

富国基金管理有限公司 企业年金基金投资管理情况

2013 年 1 季度

一、2013 年 1 季度投资管理基本情况

管理机构	组合数 (个)				组合资产净值 (万元)				当年投资 收益额 (万元)
	一季度	二季度	三季度	四季度	一季度	二季度	三 季 度	四季度	
富国基金管 理有限公司	31				950,287.59				24,901.23

注：当年投资收益额=当年投资资产利息收入+投资处置收益+公允价值变动损益+其他收入-受托费-托管费-投资管理费-交易费用-利息支出-其他费用。“当年投资收益额”数据由各投资管理人上报的季度统计报表（人社监司便函[2011]15号）表四“当期投资收益”4个季度数据加总得出。

二、2013 年投资管理收益率

机构名称	计划 类型	组合类型	满期组合数 (个)	满期组合期末资 产规模 (万元)	2013 年加权 平均收益率 (%)
富国基金管 理有限公司	集合 计划	不含权益类			
		含权益类	1	101854.61	2.92%
	单一 计划	不含权益类	2	23303.26	0.97%
		含权益类	28	825129.72	2.86%
	其他	不含权益类			
		含权益类			

注：1. 计算样本为投资运作满全年的投资组合，按是否含权益类投资标的来分类，以期初合同或备忘录为准，明确约定不能投资权益类的组合为不含权益类；没有明确约定或中间发生类别变动的，都视同为含权益类。

2. 投资收益率计算方法为该公司管理的所有样本组合收益率的规模加权，以年初和 4 个季度末平均规模为权重；组合收益率为单位净值增长率。

3. “集合计划”是指通过人社部备案并取得计划登记号、已实行规范化管理的集合型企业年金计划；“其他”是指尚未转入规范化集合计划或者建立单一计划的过渡计划和准集合计划。

三、2013 年投资组合收益率分布情况

富国基金管理有限公司		
收益率 (R)	组合数 (个)	期末资产规模 (万元)
$R \geq 4\%$		
$4\% > R \geq 3\%$	7	433802.93
$3\% > R \geq 2\%$	18	463223.00
$2\% > R \geq 1\%$	4	29958.40
$1\% > R \geq 0$	2	23303.26
$R < 0$		
合计	31	950287.59

注：计算样本为投资运作满全年的投资组合，“组合数”和“期末资产规模”是指收益率在该区间的组合个数和这些组合期末资产之和。组合收益率计算方法为单位净值增长率。