

B056信息披露Disclosure

(上接B055版)

法人代表: 苗杰
联系电话: (010) 57390062
传真电话: (010) 57390058
联系人: 徐福福
客服电话: 96571
公司网站: www.founderscm.com
(67) 中原证券股份有限公司
注册地址: 郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址: 郑州市郑东新区商务外环路10号
法人代表: 吕明军
联系电话: 0371-65585670
传真电话: 0371-65585665
联系人: 程月艳
客服电话: 0371-967218, 400-813-9666
公司网站: www.ccnew.com
(68) 中国银河证券股份有限公司
注册地址: 北京市建国门外大街1号国贸大厦27层及28层
办公地址: 北京市建国门外大街甲6号SK大厦3层
法人代表: 李剑刚
联系电话: 010-65051166
传真电话: 010-65051166
联系人: 魏舜涛
客服电话: 010-65051166
公司网站: www.cicc.com.cn
(69) 中期时代基金销售有限公司
注册地址: 北京市朝阳区建国门外光华路16号中国中期大厦A座11层
办公地址: 北京市朝阳区建国门外光华路16号中国中期大厦A座11层
法人代表: 路颖
联系电话: 010-50630718
传真电话: 010-50630701
联系人: 侯建雄
客服电话: 96162, 4008888160
公司网站: www.citicfund.com
(70) 广州农村商业银行股份有限公司
注册地址: 广州市天河区珠江新城华夏路1号
办公地址: 广州市天河区珠江新城华夏路1号
法人代表: 王捷雄
联系电话: 020-28010593
传真电话: 020-22388014
联系人: 廖超雄
客服电话: 020-961111
公司网站: www.grcbank.com
(71) 中国银河证券股份有限公司
注册地址: 北京市西城区金融大街4号
办公地址: 北京市西城区金融大街3号
法人代表: 刘国华
联系电话: (010) 68850657
传真电话: (010) 68850657
联系人: 王颖
客服电话: 96590
公司网站: www.patcc.com
基金管理人可根据有关法律法规的要求, 选择其它符合要求的机构代理销售本基金, 并及时公告。

(二) 登记机构
名称: 富国基金管理有限公司
住所: 上海市浦东新区世纪大道9号上海国金中心二期16、17层
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道9号上海国金中心二期16、17层
电话: (021) 20361818
传真: (021) 20361616
联系人: 雷蕾
(三) 出具法律意见书的律师事务所(基金募集时)
名称: 上海市通力律师事务所
住所: 上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址: 上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人: 陈皓
电话: (021) 31350666
传真: (021) 31350600
联系人: 黎明
经办律师: 吕红、黎明
(四) 审计基金财产的会计师事务所
名称: 安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址: 北京市东城区东长安街1号东方广场E座大楼16层
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心50楼
法定代表人: 葛明
联系电话: 021-22288888
传真: 021-22280000
联系人: 徐彬
经办注册会计师: 徐彬、蒋燕华

富国基金业绩比较基准: 沪深300指数

本基金为债券型证券投资基金, 业绩比较基准为: 中债综合全价指数

本基金在追求本金安全、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, 力争为持有人提供超越业绩比较基准的长期稳定的投资回报。

本基金的投资范围具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券、可分离交易可转债的债券品种等金融工具以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不直接买入二级市场买入权证、股票等权益类资产, 也不参与一级市场的新股申购或增发, 可转债转股所得的可分离交易可转债除外。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人将在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为: 投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%, 现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

八、基金的投资策略

1. 资产配置策略

本基金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类属资产配置, 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, 根据整体资产

资产配置策略动态调整大类金融资产的比例; 在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上, 根据类属资产配置策略对投资组合进行优化配置和调整。

(1) 整体资产配置策略

通过国内外宏观经济状况、市场利率走势、市场资金供求情况, 以及证券市场走势、信用风险情况、风险偏好和有关法律法规等因素的综合分析, 在整体资产之间进行动态配置, 确定资产的最优配置比例和相应的风险水平。

(2) 类属资产配置策略

在整体资产配置策略的指导下, 根据不同类属资产的风险来源、收益率水平、利息支付方式、利息税务处理、信用等级选择价值、类属资产收益差异、市场偏好以及流动性等因素, 采取积极投资策略, 定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整, 确定类属资产的最优权重。

(3) 明细资产配置策略

在明细资产配置上, 首先根据明细资产的剩余期限、资产信用等级、流动性指标决定是否纳入组合; 其次, 根据信用债的收益率和流动性指标决定投资策略, 按照基金的收益要求决定是否纳入组合; 最后, 根据个别债券的流动性指标决定投资总量。

2. 普通债券投资策略

本基金在普通债券的投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及宏观经济状况、利率预期、信用风险等因素, 主要包含: 久期控制、期限结构配置、信用风险配置、跨市场套利和相对价值判断等管理手段, 对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券品种的定价进行预测, 相对主动、积极调整。

(1) 久期控制是根据对宏观经济形势、信用债利率变化进行预测, 相对主动、积极调整。

(2) 期限结构配置是在确定组合久期后, 针对收益率曲线形态特征确定的合理的组合期限结构, 包括采用集中策略、两端策略和梯形策略等, 在长期、中期和短期债券间进行动态调整, 从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

(3) 信用风险控制是管理人充分利用现有行业与公司研究力量, 根据发债主体的经营情况和现金流等情况评估其信用风险进行评估, 以此作为品种选择的基本依据。信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

本基金认为, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一, 信用评级是基金投资的重要环节之一。

3. 报告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股票资产。

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	8,098,700.00	1.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	35,053,000.00	4.82
4	其中: 政策性金融债	35,053,000.00	4.82
4	企业债券	450,377,343.50	61.96
5	企业短期融资券	170,455,000.00	23.47
6	中期票据	19,972,000.00	2.75
7	可转债	-	-
8	中小企业私募债	44,948,754.11	6.18
9	其他	-	-
10	合计	729,094,707.61	100.30

5. 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债券投资明细

序号	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122675	125	50,897,045.70	7.00
2	041401010 14国债CP001	500,000	50,405,000.00	6.93
3	122778	115	40,844,625.00	5.62
4	122225 12-国债1	358,070	35,651,798.00	4.90
5	122886 02国债债	340,070	34,007,000.00	4.68

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

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贵金属投资明细

注: 本基金本报告期末未持有贵金属。

8. 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

注: 本基金本报告期末未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注: 本基金本报告期末未投资股指期货。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定, 不允许投资股指期货。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(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。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注: 本基金本报告期末未投资国债期货。

(3) 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。

11. 投资组合报告附注

(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。

(2) 申明本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。

注: 本基金本报告期末未持有股票资产。

(3) 其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	存出保证金	144,996.42
2	应收证券清算款	1,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	17,668,187.27
5	应收申购款	896,753.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他资产	19,711,935.57
9	合计	-

(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) 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。

(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, 投资组合报告市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

十二、业绩比较基准

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产, 但不保证基金一定盈利, 也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现, 投资有风险, 投资者在进行投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

1. 富国纯债债券型发起式证券投资基金历史各时间段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

(1) A/B级

阶段	净值增长率①	净值增长率比较基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③
2012.1.22-2012.12.31	0.30%	0.03%	0.22%	0.08%	0.01%
2013.1.1-2012.12.31	0.32%	0.09%	-0.47%	0.09%	0.00%
2014.1.1-2014.6.30	5.73%	0.13%	5.82%	0.08%	-0.09%
2014.1.1-2014.9.30	8.30%	0.11%	7.56%	0.08%	-0.02%
2012.1.22-2014.9.30	9.06%	0.10%	7.36%	0.08%	1.70%

(2) C级

阶段	净值增长率①	净值增长率比较基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③
2012.1.22-2012.12.31	0.20%	0.03%	0.22%	0.02%	-0.02%
2013.1.1-2012.12.31	0.26%	0.08%	-0.47%	0.09%	0.49%
2014.1.1-2014.6.30	5.41%	0.14%	5.82%	0.08%	-0.38%
2014.1.1-2014.9.30	8.04%	0.12%	7.56%	0.08%	0.45%
2012.1.22-2014.9.30	8.24%	0.10%	7.36%	0.08%	0.02%

注: 本基金本报告期末未持有股票资产。

注: 本基金本报告期末未持有股票资产。

注: 本基金本报告期末未持有股票资产。

注: 本基金本报告期末未持有股票资产。

注: 本基金本报告期末未持有股票资产。

注: 本基金本报告期末未持有股票资产。

注: 本基金本报告期末未持有股票资产。

注: 本基金本报告期末未持有股票资产。

注: 本基金本报告期末未持有股票资产。

注: 本基金本报告期末未持有股票资产。

注: 本基金本报告期末未持有股票资产。

注: 本基金本报告期末未持有股票资产。

注: 本基金本报告期末未持有股票资产。

注: 本基金本报告期末未持有股票资产。