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
送出日期：2013年03月26日

# 富国可转换债券证券投资基金

## 2012 年度 报告摘要

2012年12月31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。

基金托管人中国农业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。

本报告期自2012年1月1日起至2012年12月31日止。

## §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 富国可转换债券 |
| 基金主代码 | 100051 |
| 交易代码 | 前端交易代码：100051<br>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 |
| 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 | 2,551,614,373.86份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 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。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 富国基金管理有限公司 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 范伟舅 | 李芳菲 |
| | 联系电话 | 021-20361818 | 010-66060069 |
| | 电子邮箱 | public@fullgoal.com.cn | lifangfei@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 95105686，4008880688 | 95599 |
| 传真 | | 021-20361616 | 010-63201816 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.fullgoal.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<br>中国农业银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9 |

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1期间数据和指标 | 2012年 | 2011年 | 2010年12月08日(基金合同生效日)至2010年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | -229,276,711.99 | -153,903,045.80 | 3,257,947.14 |
| 本期利润 | 19,672,897.85 | -394,982,448.38 | -14,542,480.48 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0064 | -0.1120 | -0.0034 |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.70% | -11.43% | -0.30% |
| 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 | -0.1216 | -0.1167 | -0.0034 |
| 期末基金资产净值 | 2,290,668,215.65 | 2,663,110,258.22 | 4,250,604,449.61 |
| 期末基金份额净值 | 0.898 | 0.883 | 0.997 |

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 | 5.15% | 0.45% | 4.78% | 0.43% | 0.37% | 0.02% |
| 过去六个月 | 0.56% | 0.40% | 1.35% | 0.39% | -0.79% | 0.01% |
| 过去一年 | 1.70% | 0.43% | 4.60% | 0.44% | -2.90% | -0.01% |
| 自基金合同生效日起至今 | -10.20% | 0.49% | -9.39% | 0.51% | -0.81% | -0.02% |

注：本基金合同生效日是2010年12月8日。

根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定，本基金业绩比较基准＝天相转债指数收益率×60%＋中债综合指数收益率×20%＋沪深300指数收益率×20%。

本基金可转债投资部分、其它固定收益类证券投资部分、股票投资部分的业绩比较基准分别采用具有代表性的天相转债指数、中债综合指数和沪深300指数。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，1日收益率（benchmarkt）按下列公式计算：

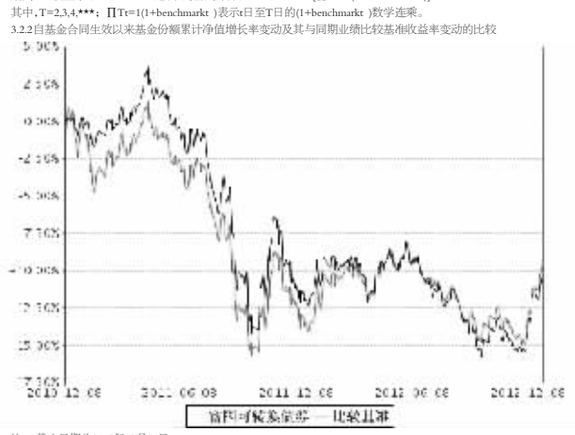
benchmark t = 60% *[天相转债指数t/(天相转债指数t-1)-1] +20% * [中债综合指数t/(中债综合指数t-1)-1]+20% * [沪深300指数t/(沪深300指数t-1)-1]；

其中，t=1,2,3,***，T，T表示时间截至日；

期间T日收益率（benchmarkT）按下列公式计算：benchmarkT =[∏Tt=1(1+benchmarkt )]-1

其中，T=2,3,4,***；∏Tt=1(1+benchmark t)表示t日至T日的(1+benchmark t)数学连乘。

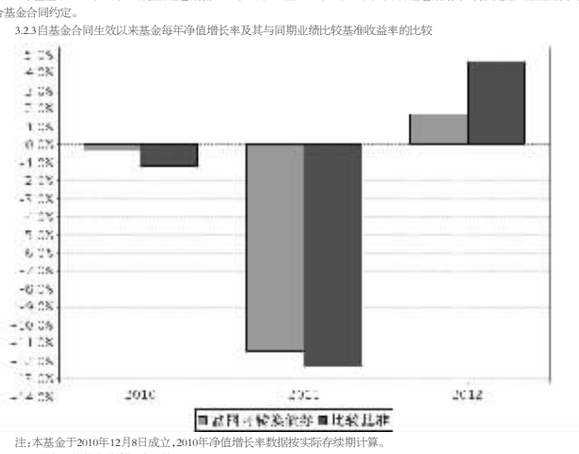
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较




注：1.截止日期为2012年12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。

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：本基金于2010年12月8日成立，2010年净值增长率数据按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 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 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

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局登记注册成立，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汉盛证券投资基金、汉兴证券投资基金、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、富国天合稳健优选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、富国通胀通缩主题轮动股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、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、富国天盈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天理财宝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

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 任职日期 | 离任日期 | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 赵恒毅 | 本基金基金经理兼任富国天盈分级债券型证券投资基金基金经理、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金基金经理 | 2012-06-20 | — | 8年 | 硕士，曾任通用技术集团投资管理有限公司研究员，2008年4月至2011年5月任富国基金管理有限公司固定收益部研究员，2011年5月起任富国天盈分级债券型证券投资基金基金经理，2012年5月起任富国新天锋定期开放债券型证券投资基金基金经理，2012年6月起任富国可转换债券证券投资基金基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。 |
| 陈曙亮 | 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、富国优化增强债券型证券投资基金基金经理 | 2012-07-02 | — | 5年 | 硕士，2008年6月至2012年1月任富国基金管理有限公司助理定量研究员、定量研究员；2012年2月至4月任富国基金管理有限公司年金投资经理；2012年7月任富国天利增长债券投资基金基金经理、富国可转换债券证券投资基金基金经理；2012年12月任富国优化增强债券基金基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。 |
| 杨贵宾 | 本基金前任基金经理 | 2010-12-08 | 2012-06-20 | 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月至2012年6月任富国天利基金经理；2010年12月至2012年6月任富国可转债基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。 |

注：1、上述表格内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。

证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

2、本公司于2012年6月20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，聘任赵恒毅先生担任本基金基金经理；杨贵宾先生不再担任本基金基金经理。本公司于2012年7月2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，增聘陈曙亮先生担任本基金基金经理；与赵恒毅先生共同管理本基金。

4.2 管理人对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，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规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1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（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。

4.3.2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（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布假设检验并对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。

4.3.3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，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现5次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。

4.4 管理人对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

2012年，中国国内经济增长速度放缓，通胀水平处于较低的位置。由于房地产市场的持续调控、地方融资平台融资渠道的收紧，投资对经济的支撑力量减弱。加上进出口情况不佳，微观实体的经营环境显著恶化，上市公司业绩普遍超预期下滑。尽管市场整体流动性尚可，但是资金主要被吸引到债券市场，股市资金供给并不充裕。股市方面，全年看来实现微涨，但是其中下跌持续的时间最长，仅靠12月快速上涨得以收复失地。

2012年，我们维持了较高的可转债仓位，尤其是在二季度显著提高了可转债的仓位，当时我们判断股市可能存在机会，之后的市场证明我们的判断出现了问题。在三季度我们曾进行过一定的减仓操作，并在四季度回补，这减少了部分损失。另外，我们曾参与了部分新股的申购，但是收获不多。此外还配置了部分比例的信用债，获取杠杆息差，可以增强组合收益。股票方面，我们主要是用于替代部分转债的效果，在转债估值下降的过程中这项操作可以提高收益。

4.4.2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0.898元，份额累计净值为0.898元。报告期内，本基金份额净值增长率为1.70%，同期业绩比较基准收益率为4.60%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013年，国内经济增长速度将逐季回升，通胀水平虽然也呈现出上升的趋势，但是目前看来仍不会太高，货币政策方面预计略偏宽松，这种宏观环境对股市非常有利。另外，2012年下半年以来的数据显示，房地产市场的销量在上升，汽车销售情况也非常良好，这两个行业的复苏对其他行业的拉动作用非常显著。因此，上市公司的盈利将出现好转，加上境外资金的进入和赚钱效应的显现，股市资金面也在好转。于是，我们对今年股市报以乐观的态度，并且会维持较高的转债仓位和股票仓位。

4.6 管理人对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，维护基金持有人的利益。基金经理是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估值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。

4.7 管理人对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

在托管富国可转换债券证券投资基金的过程中，本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《富国可转换债券证券投资基金基金合同》、《富国可转换债券证券投资基金托管协议》的约定，对富国可转换债券证券投资基金管理人—富国基金管理有限公司2012年1月1日至2012年12月31日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，富国基金管理有限公司在富国可转换债券证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，富国基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的富国可转换债券证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

中国农业银行股份有限公司托管业务部
2013年3月22日

## §6 审计报告

本基金审计的注册会计师出具的是无保留意见的审计报告。

投资者可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：富国可转换债券证券投资基金

报告截止日：2012年12月31日

单位：人民币元

| 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 | 3,606,568.33 | 18,484,669.99 |
| 结算备付金 | 53,087,357.93 | 5,720,157.16 |
| 存出保证金 | — | 256,542.71 |
| 交易性金融资产 | 2,875,348,267.40 | 2,618,528,760.92 |
| 其中：股票投资 | 335,704,509.72 | 135,712,719.81 |
| 基金投资 | — | — |
| 债券投资 | 2,539,643,757.68 | 2,482,816,041.11 |
| 资产支持证券投资 | — | — |
| 衍生金融资产 | — | — |
| 买入返售金融资产 | 368,901,282.94 | — |
| 应收证券清算款 | 123,340,671.35 | 14,094,223.18 |
| 应收利息 | 18,071,562.52 | 14,190,482.48 |
| 应收股利 | — | — |
| 应收申购款 | 163,052.33 | 129,284.85 |
| 递延所得税资产 | — | — |
| 其他资产 | — | — |
| 资产总计 | 3,442,518,762.80 | 2,671,404,121.29 |
| 负债和所有者权益 | 本期末（2012年12月31日） | 上年度末（2011年12月31日） |
| 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 | 1,143,700,000.00 | 4,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | 2,742,890.98 | — |
| 应付赎回款 | 2,108,109.75 | 985,075.10 |
| 应付管理人报酬 | 1,354,281.87 | 1,615,735.16 |
| 应付托管费 | 386,937.67 | 461,638.61 |
| 应付销售服务费 | — | — |
| 应付交易费用 | 703,083.95 | 683,245.31 |
| 应交税费 | 53,115.20 | 53,115.20 |
| 应付利息 | 399,132.08 | 2,032.80 |
| 应付利润 | — | — |
| 递延所得税负债 | — | — |
| 其他负债 | 402,995.65 | 493,020.89 |
| 负债合计 | 1,151,850,547.15 | 8,293,863.07 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 2,551,614,373.86 | 3,014,946,172.10 |
| 未分配利润 | -260,946,158.21 | -351,835,913.88 |
| 所有者权益合计 | 2,290,668,215.65 | 2,663,110,258.22 |
| 负债和所有者权益总计 | 3,442,518,762.80 | 2,671,404,121.29 |

注：报告截止日2012年12月31日，基金份额净值0.898元，基金份额总额2,551,614,373.86份。

7.2 利润表

会计主体：富国可转换债券证券投资基金

本报告期：2012年01月01日至2012年12月31日

单位：人民币元

| 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 | 76,618,902.36 | -355,352,151.17 |
| 1.利息收入 | 38,016,623.65 | 35,500,729.95 |
| 其中：存款利息收入 | 1,005,711.32 | 1,589,084.66 |
| 债券利息收入 | 35,621,641.79 | 25,939,668.87 |
| 资产支持证券利息收入 | — | — |
| 买入返售金融资产收入 | 1,389,270.54 | 7,971,976.42 |
| 其他利息收入 | — | — |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | -210,519,658.85 | -150,444,022.88 |
| 其中：股票投资收益 | -41,455,717.27 | -67,697,565.85 |
| 基金投资收益 | — | — |
| 债券投资收益 | -173,530,009.10 | -92,057,543.51 |
| 资产支持证券投资收益 | — | — |
| 衍生工具投资收益 | — | — |
| 股利收益 | 4,466,067.52 | 9,311,086.48 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 248,949,609.84 | -241,079,402.58 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | — | — |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 172,327.72 | 670,544.34 |
| 减：二、费用 | 56,946,004.51 | 39,630,297.21 |
| 1. 管理人报酬 | 18,968,627.26 | 23,847,447.03 |
| 2. 托管费 | 5,419,607.86 | 6,813,556.40 |
| 3. 销售服务费 | — | — |
| 4. 交易费用 | 5,601,541.04 | 6,043,592.86 |
| 5. 利息支出 | 26,508,123.58 | 2,430,572.03 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 26,508,123.58 | 2,430,572.03 |
| 6. 其他费用 | 448,104.77 | 495,128.89 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 19,672,897.85 | -394,982,448.38 |
| 减：所得税费用 | — | — |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 19,672,897.85 | -394,982,448.38 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国可转换债券证券投资基金

本报告期：2012年01月01日至2012年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2012年01月01日至2012年12月31日） | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 3,014,946,172.10 | -351,835,913.88 | 2,663,110,258.22 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | — | 19,672,897.85 | 19,672,897.85 |
| 三、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） | -463,331,798.24 | 71,216,857.82 | -392,114,940.42 |
| 其中：1.基金申购款 | 837,073,596.22 | -85,414,351.69 | 751,659,244.53 |
| 2.基金赎回款 | -1,300,405,394.46 | 156,631,209.51 | -1,143,774,184.95 |
| 四、本期向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） | 2,551,614,373.86 | -260,946,158.21 | 2,290,668,215.65 |
| 项目 | 上年度可比期间（2011年01月01日至2011年12月31日） | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 4,265,146,930.09 | -14,542,480.48 | 4,250,604,449.61 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | — | -394,982,448.38 | -394,982,448.38 |
| 三、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） | -1,250,200,757.99 | 57,689,014.98 | -1,192,511,743.01 |
| 其中：1.基金申购款 | 1,516,063,375.47 | -16,438,893.52 | 1,499,624,481.95 |
| 2.基金赎回款 | -2,766,264,133.46 | 74,127,908.50 | -2,692,136,224.96 |
| 四、本期向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） | 3,014,946,172.10 | -351,835,913.88 | 2,663,110,258.22 |

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：

窦玉明　　林志松　　雷青松

基金管理公司负责人　　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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报告相一致。

7.4.2会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.3关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 富国基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 海通证券股份有限公司（“海通证券”） | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 申银万国证券股份有限公司（“申银万国”） | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 山东省国际信托有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 蒙特利尔银行 | 基金管理人的股东 |
| 中国农业银行股份有限公司（“农业银行”） | 基金托管人、基金代销机构 |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 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） | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例(%) |
| 海通证券 | 68,655,006.11 | 1.96 | 445,108,147.11 | 11.93 |
| 申银万国 | 671,273,918.32 | 19.18 | 884,499,233.45 | 23.71 |

7.4.4.1.2权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.4.1.3债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 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） | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例(%) |
| 海通证券 | 82,172,859.42 | 0.93 | 72,047,924.80 | 1.29 |
| 申银万国 | 2,109,289,554.86 | 23.80 | 1,615,699,550.44 | 28.99 |

7.4.4.1.4回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 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） | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例(%) |
| 申银万国 | 16,743,100,000.00 | 17.23 | 3,695,300,000.00 | 27.01 |

7.4.4.1.5应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期（2012年01月01日至2012年12月31日） | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 佣金 | 占当期佣金总量的比例(%) | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例(%) |
| 海通证券 | 57,195.49 | 1.87 | 11,523.04 | 1.65 |
| 申银万国 | 581,574.09 | 19.06 | 22,691.90 | 3.24 |
| 关联方名称 | 上年度可比期间（2011年01月01日至2011年12月31日） | | | |
| | 佣金 | 占当期佣金总量的比例(%) | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例(%) |
| 海通证券 | 361,654.04 | 11.55 | 169,654.50 | 24.97 |
| 申银万国 | 748,299.54 | 23.89 | 195,126.05 | 28.72 |

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除由证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和买（卖）证管费等）。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.4.2关联方报酬

7.4.4.2.1基金管理费

单位：人民币元

| 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） |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 18,968,627.26 | 23,847,447.03 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 5,178,945.96 | 7,391,623.10 |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.70%年费率计提，计算方法如下：

H＝E×0.70%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.4.2.2基金托管费

单位：人民币元

| 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） |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 5,419,607.86 | 6,813,556.40 |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提，计算方法如下：

H＝E×0.20%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.4.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期（2012年01月01日至2012年12月31日） | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| — | — | — | — | — | — | — |
| 上年度可比期间（2011年01月01日至2011年12月31日） | | | | | | |
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 农业银行 | 20,077,782.73 | — | — | — | — | — |

7.4.4.4各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.4.4.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末（2012年12月31日） | | 上期末（2011年12月31日） | |
|---|---|---|---|---|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例(%) | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例(%) |
| 海通证券股份有限公司 | 220,993,370.17 | 8.66 | — | — |

注：本基金管理人之外的其他关联方本期投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

7.4.4.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 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） | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 3,606,568.33 | 384,427.36 | 18,484,669.99 | 1,393,022.66 |

7.4.4.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.4.7其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联方交易事项。

7.4.5期末（2012年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.5.1.1受限证券类别：债券

金额单位：人民币元

| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：张） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 127001 | 海直转债 | 2012-12-24 | 2013-01-07 | 认购新发证券 | 100.00 | 100.00 | 20,590 | 2,059,000.00 | 2,059,000.00 | |

7.4.5.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌股票。

7.4.5.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末2012年12月31日止，本基金无银行间市场债券正回购，未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.5.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末2012年12月31日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币1,143,700,000.00元，分别于2013年1月4日、2013年1月7日、2013年1月8日、2013年1月11日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.6有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 335,704,509.72 | 9.75 |
| | 其中：股票 | 335,704,509.72 | 9.75 |
| 2 | 固定收益投资 | 2,539,643,757.68 | 73.77 |
| | 其中：债券 | 2,539,643,757.68 | 73.77 |
| | 资产支持证券 | — | — |
| 3 | 金融衍生品投资 | — | — |
| 4 | 买入返售金融资产 | 368,901,282.94 | 10.72 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | 200,000,709.59 | 5.81 |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 56,693,926.26 | 1.65 |
| 6 | 其他各项资产 | 141,575,286.20 | 4.11 |
| 7 | 合计 | 3,442,518,762.80 | 100.00 |

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | — | — |
| B | 采掘业 | 30,028,447.32 | 1.31 |
| C | 制造业 | 135,047,128.98 | 5.90 |
| C0 | 食品、饮料 | — | — |
| C1 | 纺织、服装、