

富国全球债券证券投资基金

二〇一二年年度报告

(摘要)

2012年12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

送出日期： 2013年03月26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。

基金托管人中国工商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
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
报告期末基金份额总额	102,699,987.53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管理人的投资风险）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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	范伟隽
	联系电话	021-20361818
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn
客户服务电话	95105686、4008880688	95588
传真	021-20361616	010—66105798

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	BMO Asset Management Inc.	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	蒙特利尔银行资产管理公司	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		77 King Street West Suite 4200 Toronto, ON M5K 1J5 Canada	140 Broadway New York, NY 10005
办公地址		77 King Street West Suite 4200 Toronto, ON M5K 1J5 Canada	140 Broadway New York, NY 10005
邮政编码		M5K 1J5	10005

2.5 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 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街55号

§ 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10月20日 (基金合同生效日) 至2010年12月31日
本期已实现收益	2,238,714.63	-5,195,684.47	-333,595.03
本期利润	8,176,938.34	-6,350,033.98	-139,103.93
加权平均基金份额本期利润	0.0582	-0.0228	-0.0002
本期基金份额净值增长率	6.06%	-4.30%	0.00%

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	-0.0186	-0.0425	-0.0014
期末基金资产净值	104,197,136.48	160,361,925.98	465,612,177.60
期末基金份额净值	1.015	0.957	1.0000

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	-0.20%	0.12%	-1.35%	0.16%	1.15%	-0.04%
过去六个月	4.64%	0.14%	2.14%	0.20%	2.50%	-0.06%
过去一年	6.06%	0.16%	4.06%	0.23%	2.00%	-0.07%
自基金合同生效日起至今	1.50%	0.19%	1.84%	0.29%	-0.34%	-0.10%

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：截止日期为 2012 年 12 月 31 日。

本基金建仓期 6 个月，即从 2010 年 10 月 20 日起至 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。

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：本基金合同生效日为 2010 年 10 月 20 日，2010 年净值增长率按实际存续期计算。

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李军	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	2012-11-16	—	10 年	硕士，曾任职于美国华尔街对冲基金 Fore Research & Management, LP 基金经理助理、工银瑞信基金管理有限公司海外高级分析师；2011 年 4 月至 2012 年 11 月任富国基金管理有限公司富国全球债券证券投资基金、富国全球顶级消费品股票型证券投资基金基金经理助理，2012 年 11 月起任富国全球债券证券投资基金、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，中国国籍。
张峰	本基金前任基金经理	2011-04-12	2012-12-18	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，2011 年 4 月至 2012 年 12 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，自2012年9月起任富国中国中小盘（香港上市）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。
--	--	--	--	--	---

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11月16日、12月18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，聘任李军先生担任本基金基金经理；张峰先生不再担任本基金基金经理。

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24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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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，未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（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。

4.4.2 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t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。

4.4.3 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未出现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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012年，全球债券市场表现良好。在美国与欧洲央行量化宽松的支持下，国债收益率维持在很低的水平，风险偏好上升，国债、可投资级公司债、高收益债等各类型债券都取得不错收益。全年巴克莱全球债券指数按人民币中间价计算上涨4.06%，本基金净值增长6.06%。

本基金全年采取了较为均衡的配置策略，在考虑基准指数配置的同时，适度加大了对高评级公司债券的投资，也适当加了少许新兴市场债券，超额收益较为明显。

4.5.2 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1.015元，份额累计净值为1.015元。报告期内，本基金份额净值增长率为6.06%，同期业绩比较基准收益率为4.06%。

4.6 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，我们认为欧美央行的货币政策会保持宽松，债券收益率将比较平稳，全球债券的投资价值将主要体现在两个方面：一是分散资产配置，降低投资风险；二是分散货币配置，降低汇率风险。

4.7 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投资基金行业从业经验。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。

4.8 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

2012年，本基金托管人在对富国全球债券证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

2012年,富国全球债券证券投资基金的管理人——富国基金管理有限公司在富国全球债券证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,富国全球债券证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露的富国全球债券证券投资基金2012年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部
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:富国全球债券证券投资基金

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	10,625,776.68	33,930,809.10
结算备付金	—	—
存出保证金	—	—
交易性金融资产	95,400,141.23	129,638,313.47
其中:股票投资	—	—
基金投资	95,400,141.23	129,638,313.47
债券投资	—	—
资产支持证券投资	—	—
衍生金融资产	—	39,300.00
买入返售金融资产	—	16,000,000.00
应收证券清算款	71,007.54	—

应收利息	961.23	7,147.89
应收股利	52,214.40	99,397.45
应收申购款	27,137.69	5,014.13
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	106,177,238.77	179,719,982.04
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	(2012年12月31日)	(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	—	—
应付证券清算款	—	17,575,697.57
应付赎回款	1,527,160.22	1,146,981.76
应付管理人报酬	82,598.88	124,839.31
应付托管费	20,190.82	30,516.27
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	—	—
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	350,152.37	480,021.15
负债合计	1,980,102.29	19,358,056.06
所有者权益:		
实收基金	102,699,987.53	167,487,783.29
未分配利润	1,497,148.95	-7,125,857.31
所有者权益合计	104,197,136.48	160,361,925.98
负债和所有者权益总计	106,177,238.77	179,719,982.04

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.015 元，基金份额总额 102,699,987.53 份。

7.2 利润表

会计主体：富国全球债券证券投资基金

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	10,183,588.66	-2,454,604.87

1. 利息收入	138,992.64	1,576,813.92
其中：存款利息收入	37,883.53	361,019.52
债券利息收入	—	—
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	101,109.11	1,215,794.40
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	4,362,930.60	-2,190,697.35
其中：股票投资收益	—	—
基金投资收益	2,863,122.53	-5,371,261.31
债券投资收益	—	—
资产支持证券投资收益	—	—
衍生工具投资收益	38,100.00	674,364.75
股利收益	1,461,708.07	2,506,199.21
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	5,938,223.71	-1,154,349.51
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-499,873.46	-1,001,929.37
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	243,315.17	315,557.44
减：二、费用	2,006,650.32	3,895,429.11
1. 管理人报酬	1,248,933.32	2,530,527.90
2. 托管费	305,294.85	618,573.56
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	84,036.15	320,440.85
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 其他费用	368,386.00	425,886.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	8,176,938.34	-6,350,033.98
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	8,176,938.34	-6,350,033.98

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国全球债券证券投资基金

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）	167,487,783.29	-7,125,857.31	160,361,925.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	—	8,176,938.34	8,176,938.34
三、本期基金份额交易产生的基金净值变	-64,787,795.76	446,067.92	-64,341,727.84

动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	5,918,885.93	-9,583.24	5,909,302.69
2. 基金赎回款	-70,706,681.69	455,651.16	-70,251,030.53
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）	102,699,987.53	1,497,148.95	104,197,136.48
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）	465,763,340.64	-151,163.04	465,612,177.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-6,350,033.98	-6,350,033.98
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）	-298,275,557.35	-624,660.29	-298,900,217.64
其中：1. 基金申购款	3,939,361.55	4,119.43	3,943,480.98
2. 基金赎回款	-302,214,918.90	-628,779.72	-302,843,698.62
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）	167,487,783.29	-7,125,857.31	160,361,925.98

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
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金代销机构

布朗兄弟哈里曼银行（“布朗兄弟银行”）	基金境外托管行
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
蒙特利尔银行资产管理公司	境外投资顾问

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

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股票交易。

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

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债券交易。

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（%）
海通证券股份有限公司	12,000,000.00	8.60	22,000,000.00	1.15
申银万国证券股份有限公司	29,000,000.00	20.79	340,000,000.00	17.77

7.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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	1,248,933.32	2,530,527.90
其中：支付销售机构的客户维护费	569,426.16	1,142,033.23

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值0.90%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.90\% / \text{当年天数}$

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金的管理费每日计算，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)	
		期末余额	当期利息收入
当期发生的基金应支付的托管费	305,294.85	22,771,290.96	336,529.68

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.22%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.22\% / \text{当年天数}$

H 为每日应支付的基金托管费

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

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
中国工商银行股份有限公司	3,028,807.01	33,873.86	22,771,290.96	336,529.68
布朗兄弟哈里曼银行	7,596,969.67	2,874.01	11,159,518.14	11,638.01

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

本基金按照2011年7月6日与托管人工商银行签订的远期结售汇协议约定，于2012年7月11日向工商银行出售美元1,000,000元。该笔交易本期产生衍生工具收益人民币38,100元及公允价值变动损益人民币-39,300元。

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

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.5.2 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等流通受限股票。

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，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期无需要说明的其他事项。

§ 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	—	—
	其中：普通股	—	—
	存托凭证	—	—
2	基金投资	95,400,141.23	89.85
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	—	—
	其中：远期	—	—
	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	10,625,776.68	10.01
8	其他各项资产	151,320.86	0.14
9	合计	106,177,238.77	100.00

8.2 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。

8.3 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。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有权益投资。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

注：本基金本报告期末未买入权益投资。

8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

注：本基金本报告期末未卖出权益投资。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

注：本基金本报告期无权益投资。

8.6 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。

8.7 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资产。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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：人民币元

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	ISHARE S IBOXX INV GR CORP BD	开放式	ETF 基金	BlackRoc k Fund Advisors	19,316,259.18	18.54
2	PIMCO- GLOBAL BOND-U S UH I AC	开放式	普通开放 式基金	PIMCO Global Advisors Ireland Ltd	19,037,190.59	18.27

3	PIMCO GBL INV GRADE- INS \$ACC	开放式	普通开放 式基金	PIMCO Global Advisors Ireland Ltd	12,977,922.58	12.46
4	SKANDI A-GLOB AL BOND-A	开放式	普通开放 式基金	Wellingt on Manageme nt Co LLP	11,743,145.59	11.27
5	SKANDI A-INV GR CORP BD-A1I	开放式	普通开放 式基金	Wellingt on Manageme nt Co LLP	9,100,999.28	8.73
6	PIMCO- EURO BD- INS ACC	开放式	普通开放 式基金	PIMCO Global Advisors Ireland Ltd	8,471,885.41	8.13
7	FULLER TON ASIAN BOND-A	开放式	普通开放 式基金	Fullerto n Fund Manageme nt Co Ltd	4,807,546.39	4.61
8	METZLE R EURO CORPOR ATES-A I	开放式	普通开放 式基金	Metzler Inventme nt GmbH	3,438,802.76	3.30
9	FUNDLO GIC-DJ UBS DIV BACK-A	开放式	普通开放 式基金	FUNDLOGI C SAS/FRAN CE	1,818,432.23	1.75
10	LM-WA ASIAN OPPS. FD-AA\$	开放式	普通开放 式基金	Legg Mason Investme nts Europe Ltd	1,572,493.69	1.51

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

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的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

8.11.2 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基金中，没有投资于超出基金合同规定备选基金库之外的基金。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	—
2	应收证券清算款	71,007.54
3	应收股利	52,214.40
4	应收利息	961.23
5	应收申购款	27,137.69
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	151,320.86

8.11.4 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。

8.11.5 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。

8.11.6 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可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
3099	33,139.72	198,923.16	0.19	102,501,064.37	99.81

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理公司所有从业人员持有本基金	50,664.41	0.0493

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

2、本基金的基金经理持有本基金份额总量为 0 万份至 10 万份。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2010年10月20日)基金份额总额	828,405,192.16
报告期期初基金份额总额	167,487,783.29
本报告期基金总申购份额	5,918,885.93
减：本报告期基金总赎回份额	70,706,681.69
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	102,699,987.53

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

本报告期，基金管理人经中国证监会核准聘任范伟隽先生担任公司督察长，李长伟先生不再担任公司督察长。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所的报酬为 5 万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 10 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	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(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
CCB International	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
China Everbright Securities (HK) Limited	—	—	—	—	—	—	—	—	—	656,218.77	0.30	787.46	1.53	—
DBS Vickers	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Goldman Sachs	—	—	—	—	—	—	—	—	—	71,461,952.48	32.47	13,732.47	26.62	—
HSBC	—	—	—	—	—	—	—	—	—	7,266,369.13	3.30	2,906.56	5.63	—
HAITONG INTERNATIONAL	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Morgan Stanley	—	—	—	—	—	—	—	—	—	133,979,520.95	60.87	29,429.95	57.05	—
Merrill Lynch	—	—	—	—	—	—	—	—	—	4,535,462.69	2.06	2,732.92	5.30	—

Nomura International	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
State Street Bank & Trust Company	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
UBS Limited	—	—	—	—	—	—	—	—	—	1,694,093.73	0.77	1,694.12	3.28	—	
UOB Kay Hian (Hong Kong) Limited	—	—	—	—	—	—	—	—	—	501,308.96	0.23	300.79	0.58	—	
安信证券	1	—	—	—	—	15,000,000.00	10.75	—	—	—	—	—	—	—	
东兴证券	1	—	—	—	—	3,000,000.00	2.15	—	—	—	—	—	—	—	
广发证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
国信证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
海通证券	1	—	—	—	—	12,000,000.00	8.60	—	—	—	—	—	—	—	
宏源证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
红塔证券	1	—	—	—	—	11,500,000.00	8.24	—	—	—	—	—	—	—	
华创证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
华西证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
民生证券	1	—	—	—	—	33,000,000.00	23.66	—	—	—	—	—	—	—	
申银万国	1	—	—	—	—	29,000,000.00	20.79	—	—	—	—	—	—	—	
湘财证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
兴业证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
中投证券	1	—	—	—	—	26,000,000.00	18.64	—	—	—	—	—	—	—	

中信证券	1	-	-	-	-	10,000,000.00	7.17	-	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---------------	------	---	---	---	---	---	---	---

注：1. 我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。

2. 基金债券回购交易与富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）共用交易单元。本报告期本基金退租券商交易单元：中邮证券 24977。本报告期本基金新增券商交易单元：广发证券 26138；国信证券 26178；宏源证券 26642。其余租用券商交易单元未发生变动。

