

## 富国7天理财宝债券型证券投资基金

## [2013] 第一季度报告

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:	2013年04月22日

## § 1 重要提示

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,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运作分析

2013年第一季度,宏观经济整体延续温和复苏的进程,CPI指数低位运行,市场流动性处于中性偏宽松的状态。本基金严格遵守《基金合同》的约定,在资产配置比例的基础上,根据整体资产配置策略进行投资管理,根据对市场流动性的预期,在资产配置比例的基础上加大债券类资产的投资比重,适当增加组合久期,同时压缩了短期回购的比例,获取了一季度稳定性宽松环境下固收收益率价值上升的收益。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

4.5.1报告期本基金单位净值收益率为0.9162%,B级0.9887%,同期业绩比较基准收益率为A级0.3375%、B级0.3375%。

## § 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	固定收益投资	301,247,552.62	36.10
其中:债券	301,247,552.62	36.10	
资产支持证券	-	-	
2	买入返售金融资产	181,000,591.50	21.69
其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-	
3	银行存款和结算备付金合计	318,258,035.98	38.14
4	其他资产	33,874,039.05	4.06
5	合计	834,380,219.15	100.00

## 5.2报告期末债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资本金额	9.28
其中:买断式回购融资	-	
2	报告期末债券回购融资本金额	157,999,481.00
其中:买断式回购融资	23.36	

## 5.3报告期末持有的债券回购融资基本情况

序号	项目	天数
1	报告期内未投资组合平均剩余期限	67
2	报告期内内投资组合平均剩余期限最高值	109
3	报告期内内投资组合平均剩余期限最低值	56

报告期初投资组合平均剩余期限超过127天的说明  
注:本基金管理人承诺:“本基金在进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;在报告期间内,本基金未发生超标情况。”

## 5.4报告期末按行业分类的债券投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	债券投资	834,380,219.15	100.00
2	其中:国债	-	-
3	地方政府债	-	-
4	企业债	-	-
5	金融债	-	-
6	可转换债券	-	-
7	信用债	-	-
8	短期融资券	-	-
9	超短期融资券	-	-
10	资产支持证券	-	-
11	次级债	-	-
12	中小企业私募债	-	-
13	其他	-	-

## 5.5报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	080210	08国债10	800,000.00	9.28
2	100001	09国债01	50,409,763.00	5.74
3	041252016	12农商行CP001	400,000,000.00	4.59
4	1008051	10农银票据01	30,000,000.00	3.43
5	041270005	12浦发银行CP001	300,000,000.00	3.44
6	04125602	12光大银行P003	200,000,000.00	2.38
7	0810149	10宏图国債01	200,000,000.00	2.37
8	041262030	12沪农商行CP001	100,000,000.00	1.10
9	041260097	12闻泰龙CP002	100,000,000.00	1.10
10	1082117	10上海港MTN1	100,000,000.00	1.10

## 5.6关于定价与预估值确定的基金资产净值的偏离

序号	项目	偏离情况
1	报告期年内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%之间的次数	-
2	报告期内内偏离度的最高值	0.1891%
3	报告期内内偏离度的最低值	0.0623%
4	报告期内内每只交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1067%

## 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债券投资明细

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	080210	08国债10	800,000.00	9.28
2	100001	09国债01	50,409,763.00	5.74
3	041252016	12农商行CP001	400,000,000.00	4.59
4	1008051	10农银票据01	30,000,000.00	3.43
5	041270005	12浦发银行CP001	300,000,000.00	3.44

## 5.8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资产支持证券投资明细

序号	资产支持证券代码	资产支持证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	080210	08国债10	800,000.00	9.28
2	100001	09国债01	50,409,763.00	5.74
3	041252016	12农商行CP001	400,000,000.00	4.59
4	1008051	10农银票据01	30,000,000.00	3.43
5	041270005	12浦发银行CP001	300,000,000.00	3.44

## 5.9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贵金属投资明细

序号	品种	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	存出保证金	-	-	-
2	应收证券清算款	-	-	-
3	应收股利	-	-	-
4	应收利息	-	-	-
5	应付申购款	-	-	-
6	其他应收款	-	-	-
7	待摊费用	-	-	-
8	其他	-	-	-
9	合计	-	-	-

## 5.10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

序号	证券代码	证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600031	上海银行	10,000,000.00	1.19
2	600036	招商银行	9,000,000.00	1.04
3	600039	工商银行	8,000,000.00	0.90
4	600051	交通银行	7,000,000.00	0.80
5	600058	浦发银行	6,000,000.00	0.67
6	600060	兴业银行	5,000,000.00	0.56
7	600066	平安银行	4,000,000.00	0.45
8	600068	中信银行	3,000,000.00	0.34
9	600070	建设银行	2,000,000.00	0.23
10	600077	民生银行	1,000,000.00	0.11

## 5.11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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)



<tbl\_r cells="5" ix="3" maxcspan