# 富国信用债债券型证券投资基金

## 【2013】第三季度报告

| | |
|---|---|
| 基金管理人: | 富国基金管理有限公司 |
| 基金托管人: | 中国建设银行股份有限公司 |
| 报告送出日期: | 2013年10月23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2013年10月21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7月1日起至2013年9月30日止。

### §2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 富国信用债债券 | |
| 基金主代码 | 000191 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2013年06月25日 | |
| 报告期末基金份额总额(单位:份) | 762,425,314.53 | |
| 投资目标 | 本基金以信用债券为主要投资对象,在追求本金安全的基础上谨慎投资,力争实现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类属资产进行最优化配置和调整。 | |
| 业绩比较基准 | 中债企业债总全价指数 | |
| 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 | |
| 下属两级基金的基金简称 | 富国信用债债券A | 富国信用债债券C |
| 下属两级基金的交易代码 | 000191 | 000192 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额(单位:份) | 509,686,261.55 | 252,739,052.98 |

### §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 | A级 报告期(2013年07月01日-2013年09月30日) | C级 报告期(2013年07月01日-2013年09月30日) |
|---|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 7,589,775.75 | 3,541,908.17 |
| 2.本期利润 | 5,962,187.00 | 2,672,430.11 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0101 | 0.0089 |
| 4.期末基金资产净值 | 515,330,157.89 | 255,252,838.68 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0110 | 1.0100 |

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

①A级

| 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 | 1.00% | 0.07% | -1.44% | 0.08% | 2.44% | -0.01% |

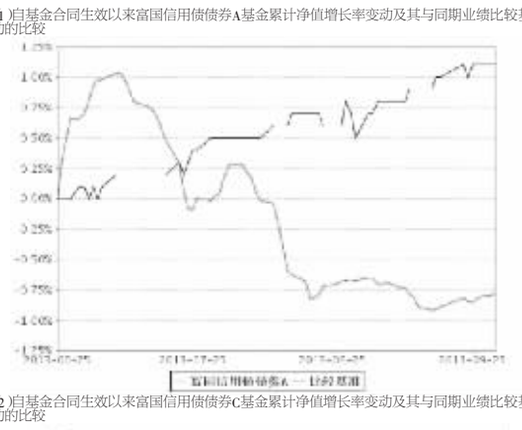
②C级

| 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 | 0.90% | 0.07% | -1.44% | 0.08% | 2.34% | -0.01% |

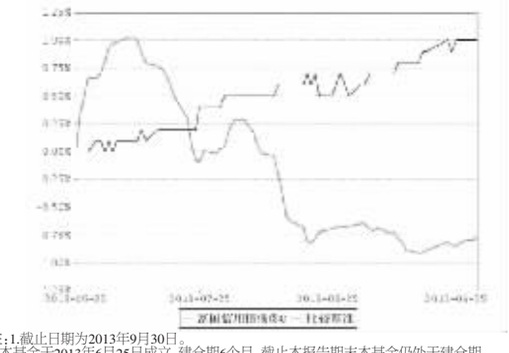
注:过去三个月指2013年7月1日-2013年9月30日

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净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

①自基金合同生效以来富国信用债债券A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



②自基金合同生效以来富国信用债债券C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:1.截止日期为2013年9月30日。
2.本基金于2013年6月25日成立,建仓期6个月,截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

### §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 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 邹卉 | 本基金基金经理兼任富国天时货币市场基金基金经理、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金基金经理、富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理 | 2013-06-25 | - | 8年 | 硕士,曾任上海国泰人寿保险有限公司投资部投资助理,东方基金管理有限公司债券研究员,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,2012年11月起任富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理,2013年6月起任富国信用债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信用债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》、《富国信用债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长为目标,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、操作层面确保各组合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

四季度经济政策不可预见性仍然较高,本基金将密切关注经济通胀以及政策对债市的影响。操作上,信用债将继续强调风险控制至上的原则,严格把控产业债和城投债的资质,注重组合的分散性,而对利率债,则从观望态度转向适当参与,杠杆或有适当变化。总而言之,本基金将持续调整持仓结构,争取为基金持有人带来可持续的稳定投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期,本基金净值增长率A级1.00%、C级0.90%;业绩比较基准收益率A级-1.44%、C级-1.44%。

### §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 | 768,074,861.90 | 68.92 |
| | 其中:债券 | 768,074,861.90 | 68.92 |
| | 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 | 320,233,323.67 | 28.73 |
| 6 | 其他资产 | 26,199,233.17 | 2.35 |
| 7 | 合计 | 1,114,507,418.74 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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投资。

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 | - | - |
| | 其中:政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 768,074,861.90 | 99.67 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 768,074,861.90 | 99.67 |

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 | 123461 | 13证金16 | 800,000 | 80,000,000.00 | 10.38 |
| 2 | 122760 | 12南富债 | 550,000 | 56,540,000.00 | 7.34 |
| 3 | 122789 | 11象屿债 | 500,000 | 50,800,000.00 | 6.59 |
| 4 | 122567 | 12小清河 | 399,990 | 41,198,970.00 | 5.35 |
| 5 | 122722 | 12准水利 | 300,010 | 31,591,053.00 | 4.10 |

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投资。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 74,620.63 |
| 2 | 应收证券清算款 | 12,363,795.13 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 13,701,194.39 |
| 5 | 应收申购款 | 59,623.02 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 26,199,233.17 |

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:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

| 项目 | A级 | C级 |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 603,928,919.59 | 315,301,677.40 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 447,332.63 | 35,296,525.39 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 94,689,990.67 | 97,859,149.81 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 509,686,261.55 | 252,739,052.98 |

### §7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

注:本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎本基金。

### §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信用债债券型证券投资基金的文件
2、富国信用债债券型证券投资基金基金合同
3、富国信用债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、富国信用债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

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
2013年10月23日

# 富国优化增强债券型证券投资基金

## 【2013】第三季度报告

| | |
|---|---|
| 基金管理人: | 富国基金管理有限公司 |
| 基金托管人: | 中国建设银行股份有限公司 |
| 报告送出日期: | 2013年10月23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2013年10月21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7月1日起至2013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 | |
| 基金主代码 | 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) | 691,547,586.69 | |
| 投资目标 | 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以及长期稳定的投资回报。 | |
| 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,在债券投资过程中突出主动性的投资管理。<br>本基金通过对宏观经济以及债券市场中长期发展趋势的客观判断,合理配置收益率相对较高的企业债、公司债、资产支持证券,以及风险收益特征优异的可转换债、可分离债券、可交换债券等,加以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 | |
| 下属两级基金的基金简称 | 富国优化增强债券A/B级 | 富国优化增强债券C级 |
| 下属两级基金的交易代码 | 100035 | 100037 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额(单位:份) | 386,658,920.02 | 304,888,666.67 |

### §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 | A/B级 报告期(2013年07月01日-2013年09月30日) | C级 报告期(2013年07月01日-2013年09月30日) |
|---|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 5,665,541.83 | 5,544,977.93 |
| 2.本期利润 | 4,511,349.18 | 7,166,682.54 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0157 | 0.0246 |
| 4.期末基金资产净值 | 419,165,717.35 | 324,461,972.99 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.084 | 1.064 |

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

①A/B级

| 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 | 1.31% | 0.14% | 0.04% | 0.16% | 1.27% | -0.02% |

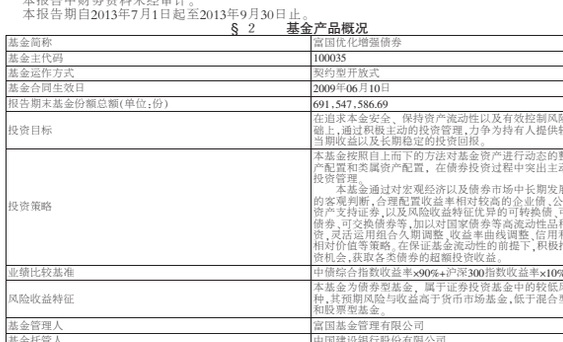
②C级

| 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 | 1.24% | 0.13% | 0.04% | 0.16% | 1.20% | -0.03% |

注:过去三个月指2013年7月1日-2013年9月30日

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净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

①自基金合同生效以来富国优化增强债券A/B级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



②自基金合同生效以来富国优化增强债券C级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2013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(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 陈曙光 | 本基金基金经理兼任富国天利增长债券投资基金基金经理、富国可转换债券证券投资基金基金经理 | 2012-12-18 | - | 6年 | 硕士,2008年6月至2012年1月任富国基金管理有限公司助理定量研究员、定量研究员;2012年2月至4月任富国基金管理有限公司年金投资经理,2012年7月任富国天利增长债券投资基金基金经理,富国可转换债券证券投资基金基金经理;2012年12月任富国优化增强债券基金基金经理。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、操作层面确保各组合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

三季度以来,受到海外需求恢复以及大宗商品价格上升的影响,企业生产预期转暖,同时受到稳增长政策预期的推动,工业生产止跌回升,经济增速上升。但由于经济内需动力不强,持续复苏难以看到,预计四季度工业生产将有所放缓,整体经济呈现平稳态势。

三季度中,我们保持较低的风险资产,缩短组合久期,降低组合的杠杆比例,在市场收益率上行的过程中,保持了组合净值的稳定上行。并分享了重工转债复牌对组合净值的积极贡献。

四季度,我们会适时提高组合的杠杆,在控制信用风险的前提下,增加组合的弹性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期,本基金净值增长率A/B级1.31%、C级1.24%;业绩比较基准收益率A/B级0.04%、C级0.04%。

### §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 | 654,771,986.66 | 85.15 |
| | 其中:债券 | 654,771,986.66 | 85.15 |
| | 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 | 91,848,983.68 | 11.94 |
| 6 | 其他资产 | 22,353,046.31 | 2.91 |
| 7 | 合计 | 768,974,016.65 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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投资。

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 | 22,988,500.00 | 3.09 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 29,958,000.00 | 4.03 |
| | 其中:政策性金融债 | 29,958,000.00 | 4.03 |
| 4 | 企业债券 | 593,360,686.66 | 79.79 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 8,464,800.00 | 1.14 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 654,771,986.66 | 88.05 |

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 | 0980100 | 09常高新债 | 500,000 | 49,865,000.00 | 6.71 |
| 2 | 120245 | 12国开45 | 300,000 | 29,958,000.00 | 4.03 |
| 3 | 122952 | 09赣州债 | 238,540 | 24,020,978.00 | 3.23 |
| 4 | 019219 | 12国债19 | 230,000 | 22,988,500.00 | 3.09 |
| 5 | 122964 | 09龙湖债 | 199,360 | 20,653,696.00 | 2.78 |

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投资。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 178,155.53 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 16,838,572.81 |
| 5 | 应收申购款 | 5,336,317.97 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 22,353,046.31 |

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 | 8,464,800.00 | 1.14 |

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

| 项目 | A/B级 | C级 |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 190,154,774.18 | 218,209,617.49 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 252,053,058.67 | 545,912,819.97 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 55,548,912.83 | 459,233,770.79 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 386,658,920.02 | 304,888,666.67 |

### §7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

注: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 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基金管理有限公司的文件
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

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
2013年10月23日

# 富国中国中小盘(香港上市)股票型证券投资基金

## 【2013】第三季度报告

| | |
|---|---|
| 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10月23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10月21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7月1日起至2013年9月30日止。

### §2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 富国中国中小盘股票(QDII) |
| 基金主代码 | 100061 |
| 交易代码 | 前端交易代码:100061<br>后端交易代码:000162 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2012年09月04日 |
| 报告期末基金份额总额(单位:份) | 35,131,544.31 |
| 投资目标 | 本基金主要投资于香港市场中的中国概念中小盘股票,通过精选个股和风险控制,力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。 |
| 投资策略 | 通过积极主动的投资,精选香港市场中具有中国概念的优质股票进行投资,分享中国经济快速成长的成果。中小盘股票成长空间大,且往往存在估值洼地,能够为投资者带来超额收益。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为:MSCI中国自由投资中小盘股票指数(MSCI China Free SMID Index)收益率×80%+香港三个月期银行同业拆借利率(Hong Kong 3-Month Interbank Offer Rate)×20%。 |
| 风险收益特征 | 本基金是股票型基金,其预期风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的投资品种。 |
| 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 |
| 境外投资顾问 | 英文名称:-<br>中文名称:- |
| 境外资产托管人 | 英文名称:The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited<br>中文名称:香港上海汇丰银行有限公司 |

### §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07月01日-2013年09月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 1,629,975.47 |
| 2.本期利润 | 4,071,895.63 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1189 |
| 4.期末基金资产净值 | 49,835,677.81 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.419 |

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。

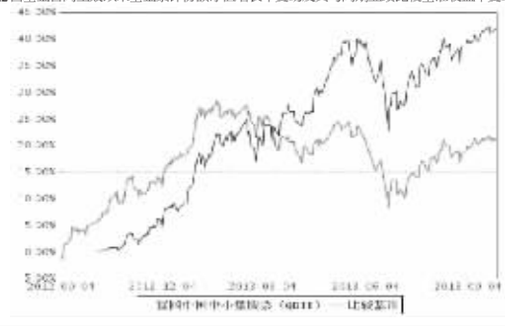
3.2 基金净值表现

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 | 9.32% | 0.89% | 6.38% | 0.75% | 2.94% | 0.14% |

注:过去三个月指2013年7月1日-2013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



注:截止日期为2013年9月30日。

本基金建仓期6个月,即从2012年9月4日起至2013年3月3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 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 张峰 | 本基金基金经理兼任富国全球顶级消费品股票型证券投资基金基金经理 | 2012-09-04 | - | 12年 | 硕士,曾任摩根史丹利研究部助理,里昂证券股票分析员,摩根大通执行董事,美林证券高级董事;自2009年7月至2011年4月任富国基金管理有限公司周期性行业研究负责人,2011年4月至2012年12月起任富国全球债券证券投资基金基金经理,自2011年7月起任富国全球顶级消费品股票型证券投资基金基金经理,自2012年9月起任富国中国中小盘(香港上市)股票型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格,中国香港。 |

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注:本基金无境外投资顾问。

4.3 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中国中小盘(香港上市)股票型证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国中国中小盘(香港上市)股票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长为目标,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。

4.4 公