

富国可转换债券证券投资基金

[2015] 第二季度报告

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

报告告出日期：2015年07月21日

§1

重要提示

富国基金管理有限公司的董事会及基金经理所披露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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2015年7月17日复核了本报告中的财务报表、净值表现和资产组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金托管人中国农业银行股份有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，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。

本报告期财务数据未经审计。

§2

基金产品概况

注：1.截止日期为2015年6月30日；

2.本基金于2010年12月9日成立，建仓期自2010年12月8日至2011年6月7日共6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3

基金管理人（基金经理小组）简介

基金名称：富国可转换债券证券投资基金

基金代码：100051

交易代码：161051

基金合同成立日：2010-12-10

基金合同生效日：2010-12-10

报告期末基金总资产(单位：元)：345,476,958.57

投资目标：本基金主要投资于股票品种并具备债券特性的品种，通过将一部分资产投资于股票类品种与部分资产投资于债券类品种，在保证在约定的投资期限内下方风险的基础上实现资产的增值。

投资策略：本基金主要投资于可转债品种，另一方面通过所持有的债券的特性，确保收益的安全性和稳定性，另一方面利用债券的特性（包含股票型），分享股票上涨所带来的较高收益。

业绩比较基准：本基金业绩比较基准：一年期国债指数收益率×60%+沪深300指数收益率×20%+中证转债指数收益率×20%

风险收益特征：本基金为债券型基金，属于债券基金中风险较低的品种，其预期风险与预期收益均低于货币市场基金，高于债券基金和股票基金。本基金主要投资于债券类资产，因此其风险和收益均低于股票类基金。

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

报告期末基金份额总额(单位：份)：62,309,051.05

报告期末开放式基金份额净值：1.0028

报告期末基金份额净值增长率：0.1628%

报告期末基金份额净值增长率标准差：0.0205%

报告期末基金份额净值增长率最大回撤：-0.51%

报告期末基金份额净值增长率最小回撤：-1.13%

报告期末基金份额净值增长率波动率：3.26%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：4.03%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：2.75%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：14.36%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：0.51%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：0.1628%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：0.0205%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.51%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-1.13%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-3.26%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-4.03%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-2.75%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-14.36%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.51%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.1628%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.0205%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.51%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-1.13%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-3.26%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-4.03%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-2.75%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-14.36%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.51%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.1628%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.0205%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.51%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-1.13%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-3.26%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-4.03%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-2.75%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-14.36%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.51%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.1628%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.0205%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.51%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-1.13%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-3.26%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-4.03%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-2.75%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-14.36%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.51%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.1628%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.0205%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.51%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-1.13%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-3.26%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-4.03%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-2.75%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-14.36%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.51%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.1628%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.0205%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.51%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-1.13%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-3.26%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-4.03%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-2.75%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-14.36%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.51%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.1628%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.0205%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.51%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-1.13%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-3.26%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-4.03%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-2.75%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-14.36%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.51%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.1628%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.0205%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.51%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-1.13%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-3.26%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-4.03%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-2.75%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-14.36%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.51%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.1628%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.0205%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.51%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-1.13%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-3.26%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-4.03%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-2.75%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-14.36%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.51%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.1628%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.0205%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.51%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-1.13%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-3.26%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-4.03%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-2.75%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-14.36%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.51%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.1628%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.0205%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.51%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-1.13%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-3.26%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-4.03%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-2.75%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-14.36%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.51%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.1628%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.0205%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.51%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-1.13%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-3.26%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-4.03%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-2.75%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-14.36%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.51%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.1628%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.0205%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.51%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-1.13%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-3.26%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-4.03%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-2.75%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-14.36%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.51%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.1628%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.0205%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.51%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-1.13%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-3.26%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-4.03%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-2.75%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-14.36%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.51%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.1628%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.0205%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-0.51%

报告期末基金份额净值增长率标准差系数：-1.13%