

(上接B113版)

注册地址: 湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
办公地址: 湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法人代表: 雷杰
联系电话: (010) 57390062
传真电话: (010) 57390058
联系人: 徐锦福
客服电话: 96571
公司网站: www.foundersc.com
(40) 长城证券股份有限公司
注册地址: 深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16、17层
办公地址: 深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法人代表: 黄耀华
联系电话: (0755) 83516289
传真电话: (0755) 83515567
联系人: 刘阳
客服电话: (0755) 33690000 (深圳)、400-6666-888 (非深圳)
公司网站: www.cgws.com
(41) 光大证券股份有限公司
注册地址: 上海市静安区新闻路1508号
办公地址: 上海市静安区新闻路1508号
法人代表: 薛峰
联系电话: 021-22169999
传真电话: 021-22169134
联系人: 刘晨、李芳芳
客服电话: 95525
公司网站: www.ebscn.com

(42) 东北证券股份有限公司
注册地址: 长春市自由大路1138号
办公地址: 长春市自由大路1138号
法人代表: 杨树林
联系电话: 0431-85096517
传真电话: 0431-85096517
联系人: 安岩岩
客服电话: 400-600-0686
公司网站: www.nesc.com.cn
(43) 上海证券有限责任公司
注册地址: 上海市黄浦区西藏中路336号
办公地址: 上海市黄浦区西藏中路336号
法人代表: 龚德雄
联系电话: (021) 53519888
传真电话: (021) 53519888
联系人: 张瑞
客服电话: (021) 962518
公司网站: www.962518.com

(44) 光大证券股份有限公司
注册地址: 上海市静安区新闻路1508号
办公地址: 上海市静安区新闻路1508号
法人代表: 薛峰
联系电话: 021-22169999
传真电话: 021-22169134
联系人: 刘晨、李芳芳
客服电话: 95525
公司网站: www.ebscn.com
(45) 平安证券有限责任公司
注册地址: 深圳市福田区金田路4188号平安大厦16楼
办公地址: 深圳市福田区金田路4188号平安大厦16楼
法人代表: 杨宇翔
联系电话: 0755-82080798
传真电话: 0755-82080798
联系人: 杨薇
客服电话: 4006-788-887
公司网站: 众禄基金网 www.zlfund.cn 基金买卖网 www.jmmw.com

(46) 上海天天基金销售有限公司
注册地址: 上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址: 上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
法人代表: 其实
联系电话: 021-54509998
传真电话: 021-64385008
联系人: 潘世华
客服电话: 400-1818-188
公司网站: www.1234567.com.cn
(47) 上海好买基金销售有限公司
注册地址: 上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址: 上海市浦东新区南汇新城镇1118号鄂尔多斯大厦903-906室
法人代表: 杨文斌
联系电话: (021) 58870011
传真电话: (021) 68596916
联系人: 张迪
客服电话: 4007009665
公司网站: www.ehowbuy.com
(48) 杭州数米基金销售有限公司
注册地址: 杭州市余杭区仓前街216号1幢202室
办公地址: 杭州市余杭区仓前街216号1幢202室
法人代表: 陈柏青
联系电话: 021-60897840
传真电话: 021-60897013
联系人: 张裕
客服电话: 4000766123
公司网站: www.fund123.com
(49) 上海长量基金销售有限公司
注册地址: 上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址: 上海市浦东新区浦东南路556号裕景国际B座16层
法人代表: 张跃伟
联系电话: 021-58789678
传真电话: 021-58787698
联系人: 沈雯雯
客服电话: 400-089-1289
公司网站: www.erichfund.com
(50) 浙江同顺基金销售有限公司
注册地址: 杭州市文二西路1号903室
办公地址: 浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼
法人代表: 凌顺平
联系电话: 0571-88911818
传真电话: 0571-88900423
联系人: 吴强
客服电话: 4008-773-772
公司网站: www.5ifund.com
(51) 北京展恒基金销售有限公司
注册地址: 北京市朝阳区后厂村路68号401室
办公地址: 北京市朝阳区德胜门内大街19号2号楼2层
法人代表: 邵文彬
联系电话: (010) 62020088
传真电话: (010) 62020088
联系人: 宋丽禹
客服电话: 4008886661
公司网站: www.mylfund.com
(52) 上海中融基金销售有限公司
注册地址: 上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元
法人代表: 赵学军
联系电话: 021-20289890
传真电话: 021-20289110
联系人: 张倩
客服电话: 400-021-8850
公司网站: www.harvestwm.cn
(53) 北京创金富信投资管理有限公司
注册地址: 北京市西城区民丰胡同31号5号楼2215A
办公地址: 北京市西城区民丰胡同31号5号楼2215A
法人代表: 梁蓉
联系电话: (010) 66154828
传真电话: (010) 89067526
联系人: 张旭
客服电话: 400-6262-818
公司网站: www.51rich.com
(74) 宜信普泽投资顾问(北京)有限公司
注册地址: 北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址: 北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
法人代表: 沈伟彬
联系电话: 010-52657312
传真电话: 010-58994285
联系人: 程刚
客服电话: 400-609-9200
公司网站: www.yixinfund.com
(75) 北京君德财富投资管理有限公司
注册地址: 北京市东城区建国门内大街18号15层办公楼一座1502

第18层-21层及第04层01、02、03、05、11
办公地址: 深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法人代表: 高海
联系电话: (0755) 82023442
传真电话: (0755) 82026539
联系人: 刘毅
客服电话: 95532、400-600-8008
公司网站: www.china-invs.cn
(58) 上海证券有限责任公司
注册地址: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路66号
办公地址: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路66号
法人代表: 孙名扬
联系电话: 0451-58863719
传真电话: 0451-82287211
联系人: 刘爽
客服电话: 400-666-2288
公司网站: www.jhzq.com.cn

(59) 华宝证券有限责任公司
注册地址: 上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层
法人代表: 陈林
联系电话: 021-68777222
传真电话: 021-68777822
联系人: 刘闻川
客服电话: 4008209898
公司网站: www.cnhbstock.com
(60) 大通证券股份有限公司
注册地址: 大连市中山区人民路24号
办公地址: 大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦39层
法人代表: 张智河
联系电话: 0411-39673202
传真电话: 0411-39673219
联系人: 谢立军
客服电话: 4008-169-169
公司网站: www.datong.com.cn
(61) 江苏金百临投资咨询有限公司
注册地址: 无锡市太湖新城锦溪溪泾路9号9楼
办公地址: 无锡市太湖新城锦溪溪泾路9号9楼
法人代表: 费晓燕
联系电话: 0510-82758877
传真电话: 0510-88565898
联系人: 袁丽萍
客服电话: 0510-9688988
公司网站: www.jsjhl.com
(62) 和讯信息科技有限公司
注册地址: 北京市朝阳区东大街22号泛利大厦10层
办公地址: 上海市浦东新区东方路18号保利大厦18楼
法人代表: 王莉
联系电话: 400-920-0022
传真电话: 021-20835879
联系人: 于畅
客服电话: 400-920-0022
公司网站: licaike.hexun.com

(63) 诺亚正行(上海)基金销售有限公司
注册地址: 上海市金山区廊下镇漕康公路7650号205室
办公地址: 上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼
法人代表: 汪静波
联系电话: 021-3860-0672
传真电话: 021-3860-2300
联系人: 张姚杰
客服电话: 400-821-5399
公司网站: www.noah-fund.com
(64) 深圳众禄基金控股股份有限公司
注册地址: 深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼1J单元
办公地址: 深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼1J单元
法人代表: 薛峰
联系电话: 0755-33227950
传真电话: 0755-82080798
联系人: 汤素娅
客服电话: 4006-788-887
公司网站: 众禄基金网 www.zlfund.cn 基金买卖网 www.jmmw.com

(65) 上海天天基金销售有限公司
注册地址: 上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址: 上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
法人代表: 其实
联系电话: 021-54509998
传真电话: 021-64385008
联系人: 潘世华
客服电话: 400-1818-188
公司网站: www.1234567.com.cn
(47) 上海好买基金销售有限公司
注册地址: 上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址: 上海市浦东新区南汇新城镇1118号鄂尔多斯大厦903-906室
法人代表: 杨文斌
联系电话: (021) 58870011
传真电话: (021) 68596916
联系人: 张迪
客服电话: 4007009665
公司网站: www.ehowbuy.com
(48) 杭州数米基金销售有限公司
注册地址: 杭州市余杭区仓前街216号1幢202室
办公地址: 杭州市余杭区仓前街216号1幢202室
法人代表: 陈柏青
联系电话: 021-60897840
传真电话: 021-60897013
联系人: 张裕
客服电话: 4000766123
公司网站: www.fund123.com
(49) 上海长量基金销售有限公司
注册地址: 上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址: 上海市浦东新区浦东南路556号裕景国际B座16层
法人代表: 张跃伟
联系电话: 021-58789678
传真电话: 021-58787698
联系人: 沈雯雯
客服电话: 400-089-1289
公司网站: www.erichfund.com
(50) 浙江同顺基金销售有限公司
注册地址: 杭州市文二西路1号903室
办公地址: 浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼
法人代表: 凌顺平
联系电话: 0571-88911818
传真电话: 0571-88900423
联系人: 吴强
客服电话: 4008-773-772
公司网站: www.5ifund.com
(51) 北京展恒基金销售有限公司
注册地址: 北京市朝阳区后厂村路68号401室
办公地址: 北京市朝阳区德胜门内大街19号2号楼2层
法人代表: 邵文彬
联系电话: (010) 62020088
传真电话: (010) 62020088
联系人: 宋丽禹
客服电话: 4008886661
公司网站: www.mylfund.com
(52) 上海中融基金销售有限公司
注册地址: 上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元
法人代表: 赵学军
联系电话: 021-20289890
传真电话: 021-20289110
联系人: 张倩
客服电话: 400-021-8850
公司网站: www.harvestwm.cn
(53) 北京创金富信投资管理有限公司
注册地址: 北京市西城区民丰胡同31号5号楼2215A
办公地址: 北京市西城区民丰胡同31号5号楼2215A
法人代表: 梁蓉
联系电话: (010) 66154828
传真电话: (010) 89067526
联系人: 张旭
客服电话: 400-6262-818
公司网站: www.51rich.com
(74) 宜信普泽投资顾问(北京)有限公司
注册地址: 北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址: 北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
法人代表: 沈伟彬
联系电话: 010-52657312
传真电话: 010-58994285
联系人: 程刚
客服电话: 400-609-9200
公司网站: www.yixinfund.com
(75) 北京君德财富投资管理有限公司
注册地址: 北京市东城区建国门内大街18号15层办公楼一座1502

室
办公地址: 北京市东城区建国门内大街18号恒基中心办公楼一座2202室
法人代表: 李振
联系电话: 010-65181028
传真电话: 010-65174782/65231189
联系人: 魏尧
客服电话: 400-066-9355
公司网站: www.kstrea.com.cn
(76) 上海联泰资产管理有限公司
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址: 上海市长宁区福泉北路518号8座3楼
法人代表: 燕斌
联系电话: 021-52822063
传真电话: 021-52875270
联系人: 凌秋艳
客服电话: 400-046-6788
公司网站: www.66zichan.com
(77) 上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址: 上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
办公地址: 上海市黄浦区延安路1号凯石大厦4楼
法人代表: 陈继武
联系电话: 021-63333333
传真电话: 021-63332523
联系人: 李晓明
客服电话: 4000-178-000
公司网站: www.lingxianfund.com
(78) 上海陆金所资产管理有限公司
注册地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法人代表: 郭坚
联系电话: 021-20666562
传真电话: 021-22066563
联系人: 宁博宇
客服电话: 4008219031
公司网站: www.lufunds.com
(79) 珠海盈米财富管理有限公司
注册地址: 珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址: 广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
法人代表: 肖雯
联系电话: 020-89629099
传真电话: 020-89629011
联系人: 吴煜浩
客服电话: 020-89629066
公司网站: www.yingmi.com.cn

基金管理人可根据有关法律法规的要求, 选择其他符合要求的机构代理销售本基金, 并及时公告。
(二) 基金注册登记机构
名称: 富国基金管理有限公司
注册地址: 上海市浦东新区世纪大道8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8号上海国金中心二期16-17层
总经理: 陈戈
成立日期: 1999年4月13日
电话: (021) 20361818
传真: (021) 20361616
联系人: 雷青松
(三) 律师事务所和经办律师(基金募集时)
名称: 上海源泰律师事务所
注册地址: 上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼
办公地址: 上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼
负责人: 廖海
经办律师: 梁丽金、刘佳
电话: (021) 51150298
传真: (021) 51150398
(四) 会计师事务所和经办注册会计师
名称: 安永华明会计师事务所
注册地址: 北京市东城区东长安街1号东方广场东塔楼安永大16层1601室
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: 徐艳
经办注册会计师: 徐艳、蒋燕华

四、基金的名称
富国产业债债券型证券投资基金
五、基金的类型
债券型
六、基金的投资目标
本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上, 力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。
七、基金的投资方向
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行的国债、金融债、次级债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券、可分离债券等金融工具以及法律法规或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)。
本基金也可投资于非固定收益类金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产, 也不参与一级市场的新股申购或增发新股, 仅可持有因可转债、可交换债转股所形成的股票, 因所持股票所派发的权证以及因投资可转债而产生的权证, 以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非固定收益类品种(但须符合中国证监会的相关规定)。因上述原因持有股票和权证资产, 本基金应在其可交易之日起30个交易日卖出。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种, 基金管理人可在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略
1、资产配置策略
本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内类属资产进行优化配置和调整。
(1) 整体资产配置策略
通过对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、风险预算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、附加选择权价值、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, 根据个别债券的收益率与剩余期限的配比, 对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对宏观经济的动态跟踪, 采用久期控制下的主动性投资策略。主要包括: 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价格的变化进行预测, 相机而动、积极调整。
(1) 久期控制是根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合的整体久期, 有效的控制整体资产风险。
(2) 期限结构配置是在确定组合久期后, 针对收益率曲线形状特征确定合理的组合期限结构, 包括采用集中策略、两端策略和梯次策略等, 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、现金流状况、信用评级进行评价, 以此作为品种选择的基本依据。信用产品投资是本基金的重要特点之一。
本基金所指的结构化产品为信用产品, 包括公司债、企业债(不含城投债)、中期票据、短期融资券和可分离债。
本基金认为, 信用债市场运行的中枢既取决于利率变动, 也取决于发行人的整体信用状况。监管层的相关政策指导、信用评级机构的投资理念及其行为等变化决定了信用债收益率的变动区间, 整个市场资金面的松紧程度以及信用债的供求情况等左右市场的短期波动。
基金管理人将自上而下通过对宏观经济形势、基准利率走势、资金面状况、行业以及个股信用状况的研判, 积极主动发掘收益充分覆盖风险, 甚至在覆盖之余还存有超额收益的投资品种; 同时通过行业及个券信用等级限定、久期控制等方式有效控制投资信用风险、利率风险以及流动性风险, 以求得投资组合盈利性、安全性的中长期有效结合。
同一信用产品在不同市场状态下往往会有不同的表现, 针对不同的表现, 管理人将采取不同的操作方式: 如果信用债一二级市场利率高于管理人判断的正常区间, 管理人将在该信用债上市时就寻找适当的时机卖出实现利润; 如果一二级市场利率处于基金管理人判断的正常区间, 基金管理人将持券一段时间后再行卖出, 获取该段时间里的债券收益和持有期间的票息收益; 本基金信用债投资在操作上主要以博取利率和票息收益为主, 这种以时间换空间的操作方式决定了本基金管理人在具体操作上必须在获取收益和防范信用风险之间取得平衡。
(4) 跨市场套利根据不同债券市场的运行规律和风险特性, 构建和调整债券投资组合, 提高投资收益, 实现跨市场套利。
(5) 相对价值判断是根据对同类债券的相对价值判断, 选择合适的交易时机, 增持相对低估、价格将上升的债券, 减持相对高估、价格将下降的债券。
3、可转换债券投资策略
可转换公司债券不同于一般的企(公)司债券, 其投资人具有在一定条件下转股和回售的权利, 因此其理论价值应当等于作为普通债券的基础价值加上可转换公司债券内含期权价值, 是一种既具有债性, 又具有股性的混合债券产品。
本基金可参与一级市场可转换债券的申购。在二级市场上, 本基金将关注投资价值较强的可转换品种, 回避股性较强的可转换品种, 且仅投资于到期收益率或回售收益率高于2%的可转换品种。
4、回购套利策略
回购套利策略是本基金重要的操作策略之一, 把信用产品投资和回购套利结合起来, 基金管理人根据信用产品的特征, 在信用风险和流动性风险可控的前提下, 或者通过回购融资来赚取超额收益, 或者通过

购的不断滚动来赚取信用债收益率和资金成本的利差。
5、投资决策与交易机制
本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。
投资决策委员会负责确定本基金的大类资产配置比例、组合基准久期、回购的最高比例等重大投资决策。
基金经理在投资决策委员会确定的投资范围内制定并实施具体的投资策略, 向集中交易室下达投资指令。
集中交易室设立债券交易员, 负责执行投资指令, 就指令执行过程中的问题及市场面的变化对指令执行的影响等问题及时向基金经理反馈, 并可提出基于市场面的具体建议。集中交易室同时负责各项投资限制的监控以及本基金资产与公司旗下其他基金之间的公平交易控制。
6、投资程序
投资决策委员会负责决定基金投资的重大决策。基金经理在授权范围内, 制定具体的投资组合方案并执行。集中交易室负责执行投资指令。
(1) 基金经理根据市场的趋势、运行的格局和特点, 并结合本基金合同、投资风格拟定投资策略报告。
(2) 投资策略报告提交给投资决策委员会。投资决策委员会审批决定基金的投资比例、大类资产分布比例、组合基准久期、回购比例等重要事项。
(3) 基金经理根据批准后的投资策略确定最终的资产分布比例、组合基准久期和个券投资策略分布方式等。
(4) 对已投资品种进行跟踪, 对投资组合进行动态调整。

九、基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为中央国债登记结算有限责任公司编制并发布的中债综合指数。
十、基金的风险收益特征
本基金为债券型主题基金, 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型基金, 低于混合型基金和股票型基金。
十一、基金的投资组合报告
1、报告期末基金资产组合情况

资产中投资于中国国债、

十、基金的风险收益特征

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。

十一、基金的投资组合报告

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	2,613,078,667.41	97.02
	其中:债券	2,507,671,314.96	93.11
	资产支持证券	105,407,342.46	3.91
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	33,745,418.17	1.25
7	其他资产	46,452,214.09	1.72
8	合计	2,693,276,289.67	100.00

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。
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

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合			占基金资产净值比例
序号	债券品种	公允价值(元)	(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	231,885,372.00	8.76
	其中:政策性金融债	202,210,000.00	7.64
4	企业债券	622,066,942.96	23.49
5	企业短期融资券	1,254,505,000.00	47.37
6	中期票据	363,299,000.00	13.72
7	可转债	6,085,000.00	0.23
8	同业存单	-	-
9	中小企业私募债	2980000.00	1.125
10	其他	-	-
11	合计	2,507,671,314.96	94.69

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
券投资组合
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 011523 15天康 SCP005 800,000 80,000.00 3.02
2 011599 15中钢债 SCP007 800,000 79,992.00 3.02
3 041480 14广农发债 CP001 700,000 70,735.00 2.67
4 101566 15远东租赁 MTN001 700,000 70,672.00 2.67
5 041566 15农发行 CP001 700,000 70,028.00 2.64

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五名资产支持证券投资明细
序号 证券代码 证券名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 119027 侨城05 410,000 38,586.61 1.46
2 119026 侨城04 370,000 34,822.00 1.31
3 119025 侨城03 340,000 31,998.00 1.21

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。
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
(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) 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未投资国债期货。
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。
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、处罚的情形。
(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前十名股票超出基金合同规定的备选股票库。
(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	84,276.23
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	46,061,869.36
5	应收申购款	306,068.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,452,214.09

(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未持有流通受限的股票。
(6) 投资组合报告附注的其他文本描述部分。
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、基金业绩
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代表其未来表现。投资有风险, 投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、富国产业债债券型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
阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② ①-③ ②-④
2012.1.1至2012.12.31 9.68% 0.10% 3.60% 0.06% 6.08% 0.04%
2013.1.1至2013.12.31 0.90% 0.09% -0.47% 0.09% 1.37% 0.00%
2014.1.1至2014.12.31 15.06% 0.15% 10.34% 0.11% 4.71% 0.04%
2015.1.1至2015.9.30 8.01% 0.09% 5.28% 0.08% 2.73% 0.01%
2011.1.1至2015.9.30 37.66% 0.11% 20.25% 0.09% 17.41% 0.02%

2、自基金合同生效以来富国产业债债券型证券投资基金累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
注: 截止日期为2015年9月30日。
本基金于2011年12月5日成立。本基金建仓期6个月, 即从2011年12月5日起至2012年6月4日, 建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。
十三、费用概览
(一) 与基金运作有关的费用
1、基金费用的种类
(1) 基金管理人的管理费;
(2) 基金托管人的托管费;
(3) 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
(4) 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
(5) 基金份额持有人大会费用;
(6) 基金的证券交易费用;
(7) 基金的银行汇划费用;
(8) 按照国家有关规定和《基金合同》约定, 可以在基金财产中列支的其他费用。
本基金终止清算时所发生费用, 按实际支出额从基金财产总值中扣除。
2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式
(1) 基金管理人的管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下:
 $H = E \times 0.6\% \times \text{当年天数}$
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令, 基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等, 支付日期顺延。
(2) 基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
 $H = E \times 0.2\% \times \text{当年天数}$
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值
基金托管费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令, 基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等, 支付日期顺延。
上述“一、基金费用的种类”中第3-7项费用, 根据有关法规及相应协议规定, 按费用实际支出金额列入当期费用, 由基金托管人从基金财产中支付。
3、不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用:
(1) 基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
(2) 基金管理人处理和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
(3) 《基金合同》生效前的相关费用, 包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;
(4) 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。
(二) 与基金销售有关的费用
1、申购费
(1) 本基金的前端申购费率:
本基金前端收费模式下通过直销柜台申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。
A、前端申购费率:

申购金额(M)	前端申购费率
M < 100万元	0.8%
100万元 ≤ M < 500万元	0.5%
M ≥ 500万元	每笔1000元

注: 上述前端申购费率适用于通过本公司直销柜台申购的养老金客户以外的其他选择前端收费模式申购本基金基金份额的投资者。
B、特定申购费率:

申购金额(M)	特定申购费率
M < 100万元	0.24%
100万元 ≤ M < 500万元	0.15%
M ≥ 500万元	每笔1000元

注: 上述特定申购费率适用于通过本公司直销柜台、选择前端收费模式申购本基金基金份额的养老金客户, 包括基本养老金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老金等, 具体包括: 全国社会保障基金, 可以投资基金的地方社会保障基金; 企业年金单一计划及集合计划; 企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划; 企业年金养老产品。
如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型, 本公司将在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围, 并按规定向中国证监会备案。
(2) 本基金的后端申购费率:
本基金基金份额的后端申购费率见下表:

持有时间(Y)	后端申购费率
1年以内(含)	1.0%
1年-3年(含)	0.6%
3年-5年(含)	0.4%
5年以上	0

注: 上表中, 1年按365天计算。
(3) 本基金的申购费用由基金申购人承担, 不列入