富国城镇发展股票型证券投资基金

【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：	中国建设银行股份有限公司
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。
基金托管人中国建设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。

§2 基金产品概况

基金简称	富国城镇发展股票
基金主代码	000471
交易代码	000471
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年01月28日
报告期末基金份额总额(单位:份)	1,175,682,846.89
投资目标	本基金主要投资于城镇发展相关股票，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	本基金采取"自上而下"的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
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

§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	53,732,376.93
2.本期利润	145,929,237.53
3.加权平均基金份额本期利润	0.2542
4.期末基金资产净值	1,605,239,219.60
5.期末基金份额净值	1.365

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	20.80%	0.83%	10.84%	0.72%	9.96%	0.11%

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。
本基金于2014年1月28日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。
本基金建仓期6个月，即从2014年1月28日起至2014年7月27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		
汪鸣	本基金基金经理	2014-01-28	-	8年	硕士，自2007年4月至2014年1月历任富国基金管理有限公司助理行业研究员、行业研究员、高级行业研究员，2014年1月起任富国城镇发展股票型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富国城镇发展股票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》、《富国城镇发展股票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，通过交易系统对组合间同向交易的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等，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
本报告期内公司旗下基金没有发现异常交易行为。
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9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报告期内基金投资策略和业绩表现说明
4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析
2014年三季度，宏观经济继续落，需求不振；市场资金成本在央行多种创新工具推动下维持低位，A股市场出现大幅上涨。
本基金三季度加强选股，"自下而上"寻找并重点投资能够在经济弱周期中保持业绩较快增长的公司。行业配置方面，重点超配传媒、房地产，其他行业较均衡。
本基金未来仍将重点精选竞争力强、可中长期投资的公司，并积极研究经济转型方向，在控制风险的基础上，不断优化组合。
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20.80%，同期业绩比较基准收益率10.84%。

§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	1,411,285,673.34	84.07
	其中:股票	1,411,285,673.34	84.07
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	175,162,054.30	10.43
7	其他资产	92,353,907.81	5.50
8	合计	1,678,801,635.45	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	13,280,000.00	0.83
B	采矿业	2,664,000.00	0.17
C	制造业	668,055,234.98	41.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	32,936,622.92	2.05
E	建筑业	63,369,998.77	3.95
F	批发和零售业	52,216,312.80	3.25
G	交通运输、仓储和邮政业	32,880,953.52	2.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	178,240,121.32	11.10
J	金融业	58,966,660.77	3.67
K	房地产业	167,899,663.96	10.46
L	租赁和商务服务业	133,888,104.30	8.34
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	6,888,000.00	0.43
	合计	1,411,285,673.34	87.92

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	300058	蓝色光标	5,555,523	133,888,104.30	8.34
2	000671	阳 光 城	9,999,972	125,999,647.20	7.85
3	300257	开山股份	2,222,225	81,866,769.00	5.10
4	002318	久立特材	2,854,394	70,817,515.14	4.41
5	002421	达实智能	1,996,297	63,282,614.90	3.94
6	000748	长城信息	2,150,000	63,210,000.00	3.94
7	000712	锦龙股份	3,333,333	58,966,660.77	3.67
8	600309	万华化学	3,001,027	51,947,777.37	3.24
9	300285	国瓷材料	1,268,899	50,946,294.85	3.17
10	300203	聚光科技	2,550,079	47,507,971.77	2.96

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合
注：本基金本报告期末未持有债券资产。
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
注：本基金本报告期末未持有债券资产。
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
本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。
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	537,698.59
2	应收证券清算款	58,032,171.41
3	应收股利	-
4	应收利息	46,547.50
5	应收申购款	33,737,490.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	92,353,907.81

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 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	122,939,236.76
报告期期间基金总申购份额	1,809,266,365.63
减：报告期期间基金总赎回份额	756,522,755.50
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	1,175,682,846.89

§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 备查文件目录

8.1备查文件目录
1、中国证监会批准设立富国城镇发展股票型证券投资基金的文件
2、富国城镇发展股票型证券投资基金基金合同
3、富国城镇发展股票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、富国城镇发展股票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
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

富国创业板指数分级证券投资基金

【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：	中国建设银行股份有限公司
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。
基金托管人中国建设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	富国创业板指数分级	
场内简称	富国创业	
基金主代码	161022	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年09月12日	
报告期末基金份额总额	1,090,413,023.44	
投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪创业板指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。	
投资策略	本基金主要采用完全复制法进行投资，依托富国量化投资平台，利用长期稳定的风险模型和交易成本模型，按照成份股在创业板指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪创业板指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。	
业绩比较基准	95%×创业板指数收益率 +5%×银行人民币活期存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。	
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	
下属三级基金的基金简称	创业板A	创业板B	富国创业板指数分级(场内简称:富国创业)
下属三级基金的交易代码	150152	150153	161022
报告期末下属三级基金的份额总额(单位:份)	476,487,206.00	476,487,207.00	137,438,610.44
下属三级基金的风险收益特征	富国创业板A份额具有低风险、收益相对稳定的特征。	富国创业板B份额具有高风险、高预期收益的特征。	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。

§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	77,448,207.65
2.本期利润	170,714,799.29
3.加权平均基金份额本期利润	0.1293
4.期末基金资产净值	1,192,887,319.47
5.期末基金份额净值	1.094

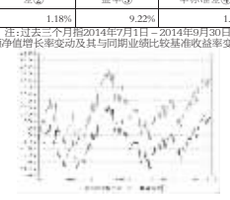
注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	8.21%	1.18%	9.22%	1.18%	-1.01%	0.00%

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2013年9月12日成立，建仓期6个月，从2013年9月12日至2014年3月11日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。
3.3其他指标

其他指标	报告期末(2014年09月30日)
创业板A与创业板B基金份额配比	1:1
期末创业板A份额参考净值	1.048
期末创业板A份额累计参考净值	1.067
期末创业板B份额参考净值	1.140
期末创业板B份额累计参考净值	1.140
2014年富国创业板A的预计年收益率	6.5%

§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		
王保合	兼任量化投资副总监、上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金经理、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、富国中证军工指数分级证券投资基金基金经理	2013-09-12	-	9年	博士，曾任富国基金管理有限公司研究员；富国沪深300增强证券投资基金基金经理助理；2011年3月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2013年9月起任富国创业板指数分级证券投资基金基金经理，2014年4月起任富国中证军工指数分级证券投资基金基金经理；兼任量化投资副总监；具有基金从业资格。
章根元	本基金基金经理兼任富国中证军工指数分级证券投资基金基金经理、富国中证移动互联网指数分级证券投资基金基金经理	2013-12-05	-	7年	硕士，自2008年7月至2011年5月在建信基金管理有限责任公司任研究员助理、初级研究员、研究员；自2011年5月至2013年12月在富国基金管理有限公司任基金经理助理，自2013年12月起任富国创业板指数分级证券投资基金基金经理，2014年4月起任富国中证军工指数分级证券投资基金基金经理，2014年9月起任富国中证移动互联网指数分级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富国创业板指数分级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》、《富国创业板指数分级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，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。
4.4报告期内基金投资策略和业绩表现说明
4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析
2014年三季度，宏观经济继续复苏出现疲折，CPI依旧低位运行，市场处于宽货币、紧信用格局，央行在公开市场引导资金利率下行，有利的市场环境促使债券收益率明显下行。基金管理人严格按照基金合同进行投资管理，在三季度，基于收益率曲线季度平坦化，积极缩短久期，同时保持仓位在一定水平，获取了相应的回报。
4.4.2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A/B级2.51%、C级2.43%；同期业绩比较基准收益率A/B级1.65%、C级1.65%。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	729,094,797.61	92.36
	其中:债券	729,094,797.61	92.36
	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	34,000,000.00	4.31
	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	6,639,398.45	0.84
7	其他资产	19,711,935.37	2.50
8	合计	789,446,131.43	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合
注：本基金本报告期末未持有股票资产。
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
注：本基金本报告期末未持有股票资产。
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	8,098,700.00	1.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	35,053,000.00	4.82
	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	170,645,000.00	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	729,094,797.61	100.30

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	122675	12杭城投	502,290	50,897,045.70	7.00
2	041451010	14新物产CP001	500,000	50,405,000.00	6.93
3	122778	11建发债	379,950	40,844,625.00	5.62
4	122225	12一拖01	358,670	35,651,798.00	4.90
5	122886	10云投债	340,070	34,007,000.00	4.68

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	596,834.91
2	应收证券清算款	21,127,949.17
3	应收股利	-
4	应收利息	23,481.34
5	应收申购款	127,948.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,876,213.85

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
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

报告期期初基金份额总额	403,460,720.00
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-146,052,972.00
报告期期末基金份额总额	137,438,610.44

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额和定期折算调整的份额。

§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 备查文件目录

8.1备查文件目录
1、中国证监会批准设立富国创业板指数分级证券投资基金的文件
2、富国创业板指数分级证券投资基金基金合同
3、富国创业板指数分级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、富国创业板指数分级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
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

富国纯债债券型发起式证券投资基金

【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	富国纯债债券发起	
基金主代码	100066	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年11月22日	
报告期末基金份额总额	689,311,456.19	
投资目标	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，力争为持有人提供较高的当期收益以及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类属资产进行最优化配置和调整。	
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，其短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	
下属两级基金的基金简称	富国纯债债券发起A/B	富国纯债债券发起C
下属两级基金的交易代码	100066	100068
报告期末下属两级基金的份额总额(单位:份)	233,278,151.50	456,033,304.69

§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(2014年07月01日-2014年09月30日)	C级 报告期(2014年07月01日-2014年09月30日)
1.本期已实现收益	4,183,121.57	5,436,006.02
2.本期利润	6,003,903.46	8,156,724.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.0259	0.0230
4.期末基金资产净值	247,281,983.58	479,654,427.89
5.期末基金份额净值	1.060	1.052

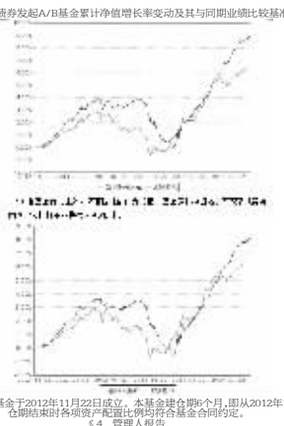
注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	2.51%	0.06%	1.65%	0.07%	0.86%	-0.01%

（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	2.43%	0.06%	1.65%	0.07%	0.78%	-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