

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
报告送出日期：2012年10月25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2012年10月23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。

本报告自2012年07月01日起至2012年09月30日止。

§2 基金产品概况	
基金简称	富国新天锋定期开放债券（场内简称：富国天锋）
基金代码	161019
交易代码	前端交易代码：161019 后端交易代码：161020
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，自基金合同生效日起每三年开放一次。
基金合同生效日	2012年05月07日
报告期末基金份额总额(单位:份)	945,778,694.63
投资目标	本基金在追求基金资产长期安全的基础上，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中类属资产进行最佳化配置和调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：中国国债+记账有价证券+可转债+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较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币型基金，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
基金简称	报告(2012年07月01日至2012年09月30日)
1.本期已实现收益	22,842,477.32
2.本期利润	12,229,923.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.0129
4.期末基金资产净值	959,625,495.84
5.期末基金份额净值	1.015

3.2 基金净值表现

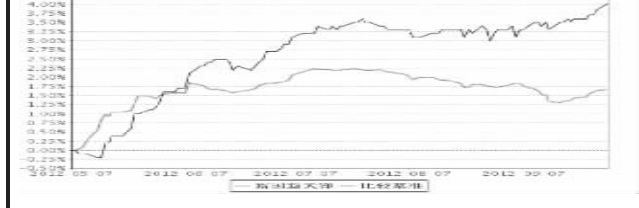
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.28%	0.11%	-0.15%	0.05%	1.43%	0.06%

注：过去三个月指2012年7月1日至2012年9月30日

注：过去三个月指2012年7月1日至2012年9月30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



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
报告送出日期：2012年10月25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2012年10月23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。

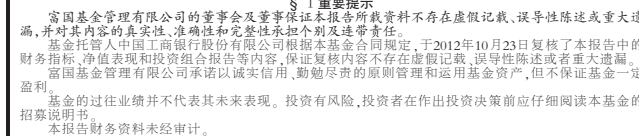
本报告自2012年7月1日起至2012年9月30日止。

§2 基金产品概况	
基金简称	富国优化增强债券
基金代码	100035
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年06月10日
报告期末基金份额总额(单位:份)	594,960,716.20
投资目标	在追求基金安全、保持资产流动性以及有效控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为持有人提供稳定的当期收益以及长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金通过对手宏观判断、合理配置收益相对中长期发展趋势的客观判断、合理配置收益相对中长期发展的企业债、可转债、可分离债券、可交换债券等，加大对国家债券等高流动性品种的投资，灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值等策略。在保证基金流动性的前提下，积极把握投资机会，获取各类债券的超额投资收益。
业绩比较基准	中债综合指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%
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型基金，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
下属两级基金的基金简称	富国优化增强债券A/B级
下属两级基金的交易代码	100035
报告期末下属两级基金的份额总额(单位:份)	282,114,488.42

§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(2012年07月01日至2012年09月30日)
1.本期已实现收益	20,214.40
2.本期利润	-9,217,384.35
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0275
4.期末基金资产净值	303,185,614.20
5.期末基金份额净值	0.969

注：截止日期为2012年9月30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



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：2012年10月25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股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年10月23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。

本报告自2012年7月1日起至2012年9月30日止。

§2 基金产品概况	
基金简称	富国中证500指数增强（LOF）（场内简称：富国500）
基金代码	161017
交易代码	前端交易代码：161017 后端交易代码：—
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年10月12日
报告期末基金份额总额(单位:份)	390,056,990.70
投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对中证500指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以“量化投资为主，主动性投资为辅”，在复制目标指数的基础上，适度调整个股权重，力求投资收益能够跟踪并适度超越目标指数。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为：95%×中证500指数收益率+5%×（年化收益率，按年化利率调整）。
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，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币型基金。
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

§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(2012年07月01日至2012年09月30日)
1.本期已实现收益	-9,569,283.34
2.本期利润	-18,043,358.84
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0498
4.期末基金资产净值	344,876,808.35
5.期末基金份额净值	0.884

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	净值增长率基准②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准收益④	①-③	②-④
过去三个月	-5.08%	1.38%	-7.17%	1.42%	2.12%	-0.04%

注：过去三个月指2012年7月1日至2012年9月30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

富国新天锋定期开放债券型证券投资基金

注：截止日期为2012年9月30日。

本基金于2012年5月7日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

本基金成立至今，即从2012年5月7日起至2012年11月6日，截至本报告期末，本基金处于建仓期。

§4 管理人报告

4.1 基金经理 基金经理小组简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	年限	说明
赵恒数	本基金基金经理 兼任富国天 盈分级债券型 证券投资基金 基金经理、富 国可转债债 券投资基金 基金经理	2012-05-07	-	8年	硕士，曾任通用技术集团投资管理有限公司研究员，2008年4月至2011年5月任富国基金管理有限公司固定收益部研究员，2011年5月起任富国天盈分级债券型证券投资基金基金经理，2012年5月起任富国新天锋定期开放债券型证券投资基金基金经理，2012年6月起任富国可转债债券证券投资基金基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。
邓华	本基金基金经理 兼任富国天 时货币市场 基金基金经理	2012-05-07	-	7年	硕士，自2006年3月至2007年8月任上海国泰人寿保险有限公司投资部投资助理，自2007年8月至2008年8月任东方基金管理有限责任公司债券研究员，自2008年9月至2011年7月任富国基金管理有限公司债券研究员，自2011年8月起任富国天时货币市场基金基金经理，2012年5月起任富国新天锋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。

4.2 报告期末本基金运作遵守情况说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国新天锋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》、《富国新天锋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，确保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增值为目标，管理和运用基金资产，无损害基金份额持有人的利益，基金投资组合符合有关法律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律法规要求，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，并保持组合的独立投资策略。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审批、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一日交易方向为限制行为，非特殊控制措施申请回避，不进行；对于同一日向交易对手交易同一品种的证券，同一投资组合的同一日交易方向为限制行为，非特殊控制措施申请回避，不进行；对于同一日向交易对手交易同一品种的证券，同一投资组合的同一日交易方向为限制行为，非特殊控制措施申请回避，不进行。

4.3.2 基金间公平交易的事后监督分析

3.2.2.2 基金合同生效以来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

4.1 自基金合同生效以来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：截止日期为2012年9月30日。

本基金于2012年5月7日成立，建仓期6个月，从2012年5月10日至2012年11月6日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

富国优化增强债券型证券投资基金

注：截止日期为2012年9月30日。

本基金于2009年6月10日成立，建仓期6个月，从2009年6月10日至2009年12月9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 基金经理小组简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	年限	说明
钟智伟	本基金基金经理 兼任富国天 盈分级债券型 证券投资基金 基金经理、富 国可转债债 券投资基金 基金经理	2009-06-10	-	19年	硕士，曾任平安资产管理有限责任公司研究员，2005年5月至2006年6月任富国基金管理有限公司研究员，2006年6月至2009年6月任富国天盈分级债券型证券投资基金基金经理，2009年6月至2011年7月任富国天盈分级债券型证券投资基金基金经理，2011年7月起任富国优化增强债券型证券投资基金基金经理，兼任富国可转债债券证券投资基金基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。

4.2 报告期末本基金运作遵守情况说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国优化增强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》、《富国优化增强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，确保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增值为目标，管理和运用基金资产，无损害基金份额持有人的利益，基金投资组合符合有关法律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律法规要求，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，并保持组合的独立投资策略。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审批、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一日交易方向为限制行为，非特殊控制措施申请回避，不进行；对于同一日向交易对手交易同一品种的证券，同一投资组合的同一日交易方向为限制行为，非特殊控制措施申请回避，不进行；对于同一日向交易对手交易同一品种的证券，同一投资组合的同一日交易方向为限制行为，非特殊控制措施申请回避，不进行。

4.3.2 基金间公平交易的事后监督分析

3.2.2.2 基金合同生效以来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

4.1 自基金合同生效以来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

富国中证500指数增强型证券投资基金（LOF）

注：截止日期为2012年9月30日。

本基金于2011年10月12日成立，建仓期6个月，从2011年10月12日至2012年4月11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 基金经理小组简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	年限	说明
李英薇	本基金基金经理 兼任富国天 盈分级债券型 证券投资基金 基金经理、富 国可转债债 券投资基金 基金经理	2011-10-12	-	10年	博士，曾任南京诺德投资管理有限公司研究员，2006年6月至2009年6月任富国基金管理有限公司研究员，2009年6月至2011年7月任富国天盈分级债券型证券投资基金基金经理，2011年7月起任富国中证500指数增强型证券投资基金基金经理，2011年7月起任富国中证500指数增强型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。
陈华	本基金基金经理 兼任富国天 盈分级债券型 证券投资基金 基金经理、富 国可转债债 券投资基金 基金经理	2011-10-12	-	8年	硕士，曾任南京诺德投资管理有限公司研究员，2006年6月至2009年6月任富国基金管理有限公司研究员，2009年6月至2011年7月任富国天盈分级债券型证券投资基金基金经理，2011年7月起任富国中证500指数增强型证券投资基金基金经理，2011年7月起任富国中证500指数增强型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。

4.2 报告期末本基金运作遵守情况说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国中证500指数增强型证券投资基金（LOF）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》、《富国中证500指数增强型证券投资基金（LOF）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，确保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增值为目标，管理和运用基金资产，无损害基金份额持有人的利益，基金投资组合符合有关法律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律法规要求，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，并保持组合的独立投资策略。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审批、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一日交易方向为限制行为，非特殊控制措施申请回避，不进行；对于同一日向交易对手交易同一品种的证券，同一投资组合的同一日交易方向为限制行为，非特殊控制措施申请回避，不进行；对于同一日向交易对手交易同一品种的证券，同一投资组合的同一日交易方向为限制行为，非特殊控制措施申请回避，不进行。

4.3.2 基金间公平交易的事后监督分析

3.2.2.2 基金合同生效以来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

4.1 自基金合同生效以来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：截止日期为2012年9月30日。

本基金于2011年10月12日成立，建仓期6个月，从2011年10月12日至2012年4月11日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

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	122761	11南国资	500,000	52,000,000.00	5.42
2	122949	09鲁投债	500,020	50,252,010.00	5.24
3	1080050	10鲁城投债	500,000	50,005,000.00	5.21
4	122968	09杭城投	500,010	50,001,000.00	5.21
5	122896	10开升债	500,000	49,125,000.00	5.12

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 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内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、处罚的情况

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。

5.8.2 报告期内本基金投资的前十名股票中，有基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中，没有基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	33,976,734.40
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	24,511.79
8	其他	-
9	合计	34,001,246.19

5.8.4 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。

5.8.5 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。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因报告期末本基金投资组合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

报告期初基金份额总额	945,778,694.63
报告期间基金总申购份额	-
减：报告期间基金总赎回份额	-
报告期间基金份额变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期末基金份额总额	945,778,694.63

§7 备查文件目录

1、中国证监会批准设立富国新天锋定期开放债券型证券投资基金的文件

2、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金基金合同

3、富国新天锋定期开放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新天锋定期开放债券型证券投资基金的文件

5、富国新天锋定期开放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

7.2 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

7.3 查阅方式

投资者对本报告如有任何疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。

咨询电话：95105866、4008888888（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
2012年10月25日

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	601318	中国平安	200,000	8,388,000.00	1.44
2	601699	300转债	300,000	5,625,000.00	0.93
3	600259	广生有色	114,681	5,583,817.89	0.96
4	601388	中国铝业	500,000	5,580,000.00	0.96
5	600000	一汽轿车	803,760	5,481,213.80	0.94
6	600027	一汽夏利	405,093	5,474,040.26	0.94
7	600036	中信证券	400,000	4,716,000.00	0.81
8	600549	厦门国贸	88,314	3,567,002.46	0.61
9	600219	天目药业	401,147	3,255,520.06	0.56

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	113001	中行转债	2,030,000	195,204,800.00	33.62
2	110015	石化转债	1,750,000	170,275,000.00	29.32
3	113002	华电转债	900,000	90,900,000.00	15.65
4	0980100	09鲁城投债	400,000	40,295,000.00	8.49

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 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内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、处罚的情况

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。

5.8.2 报告期内本基金投资的前十名股票中，有基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中，没有基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	27,000.00
4	应收利息	11,557,129.79
5	应收申购款	-
6	其他应收款	119,068.32
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,953,248.11

7	应付账款				
8	预收账款				119,068.32
9	应付利息				
10	递延收益				
11	递延所得税负债				
12	其他应付款				
13	其他				
14	合计				11,953,248.11

5.8.4 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	113001	中行转债	195,204,800.00	33.62
2	110015	石化转债	170,275,000.00	29.32
3	113002	华电转债	90,900,000.00	15.65

5.8.5 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。

5.8.4 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。

5.8.5 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。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因报告期末本基金投资组合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

报告期初基金份额总额	390,056,990.70
报告期间基金总申购份额	-
减：报告期间基金总赎回份额	-
报告期间基金份额变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期末基金份额总额	390,056,990.70

§7 备查文件目录

1、中国证监会批准设立富国优化增强债券型证券投资基金的文件

2、富国优化增强债券型证券投资基金基金合同

3、富国优化增强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优化增强债券型证券投资基金的文件

5、富国优化增强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

7.2 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

7.3 查阅方式

投资者对本报告如有任何疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。

咨询电话：95105866、4008888888（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
2012年10月25日

2	600050	中化国际	505,274	2,991,222.08	0.87
3	600104	上汽集团	206,106	2,790,594.00	0.81
4	600219	南昌铝业	369,300	2,492,775.00	0.72
5	601186	中国神华	500,800	2,316,364.00	0.67

5.5 报告期内按债券信用等级分类的债券投资组合情况

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期内按债券品种分类的债券投资组合情况

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期内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

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.8 报告期内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。

5.9 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。