

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 送出日期:2013年03月26日	§1 重要提示及目录 1.1 重要提示 富国基金管理有限公司的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。 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3月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。 本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。 本报告自2012年1月1日起至2012年12月31日止。
--	--

2.1 基金基本情况	富国全球债券(QDII-FOF)
基金名称	富国全球债券(QDII-FOF)
基金代码	100050
交易代码	前端交易代码:100050 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	2010年10月20日
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
报告期末基金份额总额	102,699,987.53份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明	富国全球债券(QDII-FOF)
投资目标	本基金主要投资于全球债券市场,通过运用基金中基金(FOF:fund of funds)这种国际流行的投资管理方式,力争实现资产运作精细化,组合配置最优化,风险调整后收益最大化,从而实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用战略资产配置与战术资产配置相结合的策略,通过“自上而下”的方式进行资产配置,在有效分散风险(即,分散投资于单一国家或区域债券基金、单一债券类型基金以及单一基金公司及经理人的投资风险)的同时,力争实现基金资产风险调整后收益最大化。在本基金资产组合构建过程中,根据不同投资标的的投资等级和流动性等因素,将基金资产细分为核心仓位和卫星仓位。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:Barclay Global Aggregate Index。
风险收益特征	本基金为债券型基金中基金,属于证券投资基金中的中低风险品种,其预期风险和收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人	基金管理人	基金托管人
名称	富国基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	陈永涛	010—66105799
电子邮箱	public@fuguo.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	95105666,400880668	95588
传真	021-20361616	010—66105798

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文 BMO Asset Management Inc. 中文 蒙特利尔银行资产管理公司	Brown Brothers Harriman & Co. 布朗兄弟哈里斯曼银行
注册地址	77 King Street West Suite 4200 Toronto, ON M5K 1J5 Canada	140 Broadway New York, NY 10005
办公地址	77 King Street West Suite 4200 Toronto, ON M5K 1J5 Canada	140 Broadway New York, NY 10005
邮政编码	M5K 1J5	10005

2.5 信息披露方式	富国基金信息披露网站
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fuguo.com.cn
基金年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16—17层 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街55号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	富国全球债券(QDII-FOF)
3.1 主要会计数据和财务指标	富国全球债券(QDII-FOF)

3.1.1 期间数据和指标	2012年	2011年	2010年10月20日(基金合同生效日)至2010年12月31日
本期已实现收益	2,238,714.63	-5,195,684.47	-333,595.03
本期利润	8,176,388.34	-6,350,033.98	-139,103.93
加权平均基金份额本期利润	0.0682	-0.0228	-0.0002
本期基金份额净值增长率	6.05%	-4.30%	-0.00%
3.1.2 期末数据和指标	2012年12月31日	2011年12月31日	2010年12月31日
期末可供分配基金份额利润	-0.0186	-0.0425	-0.0014
期末基金资产净值	104,197,136.48	160,361,925.98	465,612,177.60
期末基金份额净值	1.015	0.957	1.0000

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。

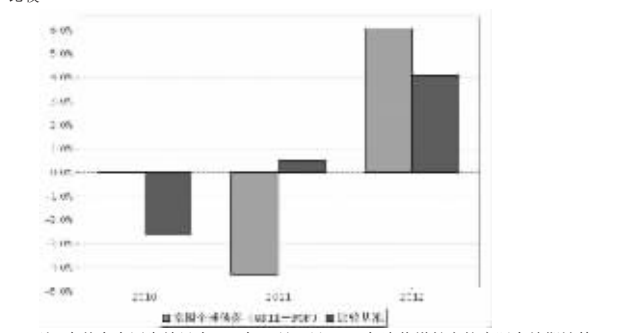
3.2 基金净值表现						
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率比较基准②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-0.20%	0.12%	-1.35%	0.16%	1.15%	-0.04%
过去六个月	4.64%	0.14%	2.14%	0.20%	2.50%	-0.06%
过去一年	6.06%	0.16%	4.06%	0.23%	2.00%	-0.07%
自基金合同生效	1.50%	0.19%	1.84%	0.29%	-0.34%	-0.10%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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2012年12月31日。
本基金建仓期为6个月,即从2010年10月20日起至2011年4月19日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金合同生效日为2010年10月20日,2010年净值增长率按实际存续期计算。

单位:人民币元

年度	每10份基金份额 分红金额	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	年度利润分配合计	备注
2012年	-	-	-	-	-
2011年	-	-	-	-	-
2010年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

4.1 基金管理人及基金经理情况	富国全球债券(QDII-FOF)
4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验	富国基金管理有限公司于1999年4月13日获国家工商行政管理部门登记注册成立,是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一,公司于2001年3月从北京迁址上海。2003年9月加拿大蒙特利尔银行(BMO)参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕,富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中,第一家中外合资的基金管理公司。截止2012年12月31日,本基金管理人共管理14项证券投资基金,1项兴证证券投资基金。富国天源平衡混合型证券投资基金、富国天利增长债券证券投资基金、富国天益价值证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金 LOF、富国天时货币市场基金、富国天合稳健增值股票型证券投资基金、富国天博创新主题股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、富国天丰强化收益债券型证券投资基金、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国优化增强债券型证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金、富国全球顶级消费品股票型证券投资基金、富国汇利分级债型证券投资基金、富国全球债券证券投资基金、富国可转换债券证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国天益分级债券型证券投资基金、富国全球顶级消费品股票型证券投资基金、富国低碳环保股票型证券投资基金、富国中证500指数增强型证券投资基金 LOF、富国产业债债券型证券投资基金、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金、富国高新技术产业股票型证券投资基金、富国中国中小盘(香港上市)股票型证券投资基金、富国7天理财债债券型证券投资基金、富国纯债债券型发起式证券投资基金、富国强化收益定期开放债券型证券投资基金三十二只证券投资基金。
4.1.2 基金经理、或基金经理小组简介	富国全球债券(QDII-FOF)

姓名	职务	任本基金基金经理期间 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
李军	本基金基金经理	2012-11-16	-	10年	硕士,曾任职于美国华尔街对冲基金 Fire Research & Management、LPS基金经理助理,工银瑞信基金管理有限公司境外高级分析师,2011年4月至2012年11月任富国基金资产管理人富国全球债券证券投资基金、富国全球顶级消费品股票型证券投资基金基金经理助理,2012年11月起任富国全球债券证券投资基金、富国全球顶级消费品股票型证券投资基金基金经理,具有基金从业资格,中国国籍。
张峰	本基金前任基金经理	2011-04-12	2012-12-18	11年	硕士,曾任摩根史丹利研究助理,担任证券股票分析师,摩根大通基金股票研究员,美国证券分析师,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员,自2011年4月至2012年12月担任富国全球债券证券投资基金、富国全球顶级消费品股票型证券投资基金基金经理,具有基金从业资格,中国国籍。

注:1、上述表列基金经理的任职日期、离任日期均指公司作出决定并公告披露之日。
证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

富国全球债券证券投资基金

2012 年度 报告 摘要

2、本公司于2012年11月16日、12月18日在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站上做公告,聘任李军先生担任本基金基金经理,张峰先生不再担任本基金基金经理。

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Michael Stanley	投资长, 总裁, 执行长	19	执行长, 同时也担任投资长, 并负责管理加拿大股票组合, 1994年加入蒙特利尔银行, 然后在1996年2月加入蒙特利尔资产管理公司至今。1979年获得多伦多大学工商管理士, 同时是注册金融分析师。
Mark McMahon	资深副总裁及固定收益主管	24	在加拿大固定收益市场有超过24年经验, 从2004年末开始成为蒙特利尔资产管理公司固定收益的领导投资经理至今。在此前, 负责管理蒙特利尔资产管理公司客户的债券组合, 1990年到加入蒙特利尔银行前, 在一家主要券商负责管理海外交易并且是私人客户部门的固定收益投资策略师, 1987年毕业于西蒙菲沙大学, 主修经济与金融, 同时是注册金融分析师。

4.3 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
本报告期, 富国基金管理有限公司作为富国全球债券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》、富国全球债券证券投资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, 力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约定。

4.4 管理人对于报告期内公平交易情况的专项说明
4.4.1 公平交易制度和控制方法
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、二级市场交易活动中的研究分析、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。

事中控制主要包括: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、交易所对手库及授权管理, 对投资标的、交易所对手操作权限进行市场化控制。
事后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易为限制行为, 非经特别控制流程审批同意, 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价格合理性评估, 以及不同时间窗口下4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行行为进行分析评估, 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。

4.4.2 公平交易制度的执行情况
本报告期, 在同向交易价差分析方面, 公司采集连续四个季度、不同时间窗口(4日内、3日内、5日内)的同向交易样本, 在假设同向交易价差为零及95%的置信水平下, 对同向交易价差进行分析并做检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。
本报告期内公司旗下本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。

4.4.3 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同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.5 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析
2012年, 全球债券市场表现良好。在美国与欧洲央行量化宽松的支持下, 国债收益率维持在较低的水平, 风险偏好上升, 国债、可转债级公司债、高收益债等各类债券都取得不错收益。全年巴采莱全球债券指数较人民币中间价计价上涨 4.06%, 本基金净值增长 6.06%。

本基金全年采取了较为均衡的配置策略, 在考虑无偏指数配置的同时, 适度加大了对高评级公司债券的投资, 也适当加了些许新兴市场债券, 超额收益较为明显。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现
截至2012年12月31日, 本基金份额净值为1.015元, 份额累计净值为1.015元。报告期内, 本基金份额净值增长率为6.06%, 同期业绩比较基准收益率为4.06%。

4.6 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望2013年, 我们认为欧美央行的货币政策会保持宽松, 债券收益率将比较平稳, 全球债券的投资价值将主要体现在两个方面:一是分散资产配置, 降低投资风险;二是分散货币配置, 降低汇率风险。

4.7 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
本公司按照相关法律法规的规定成立了估值委员会, 并制订了《富国基金管理有限公司估值委员会运作管理办法》。估值委员会是公司基金估值的主要决策机关, 由主管运营副总经理负责, 成员包括基金清算、监察稽核、金融工程方面的业务骨干以及相关基金经理, 所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会负责提出估值意见、提供和评估估值技术、执行估值决策和程序、对外信息披露等工作, 保证基金估值的公允性和合理性, 维护基金份额持有人的利益。估值委员会的重要成员, 必须列席估值委员会的定期会议, 提出基金估值流程及基金技术中存在的潜在问题, 参与估值程序和估值技术的决策。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

4.8 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况, 2012年报告期末本基金未满足收益分配条件, 故不进行收益分配。

§5 托管人报告
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明
2012年, 本基金托管人在对富国全球债券证券投资基金的托管过程中, 严格遵守《证券投资基金法》及相关法律法规和基金合同的有关规定, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
2012年, 富国全球债券证券投资基金的管理人——富国基金有限公司在富国全球债券证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 在各项方面的运作严格按照基金合同的约定进行。本报告期内, 富国全球债券证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告财务信息内容的真实性、准确和完整发表意见
本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露的富国全球债券证券投资基金2012年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查, 以上内容真实、准确和完整。

资产	本期末 (2012年12月31日)	上年度末 (2011年12月31日)
资产:		
银行存款	10,625,776.68	33,930,809.10
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	95,400,141.23	129,638,313.47
其中: 股票投资	-	-
基金投资	95,400,141.23	129,638,313.47
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	39,300.00
买入返售金融资产	-	16,000,000.00
应收利息	71,007.54	-
应收股利	961.23	7,147.89
应收申购款	52,214.40	99,397.45
应收待摊费用	27,137.69	5,014.13
其他资产	-	-
资产总计	106,177,238.77	179,719,982.04
负债和所有者权益		
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	17,575,697.57
应付赎回款	1,527,160.22	1,146,981.76
应付管理人报酬	82,598.88	124,839.31
应付托管费	20,190.82	30,516.27
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	-	-
负债合计	350,152.37	480,201.15
所有者权益	1,980,102.29	19,358,056.06
所有者权益:		
实收基金	102,699,987.53	167,487,783.29
未分配利润	1,407,148.95	-7,125,857.31
所有者权益合计	104,197,136.48	160,361,925.98
负债和所有者权益总计	106,177,238.77	179,719,982.04

注:报告截止日2012年12月31日, 基金份额净值1.015元, 基金份额总额102,699,987.53份。

7.2 利润表
会计主体: 富国全球债券证券投资基金
本报告期: 2012年01月01日至2012年12月31日

项目	本期 (2012年01月01日至2012年12月31日)	上年度可比期间 (2011年01月01日至2011年12月31日)
一、收入	10,183,588.66	-2,454,604.87
1.利息收入	138,992.64	1,576,813.92
其中: 国债利息收入	37,883.53	361,019.52
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
2.股利收入	-	-
其中: 股票股利收入	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	4,362,930.60	-2,190,697.35
其中: 处置投资资产收益	-	-
基金投资收益	2,863,122.53	-5,371,261.31
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具投资收益	38,100.00	674,364.75
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	1,461,708.07	2,506,199.21
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	5,938,223.71	-1,154,349.51
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-499,873.46	-1,001,929.37
5.其他收入(损失以“-”号填列)	243,315.17	315,557.44
其中: 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	2,006,450.32	3,895,429.11
二、费用	1,248,933.32	2,530,527.90
1.管理人报酬	-	-
2.托管费	305,294.85	618,573.56
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	84,036.15	320,440.85
5.利息支出	-	-
其中: 卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	368,386.00	425,886.80
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	8,176,938.34	-6,350,033.98
减: 所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	8,176,938.34	-6,350,033.98

项目	本期 (2012年01月01日至2012年12月31日)	上年度可比期间 (2011年01月01日至2011年12月31日)
一、期初所有者权益(基金净值)	167,487,783.29	-7,125,857.31
二、本期损益活动产生的基金净值变动数(本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-64,787,795.76	446,067.92
其中: 1.基金申购款	5,918,885.93	-9,583.24
2.基金赎回款	-70,706,681.69	455,651.16
其中: 1.基金申购款	-	-
三、期末所有者权益(基金净值)	102,699,987.53	1,497,148.95
四、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	102,699,987.53	1,497,148.95
六、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-
七、期末所有者权益(基金净值)	102,699,987.53	1,497,148.95

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体: 富国全球债券证券投资基金
本报告期: 2012年01月01日至2012年12月31日

项目	本期 (2012年01月01日至2012年12月31日)	上期 (2011年01月01日至2011年12月31日)
一、期初所有者权益(基金净值)	167,487,783.29	-7,125,857.31
二、本期损益活动产生的基金净值变动数(本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-64,787,795.76	446,067.92
其中: 1.基金申购款	5,918,885.93	-9,583.24
2.基金赎回款	-70,706,681.69	455,651.16
其中: 1.基金申购款	-	-
三、期末所有者权益(基金净值)	102,699,987.53	1,497,148.95
四、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	102,699,987.53	1,497,148.95

报表附注为财务报表的组成部分。
本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

基金会计负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人
7.4 报表附注	7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明	7.4.2 会计差错更正的说明
7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明	7.4.2 会计差错更正的说明	7.4.3 关联方关系
7.4.2 会计差错更正的说明	7.4.3 关联方关系	7.4.4 关联方交易
7.4.3 关联方关系	7.4.4 关联方交易	7.4.5 关联方交易
7.4.4 关联方交易	7.4.5 关联方交易	7.4.6 关联方交易
7.4.5 关联方交易	7.4.6 关联方交易	7.4.7 关联方交易
7.4.6 关联方交易	7.4.7 关联方交易	7.4.8 关联方交易
7.4.7 关联方交易	7.4.8 关联方交易	7.4.9 关联方交易
7.4.8 关联方交易	7.4.9 关联方交易	7.4.10 关联方交易
7.4.9 关联方交易	7.4.10 关联方交易	7.4.11 关联方交易
7.4.10 关联方交易	7.4.11 关联方交易	7.4.12 关联方交易
7.4.11 关联方交易	7.4.12 关联方交易	7.4.13 关联方交易
7.4.12 关联方交易	7.4.13 关联方交易	7.4.14 关联方交易
7.4.13 关联方交易	7.4.14 关联方交易	7.4.15 关联方交易
7.4.14 关联方交易	7.4.15 关联方交易	7.4.16 关联方交易
7.4.15 关联方交易	7.4.16 关联方交易	7.4.17 关联方交易