

富国可转换债券证券投资基金

2012 第三季度 报告

2012年9月30日

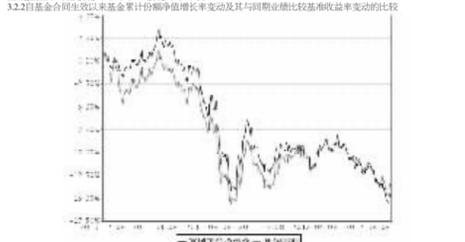
基金管理人:富国基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2012年10月25日

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。

Table with 2 columns: Item (基金名称, 基金代码, etc.) and Value (富国可转换债券, 100001, etc.)

Table with 2 columns: Item (1.本期已实现收益, 2.本期利润, etc.) and Value (-95,488,065.54, -118,798,905.59, etc.)

Table with 2 columns: Item (阶段, 净值增长率) and Value (-4.37%, 0.33%, etc.)



注:1.截止至本报告2012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比例符合基金合同的约定。

4.4 基金经理

Table with 5 columns: Name, Position, Start Date, End Date, and Remarks (赵恒, 基金经理, 2012-06-20, etc.)

4.5 公平交易情况说明

公平交易制度的执行情况
本基金经理严格按照法律法规要求,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、二级市场交易的分析、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管理。

4.6 异常交易行为专项说明

异常交易行为专项说明
报告期内,本基金管理人严格执行了《公平交易管理办法》,未发现异常交易行为。

4.7 关联交易情况说明

关联交易情况说明
报告期内,本基金管理人严格执行了《公平交易管理办法》,未发现关联交易行为。

4.8 报告期内基金的投资策略和业绩表现

报告期内基金的投资策略和业绩表现
报告期内,本基金管理人严格执行了《公平交易管理办法》,未发现异常交易行为。

4.9 投资组合报告

Table with 2 columns: Item (序号, 项目) and Value (1, 权益投资, 223,904,601.28, etc.)

5.1 主要财务指标

Table with 2 columns: Item (1.本期已实现收益, 2.本期利润, etc.) and Value (-12,383,191.54, -24,428,414.62, etc.)

5.2 业绩比较基准

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证转债指数收益率\*60%+沪深300指数收益率\*40%

5.3 风险收益特征

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,其预期风险和预期收益高于货币型基金,低于混合型基金。

5.4 基金管理人

基金管理人:富国基金管理有限公司

5.5 基金托管人

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

5.6 主要财务指标

Table with 2 columns: Item (1.本期已实现收益, 2.本期利润, etc.) and Value (-12,383,191.54, -24,428,414.62, etc.)

5.7 业绩比较基准

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证转债指数收益率\*60%+沪深300指数收益率\*40%

5.8 风险收益特征

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,其预期风险和预期收益高于货币型基金,低于混合型基金。

5.9 基金管理人

基金管理人:富国基金管理有限公司

5.10 基金托管人

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

5.11 主要财务指标

Table with 2 columns: Item (1.本期已实现收益, 2.本期利润, etc.) and Value (-12,383,191.54, -24,428,414.62, etc.)

5.12 业绩比较基准

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证转债指数收益率\*60%+沪深300指数收益率\*40%

5.13 风险收益特征

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,其预期风险和预期收益高于货币型基金,低于混合型基金。

5.14 基金管理人

基金管理人:富国基金管理有限公司

5.15 基金托管人

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

5.16 主要财务指标

Table with 2 columns: Item (1.本期已实现收益, 2.本期利润, etc.) and Value (-12,383,191.54, -24,428,414.62, etc.)

5.17 业绩比较基准

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证转债指数收益率\*60%+沪深300指数收益率\*40%

5.18 风险收益特征

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,其预期风险和预期收益高于货币型基金,低于混合型基金。

5.19 基金管理人

基金管理人:富国基金管理有限公司

5.20 基金托管人

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

5.21 主要财务指标

Table with 2 columns: Item (1.本期已实现收益, 2.本期利润, etc.) and Value (-12,383,191.54, -24,428,414.62, etc.)

5.22 业绩比较基准

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证转债指数收益率\*60%+沪深300指数收益率\*40%

5.23 风险收益特征

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,其预期风险和预期收益高于货币型基金,低于混合型基金。

5.24 基金管理人

基金管理人:富国基金管理有限公司

5.25 基金托管人

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

5.26 主要财务指标

Table with 2 columns: Item (1.本期已实现收益, 2.本期利润, etc.) and Value (-12,383,191.54, -24,428,414.62, etc.)

5.27 业绩比较基准

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证转债指数收益率\*60%+沪深300指数收益率\*40%

5.28 风险收益特征

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,其预期风险和预期收益高于货币型基金,低于混合型基金。

5.29 基金管理人

基金管理人:富国基金管理有限公司

5.30 基金托管人

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

5.31 主要财务指标

Table with 2 columns: Item (1.本期已实现收益, 2.本期利润, etc.) and Value (-12,383,191.54, -24,428,414.62, etc.)

5.32 业绩比较基准

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证转债指数收益率\*60%+沪深300指数收益率\*40%

5.33 风险收益特征

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,其预期风险和预期收益高于货币型基金,低于混合型基金。

5.34 基金管理人

基金管理人:富国基金管理有限公司

5.35 基金托管人

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

5.36 主要财务指标

Table with 2 columns: Item (1.本期已实现收益, 2.本期利润, etc.) and Value (-12,383,191.54, -24,428,414.62, etc.)

5.37 业绩比较基准

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证转债指数收益率\*60%+沪深300指数收益率\*40%

5.38 风险收益特征

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,其预期风险和预期收益高于货币型基金,低于混合型基金。

5.39 基金管理人

基金管理人:富国基金管理有限公司

5.40 基金托管人

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

5.41 主要财务指标

Table with 2 columns: Item (1.本期已实现收益, 2.本期利润, etc.) and Value (-12,383,191.54, -24,428,414.62, etc.)

5.42 业绩比较基准

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证转债指数收益率\*60%+沪深300指数收益率\*40%

5.43 风险收益特征

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,其预期风险和预期收益高于货币型基金,低于混合型基金。

5.44 基金管理人

基金管理人:富国基金管理有限公司

5.45 基金托管人

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

5.46 主要财务指标

Table with 2 columns: Item (1.本期已实现收益, 2.本期利润, etc.) and Value (-12,383,191.54, -24,428,414.62, etc.)

5.47 业绩比较基准

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证转债指数收益率\*60%+沪深300指数收益率\*40%

5.48 风险收益特征

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,其预期风险和预期收益高于货币型基金,低于混合型基金。

5.49 基金管理人

基金管理人:富国基金管理有限公司

5.50 基金托管人

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

5.51 主要财务指标

Table with 2 columns: Item (1.本期已实现收益, 2.本期利润, etc.) and Value (-12,383,191.54, -24,428,414.62, etc.)

5.52 业绩比较基准

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证转债指数收益率\*60%+沪深300指数收益率\*40%

5.53 风险收益特征

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,其预期风险和预期收益高于货币型基金,低于混合型基金。

5.54 基金管理人

基金管理人:富国基金管理有限公司

5.55 基金托管人

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

5.56 主要财务指标

Table with 2 columns: Item (1.本期已实现收益, 2.本期利润, etc.) and Value (-12,383,191.54, -24,428,414.62, etc.)

5.57 业绩比较基准

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证转债指数收益率\*60%+沪深300指数收益率\*40%

5.58 风险收益特征

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,其预期风险和预期收益高于货币型基金,低于混合型基金。

5.59 基金管理人

基金管理人:富国基金管理有限公司

5.60 基金托管人

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

5.61 主要财务指标

Table with 2 columns: Item (1.本期已实现收益, 2.本期利润, etc.) and Value (-12,383,191.54, -24,428,414.62, etc.)

5.62 业绩比较基准

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证转债指数收益率\*60%+沪深300指数收益率\*40%

5.63 风险收益特征

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,其预期风险和预期收益高于货币型基金,低于混合型基金。

5.64 基金管理人

基金管理人:富国基金管理有限公司

5.65 基金托管人

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

5.66 主要财务指标

Table with 2 columns: Item (1.本期已实现收益, 2.本期利润, etc.) and Value (-12,383,191.54, -24,428,414.62, etc.)

5.67 业绩比较基准

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证转债指数收益率\*60%+沪深300指数收益率\*40%

5.68 风险收益特征

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,其预期风险和预期收益高于货币型基金,低于混合型基金。

5.69 基金管理人

基金管理人:富国基金管理有限公司

5.70 基金托管人

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

5.71 主要财务指标

Table with 2 columns: Item (1.本期已实现收益, 2.本期利润, etc.) and Value (-12,383,191.54, -24,428,414.62, etc.)

5.72 业绩比较基准

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证转债指数收益率\*60%+沪深300指数收益率\*40%

5.73 风险收益特征

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,其预期风险和预期收益高于货币型基金,低于混合型基金。

5.74 基金管理人

基金管理人:富国基金管理有限公司

5.75 基金托管人

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

5.76 主要财务指标

Table with 2 columns: Item (1.本期已实现收益, 2.本期利润, etc.) and Value (-12,383,191.54, -24,428,414.62, etc.)

5.77 业绩比较基准

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证转债指数收益率\*60%+沪深300指数收益率\*40%

5.78 风险收益特征

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,其预期风险和预期收益高于货币型基金,低于混合型基金。

5.79 基金管理人

基金管理人:富国基金管理有限公司

5.80 基金托管人

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

5.81 主要财务指标

Table with 2 columns: Item (1.本期已实现收益, 2.本期利润, etc.) and Value (-12,383,191.54, -24,428,414.62, etc.)

5.82 业绩比较基准

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证转债指数收益率\*60%+沪深300指数收益率\*40%

5.83 风险收益特征

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,其预期风险和预期收益高于货币型基金,低于混合型基金。

5.84 基金管理人

基金管理人:富国基金管理有限公司

5.85 基金托管人

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

5.86 主要财务指标

Table with 2 columns: Item (1.本期已实现收益, 2.本期利润, etc.) and Value (-12,383,191.54, -24,428,414.62, etc.)

5.87 业绩比较基准

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证转债指数收益率\*60%+沪深300指数收益率\*40%

5.88 风险收益特征

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,其预期风险和预期收益高于货币型基金,低于混合型基金。

5.89 基金管理人

基金管理人:富国基金管理有限公司

5.90 基金托管人

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

5.91 主要财务指标

Table with 2 columns: Item (1.本期已实现收益, 2.本期利润, etc.) and Value (-12,383,191.54, -24,428,414.62, etc.)

5.92 业绩比较基准

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证转债指数收益率\*60%+沪深300指数收益率\*40%

5.93 风险收益特征

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,其预期风险和预期收益高于货币型基金,低于混合型基金。

5.94 基金管理人

基金管理人:富国基金管理有限公司

5.95 基金托管人

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

5.96 主要财务指标

Table with 2 columns: Item (1.本期已实现收益, 2.本期利润, etc.) and Value (-12,383,191.54, -24,428,414.62, etc.)

5.97 业绩比较基准

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证转债指数收益率\*60%+沪深300指数收益率\*40%

5.98 风险收益特征

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,其预期风险和预期收益高于货币型基金,低于混合型基金。

5.99 基金管理人

基金管理人:富国基金管理有限公司

5.100 基金托管人

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

5.101 主要财务指标

Table with 2 columns: Item (1.本期已实现收益, 2.本期利润, etc.) and Value (-12,383,191.54, -24,428,414.62, etc.)

5.102 业绩比较基准

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证转债指数收益率\*60%+沪深300指数收益率\*40%

5.103 风险收益特征

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,其预期风险和预期收益高于货币型基金,低于混合型基金。

5.104 基金管理人

基金管理人:富国基金管理有限公司

5.105 基金托管人