货等衍生品波动不定也是影响净值波动的重要因素,在总体市场偏弱,结构分化明显的行情下,本报告我们个股和行业的配置,需要我们去进一步跟踪和总结。					
4.4.2 报告期末本基金的投资风格					
本报告期内,本基金份额净值增长率为-0.26%,同期业绩比较基准收益率为-2.69%。					

4.4 报告期末基金的投资绩效		§5 投资策略	
本报告期,本基金份额净值增长率为-0.26%,同期业绩比较基准收益率为-2.69%。			
§5 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	5,000,242,183.07	93.00
	其中:股票	5,000,242,183.07	93.00
2	固定收益投资	351,379,296.30	6.54
	其中:债券	351,379,296.30	6.54
	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:逆回购及买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	11,924,001.21	0.22
	其他资产	13,009,034.88	0.24
7	合计	5,376,555,415.46	100.00

<p><b>§1 重要提示</b></p> <p>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法律责任。  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,保证其中不存在虚假记载、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,也不保证基金份额持有人本金不受损失或者本金不受其他实质性损失,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。  本报告自2014年1月20日起生效,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。  本报告日期2013年10月1日起至2013年12月31日。</p>	<p><b>§2 基金产品概况</b></p> <p>基金名称 富国天益价值混合  基金代码 100022  后缩交易代码:100022  交易代码 100022  基金运作方式 契约型开放式  基金合同生效日 2005/04/17日  报告期末基金份额总额(单位:份) 5,745,066,611.90</p> <p>报告期末基金份额总额(单位:份)</p> <p>基金管理人 富国基金管理有限公司  基金托管人 交通银行股份有限公司</p>
---	--

	§2	基金产品概况
基金简称		富国天瑞强势地区混合
基金主代码		100022
交易代码		前端交易代码:100022 后端交易代码:100023
基金出资方式		契约型开放式
基金合同生效日		2005/04/18/日
报告期末基金资产规模(单位:份)		5,745,068,661.90
投资目标		本基金主要投资于优势地区、区域经济发展较快,已经形成一定产业规模,具有较大发展潜力,具有较强竞争力、经营稳健、信誉良好、成长性较强的上市公司股票。本基金通过 富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金,通过自上而下的积极投资管理,在符合投资限制的前提下,投资于具有长期竞争优势的上市公司股票,注重基金资产增值,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略		本基金主要采用“自上而下”的主动投资管理策略,在充分研究宏观经济状况、资本市场运行特征和估值水平的基础上,以优势地区内具有较强投资价值的证券作为核心,通过积极配置策略,精选具有中长期增长有效性的股票。
业绩比较基准		上证指数收益率*70%+上证国债指数收益率*25%+富国货币市场基金收益率



注:1.截止日期为2013年12月31日。  
2.本基金于2008年4月15日成立,建仓期6个月,从2008年4月15日至2008年10月1日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。本基金于2013年11月17日召开基金份额持有人大会,建仓期6个月,从2013年11月22日至2013年4月21日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	34,790,000.00	0.65
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,034,647,768.97	56.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	122,649,232.18	2.29
E	建筑业	80,323,642.00	1.50
F	批发和零售业	75,751,146.20	1.45
G	交通运输、仓储和邮政业	45,844,739.77	0.86
H	住宿和餐饮业	16,125,732.00	0.30
I	信息传输、软件和信息技术服务业	275,318,046.54	7.01
J	金融业	216,583,117.35	4.05
K	房地产业	942,460,922.06	17.61
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	739,885.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	819,800.00	0.02
O	国防装备、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	52,366,060.80	0.98
S	综合	-	-
	合计	5,000,242,183.07	93.42

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000581	瑞孚科技	16,800.00	57,740,000.00	9.67
2	002271	东方既白	15,627,892	41,207,512.04	7.20
3	600519	贵州茅台	3,000.00	385,140,000.00	7.20
4	000024	招商局A	18,000.00	374,000,000.00	6.99
5	600703	三七安地	14,807,234	36,071,130.86	6.28
6	000718	苏宁电器	61,807,000	28,457,590.00	5.36
7	600037	百润酒业	5,002,114	184,925,154.58	3.41
8	600166	兴业银行	18,525,000.00	3,346,000.00	0.62
9	600561	信达地产	8,000,000	10,160,000.00	1.90
10	600570	恒生电子	7,500.00	196,450,000.00	2.92

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	39,980,000.00	0.75
2	央行票据	-	-
3	金融债	239,012,000.00	4.47
4	其中:政策性金融债	239,012,000.00	4.47
5	企业债/公司债	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	72,387,296.30	1.35
8	其他	-	-
9	合计	351,379,296.30	6.56

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130011	13国债01	100,000.00	99,990,000.00	1.88
2	130111	13国债01	600,000.00	599,220,000.00	1.11
3	131005	平国开债	500,000.00	535,625,000.00	1.00
4	130418	13农发08	500,000.00	49,675,000.00	0.93
5	130002	13国债02	400,000.00	39,980,000.00	0.75

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交易情况说明 注:本基金本报告期末未投资股指期货。
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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 注:本基金本报告期末未投资国债期货。
5.10 报告期末本基金投资的贵金属交易情况	5.10.1 报告期末本基金投资的贵金属交易情况 注:本基金本报告期末未投资贵金属。
5.11 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.11.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.12 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.12.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.13 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.13.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.14 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.14.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.15 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.15.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.16 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.16.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.17 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.17.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.18 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.18.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.19 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.19.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.20 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.20.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.21 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.21.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.22 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.22.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.23 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.23.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.24 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.24.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.25 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.25.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.26 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.26.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.27 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.27.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.28 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.28.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.29 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.29.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.30 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.30.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.31 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.31.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.32 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.32.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.33 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.33.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.34 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.34.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.35 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.35.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.36 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.36.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.37 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.37.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.38 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.38.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.39 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.39.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.40 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.40.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.41 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.41.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.42 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.42.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.43 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.43.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.44 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.44.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。
5.45 报告期末本基金投资的衍生品交易情况	5.45.1 报告期末本基金投资的衍生品交易情况 注:本基金本报告期末未投资衍生品。