# 汉兴证券投资基金

## 【2014】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： | 交通银行股份有限公司 |
| 报告送出日期： | 2014年10月27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。
基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年10月23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。
本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 富国汉兴封闭 |
| 基金主代码 | 500015 |
| 交易代码 | 500015 |
| 基金运作方式 | 契约型封闭式 |
| 基金合同生效日 | 1999年12月30日 |
| 报告期末基金份额总额(单位:份) | 3,000,000,000.00 |
| 投资目标 | 本基金为平衡型证券投资基金，兼顾稳定收益和资本利得。即在投资于绩优型上市公司和债券的同时，兼顾成长型上市公司的投资，充分注重投资组合的流动性，从而为投资者减少和分散投资风险，确保基金资产的安全，谋求基金资产的长期稳定收益。 |
| 投资策略 | 坚持长期投资的同时加强波段操作，注重投资组合的长、中、短线相结合，适度投资，分散风险；根据行业研究的成果，在个股投资上注重挖掘个股价值和成长性，精选个股，强调组合的成长和价值的平衡。 |
| 业绩比较基准 | 无 |
| 风险收益特征 | 无 |
| 基金管理人 | 富国基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标

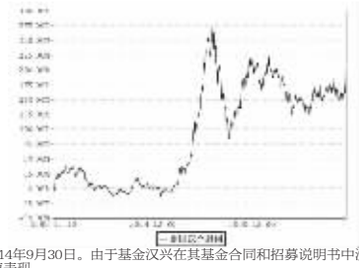
单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2014年07月01日-2014年09月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 58,488,792.83 |
| 2.本期利润 | 309,557,341.81 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1032 |
| 4.期末基金资产净值 | 3,256,622,857.64 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0855 |

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，封闭式基金交易佣金等），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 | 10.49% | 1.65% | - | - | - | - |

注：过去三个月指2014年7月1日－2014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2014年9月30日。由于基金汉兴在其基金合同和招募说明书中没有业绩比较基准，此图只列示基金的净值表现。
本基金于1999年12月30日成立，建仓期6个月，从1999年12月30日至2000年6月29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 | | |
| 戴益强 | 本基金基金经理兼任富国医疗保健行业股票型证券投资基金基金经理 | 2014-01-13 | - | 8年 | 硕士，曾任易方达基金管理有限公司行业研究员；2008年9月至2012年10月任富国基金管理有限公司行业研究员；2012年10月至2014年1月任汉盛证券投资基金基金经理，2013年8月起任富国医疗保健行业股票型证券投资基金基金经理，2014年1月起任汉兴证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。 |

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汉兴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》、《汉兴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。
4.3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1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业绩表现说明
4.4.1报告期内基金的投资策略和运作分析
三季度内，整体宏观经济运行平稳略疲软，主要经济指标显示经济有一定的下行压力。本基金在季度内基本保持了股票较高的仓位，债券仓位基本平稳。从选股策略上，坚持自下而上为主，精选个股的方法，在某些个股上获得了较好的收益。
4.4.2报告期内基金的业绩表现
本报告期，本基金净值增长率为10.49%。

### §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 | 2,319,112,436.26 | 68.90 |
| | 其中：股票 | 2,319,112,436.26 | 68.90 |
| 2 | 固定收益投资 | 635,495,175.00 | 18.88 |
| | 其中：债券 | 635,495,175.00 | 18.88 |
| | 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 | - | - |
| | 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 | 397,935,345.19 | 11.82 |
| 7 | 其他资产 | 13,364,685.07 | 0.40 |
| 8 | 合计 | 3,365,907,641.52 | 100.00 |

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

| 序号 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 664,000.00 | 0.02 |
| B | 采矿业 | 46,436,065.60 | 1.43 |
| C | 制造业 | 1,597,140,790.21 | 49.04 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 65,010,344.12 | 2.00 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 196,983,282.54 | 6.05 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | 42,893,546.60 | 1.32 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 273,432,383.05 | 8.40 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 2,410.00 | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 34,395,974.05 | 1.06 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 4,494.69 | 0.00 |
| 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 | 62,149,145.40 | 1.91 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 2,319,112,436.26 | 71.21 |

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 | 002568 | 百润股份 | 7,263,786 | 295,636,090.20 | 9.08 |
| 2 | 300188 | 美亚柏科 | 5,125,309 | 197,068,131.05 | 6.05 |
| 3 | 601933 | 永辉超市 | 25,029,642 | 196,983,282.54 | 6.05 |
| 4 | 600418 | 江淮汽车 | 14,447,559 | 183,628,474.89 | 5.64 |
| 5 | 300049 | 福瑞股份 | 3,657,531 | 133,865,634.60 | 4.11 |
| 6 | 000952 | 广济药业 | 6,735,504 | 95,442,091.68 | 2.93 |
| 7 | 600479 | 千金药业 | 5,336,426 | 90,932,699.04 | 2.79 |
| 8 | 600519 | 贵州茅台 | 424,134 | 68,764,845.42 | 2.11 |
| 9 | 002013 | 中航机电 | 2,935,933 | 65,030,915.95 | 2.00 |
| 10 | 600979 | 广安爱众 | 9,079,657 | 65,010,344.12 | 2.00 |

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 | 89,748,175.00 | 2.76 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 545,747,000.00 | 16.76 |
| | 其中：政策性金融债 | 545,747,000.00 | 16.76 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 635,495,175.00 | 19.51 |

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 | 140212 | 14国开12 | 700,000 | 70,077,000.00 | 2.15 |
| 2 | 130228 | 13国开28 | 700,000 | 69,538,000.00 | 2.14 |
| 3 | 090417 | 09农发17 | 500,000 | 49,955,000.00 | 1.53 |
| 4 | 140213 | 14国开13 | 500,000 | 49,930,000.00 | 1.53 |
| 5 | 120316 | 12进出16 | 500,000 | 49,720,000.00 | 1.53 |

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：本基金本报告期末投资贵金属。
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基金合同规定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 | 2,008,148.71 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 11,356,536.36 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 13,364,685.07 |

5.11.4报告期未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不存在流通受限情况。
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 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

6.1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 | 10,000,000.00 |
| 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 | 10,000,000.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 0.33 |

6.2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。

### §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汉兴基金的文件
2、汉兴证券投资基金基金合同
3、汉兴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、汉兴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
上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17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
2014年10月27日

# 富国全球债券证券投资基金

## 【2014】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： | 2014年10月27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2014年10月23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。
本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 富国全球债券(QDII-FOF) |
| 基金主代码 | 100050 |
| 交易代码 | 前端交易代码：100050<br>后端交易代码：000163 |
| 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) | 49,221,974.21 |
| 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经理人的投资风险)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：<br>-<br>中文名称：<br>- |
| 境外资产托管人 | 英文名称：<br>Brown Brothers Harriman & Co.<br>中文名称：<br>布朗兄弟哈里曼银行 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标

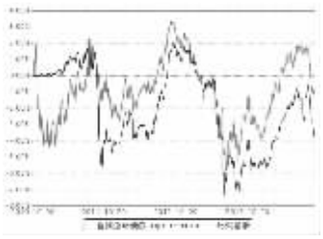
单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2014年07月01日-2014年09月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 395,559.10 |
| 2.本期利润 | -1,381,459.78 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0268 |
| 4.期末基金资产净值 | 47,377,674.61 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.963 |

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 | -2.73% | 0.20% | -3.14% | 0.21% | 0.41% | -0.01% |

注：过去三个月指2014年7月1日－2014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：1.截止日期为2014年9月30日。
2.本基金于2010年10月20日成立，建仓期6个月，从2010年10月20日至2011年4月19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 | | |
| 陈曙亮 | 本基金基金经理 | 2014-04-25 | - | 7年 | 硕士，2008年6月至2012年1月任富国基金管理有限公司助理定量研究员、定量研究员；2012年2月至4月任富国基金管理有限公司年金投资经理；2012年7月至2014年7月任富国天利增长债券投资基金基金经理、富国可转换债券证券投资基金基金经理；2012年12月至2014年7月任富国优化增强债券基金基金经理，2014年4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，中国国籍。 |

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
报告期内，联储的加息时点成为市场各方博弈的焦点，与之相伴的是美国经济的一波三折的复苏与欧洲经济进一步的衰退。期内美国市场的利率债先抑后扬，高收益债表现不佳，欧洲市场基础利率在低位徘徊，亚洲新兴市场基本保持稳定。这给基金的大类资产配置带来一定的挑战。
我们仍然认为美国经济的复苏的确定性较高，利率在未来某个阶段大概率会上行，在此背景下，未来我们会适度调整地区间的配置，减少利率上行对组合的冲击。
4.5.2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-2.73%，同期业绩比较基准收益率为-3.14%。

### §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 | 45,733,040.11 | 96.00 |
| 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 | 1,895,102.26 | 3.98 |
| 8 | 其他资产 | 8,824.00 | 0.02 |
| 9 | 合计 | 47,636,966.37 | 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资产。
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资产。
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资产。
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资产。
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 | RX HIGH INCOME-INS | 开放式 | 普通开放式基金 | FolioMetrix LLC | 9,376,454.91 | 19.79 |
| 2 | PIMCO-HI YIELD BD-$INST INC | 开放式 | 普通开放式基金 | PIMCO Global Advisors Ireland Ltd | 8,134,360.28 | 17.17 |
| 3 | FULLERTON ASIAN BOND-A | 开放式 | 普通开放式基金 | Fullerton Fund Management Co Ltd | 6,808,196.35 | 14.37 |
| 4 | DB X-TR IBX EUR SOV EZ 25+ | 开放式 | ETF基金 | DB Plantinum Advisors | 4,508,559.80 | 9.52 |
| 5 | ADVSHRS PERITUS HIGH YIELD | 开放式 | ETF基金 | AdvisorShares Investments,LLC | 4,011,373.27 | 8.47 |
| 6 | SPDR BARCLAYS HIGH YIELD BD | 开放式 | ETF基金 | State Street Bank and Trust Company | 3,713,055.90 | 7.84 |
| 7 | FIDELITY FNDS-US HIGH YLD-A$ | 开放式 | 普通开放式基金 | FIL Fund Management Ltd | 2,631,269.70 | 5.55 |
| 8 | PIMCO-EURO BD- INS ACC | 开放式 | 普通开放式基金 | PIMCO Global Advisors Ireland Ltd | 2,383,614.20 | 5.03 |
| 9 | SPDR EURO AGGREGATE BOND ETF | 开放式 | ETF基金 | State Street global advisor LTD | 1,975,960.91 | 4.17 |
| 10 | PIMCO GIS-EURO CREDIT-INS AC | 开放式 | 普通开放式基金 | Pimco Global Advisors Ltd | 1,299,838.82 | 2.74 |

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。
本基金本报告期末未持有股票资产。
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 | - |
| 4 | 应收利息 | 85.46 |
| 5 | 应收申购款 | 8,738.54 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 8,824.00 |

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 | 54,231,201.27 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 500,733.74 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 5,509,960.80 |
| 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 | 49,221,974.21 |

### §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购买本基金。

### §8 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，《公开募集证券投资基金运作管理办法》实施后，本基金已连续23个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

### §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
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
2014年10月27日

# 富国中证红利指数增强型证券投资基金

## 【2014】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： | 2014年10月27日 |

### §1 重要提示

富国基金管理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2014年10月23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。
本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 富国中证红利指数增强 |
| 基金主代码 | 100032 |
| 交易代码 | 前端交易代码：100032<br>后端交易代码：100033 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2008年11月20日 |
| 报告期末基金份额总额(单位:份) | 438,360,097.22 |
| 投资目标 | 本基金为股票指数增强型基金，其在遵循"程序化指数投资、有限度个股调整、精细化风险管理"原则的基础上，实现对中证红利指数的有效跟踪并力争实现超越，分享中国经济长期增长所带来的收益。 |
| 投资策略 | 本基金将采用"指数化投资为主、主动性投资为辅"的投资策略，在完全复制目标指数的基础上有限度地调整个股，从而最大限度降低由于交易成本造成的股票投资组合相对于目标指数的偏离，并力求投资收益能够有效跟踪并适度超越目标指数。 |
| 业绩比较基准 | 90%×中证红利指数收益率+10%×一年期银行储蓄存款利率(税后) |
| 风险收益特征 | 本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。 |
| 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 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标

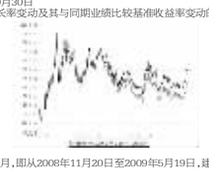
单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2014年07月01日-2014年09月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 12,253,847.62 |
| 2.本期利润 | 79,092,202.77 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1730 |
| 4.期末基金资产净值 | 498,761,561.86 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.138 |

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 | 18.05% | 0.79% | 15.99% | 0.78% | 2.06% | 0.01% |

注：过去三个月指2014年7月1日－2014年9月30日
3.2.2自基金转型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2014年9月30日。
本基金于2008年11月20日成立，建仓期6个月，即从2008年11月20日至2009年5月19日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

### §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 | | |
| 徐幼华 | 本基金基金经理兼任富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理 | 2011-05-13 | - | 10年 | 硕士，曾任上海京华创业投资有限公司投资经理助理，2006年7月至2008年12月任富国基金管理有限公司金融工程部数量研究员，2009年1月至2011年5月任富国基金管理有限公司另类投资部数量研究员，基金经理助理，2011年5月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理，2011年10月起任富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理。具有基金从业资格。 |

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中证红利指数增强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》、《富国中证红利指数增强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，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。
4.3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