

基金管理人及基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金的投资业绩并不保证其未来表现。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。

本报告中所载资料为基金财产,未经审计。

本报告自2013年9月1日起至2013年9月30日止。

基金简称	富国7天理财宝债券
基金主代码	100007
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2012年10月19日
报告期末基金份额总额	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,努力追求绝对收益,为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略,将投资组合的平均剩余期限控制在127天以内,在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下,适度参与收益。
业绩比较基准	七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金,长期内风险收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场型证券投资基金。
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
下属两级基金的简称	富国7天理财宝债券A 富国7天理财宝债券B
下属两级基金的交易代码	100007 101007
报告期末下属两级基金的份额总额	92,706,757.90 54,121,536.92

3.1. 主要财务指标		单位：人民币元	
主要财务指标	A股		B股
	(2013年07月01日~2013年09月30日)	(2013年07月01日~2013年09月30日)	
1.本期已实现收益	2,902,366.93	3,597,724.06	
2.本期利润	2,902,366.93	3,597,724.06	
3.期末基金资产净值	192,706,757.90	\$4,121,536.92	

注：所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，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。由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零。本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2. 基金净值表现

3.2.1. 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率 ①	净值收益率标准 偏差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	0.8531%	0.0017%	0.3450%	0.0000%	0.5081%	0.0017%

③ 业绩

阶段	净值收益率 ①	净值收益率标准 偏差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	0.9277%	0.0016%	0.3450%	0.0000%	0.5827%	0.0016%

3.2.2.自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(4) 自基金合同生效以来富国7天理财宝债券A基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

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 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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至2013年9月30日止。

基金管理人:	南国基金壹号资产管理公司
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 重要提示**

富国基金资产管理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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、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业绩。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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至2013年9月30日止。

基金名称	富国产业债
基金代码	100058
交易代码	前端交易代码: 100058 后端交易代码: 100059
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年12月05日
报告期末基金份额总额(单位:份)	5,646,126,635.35
投资目标	本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上,力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将采用自上而下的方法对基金资产进行动态的资产配置和类属资产配置。在认真研判宏观经济运行状况和货币市场运行趋势的基础上,根据资产配置策略动态调整股票、固定收益类资产和现金类资产在基金资产中的比例;在充分分析各市场环境下市场动态的基础上,根据类属资产配置策略对投资组合内类属资产进行权重分配和配置调整。
业绩比较基准	中债综合指数
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。
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

3.1 主要财务指标		单位：人民币元	
主要财务指标		报告期(2013年07月01日至2013年09月30日)	
1.本期已实现收益		69,685,704.25	
2.本期利润		-11,534,004.69	
3.加权平均基金份额本期利润		-0.002	
4.期末基金资产净值		5,783,217,936.77	
5.期末基金份额净值		1.02	
注：1.上述基金业绩指标不包括持有买入认购或交易基金的申购或赎回费(赎回费、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 本基金净值增长率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 净值增长率	业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准	①-③
过去三个月	-0.19%	0.07%	-1.02%
			0.07%
			0.83%
			0.00%

3.2.1 上述信息出口国收入经基金统计师验证并发生变动反共与向国际组织比较经核实变动的影响

表 1

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 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。

本公司及在中国大陆境内所有子公司均根据本基金合同规定，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等内容，保证复核内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

富国基金管理有限公司承诺不欺诈信用，勤勉尽责地为投资者提供服务和回报基金份额持有人，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。本报告中如有未尽事宜，敬请参阅本报告其他部分及有关法律法规。基金管理人对基金投资业绩及有关事项的说明请参看本报告中财务资料附录部分。

本报告期内基金管理人于2013年9月10日至2013年9月16日披露了如下公告：

基金管理人	招商证券股份有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年11月29日
报告期末基金份额总额(单位:份)	1,782,879,684.18
投资目标	本基金追求在本金安全、保持资产流动性以及有效控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为持有人提供长期稳定的投资回报。
投资策略	基金将采用自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和品种资产配置,在兼顾控制宏观经济运行状况和利率走势以及债券市场利率、相关债券资产配置策略的基础上,调整类属资产配置的比例,在充分研究债券市场环境及市场流动性的基础上,根据市场利率变化调整对固定收益类资产进行逐行配置和调整策略。
业绩比较基准	中债综合指数
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投资品种,其风险和收益与预期收益高于货币市场基金,低于混合型证券投资基金和股票基金。
基金管理人 基金托管人	招商基金管理有限公司 招商证券股份有限公司
下属两只基金的资金托管人	招商证券股份有限公司 招商证券股份有限公司
报告期末下属两只基金的份额总额(单位:份)	100,000 971,324,740.28
	811,054,943.90

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标	A/B级 报告期末(2017年07月01日—2013年09月30日)	C级 报告期末(2017年07月01日—2013年09月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	10,681,814.39	8,616,570.72	
2.本期利润	3,421,853.78	2,062,621.37	
3.期末可供基金份额净值	0.0034	0.0022	
4.期末基金资产净值	987,550,688.42	821,300,577.45	
5.期末基金份额净值	1.016	1.015	

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
过去三个月	0.29%	0.07%	-1.02%	0.07%	1.31%	0.00%

  

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
过去三个月	0.29%	0.06%	-1.02%	0.07%	1.31%	-0.01%

注：过去三个月指2013年7月11日至2013年9月30日

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

① 自基金合同生效以来富国纯债债券发起AB基金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

---

合、同一投资标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。

(3) 事后评估及反馈主要包括组合内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：①对于不同类别资产的投资行为进行事前评估、分析和决策跟踪记录；基金、社保及专户之间、非指数类资产之间、涉及公共资产的组合行为进行事前评估、分析和决策跟踪记录；②对不同产品以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为进行分析与综合评估；③对于基金管理人投资决策流程、决策依据等信息记录，并开展定期或不定期对投资组合、基金经理行为、交易价差、成交及时性等交易后评估及反馈工作；④基金经理年度述职时，应当保存，以备审查。

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) 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成批的单边交易超过该证券当日成交量5%的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

4. 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2. 本基金于2012年10月19日成立,自合同生效日至本报告期末不足一年;建仓期2周,从2012年10月19日至2012年11月11日,建仓期结束的各项资产分配比例均符合基金合同的约定。

3. 自基金合同生效后,长期国债债券**B**基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:起始日期为2012年10月19日,截止日期为2013年9月30日。

§ 4 管理人报告

4.1 报告期内基金运作遵规守信情况说明

本报告期,本基金严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规、基金合同、基金招募说明书的规定,不存在违法违规或违背基金合同、基金招募说明书的行为。

4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

本报告期,本基金净值收益率A级0.8531%、B级0.9272%,同期业绩比较基准收益率为A级0.3450%、B级0.3450%。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	120,028,052.10	47.49
	其中:债券	120,028,052.10	47.49
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	122,641,123.12	48.52
4	其他资产	10,095,037.94	3.99
5	合计	252,764,213.16	100.00

5.2 报告期末债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	2.99%

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明	报告期内是否发生被中国证监会采取行政监管措施或受到证券交易所纪律处分的情况
郑超群	本基金基金经理兼资产管理部固定收益投资副经理兼资产管理部基金经理	2012-10-19	-	6年	<p>鄭超群，曾任安邦资产管理(香港)有限公司基金经理，2011年8月至2012年10月任安邦资产管理(香港)有限公司基金经理，2012年10月加入本公司任资产管理部固定收益投资副经理兼资产管理部基金经理。2014年9月加入天弘基金管理有限公司任固定收益部副经理兼基金经理。具有多年证券投资管理经验，具有基金从业资格。</p>	2
					<p>报告期末债券回购融资余额 4,949,872.57 元，占报告期内债券回购融资余额最高值余额 4,949,872.57 元的 100%。</p> <p>其中：买断式回购融资 0 元。</p> <p>报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的 4.06%。</p> <p>本基金报告期内未发生债券正回购融资余额超过基金资产净值的 40% 的情况。</p> <p>5.3 基金投资组合平均剩余期限</p> <p>5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况</p>	2.01%
					<p>项目</p> <p>报告期末投资组合平均剩余期限 94 天</p> <p>报告期内投资组合平均剩余期限最高值 98 天</p> <p>报告期内投资组合平均剩余期限最低值 45 天</p> <p>报告期内投资组合平均剩余期限超过 127 天情况说明</p> <p>本基金报告期内未发生投资组合平均剩余期限超过 127 天的情况。</p> <p>5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例</p>	
冯彬	本基金基金经理兼资产管理部固定收益投资副经理兼资产管理部基金经理	2012-11-13	-	6年	<p>冯彬，曾任平安证券有限责任公司债券交易部交易员，2012年7月加入天弘基金管理有限公司任资产管理部固定收益投资副经理兼资产管理部基金经理。2012年11月加入天弘基金管理有限公司任固定收益部副经理兼基金经理。具有多年证券投资管理经验，具有基金从业资格。</p>	

1	30天(含)~60天(含)	21.33	2.01
其中: 剩余存续期超过397天的浮动利率资产			
2	30天(含)~60天(含)	20.26	
其中: 剩余存续期超过397天的浮动利率资产			
3	60(含)~90天(含)	14.32	
其中: 剩余存续期超过397天的浮动利率资产			
4	90(含)~180天(含)	8.10	
其中: 剩余存续期超过397天的浮动利率资产			
5	180天(含)~397天(含)	24.31	
其中: 剩余存续期超过397天的浮动利率资产			
合计		98.32	2.01

# 富国产业债债券型证券投资基金

## 【2013】 第三季度报告

图 1 截至 2012 年 1 月 31 日基金净值增长率与业绩比较基准收益率对比图

日期	基金净值增长率	业绩比较基准收益率
2011 年 1 月 31 日	1.0000	1.0000
2012 年 1 月 31 日	1.0000	1.0000

[illegible]

# 富国纯债债券型发起式证券投资基金

## 【2013】第三季度报告

[illegible]

基金名称		序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
招商中证白酒指数证券投资基金		1	国债债券	9,721,000.00	0.54
招商中证白酒指数证券投资基金		2	央行票据	-	-
招商中证白酒指数证券投资基金		3	金融债	265,256,000.00	14.66
招商中证白酒指数证券投资基金		4	其中:政策性金融债	265,256,000.00	14.66
招商中证白酒指数证券投资基金		5	企业短期融资券	1,580,928,647.98	76.34
招商中证白酒指数证券投资基金		6	企业中期票据	29,867,000.00	1.63
招商中证白酒指数证券投资基金		7	中期票据	456,591,000.00	25.24
招商中证白酒指数证券投资基金		8	可转债	-	-
招商中证白酒指数证券投资基金		9	其他企业债权类	2,102,570,834.93	6.09
招商中证白酒指数证券投资基金		10	其他	-	-
招商中证白酒指数证券投资基金		10	合计	11,252,567,482.91	124.53

5.5报告期内未按公允价值占基金资产净值比例大小排名前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券简称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122778	11北盘发债	698,880	73,032,960.00	4.04

[illegible]

---

6	中期票据	29,994,434.61	24.31
7	其他		
8	合计	120,028,052.10	48.63
9	期末公允价值超过397%的浮动利率债务	30,106,833.97	12.20

5.报告期末按流动性分类合并现金流量表项目公允价值计量的小计前十名投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	公允价值(元)	公允价值变动比例(%)
1	1080149	10%国开债01	300,000.00	30,106,833.97		12.20
2	0828112		300,000.00	29,929,425.32		12.12
3	041372001	13国债·CP01	200,000.00	20,002,682.68		8.10
4	041363008	13国债·CP01	200,000.00	20,000,034.39		8.10

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%之间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	-0.0091%
报告期内偏离度的最低值	-0.1836%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.048191
注1:以上数据按工作日统计	
注2:报告期内本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3:本基金本报告期末未持有资产支持证券。	
5.8 投资组合报告附注	
5.8.1 基金计价方法说明	
本基金采用固定份额净值,基金份额净值始终被保持为人民币1.00元。	
本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,其利息在期末前摊销,每日计提收益结转。	
5.8.2 报告期内本基金持仓余额前10名资产支持证券存续期超过397天的浮动利率债券的明细	
其报告期内本基金不存在该类浮动利率债券的持仓成本超过当日基金资产净值20%的情况。	
5.8.3 报告期内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,或在报告编制日前受到刑事处罚、行政处罚、违约情形。	
报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的,在本报告编制日前一年也不存在受到公开谴责、处罚的情况。	
5.8.4 其他资产构成	
序号	金额(元)
1 存出保证金	-
2 应收证券清算款	-
3 应收利息	3,041,915.29
4 应收申购款	7,053,122.65
5 其他应收款	-
6 待摊费用	-
7 其他	-
8 合计	10,095,037.94

§ 6 开放式基金份额变动			单位:份
项目	A级	B级	
报告期期初基金份额总额	318,401,768.43	156,031,113.66	
报告期期间基金总申购份额	1,128,575,983.22	2,666,125,187.82	
减:报告期期间基金总赎回份额	1,254,270,993.70	2,768,034,764.56	
报告期期末基金份额总额	102,706,757.95	64,121,636.07	

注:本报告期本基金的管理人未运用固有资金申购或买卖其基金份额。

**§ 基金文件目录**

**8.1 备查文件目录**

1、中国证监会批准设立富国7天理财债券型证券投资基金的文件

2、富国7天理财债券型证券投资基金基金合同

3、富国7天理财债券型证券投资基金托管协议

4、中国证监会批准设立富国基金(香港)有限公司文件

5、富国7天理财债券型证券投资基金投资基金募集说明书及募集附注

6、中国证监会在指定报刊上披露的有关事项公告

**8.2 存放地点**

上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层

**8.3 查阅方式**

投资者对本报告如有疑问,可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。

咨询电话:95105866、4008880688 (全国统一,免长途话费)

公司网址: <http://www.fundoc.com.cn>

2013年10月23日

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	119027	侨城05	410,000	41,000,000.00	0.71
2	119026	侨城04	370,000	37,000,000.00	0.64
3	119025	侨城03	340,000	34,000,000.00	0.59
4	119024	侨城02	320,000	32,000,000.00	0.55

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8 报告期内本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金未投资国债期货。

5.8.2 本基金股指期货投资的投资策略

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金未投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

5.10.1 申明本基金的资产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、处罚的情况

5.10.2 申明本基金的资产前十名证券的发行主体是否被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况

5.10.3 申明基金投资的资产前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票名单

本基金本报告期末未持有股票资产。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	974,839.72
2	应收证券清算款	413,047,587.17
3	应收股利	
4	应收利息	230,439,934.06
5	应收申购款	52,725.79
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	644,515,056.74

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	109,269,771.10	1.89

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有流通受限股票。

5.10.6 报告期末前十名其他资产描述

因四舍五入原因,投资组合报告中中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

报告期间基金份额总额	5,679,050,476.92
报告期末基金份额总额	101,007,632.21
报告期间基金份额净增加额	133,931,466.78
报告期间基金份额净变动比例(份额减少以“-”填列)	
报告期末基金份额总额	5,646,126,635.03

**§ 7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况**

注:本报告期,基金管理人运用固有资金投资本基金情况

**§ 8 备查文件目录**

1. 备查文件目录
1. 中国证监会批准设立富国产业债债券型证券投资基金的文件
2. 富国产业债债券型证券投资基金基金合同
3. 富国产业债债券型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. 富国产业债债券型证券投资基金募集说明书及募集附注
6. 报告期内在中国证监会核准的各家银行各自披露
7. 2. 存放地点
- 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层
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。

富国基金管理有限公司  
2013年10月23日

---

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

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。

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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。

本基金本报告期末未有股票资产。

1	存出保证金	273,990.29
2	应收证券清算款	1,038.02
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	56,168,604.76
6	其他应收款	32,545,884.37
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	88,989,517.44

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股票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。  
因前五名买入、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。

项目	A/级	C级
报告期期初基金份额总额	1,077,552,798.80	1,067,570,180.43
报告期期间基金总申购份额	202,590,943.97	386,327,692.38
减:报告期期间基金总赎回份额	308,319,002.49	642,842,928.91
报告期期间基金总申购份额 (份额减少部分+减列)	-	-
报告期期末基金份额总额	971,824,740.28	811,054,943.90

**§ 7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况**

注:本报告期末基金的基金管理人未运用固有资金申购或买卖本基金

**§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况**

项目	持有份额总额(份)	基金总份额占比 比例(%)	发起份额总额(份)	发起份额占基金 总份额比例 (%)	发起份额承诺 持有期限
基金管理人固有资金	10,000,600.06	0.56	10,000,600.06	0.56	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-

注：本公司运用固有资金认购国富纯债债券型发起式证券投资基金A级基金份额10000600.06份。					
10,000,600.06	0.56	10,000,600.06	0.56		

**§ 9 备查文件目录**

1. 中国证监会批准设立国富纯债债券型发起式证券投资基金的文件
2. 国富纯债债券型发起式证券投资基金基金合同
3. 国富纯债债券型发起式证券投资基金托管协议
4. 中国证监会批准设立国富基金管理有限公司的文件
5. 国富纯债债券型发起式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. 存放地点  
上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层
8. 查阅方式  
投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金经理或国富基金管理有限公司。  
咨询电话：8310596、4008886888 傅煜坚 俞玲（咨询电话）

富国基金管理有限公司  
2013年10月23日