富国收益宝货币市场基金

【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。

本报告中财务资料未经审计。

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	富国收益宝货币
基金主代码	000602
交易代码	000602
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年05月26日
报告期末基金份额总额（单位：份）	21,258,017.31
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
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120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，提高基金收益。 在投资管理过程中，基金管理人将基于“定性与定量相结合、保守与积极相结合”的原则，根据短期利率的变动和市场格局的变化，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为当期银行个人活期存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
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 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	115,793.84
2.本期利润	115,793.84
3.期末基金资产净值	21,258,017.31

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

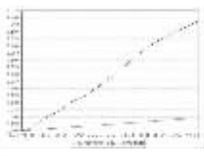
3.2.1本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.5451%	0.0006%	0.0894%	0.0000%	0.4557%	0.0006%

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

自基金合同生效以来富国收益宝货币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：1.截止日期为2015年9月30日。

2.本基金于2014年05月26日成立；建仓期6个月，即从2014年05月26日至2014年11月25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		
王颖亮	本基金基金经理兼任富国富钱包货币市场基金基金经理、富国天时货币市场基金基金经理、富国收益宝货币市场基金基金经理、富国恒利分级债券型证券投资基金基金经理、富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金基金经理	2014-08-26	-	5年	硕士，曾任上海国利货币经纪有限公司经纪人，自2010年9月至2013年7月在富国基金管理有限公司任交易员；2013年7月至2014年8月在富国基金管理有限公司任高级交易员兼研究助理；2014年8月至2015年2月任富国7天理财宝债券型证券投资基金基金经理，2014年8月起任富国收益宝货币市场基金基金经理，2015年4月起任富国恒利分级债券型证券投资基金、富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金、富国富钱包货币市场基金基金、富国天时货币市场基金基金经理。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收益宝货币市场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》、《富国收益宝货币市场基金基金合同》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2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，在去杠杆、汇改等因素影响下，市场下跌28.39%。同期天博净值下跌27.37%，组合抗跌性差，仓位高是主要原因。

应该说这是我们第一次经历证券市场如此快速的去杠杆，而短期中国宏观基本面趋弱，外部环境受美元加息预期影响也不给力，市场的恐慌情绪不断加剧。在不到3个月时间内沪深300指数从高点到低点下跌幅度达45%，远超预期。同期基金净值损失惨重，教训深刻。

展望四季度，虽然我们并不清楚市场寻底的过程会如何演绎，但我们认为市场已过度恐慌，左侧机会明显。国家积极的财政政策和货币政策依旧存在，经济转型势在必行，我们将继续积极关注代表中国经济转型方向的行业，如智能制造、生物医药、基因、大数据、新能源汽车、旅游等，力争为投资者带来更好的收益。

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-27.37%，同期业绩比较基准收益率为-22.61%。

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	1,852,105,152.08	93.41
	其中：股票	1,852,105,152.08	93.41
2	固定收益投资	100,170,000.00	5.05
	其中：债券	100,170,000.00	5.05
	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	19,437,303.34	0.98
7	其他资产	10,989,181.90	0.55
8	合计	1,982,701,637.32	100.00

5.2报告期债券回购融资情况

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	-	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：本报告期末不存在债券正回购。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注：本报告期内本基金不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

5.3基金投资组合平均剩余期限

5.3.1投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	37
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	72
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	9

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注：本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.2报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	8.82	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	90.32	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天（含）	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.14	-

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	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	-	-
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.5报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

序号	偏离情况	
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数		
报告期内偏离度的最高值		
报告期内偏离度的最低值		
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值		

注：以上数据按工作日统计

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，基金份额账面净值始终保持为人民币1.00元。

本基金估值采用摊余成本法，即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，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益或损失。

5.8.2本报告期内货币市场基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的声明

本报告期内本基金不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

5.8.3声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内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	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	22,545.28
4	应收申购款	220,000.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	242,545.28

5.8.5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	20,805,286.32
报告期期间基金总申购份额	35,743,081.64
减：报告期期间基金总赎回份额	35,290,350.65
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	21,258,017.31

注：红利再投资和基金转换转入作为本期申购资金的来源，统一计入本期总申购份额，基金转换转出作为本期赎回资金的来源，统一计入本期总赎回份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

单位：份

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	红利再投资	-	112,773.29	112,773.29	-
合计			112,773.29	112,773.29	

注：由于本基金“每日分配、按日支付”，故红利再投金额为2015年7月1日至2015年9月30日期间每日红利再投金额总和，且无相应申购费用。

§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收益宝货币市场基金的文件

2、富国收益宝货币市场基金基金合同

3、富国收益宝货币市场基金托管协议

4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件

5、富国收益宝货币市场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

2015年10月26日

富国收益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	富国收益增强债券
基金主代码	000810
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年10月28日
报告期末基金份额总额	615,665,691.89
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	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。本基金在债券投资过程中突出主动性的投资管理，在对宏观经济以及债券市场中长期发展趋势进行客观判断的基础上，通过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公司债券、可分离交易可转债、中小企业私募债券、可交换债券等债券品种，加以对国家债券、金融债券、中央银行票据以及回购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，积极把握固定收益证券市场中投资机会，获取各类债券的超额投资收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率（税后）+0.5%
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
下属分级基金的基金简称	富国收益增强债券A级 / 富国收益增强债券C级
下属分级基金的交易代码	前端：000810；后端：000811；000812
报告期末下属分级基金的份额总额（单位：份）	496,155,463.01 / 119,510,228.88

§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	-3,589,691.97	-1,282,541.19
2.本期利润	-2,039,355.89	-1,032,251.86
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0042	-0.0089
4.期末基金资产净值	588,373,823.53	141,195,634.08
5.期末基金份额净值	1.186	1.181

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	-0.34%	0.19%	0.61%	0.01%	-0.95%	0.18%

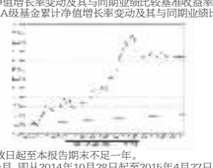
（2）C级

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	-0.51%	0.19%	0.61%	0.01%	-1.12%	0.18%

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

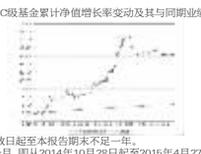
（1）自基金合同生效以来富国收益增强债券A级基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1.截止日期为2015年9月30日，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

2.本基金于2014年10月28日成立，建仓期6个月，即从2014年10月28日起至2015年4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。

（2）自基金合同生效以来富国收益增强债券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：1.截止日期为2015年9月30日，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

2.本基金于2014年10月28日成立，建仓期6个月，即从2014年10月28日起至2015年4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		
郑迎迎	本基金基金经理兼任富国可转换债券证券投资基金、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金、富国新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2015-04-20	-	7年	硕士，曾任农银汇理基金管理有限公司行业研究员；2011年8月至2012年10月任富国基金管理有限公司债券研究员，2012年10月至2015年2月任富国7天理财宝债券型证券投资基金基金经理，2013年1月至2015年4月任富国强回报定期开放债券型证券投资基金基金经理，2014年3月起任富国可转换债券证券投资基金基金经理，2015年4月起任富国新天锋定期开放债券型证券投资基金、富国收益增强债券型证券投资基金，2015年8月起任富国新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。
邹振松	本基金基金经理兼任富国新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2015-05-18	-	9年	硕士，曾任长江证券研究部高级分析师；自2009年9月至2014年8月任富国基金管理有限公司行业研究员、高级行业研究员；自2014年8月至今任富国基金管理有限公司权益研究部副总经理；自2015年5月起任富国收益增强债券型证券投资基金基金经理；自2015年8月起任富国新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。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天博创新主题混合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》、《富国收益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。

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

三季度的股熊债牛行情基本符合我们前期的判断，在策略上一直保持了高杠杆，随着对长期国债的看好，久期也渐渐拉长，但是在股票策略上略有失误，低估了汇改对股市估值的负面影响，股票仓位上的负收益削弱了债券牛市对基金净值的增厚。展望四季度，我们认为债市进入慢牛行情，股市的波段机会在加大，相比三季度，我们会更加重视股票仓位的交易；同时增加债券仓位的银行间券种比例，保持交易的灵活性，并降低交易所债的配置比例。

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级-0.34%、C级0.61%；同期业绩比较基准收益率A级-0.51%、C级0.61%。

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	11,558,626.00	1.19
	其中：股票	11,558,626.00	1.19
2	固定收益投资	928,279,244.94	95.78
	其中：债券	928,279,244.94	95.78
	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	14,356,090.14	1.48
7	其他资产	14,964,024.21	1.54
8	合计	969,147,985.29	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	11,558,626.00	1.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	-	-
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	-	-
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	11,558,626.00	1.58

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	600066	宇通客车	386,900	7,273,720.00	1.00
2	000596	古井贡酒	79,700	2,178,201.00	0.30
3	000333	美的集团	83,500	2,106,705.00	0.29

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	20,016,000.00	2.74
2	央行票据	-	-
3	金融债券	62,312,500.00	8.54
	其中：政策性金融债	60,328,000.00	8.27
4	企业债券	534,610,182.94	73.28
5	企业短期融资券	210,495,000.00	28.85
6	中期票据	92,730,000.00	12.71
7	可转债	8,115,562.00	1.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	928,279,244.94	127.24

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	122453	15联发01	700,000	70,000,000.00	9.59
2	101553006	15铁道MTN001	600,000	62,634,000.00	8.59
3	011599428	15首发SCP001	500,000	50,085,000.00	6.87
4	011516003	15华电股SCP003	500,000	50,065,000.00	6.86
5	011547002	15华润SCP002	500,000	50,025,000.00	6.86

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持有股指期货。

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	255,677.29
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,602,692.17
5	应收申购款	95,654.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,954,024.21

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

项目	A级	C级
报告期期初基金份额总额	396,870,816.41	142,332,858.31
报告期期间基金总申购份额	203,710,292.14	49,886,957.78
减：报告期期间基金总赎回份额	104,425,645.54	72,709,587.21
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	496,155,463.01	119,510,228.88

§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收益增强债券型证券投资基金的文件

2、富国收益增强债券型证券投资基金基金合同

3、富国收益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、富国收益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

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

2015年10月26日

富国天博创新主题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	富国天博创新混合
基金主代码	519035
交易代码	前端交易代码：519035 后端交易代码：519036
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年04月27日
报告期末基金份额总额（单位：份）	1,663,764,978.74
投资目标	本基金主要投资于具有良好成长性的