

富国强回报定期开放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及董事会对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的规定，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。

本报告期财务资料未经审计。

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 富国强回报定期开放债券

基金主代码 100072

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2013年01月29日

报告期末基金份额总额(单位:份) 1,297,192,218.73

投资目标 本基金的投资目标是在追求本金长期安全的基础上，通过合理的资产配置，创造超越基金基准的稳定收益。

投资策略 本基金在综合分析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别资产进行优化配置调整。

业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的商业银行定期存款基准利率(税后)+1.12%。

风险收益特征 本基金为债券型基金，属于二级债券型基金，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 中国工商银行股份有限公司

下属两级基金的基金简称 富国强回报定期开放债券A/B

下属两级基金的交易代码 100072/100073

报告期末下属两级基金的份额总额(单位:份) 515,676,247.93/781,515,970.80

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

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 7,027,401.91 10,041,327.08

2.本期利润 148,455.66 -1,156,891.95

3.加权平均基金份额本期利润 0.0003 -0.0014

4.期末基金资产净值 533,445,103.86 805,802,979.74

5.期末基金份额净值 1.034 -

3.2.1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

A/B级 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.00% 0.08% 1.21% 0.01% -1.21% 0.07%

2/Q级 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.10% 0.07% 1.21% 0.01% -1.31% 0.06%

注:过去一个季度(2013年7月1日至2013年9月30日)。

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

自基金合同生效以来富国强回报定期开放债券A/B基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.3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

A/B级 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.00% 0.08% 1.21% 0.01% -1.21% 0.07%

2/Q级 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.10% 0.07% 1.21% 0.01% -1.31% 0.06%

注:过去一个季度(2013年7月1日至2013年9月30日)。

3.2.4报告期基金份额净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

自基金合同生效以来富国强回报定期开放债券A/B基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.5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

A/B级 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.00% 0.08% 1.21% 0.01% -1.21% 0.07%

2/Q级 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.10% 0.07% 1.21% 0.01% -1.31% 0.06%

注:过去一个季度(2013年7月1日至2013年9月30日)。

3.2.6报告期基金份额净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

自基金合同生效以来富国强回报定期开放债券A/B基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.7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

A/B级 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.00% 0.08% 1.21% 0.01% -1.21% 0.07%

2/Q级 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.10% 0.07% 1.21% 0.01% -1.31% 0.06%

注:过去一个季度(2013年7月1日至2013年9月30日)。

3.2.8报告期基金份额净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

自基金合同生效以来富国强回报定期开放债券A/B基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.9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

A/B级 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.00% 0.08% 1.21% 0.01% -1.21% 0.07%

2/Q级 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.10% 0.07% 1.21% 0.01% -1.31% 0.06%

注:过去一个季度(2013年7月1日至2013年9月30日)。

3.2.10报告期基金份额净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

自基金合同生效以来富国强回报定期开放债券A/B基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.11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

A/B级 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.00% 0.08% 1.21% 0.01% -1.21% 0.07%

2/Q级 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.10% 0.07% 1.21% 0.01% -1.31% 0.06%

注:过去一个季度(2013年7月1日至2013年9月30日)。

3.2.12报告期基金份额净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

自基金合同生效以来富国强回报定期开放债券A/B基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.13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

A/B级 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.00% 0.08% 1.21% 0.01% -1.21% 0.07%

2/Q级 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.10% 0.07% 1.21% 0.01% -1.31% 0.06%

注:过去一个季度(2013年7月1日至2013年9月30日)。

3.2.14报告期基金份额净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

自基金合同生效以来富国强回报定期开放债券A/B基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.15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

A/B级 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.00% 0.08% 1.21% 0.01% -1.21% 0.07%

2/Q级 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.10% 0.07% 1.21% 0.01% -1.31% 0.06%

注:过去一个季度(2013年7月1日至2013年9月30日)。

3.2.16报告期基金份额净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

自基金合同生效以来富国强回报定期开放债券A/B基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.17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

A/B级 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.00% 0.08% 1.21% 0.01% -1.21% 0.07%

2/Q级 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.10% 0.07% 1.21% 0.01% -1.31% 0.06%

注:过去一个季度(2013年7月1日至2013年9月30日)。

3.2.18报告期基金份额净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

自基金合同生效以来富国强回报定期开放债券A/B基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.19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

A/B级 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.00% 0.08% 1.21% 0.01% -1.21% 0.07%

2/Q级 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.10% 0.07% 1.21% 0.01% -1.31% 0.06%

注:过去一个季度(2013年7月1日至2013年9月30日)。

3.2.20报告期基金份额净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

自基金合同生效以来富国强回报定期开放债券A/B基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.21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

A/B级 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.00% 0.08% 1.21% 0.01% -1.21% 0.07%

2/Q级 阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.10% 0.07% 1.21% 0.01% -1.31% 0.06%

注:过去一个季度(2013年7月1日至2013年9月30日)。

3.2.22报告期基金份额净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

自基金合同生效以来富国强回报定期开放债券A/B基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.23报告期基金份额