

富国信用增强债券型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013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:	2013年10月23日

1.1 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法律责任。

基金管理人中国工商银行股份有限公司富国信用增强债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)于2013年10月21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,保证基金不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

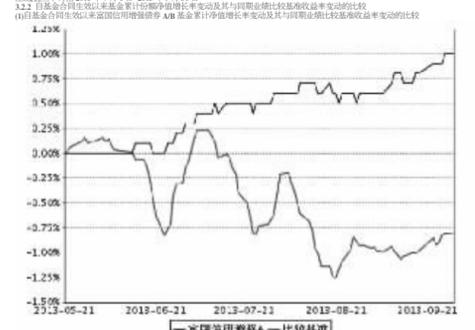
本基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告自2013年7月1日起至2013年9月30日止。

基金名称	富国信用增强债券
基金代码	000007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年05月21日
报告期内基金份额总额(单位:亿)	1,693,489,478.35
投资目标	本基金以信用债为主要投资对象,合理控制信用风险,在追求本金安全的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用自上而下的方法对基金资产运行动态的整体资产配置和战术资产配置,在认真研判宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,根据资产配置策略动态调整大类资产的比例,在充分分散非系统性风险的基础上,根据资产配置策略动态调整行业配置和个股配置。
业绩比较基准	中债企业债总指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险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
下属两级基金的名称	富国信用增强债券A/B 富国信用增强债券C
下属两级基金的份额总额(单位:亿)	000007 1,022,995,361.46 670,494,116.89

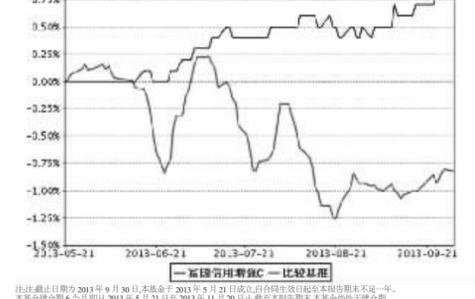
主要财务指标	单位:人民币元
1.本期已实现收益	10,396,839.50
2.本期利润	9,978,168.63
3.本期基金份额持有人应得利润	6,070.73
4.期末基金资产净值	1,030,039,662.64
5.期末基金份额净值	1.070

3.2 基金净值表现	单位:人民币元					
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	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	0.86%	0.06%	-0.51%	0.09%	1.31%	-0.03%
过去六个月	0.69%	0.06%	-0.51%	0.09%	1.11%	-0.03%
过去十二个月	0.70%	0.07%	-0.51%	0.09%	1.21%	-0.03%



富国信用增强债券A—比较基准

富国信用增强债券B—比较基准



富国信用增强债券C—比较基准

3.1 主要财务指标	单位:人民币元
1.本期已实现收益	7,589,775.75
2.本期利润	5,962,187.00
3.本期基金份额持有人应得利润	0.0000
4.期末基金资产净值	515,330,157.89
5.期末基金份额净值	1.010

3.2 基金净值表现	单位:人民币元					
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	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	1.00%	0.07%	-1.44%	0.08%	2.44%	-0.01%
过去六个月	0.90%	0.07%	-1.44%	0.08%	2.34%	-0.01%
过去十二个月	0.90%	0.07%	-1.44%	0.08%	2.34%	-0.01%



富国信用增强债券A—比较基准

富国信用增强债券B—比较基准



富国信用增强债券C—比较基准

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

报告期内,富国信用增强债券型证券投资基金的基金管理人恪尽职守,依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国信用增强债券型证券投资基金合同》及其他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,力求为基金份额持有人谋求最大利益,基金运作符合有关法律法规和基金合同约定的投资目标,基金管理人履行了基金合同约定的职责。

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律法规,结合实际情况,制定了《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、集中清算和风险控制,集中监控、事后评估及反馈的流程化管理,在制度、操作层面确保公平交易制度的有效执行,并持续跟踪各项制度的执行情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发现异常交易行为。

4.4 报告期内本基金投资合规性说明

报告期内,本基金严格遵守基金合同约定的投资范围,未发现异常交易行为。

4.5 基金管理人内部控制制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行各项内部控制制度,未发现异常交易行为。

5.2 投资组合报告	单位:人民币元
1. 权益投资	-
2. 固定收益投资	2,051,523,500.92
3. 金融衍生品投资	-
4. 买入返售金融资产	60,026,785.87
5. 其他投资	-
6. 合计	2,111,550,286.79

5.3 投资组合报告附注	单位:人民币元
1. 报告期内本基金前十名股票投资明细	
2. 报告期内本基金前十名债券投资明细	
3. 报告期内本基金前十名权证投资明细	
4. 报告期内本基金前十名资产支持证券投资明细	
5. 报告期内本基金前十名其他证券投资明细	

5.4 报告期内本基金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	000001	平安银行	1,122,743	74,764,272.20	4.39
2	000002	万科A	1,015,403	60,396,000.00	3.54
3	000003	招商银行	1,142,223	50,700,000.00	2.88
4	000013	顺鑫农业	500,000	30,435,000.00	2.16
5	04131034	13国债03001	500,000	50,205,000.00	2.85

5.5 报告期内本基金前十名债券投资明细					
序号	债券代码	债券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	浦发03	300,000	303,043,466.58	1.76
2	110032	浦发04	300,000	303,018,369.48	1.76

5.6 报告期内本基金前十名资产支持证券投资明细					
序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	浦发03	300,000	303,043,466.58	1.76
2	110032	浦发04	300,000	303,018,369.48	1.76

5.7 报告期内本基金前十名权证投资明细					
序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	浦发03	300,000	303,043,466.58	1.76
2	110032	浦发04	300,000	303,018,369.48	1.76

5.8 报告期内本基金前十名其他证券投资明细					
序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	浦发03	300,000	303,043,466.58	1.76
2	110032	浦发04	300,000	303,018,369.48	1.76

5.9 报告期内本基金前十名权证投资明细					
序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	浦发03	300,000	303,043,466.58	1.76
2	110032	浦发04	300,000	303,018,369.48	1.76

5.10 报告期内本基金前十名权证投资明细					
序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	浦发03	300,000	303,043,466.58	1.76
2	110032	浦发04	300,000	303,018,369.48	1.76

5.11 报告期内本基金前十名权证投资明细					
序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	浦发03	300,000	303,043,466.58	1.76
2	110032	浦发04	300,000	303,018,369.48	1.76

5.12 报告期内本基金前十名权证投资明细					
序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	浦发03	300,000	303,043,466.58	1.76
2	110032	浦发04	300,000	303,018,369.48	1.76

5.13 报告期内本基金前十名权证投资明细					
序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	浦发03	300,000	303,043,466.58	1.76
2	110032	浦发04	300,000	303,018,369.48	1.76

5.14 报告期内本基金前十名权证投资明细					
序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	浦发03	300,000	303,043,466.58	1.76
2	110032	浦发04	300,000	303,018,369.48	1.76

5.15 报告期内本基金前十名权证投资明细					
序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	浦发03	300,000	303,043,466.58	1.76
2	110032	浦发04	300,000	303,018,369.48	1.76

5.16 报告期内本基金前十名权证投资明细					
序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	浦发03	300,000	303,043,466.58	1.76
2	110032	浦发04	300,000	303,018,369.48	1.76

5.17 报告期内本基金前十名权证投资明细					
序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	浦发03	300,000	303,043,466.58	1.76
2	110032	浦发04	300,000	303,018,369.48	1.76

5.18 报告期内本基金前十名权证投资明细					
序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	浦发03	300,000	303,043,466.58	1.76
2	110032	浦发04	300,000	303,018,369.48	1.76

5.19 报告期内本基金前十名权证投资明细					
序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	浦发03	300,000	303,043,466.58	1.76
2	110032	浦发04	300,000	303,018,369.48	1.76

5.20 报告期内本基金前十名权证投资明细					
序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	浦发03	300,000	303,043,466.58	1.76
2	110032	浦发04	300,000	303,018,369.48	1.76

5.21 报告期内本基金前十名权证投资明细					
序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	浦发03	300,000	303,043,466.58	1.76
2	110032	浦发04	300,000	303,018,369.48	1.76

5.22 报告期内本基金前十名权证投资明细					
序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	浦发03	300,000	303,043,466.58	1.76
2	110032	浦发04	300,000	303,018,369.48	1.76

5.23 报告期内本基金前十名权证投资明细					
序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	浦发03	300,000	303,043,466.58	1.76
2	110032	浦发04	300,000	303,018,369.48	1.76

5.24 报告期内本基金前十名权证投资明细					
序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	浦发03	300,000	303,043,466.58	1.76
2	110032	浦发04	300,000	303,018,369.48	1.76

5.25 报告期内本基金前十名权证投资明细					
序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	浦发03	300,000	303,043,466.58	1.76
2	110032	浦发04	300,000	303,018,369.48	1.76

富国7天理财宝债券型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013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:	2013年10月23日

1.1 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法律责任。

基金管理人中国工商银行股份有限公司富国7天理财宝债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)于2013年10月21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,保证基金不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

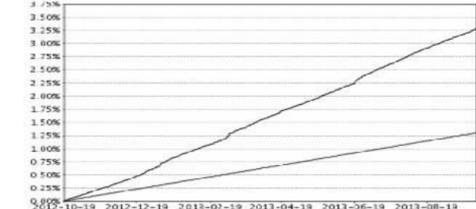
本基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告自2013年7月1日起至2013年9月30日止。

基金名称	富国7天理财宝
基金代码	100007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年10月19日
报告期内基金份额总额(单位:亿)	246,828,294.82
投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性的基础上,力争实现资产增值,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采取稳健的投资策略,在严格控制风险的前提下,通过分散化投资,追求基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期风险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
下属两级基金的名称	富国7天理财宝A 富国7天理财宝B
下属两级基金的份额总额(单位:亿)	100007 192,706,757.90 54,121,536.92

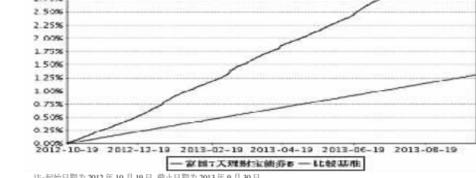
3.1 主要财务指标	单位:人民币元
1.本期已实现收益	2,902,366.93
2.本期利润	2,902,366.93
3.本期基金份额持有人应得利润	192,706,757.90

3.2 基金净值表现	单位:人民币元					
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	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	0.851%	0.0017%	0.3450%	0.0000%	0.5081%	0.0017%
过去六个月	0.727%	0.0017%	0.3450%	0.0000%	0.5826%	0.0016%
过去十二个月	0.727%	0.0017%	0.3450%	0.0000%	0.5826%	0.0016%



富国7天理财宝A—比较基准

富国7天理财宝B—比较基准



富国7天理财宝A—比较基准

富国7天理财宝B—比较基准

3.1 主要财务指标	单位:人民币元
1.本期已实现收益	2,902,366.93
2.本期利润	2,902,366.93
3.本期基金份额持有人应得利润	192,706,757.90

3.2 基金净值表现	单位:人民币元					
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	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	0.851%	0.0017%	0.3450%	0.0000%	0.5081%	0.0017%
过去六个月	0.727%	0.0017%	0.3450%	0.0000%	0.5826%	0.0016%
过去十二个月	0.727%	0.0017%	0.3450%	0.0000%	0.5826%	0.0016%

3.3 基金净值表现	单位:人民币元					
3.3.1 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	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	0.851%	0.0017%	0.3450%	0.0000%	0.5081%	0.0017%
过去六个月	0.727%	0.0017%	0.3450%	0.0000%	0.5826%	