富国可转换债券证券投资基金

2012 第一季度 报告

2012年3月31日

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
报告送出日期:2012年04月21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。

基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定,于2012年4月19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2012年1月1日起至2012年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国可转债
基金主代码	100051
交易代码	前端交易代码:100051 后端交易代码:100052
基金运作方式	契约型开放式
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)	3,102,023,458.12
投资目标	本基金主要利用可转债品种兼具债券和股票的特性,通过将“自上而下”宏观分析与“自下而上”个券选配有效结合,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稳定增值。
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,强调收益的安全性与稳定性,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较高收益。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准=天相转债指数收益率×60%+沪深300指数收益率×20%+中债综合指数收益率×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的品种,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。本基金主要投资于可转换债券,在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。
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

§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(2012年01月01日-2012年03月31日)
1.本期已实现收益	-47,102,527.39
2.本期利润	-2,872,013.20
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0009
4.期末基金资产净值	2,737,754,236.52
5.期末基金份额净值	0.883

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。

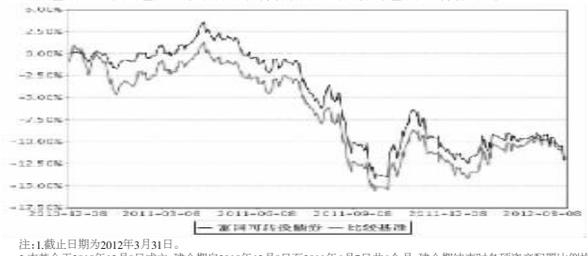
3.2 基金净值表现

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	0.00%	0.52%	1.63%	0.57%	-1.63%	-0.05%

注:过去三个月指2012年1月1日-2012年3月31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2012年3月31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		
杨贵宾	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。	2010-12-08	-	8年	博士,2005年9月任富国基金管理有限公司债券研究员、策略分析师;2009年3月至2010年6月任富国天时基金经理;2009年9月起任富国天利基金经理;2010年12月起任富国可转债基金经理。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(0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,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

1季度,欧债危机出现明显好转,虽有远忧却已无近虑,美国经济复苏也略好于预期。相形之下,国内经济回落速度快于预期,通货膨胀回落速度慢于预期。在此基础上货币政策继续偏向缓慢宽松,市场资金利率出现明显下行。市场环境从去年的“类滞胀”逐步向经济衰退+物价回落的“典型衰退”演变,略好于去年4季度。这种环境下股市出现一轮反弹,债市继续维持牛市格局。

1季度,我们认为经过连续下跌后,股市存在反弹机会,因此在债市上涨过程中,大幅减持了去年4季度加配的信用债,标配转债,同时增加了股票仓位。我们认为,未来货币政策仍将会逐步放松,经济在2季度见底的可能性比较大,股市存在波段性机会,因此转债也应有一定表现,且中小盘转债的机会更大。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金份额净值增长率为0.0%,同期业绩比较基准收益率为1.63%。

§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	486,548,008.31	16.77
	其中:股票	486,548,008.31	16.77
2	固定收益投资	2,336,705,860.58	80.55
	其中:债券	2,336,705,860.58	80.55
	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	61,097,535.84	2.11
6	其他资产	16,610,641.99	0.57
7	合计	2,900,962,046.72	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	249,996,526.72	9.13
C0	食品、饮料	60,369,985.74	2.21
C1	纺织、服装、皮毛	19,777,472.46	0.72
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	4,452,500.00	0.16
C4	石油、化学、塑胶、塑料	76,804,700.00	2.81
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	41,288,392.00	1.51
C7	机械、设备、仪表	47,303,476.52	1.73
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	77,020,095.46	2.81
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	27,916,011.54	1.02
G	信息技术业	1,643,000.00	0.06
H	批发和零售贸易	8,472,000.00	0.31
I	金融、保险业	110,248,000.00	4.03
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	11,252,374.59	0.41
M	综合类	-	-
	合计	486,548,008.31	17.77

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	17,000,000	106,590,000.00	3.89
2	600795	国电电力	18,500,037	47,730,095.46	1.74
3	000887	中鼎股份	3,230,000	35,820,700.00	1.31
4	000729	燕京啤酒	2,299,988	33,993,822.64	1.24
5	600600	青岛啤酒	809,830	26,376,163.10	0.96
6	000731	四川美丰	3,600,000	25,164,000.00	0.92
7	600674	川投能源	2,000,000	22,800,000.00	0.83
8	600219	南山铝业	2,991,325	20,939,275.00	0.76
9	002031	巨轮股份	2,987,117	20,670,849.64	0.76
10	601233	桐昆股份	1,703,486	19,777,472.46	0.72

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	150,215,000.00	5.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	81,862,128.60	2.99
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,104,628,731.98	76.87
8	其他	-	-
9	合计	2,336,705,860.58	85.35

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	113002	工行转债	5,300,000	573,831,000.00	20.96
2	113001	中行转债	5,540,000	524,748,800.00	19.17
3	110015	石化转债	4,943,300	499,668,764.00	18.25
4	019118	11国债18	1,000,000	100,200,000.00	3.66
5	110018	国电转债	870,000	90,767,100.00	3.32

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 投资组合报告附注

5.8.1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。

5.8.2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。

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。

5.8.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	105,622.49
2	应收证券清算款	4,770,705.70
3	应收股利	-
4	应收利息	11,528,867.43
5	应收申购款	205,446.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,610,641.99

5.8.4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	113002	工行转债	573,831,000.00	20.96
2	113001	中行转债	524,748,800.00	19.17
3	110015	石化转债	499,668,764.00	18.25
4	110018	国电转债	90,767,100.00	3.32
5	110013	国投转债	88,551,000.00	3.23
6	110011	歌华转债	87,609,000.00	3.20
7	110003	新钢转债	76,034,623.20	2.78
8	110012	海运转债	47,620,050.00	1.74
9	110007	博汇转债	41,462,650.00	1.51
10	110016	川投转债	30,472,954.80	1.11
11	125731	美丰转债	19,655,460.00	0.72
12	125089	深机转债	11,698,883.18	0.43
13	110017	中海转债	10,307,446.80	0.38

5.8.5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。

5.8.6 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

报告期期初基金份额总额	3,014,946,172.10
报告期期间基金总申购份额	307,745,301.23
减:报告期期间基金总赎回份额	220,668,015.21
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	3,102,023,458.12

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立富国可转换债券证券投资基金的文件

2、富国可转换债券证券投资基金基金合同

3、富国可转换债券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、富国可转换债券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

7.2 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

7.3 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
2012年04月21日

富国全球债券证券投资基金

2012 第一季度 报告

2012年3月31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
报告送出日期:2012年04月21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2012年4月19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2012年1月1日起至2012年3月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	富国全球债券(QDII-FOF)
基金主代码	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
报告期末基金份额总额 (单位:份)	155,622,822.88
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模式,力争实现资产运作细分化、组合配置最优化、风险管理精细化、风险调整后收益最大化,从而谋求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。在本基金资产组合的构建过程中,根据不同投资标的的投资等级和波动性等特征,基金资产被区分为核心资产和卫星资产。
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。
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: BMO Asset Management Inc. 中文名称: 蒙特利尔银行资产管理公司
境外资产托管人	英文名称: Brown Brothers Harriman & Co. 中文名称: 布朗兄弟哈里曼银行

§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(2012年01月01日-2012年03月31日)
1.本期已实现收益	-508,268.27
2.本期利润	1,552,325.79
3.加权平均基金份额本期利润	0.0096
4.期末基金资产净值	150,416,465.13
5.期末基金份额净值	0.967

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	1.04%	0.22%	0.77%	0.31%	0.27%	-0.09%

注:过去三个月指2012年1月1日-2012年3月31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2012年3月31日。

2.本基金于2010年10月20日成立,建仓期6个月,从2010年10月20日至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。

§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	2011-04-12	-	11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,自2011年4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。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

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年获得多伦多大学管理硕士,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22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,曾负责管理蒙特利尔资产管理公司客户的债券组合,1999年到加入蒙特利尔银行前,在一家主要券商负责管理零售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,同时也是注册金融分析师

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,以为投资者最少和分散风险,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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1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(0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。

4.4.2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,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。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期,基金净值增长率为1.04%,业绩比较基准收益率为0.77%。

§5 投资组合报告

5.1 期末基金资产组合情况

金额单位:元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:普通股	-	-
	存托凭证	-	-
2	基金投资	130,775,172.52	85.84
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	48,900.00	0.03
	其中:远期	48,900.00	0.03
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	21,511,185.84	14.12
8	其他资产	6,245.58	0.00
9	合计	152,341,503.94	100.00

5.2 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

注:本基金本报告期末未持有权益投资。

5.3 期末按行业分类的权益投资组合

注:本基金本报告期末未持有权益投资。

5.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

注:本基金本报告期末未持有权益投资。

5.5 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

注:本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位:元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	SPDR GOLD TRUST	开放式	ETF基金	World Gold Trust Services LLC/USA	5,298,736.11	2.70

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。

本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体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、处罚的证券。

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。

本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选基金库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	836.20
5	应收申购款	5,409.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,245.58

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资产。

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

报告期期初基金份额总额	167,487,783.29
报告期期间基金总申购份额	605,567.37
减:报告期期间基金总赎回份额	12,470,527.78
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	155,622,822.88

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立富国全球债券证券投资基金的文件

2、富国全球债券证券投资基金基金合同

3、富国全球债券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、富国全球债券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

7.2 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

7.3 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
2012年04月21日

富国全球顶级消费品股票型证券投资基金

2012 第一季度 报告

2012年3月31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
报告送出日期:2012年04月21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2012年4月19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2012年1月1日起至2012年3月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	富国全球顶级消费品股票(QDII)
基金主代码	100055
交易代码	前端交易代码:100055 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	2011年07月13日
报告期末基金份额总额 (单位:份)	190,775,104.73
投资目标	本基金主要投资于全球顶级消费品相关公司的股票,通过对投资对象的精选和组合投资,分散投资风险,力求实现基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	本基金采用“自上而下”资产配置与“自下而上”个券精选相结合的主动投资管理策略,通过精细化的风险管理,力求实现基金资产的中长期稳定增值。
业绩比较基准	本基金的业绩基准为道琼斯奢侈品指数(Dow Jones Luxury Index)。
风险收益特征	本基金为主要投资于全球顶级消费品制造商和顶级消费服务提供商的主动股票型基金,属于证券投资基金中高风险高预期收益的品种。
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:- 中文名称:-
境外资产托管人	英文名称: Brown Brothers Harriman & Co. 中文名称: 布朗兄弟哈里曼银行

§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(2012年01月01日-2012年03月31日)
1.本期已实现收益	11,748,043.96
2.本期利润	26,679,350.90
3.加权平均基金份额本期利润	0.1099
4.期末基金资产净值	196,216,061.77
5.期末基金份额净值	1.029

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。

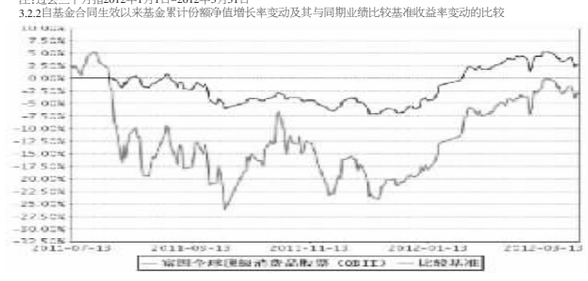
3.2 基金净值表现

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	10.41%	0.66%	22.51%	1.21%	-12.10%	-0.55%

注:过去三个月指2012年1月1日-2012年3月31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2012年3月31日。

本基金合同生效日为2011年7月13日。

本基金建仓期6个月,即从2011年7月13日起至2012年1月12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债券证券投资基金基金经理	2011-07-13	-	11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,自2011年4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。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全球顶级消费品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》、《富国全球顶级消费品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