

富国可转换债券证券投资基金

【2015】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:	2015年10月26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2015年10月22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对基金净值以公允价值计量,公允价值计量结果的不确定性可能导致基金净值波动。 基金的投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。 本报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§2 基金产品概况
基金简称: 富国可转换债券
基金代码: 100051
交易代码: 100051 后交易代码: 100052
基金运作方式: 契约开放式
基金合同生效日: 2010年12月08日
报告期末基金份额总额(单位: 份): 301,031,744.34
投资目标: 本基金主要利用可转换债券品种兼具股票和债券的特性,通过“自上而下”宏观分析与“自下而上”个股选择有效结合,力争在锁定投资组合下方风险的基础上实现基金资产的长期增值。
投资策略: 本基金主要投资于可转债品种,一方面通过利用可转债的债券特性,规避股票的安全性,通过分散化投资,另一方面利用可转债的股票特性(内含股票期权),分享股市上涨所产生的投资收益。
业绩比较基准: 业绩比较基准=天相转债指数收益率*60%+沪深300指数收益率*20%+中债国债综合收益率*20%。
风险收益特征: 本基金为债券型基金,属于证券投资基金中风险较低品种,其预期风险与预期收益高于货币型基金,低于股票型基金和股票型基金。本基金主要投资于可转债品种,在债券基金中属于风险水平相对较低的投资品种。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

基金简称	报告期(2015年07月01日-2015年09月30日)
1.本期已实现收益	7,229,767.85
2.本期利润	-66,903,273.73
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2207
4.期末基金资产净值	479,495,144.79
5.期末基金份额净值	1.594

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	-1.125%	0.72%	-18.40%	3.07%	7.21%	-2.35%

注:过去三个月指2015年7月1日-2015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:1.截止日期为2015年9月30日。
2.本基金于2010年12月8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均符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人(或基金经理)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
张峰	基金经理	任职日期: 2014-03-26 离任日期: -	7年	硕士,曾任富国基金管理有限公司研究员,2011年8月至2012年10月任富国基金管理有限公司债券研究员,2012年10月至2015年6月任富国天源财富债券型证券投资基金基金经理,2013年1月至2015年4月任富国新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2014年3月起任富国新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2015年4月起任富国全球顶级消费品混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

注:1.上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期,离任日期为公司决定确定的解聘日期;首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2.证券从业年限以从事行业执业《证券基金从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 本报告期,富国基金管理人作为富国可转换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》、《富国可转换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,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,基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况
基金管理人根据相关法律法规要求,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交易知情权、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、交易对手和授权权限进行自动化控制。

事中监控主要包括投资组合内相似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,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,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)内,不同产品之间及同一基金经理管理不同组合的交叉行为,若发现异常交易行为,监察稽核部将提请要求相关当事人做出合理解释,并按规定要求上报辖区监管机构;2、季度公平性交易分析分析报告按照内控基金经理或投资经理签字,并经督察、总经理审阅签字后,归档备查,以备后查。

本报告期内公司旗下下属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较大规模的单边交易或超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
转债市场在前三季度呈现出前所未有的观望行情,债市所谓的“资产荒”现象在转债市场尤为突出:一方面受股市IPO暂停影响,转债发行也被迫中止,导致转债溢价率创历史新高;另一方面,权益市场经过一调整期后,机构看多情绪逐渐升温,也使得转债价差居高不下。面对120-130块区间震荡的转债市场,本基金选择继续维持低仓位,静待新发转债上市,利用股票仓位赚取对冲收益的策略,因此三季度净值表现良好,但相信四季度转债供给跟进后,转债市场有望重新迎来跑赢股市的机遇机会。

4.5 报告期内基金的投资业绩和业绩归因
本报告期,本基金净值增长率为-11.25%,同期业绩比较基准收益率为-18.46%。

4.6 报告期内管理人对本基金持有人人数或基金资产净值预警情形的说明
本报告期无需说明的相关情况。

§5 投资组合报告

5.1 投资组合报告

5.1.1 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	-	-
2	其中:股票	-	-
3	固定收益投资	459,076,300.40	93.55
4	其中:债券	459,076,300.40	93.55
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	30,279,317.70	6.16
11	其他资产	1,405,000.00	0.29
12	合计	491,160,518.10	100.00

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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资产。

5.4 报告期末按券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	国债	33,146,162.10	6.91
2	央行票据	-	-
3	金融债	-	-
4	其中:政策性金融债	-	-
5	企业债	329,776,220.30	66.70
6	企业短期融资券	40,008,000.00	8.34
7	中期票据	-	-
8	可转债	56,585,578.00	11.87
9	同业存单	-	-
10	其他	-	-
11	合计	459,076,300.40	96.82

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	120818	08国债(18)	3,312,150	33,146,162.10	6.91
2	123002	15国债02B	569,570	56,585,578.00	11.87
3	011512004	15年国债04	400,000	40,008,000.00	8.34
4	020077	15国债07	179,280	17,770,762.00	3.69
5	010609	15国债09	133,010	13,327,602.00	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序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序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金基金投资的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。

5.10 本报告期本基金投资的国债期货投资情况说明

5.10.1 本报告期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。

5.10.2 本基金基金投资的国债期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定,不允许投资国债期货。

5.10.3 本报告期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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、处罚的情形。

5.11.2 申明本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。
报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	474,416.93
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	799,779.36
5	其他应收款	131,699.26
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,405,000.00

5.11.4 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。

5.11.5 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的股票。

5.11.6 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项可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

项目	单位:份
报告期初基金份额总额	345,476,906.67
报告期内基金总申购份额	67,128,778.70
减:报告期内基金总赎回份额	111,574,030.23
报告期内基金净申购份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期末基金份额总额	301,031,744.34

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	单位:份
报告期初基金总份额	345,476,906.67
报告期内基金总申购份额	67,128,778.70
减:报告期内基金总赎回份额	111,574,030.23
报告期内基金净申购份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期末基金总份额	301,031,744.34

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	单位:份
报告期初基金总份额	345,476,906.67
报告期内基金总申购份额	67,128,778.70
减:报告期内基金总赎回份额	111,574,030.23
报告期内基金净申购份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期末基金总份额	301,031,744.34

§9 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

9.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	单位:份
报告期初基金总份额	345,476,906.67
报告期内基金总申购份额	67,128,778.70
减:报告期内基金总赎回份额	111,574,030.23
报告期内基金净申购份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期末基金总份额	301,031,744.34

§10 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

10.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	单位:份
报告期初基金总份额	345,476,906.67
报告期内基金总申购份额	67,128,778.70
减:报告期内基金总赎回份额	111,574,030.23
报告期内基金净申购份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期末基金总份额	301,031,744.34

§11 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

11.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	单位:份
报告期初基金总份额	345,476,906.67
报告期内基金总申购份额	67,128,778.70
减:报告期内基金总赎回份额	111,574,030.23
报告期内基金净申购份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期末基金总份额	301,031,744.34

§12 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

12.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	单位:份
报告期初基金总份额	345,476,906.67
报告期内基金总申购份额	67,128,778.70
减:报告期内基金总赎回份额	111,574,030.23
报告期内基金净申购份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期末基金总份额	301,031,744.34

§13 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

13.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	单位:份
报告期初基金总份额	345,476,906.67
报告期内基金总申购份额	67,128,778.70
减:报告期内基金总赎回份额	111,574,030.23
报告期内基金净申购份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期末基金总份额	301,031,744.34

§14 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

14.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	单位:份
报告期初基金总份额	345,476,906.67
报告期内基金总申购份额	67,128,778.70
减:报告期内基金总赎回份额	111,574,030.23
报告期内基金净申购份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期末基金总份额	301,031,744.34

§15 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

15.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	单位:份
报告期初基金总份额	345,476,906.67
报告期内基金总申购份额	67,128,778.70
减:报告期内基金总赎回份额	111,574,030.23
报告期内基金净申购份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期末基金总份额	301,031,744.34

§16 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

16.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	单位:份
报告期初基金总份额	345,476,906.67
报告期内基金总申购份额	67,128,778.70
减:报告期内基金总赎回份额	111,574,030.23
报告期内基金净申购份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期末基金总份额	301,031,744.34

§17 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

17.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	单位:份
报告期初基金总份额	345,476,906.67
报告期内基金总申购份额	67,128,778.70
减:报告期内基金总赎回份额	111,574,030.23
报告期内基金净申购份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期末基金总份额	301,031,744.34

§18 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

18.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	单位:份
报告期初基金总份额	345,476,906.67
报告期内基金总申购份额	67,128,778.70
减:报告期内基金总赎回份额	111,574,030.23
报告期内基金净申购份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期末基金总份额	301,031,744.34

§19 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

19.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	单位:份
报告期初基金总份额	345,476,906.67
报告期内基金总申购份额	67,128,778.70
减:报告期内基金总赎回份额	111,574,030.23
报告期内基金净申购份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期末基金总份额	301,031,744.34

§20 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

20.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	单位:份
报告期初基金总份额	345,476,906.67
报告期内基金总申购份额	67,128,778.70
减:报告期内基金总赎回份额	111,574,030.23
报告期内基金净申购份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期末基金总份额	301,031,744.34

§21 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

21.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	单位:份
----	------