富国中国中小盘(香港上市)混合型证券投资基金

【2015】第三季度报告

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:	2015年10月26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2015年10月22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2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国中国中小盘混合(QDII)
基金主代码	100061
交易代码	前端交易代码:100061 后端交易代码:000162
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年09月04日
报告期末基金份额总额(单位:份)	873,979,247.86
投资目标	本基金主要投资于香港市场中的中国概念中小盘股票,通过精选个股和风险控制,力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	通过积极主动的投资,精选香港市场中具有中国概念的优质股票进行投资,分享中国经济快速成长的成果。中小盘股票成长空间大,且往往存在估值洼地,能够为投资者带来超额收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:MSCI中国自由投资中小盘股票指数(MSCI China Free SMID Index)收益率×80%+香港三个月期银行同业拆借利率(Hong Kong 3-Month Interbank Offer Rate)×20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。
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: - 中文名称: -
境外资产托管人	英文名称: The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited 中文名称: 香港上海汇丰银行有限公司

§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(2015年07月01日-2015年09月30日)
1.本期已实现收益	-200,257,460.65
2.本期利润	-343,463,701.78
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4449
4.期末基金资产净值	1,503,284,612.13
5.期末基金份额净值	1.720

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。

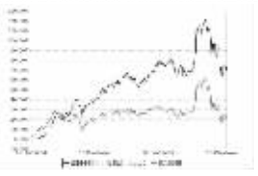
3.2 基金净值表现

3.2.1 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
过去三个月	-15.56%	2.84%	-15.54%	2.51%	-0.02%	0.33%

注:过去三个月指2015年7月1日-2015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



注:截止日期为2015年9月30日。

本基金合同生效日为2012年9月4日。

本基金建仓期6个月,即从2012年9月4日起至2013年3月3日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§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		
张峰	本基金基金经理兼任海外投资总监、富国全球顶级消费品股票型证券投资基金、富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2012-09-04	-	14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混合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)混合型证券投资基金基金经理,自2015年6月起任富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理;兼任海外投资总监。具有基金从业资格。

注:1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期,离任日期为根据公司决定确定的解聘日期;首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、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。

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

注:本基金无境外投资顾问。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期,富国基金管理有限公司作为富国中国中小盘(香港上市)混合型证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国中国中小盘(香港上市)混合型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、确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,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,非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。

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。

4.4.2 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 报告期内基金的业绩表现

本报告期,本基金份额净值增长率为-15.56%,同期业绩比较基准收益率为-15.54%。

4.7 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期无需要说明的相关情形。

§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	949,872,492.25	61.57
	其中:普通股	949,872,492.25	61.57
	存托凭证	-	-
2	基金投资	32,257.83	-
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	391,599,838.06	25.38
8	其他资产	201,252,553.56	13.04
9	合计	1,542,757,141.69	100.00

5.2 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

金额单位:元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
中国香港	888,330,019.50	59.09
美国	61,542,472.75	4.09
合计	949,872,492.25	63.19

注:截至9月30日,本基金通过沪港股通渠道持仓的港股市值为人民币88,974,006.45元。

5.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位:元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
非日常生活消费品	44,145,786.24	2.94
工业	378,272,345.45	25.16
公用事业	68,476,886.86	4.56
金融	193,562,470.65	12.88
能源	5,622.55	-
日常消费品	15,476,052.43	1.03
信息技术	97,756,980.95	6.50
医疗保健	131,578,377.91	8.75
原材料	20,597,969.21	1.37
合计	949,872,492.25	63.19

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

金额单位:元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	CHINA TAIPING INSUR-ANCE HOLD	中国太平	966 HK	香港交易所	中国	2834902	55,962,327.65	3.72
2	DONGJIANG ENVI-RONMEN-TAL-H	东江环保	895 HK	香港交易所	中国	5243225	51,730,371.98	3.44
3	TECHNO-VATOR INTERNA-TIONAL LT	科诺威德	1206 HK	香港交易所	中国	11740000	47,603,368.44	3.17
4	GUANG-DONG YUEYUN TRANS-PORTAT	广东粤运	3399 HK	香港交易所	中国	8669000	35,791,477.51	2.38
5	Concord New Energy Group Ltd	协合新能源	182 HK	香港交易所	中国	82130000	35,054,825.16	2.33
6	DAWN-RAYS PHARMA-CEUTICAL HOLD	东瑞制药	2348 HK	香港交易所	中国	6328000	34,644,551.49	2.30
7	NEW CHINA LIFE INSUR-ANCE C-H	新华保险	1336 HK	香港交易所	中国	10939000	29,899,539.17	1.99
8	CHINA COMMU-NICA-TIONS CONST-H	中国交通建设	1800 HK	香港交易所	中国	32390000	25,336,492.22	1.68
9	XIAMEN INTERNA-TIONAL PORT-H	厦门港务	3378 HK	香港交易所	中国	16338000	25,077,436.37	1.67
10	BEIJING URBAN CON-STRUC-TION-H	城建集团	1599 HK	香港交易所	中国	6885000	24,639,567.07	1.64

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

金额单位:元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	配股权证	2996 HK(复兴国际)	-	-

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	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	开放式	其它基金	越秀房托资产管理有限公司	32,257.83	-

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股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

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	-
3	应收股利	620,560.16
4	应收利息	11,473.36
5	应收申购款	200,620,520.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	201,252,553.56

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未持有流通受限的股票。

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

报告期期初基金份额总额	1,114,731,785.35
报告期期间基金总申购份额	276,600,465.13
减:报告期期间基金总赎回份额	517,353,002.62
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	873,979,247.86

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据自2014年8月8日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定,经与基金托管人协商一致,基金管理人决定自2015年8月4日起将本基金更名为富国中国中小盘(香港上市)混合型证券投资基金,并相应变更本基金的风险收益特征。本次变更符合相关法律法规的规定,对基金份额持有人利益无实质性不利影响,且不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化,不需召开基金份额持有人大会。具体见基金管理人在指定媒介上披露的相关公告。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立富国中国中小盘(香港上市)混合型证券投资基金的文件

2、富国中国中小盘(香港上市)混合型证券投资基金基金合同

3、富国中国中小盘(香港上市)混合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、富国中国中小盘(香港上市)混合型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

9.2 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

9.3 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

2015年10月26日

富国优化增强债券型证券投资基金

【2015】第三季度报告

基金管理人:	富国基金管理有限公司
基金托管人:	中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:	2015年10月26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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月22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2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国优化增强债券
基金主代码	100035
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年06月10日
报告期末基金份额总额	519,312,912.52
投资目标	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,力争为持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金按照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,在债券投资过程中突出主动性的投资管理。 本基金通过对宏观经济以及债券市场中长期发展趋势的客观判断,合理配置收益率相对较高的企业债、公司债、资产支持证券,以及风险收益特征优异的可转换债、可分离债券、可交换债券等,加以对国家债券等高流动性品种的投资,灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值等策略。在保证基金流动性的前提下,积极把握投资机会,获取各类债券的超额投资收益。
业绩比较基准	中债综合指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%
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	中国建设银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	富国优化增强债券A/B级 / 富国优化增强债券C级
下属分级基金的交易代码	前端 / 后端: 100037
报告期末下属分级基金的份额总额(单位:份)	333,345,777.35 / 185,967,135.17

§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	A/B级 报告期(2015年07月01日-2015年09月30日)	C级 报告期(2015年07月01日-2015年09月30日)
1.本期已实现收益	-4,089,911.41	-6,835,102.55
2.本期利润	2,448,832.06	-13,057,868.28
3.加权平均基金份额本期利润	0.0095	-0.0811
4.期末基金资产净值	503,123,650.91	273,337,495.61
5.期末基金份额净值	1.509	1.470

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 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

(1)A/B级

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	1.00%	0.48%	-1.13%	0.34%	2.13%	0.14%

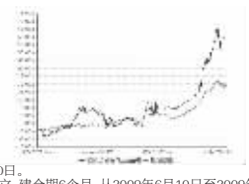
(2)C级

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	0.96%	0.48%	-1.13%	0.34%	2.09%	0.14%

注:过去三个月指2015年7月1日-2015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

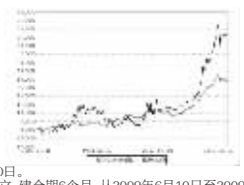
(1)自基金合同生效以来富国优化增强债券A/B级基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:截止日期为2015年9月30日。

本基金于2009年6月10日成立,建仓期6个月,从2009年6月10日至2009年12月9日建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

(2)自基金合同生效以来富国优化增强债券C级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



注:截止日期为2015年9月30日。

本基金于2009年6月10日成立,建仓期6个月,从2009年6月10日至2009年12月9日建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§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		
张钫	本基金基金经理兼任固定收益投资副总监、富国天盈债券型证券投资基金(LOF)、富国产业债债券型证券投资基金、富国信用增强债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金、富国新回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2014-07-29	-	6年	硕士,曾任华富基金管理有限公司债券研究员、基金经理助理、基金经理;自2014年3月至2014年7月在富国基金管理有限公司人力资源部工作,自2014年7月起在富国基金管理有限公司固定收益投资部工作,并自2014年7月起任富国天盈债券型证券投资基金(LOF)、富国产业债债券型证券投资基金、富国优化增强债券型证券投资基金基金经理,2014年10月起任富国国有企业债债券型证券投资基金和富国信用增强债券型证券投资基金基金经理,2014年11月起任富国新回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理;兼任固定收益投资副总监。具有基金从业资格。

注:1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期,离任日期为根据公司决定确定的解聘日期;首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、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。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期,富国基金管理有限公司作为富国优化增强债券型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》、《富国优化增强债券型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,基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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,非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。

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。

4.3.2 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,因组合流动性管理或投资策略调整需要,出现5次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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度,市场风险偏好大幅回落,大量资金涌入债市,形成债券牛市。股票市场经历去杠杆,股价快速调整。本基金通过仓位控制和结构调整,把握了净值的回撤幅度。本基金将在风险控制的前提下,适度降低风险偏好,争取为基金持有人带来可持续的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期,本基金份额净值增长率A/B级1.00%、C级-1.13%;同期业绩比较基准收益率A/B级0.96%、C级-1.13%。

4.6 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期无需要说明的相关情形。

§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	权益投资	29,143,711.80	3.66
	其中:股票	29,143,711.80	3.66
2	固定收益投资	695,734,950.10	87.32
	其中:债券	695,734,950.10	87.32
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	10,000,135.00	1.26
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	47,881,408.92	6.01
7	其他资产	14,015,315.58	1.76
8	合计	796,775,521.40	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,370,000.00	0.31
C	制造业	14,203,911.80	1.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,675,800.00	1.12
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,535,000.00	0.20
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,359,000.00	0.30
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	29,143,711.80	3.75

5.3 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000423	东阿阿胶	112,960	4,708,172.80	0.61
2	600085	同仁堂	150,000	3,370,500.00	0.43
3	002223	鱼跃医疗	100,000	3,359,000.00	0.43
4	601139	深圳燃气	380,000	3,119,800.00	0.40
5	600168	武汉控股	300,000	2,904,000.00	0.37
6	600886	国投电力	300,000	2,652,000.00	0.34
7	600028	中国石化	500,000	2,370,000.00	0.31
8	000826	桑德环境	70,000	2,359,000.00	0.30
9	002038	双鹭药业	80,000	2,054,400.00	0.26
10	600185	格力地产	100,000	1,535,000.00	0.20

5.4 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	国家债券	13,027,002.00	1.68
2	央行票据	-	-
3	金融债券	127,629,196.00	16.44
	其中:政策性金融债	127,629,196.00	16.44
4	企业债券	394,615,752.10	50.82
5	企业短期融资券	130,175,000.00	16.77
6	中期票据	30,288,000.00	3.90
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	695,734,950.10	89.60

5.5 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	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	018001	国开1301	326,000	32,896,660.00	4.24
2	150213	15国开13	300,000	30,516,000.00	3.93
3	101556018	15远东租赁MTN001	300,000	30,288,000.00	3.90
4	150212	15国开12	300,000	30,210,000.00	3.89
5	122304	13兴业03	231,730	24,065,160.50	3.10

5.6 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。

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贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

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。

5.11.2 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。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	342,261.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,587,349.93
5	应收申购款	1,085,704.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,015,315.58

5.11.4 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。

5.11.5 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未持有流通受限的股票。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	A/B级	C级
报告期期初基金份额总额	233,689,751.96	402,523,367.13
报告期期间基金总申购份额	166,184,644.04	247,109,161.23
减:报告期期间基金总赎回份额	66,528,618.65	463,665,393.19
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	333,345,777.35	185,967,135.17

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	-
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

根据自2014年8月8日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定,经与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,基金管理人决定自2015年7月21日起将本基金更名为富国医疗保健行业混合型证券投资基金(简称变更为富国医疗保健行业混合),基金类别变更为混合型基金,并相应修改本基金的风险收益特征及部分基金合同部分条款。本次变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响且不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化的情形,无需召开基金份额持有人大会。具体见基金管理人在指定媒介上披露的相关公告。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立富国优化增强债券型证券投资基金的文件

2、富国优化增强债券型证券投资基金基金合同

3、富国优化增强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、富国优化增强债券型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

9.2 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

9.3 查阅方式

投资者对本报告