

富国全球债券证券投资基金

2010 年第 4 季度报告

2010 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

报告送出日期： 2011 年 01 月 24 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 2011 年 1 月 20 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。

本基金合同于 2010 年 10 月 20 日生效，本报告期自 2010 年 10 月 20 日起至 2010 年 12 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 |
| 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） | 465,763,340.64 |
| 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。 |
| 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： |

§ 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（2010年10月20日-2010年12月31日） |
|-----------------|------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | -333,595.03 |
| 2. 本期利润 | -139,103.93 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0002 |
| 4. 期末基金资产净值 | 465,612,177.60 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.000 |

注：本基金合同于2010年10月20日生效，自合同生效日起至本报告期末不足一个季度。

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 |
|-------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 自合同生效日至报告期末 | 0.00% | 0.04% | -2.63% | 0.42% | 2.63% | -0.38% |

注：本基金合同于2010年10月20日生效，自合同生效日起至本报告期末不足一个季度。

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 2010 年 12 月 31 日。

本基金合同生效日为 2010 年 10 月 20 日，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

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，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

§ 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 | | |
| 林如惠 | 本基金基金经理 | 2010-10-20 | — | 12 年 | 硕士，曾任保诚证券投资信托股份有限公司（台湾）研究员、基金经理、基金经理海外组主管；2007 年至 2009 年任富国基金管理有限公司境外投资部副总经理；2010 年 10 月起任富国全球债券证券投资基金基金经理。具有基金从业资格，中国台湾。 |

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 | 17 | 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 | 22 | 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合规守信情况说明

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, 以为投资者减少和分散风险, 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, 投资管理和交易执行相隔离, 实行集中交易制度, 严格执行交易系统中的公平交易程序, 未出现违反公平交易制度的情况, 亦未受到监管机构的相关调查。

4.4.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人旗下无其他投资风格相似的投资组合。

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。

4.5 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

全球经济在主要央行维持宽松货币政策刺激下，持续温和复苏，其中美国的二度量化宽松对全球投资信心产生了较大激励，不过，欧元区部分国家的债务问题让包含股票债券与汇率在内的主要金融资产波动度大幅增加。

全球债券市场在第四季呈现先上后下的走势，受到美国公布经济数据优于预期影响，美国国债在四季度出现大幅回调，资金转入以股票为主的风险资产，高收益债与新兴市场债因全年涨幅达到两位数，在年底也出现获利回吐的卖压。

本基金于 2010 年 10 月 20 日成立，基金管理人当时判断债券市场面临较大回调风险，因此采取谨慎建仓策略，截至年底，基金成立以来报酬率为 0.00%，同期业绩指标表现为 -2.63%，本报告期间，基金表现超越业绩指标表现。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期，基金净值增长率为 0.00%，业绩比较基准收益率为-2.63%。

§ 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 | 94,152,506.10 | 18.63 |
| 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 | 366,016,395.70 | 72.43 |
| 8 | 其他资产 | 45,153,292.43 | 8.94 |
| 9 | 合计 | 505,322,194.23 | 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 | SKANDIA-US TOTAL RTN BOND-A | 开放式 | 契约 型开 放式 | Skandia Fund Management Ltd | 44,905,775.58 | 9.64 |
| 2 | FIDELITY FNDS-US HIGH YLD-A\$ | 开放式 | 契约 型开 放式 | FIL Limited | 26,039,115.37 | 5.59 |
| 3 | BGF-WORLD BOND FUND-\$A1 | 开放式 | 契约 型开 放式 | BlackRock Luxembourg SA | 23,207,615.15 | 4.98 |

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的，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。

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 | 45,015,412.50 |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | 85,912.38 |
| 5 | 应收申购款 | 51,967.55 |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 45,153,292.43 |

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：本基金本报告期末前十名基金中不存在流通受限情况。

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

| | |
|---|----------------|
| 基金合同生效日(2010年10月20日)基金份额总额 | 828,405,192.16 |
| 基金合同生效日(2010年10月20日)起至报告期期末基金总申购份额 | 796,916.70 |
| 基金合同生效日(2010年10月20日)起至报告期期末基金总赎回份额 | 363,438,768.22 |
| 基金合同生效日(2010年10月20日)起至报告期期末基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列) | — |
| 报告期期末基金份额总额 | 465,763,340.64 |

注：本基金合同于2010年10月20日生效。

§ 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

上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5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
2011年01月24日