

富国纯债债券型发起式证券投资基金

[2013] 第二季度报告

基金管理人:富国基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年7月18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2013年7月16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。

本报告期无财务资料未审计。

本报告期自2013年4月1日起至2013年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称:富国纯债债券发起型

基金主代码:100066

契约型开放式

基金合同生效日:2012年11月22日

报告期末基金份额总额(单位:份):2,145,122,979.23

投资目标:本基金在追求本金安全、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,力争为持有人提供较高的当期收益率以及长期稳定的回报。

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。在认真研究宏观经济运行状况和金融市场趋势的基础上,根据类属资产配置策略动态调整类属类金融资产的比例;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类属资产进行最优化配置和调整。

业绩比较基准: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低于货币市场基金,低于股票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:中国工商银行股份有限公司

下属两级基金的基金简称:富国纯债债券发起A/B

下属两级基金的交易代码:100066 100068

报告期末下属两级基金的份额总额(单位:份):1,077,552,798.80 1,067,570,180.43

§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

A/B级 报告期(2013年04月01日-2013年06月30日) 报告期(2013年04月01日-2013年06月30日)

1.本期已实现收益 16,784,895.48 15,429,899.40

2.本期利润 12,350,131.51 11,024,807.83

3.加权平均基金份额本期利润 0.0899 0.0766

4.期末基金资产净值 1,103,079,221.40 1,090,207,299.28

5.期末基金份额净值 1.024 1.021

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

1)A级

阶段(①) 净值增长率(%) 0.88% 0.93% 0.11% -0.05% -0.02%

2)C级

阶段(①) 净值增长率(%) 0.78% 0.88% 0.93% 0.11% -0.15% -0.03%

注:过去三个月指2013年4月1日-2013年6月30日

3.2.2 自基金合同生效以来富国纯债债券发起A/B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)自基金合同生效以来富国纯债债券发起A/B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

5)基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

6)报告期末持有的处于转持期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转持期的可转换债券。

5.8.1 本报告期未发现异常交易情况说明

5.8.2 本报告期未发现基金的控股股东或实际控制人未按期披露定期报告。

5.8.3 本报告期未发现基金投资组合的约定,不允许投资股指期货。

5.9.1 本报告期未发现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。

5.9.2 本报告期未发现基金投资的前十名证券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。

5.9.3 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 135,753.64

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 48,523,350.52

5 应收申购款 238,902,996.22

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 287,562,100.38

5.9.4 报告期未持有的处于转持期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转持期的可转换债券。

5.9.5 本报告期未发现异常交易情况说明

5.9.6 本报告期未发现基金的控股股东或实际控制人未按期披露定期报告。

5.9.7 本报告期未发现基金投资组合的约定,不允许投资股指期货。

5.9.8 本报告期未发现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。

5.9.9 本报告期未发现基金投资的前十名证券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。

5.9.10 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 135,753.64

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 48,523,350.52

5 应收申购款 238,902,996.22

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 287,562,100.38

5.9.11 本报告期未发现异常交易情况说明

5.9.12 本报告期未发现基金的控股股东或实际控制人未按期披露定期报告。

5.9.13 本报告期未发现基金投资组合的约定,不允许投资股指期货。

5.9.14 本报告期未发现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。

5.9.15 本报告期未发现基金投资的前十名证券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。

5.9.16 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 135,753.64

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 48,523,350.52

5 应收申购款 238,902,996.22

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 287,562,100.38

5.9.17 本报告期未发现异常交易情况说明

5.9.18 本报告期未发现基金的控股股东或实际控制人未按期披露定期报告。

5.9.19 本报告期未发现基金投资组合的约定,不允许投资股指期货。

5.9.20 本报告期未发现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。

5.9.21 本报告期未发现基金投资的前十名证券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。

5.9.22 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 135,753.64

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 48,523,350.52

5 应收申购款 238,902,996.22

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 287,562,100.38

5.9.23 本报告期未发现异常交易情况说明

5.9.24 本报告期未发现基金的控股股东或实际控制人未按期披露定期报告。

5.9.25 本报告期未发现基金投资组合的约定,不允许投资股指期货。

5.9.26 本报告期未发现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。

5.9.27 本报告期未发现基金投资的前十名证券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。

5.9.28 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 135,753.64

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 48,523,350.52

5 应收申购款 238,902,996.22

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 287,562,100.38

5.9.29 本报告期未发现异常交易情况说明

5.9.30 本报告期未发现基金的控股股东或实际控制人未按期披露定期报告。

5.9.31 本报告期未发现基金投资组合的约定,不允许投资股指期货。

5.9.32 本报告期未发现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。

5.9.33 本报告期未发现基金投资的前十名证券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。

5.9.34 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 135,753.64

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -