富国天盈分级债券型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

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：	2013年10月23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2013年10月21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2013年7月1日起至2013年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国天盈分级债券(场内简称:富国天盈)	
基金主代码	161015	
基金运作方式	契约型基金，本基金(基金合同)生效之日起3年内，天盈A日(基金合同)生效之日起每满6个月开放一次，天盈B封闭运作并上市交易；本基金(基金合同)生效后3年期届满，本基金转换为上市开放式基金(LOF)。	
基金合同生效日	2011年05月23日	
报告期末基金份额总额(单位:份)	2,636,076,641.79	
投资目标	在追求基金资产长期安全的基础上，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。	
投资策略	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类属资产进行最优化配置和调整。	
业绩比较基准	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。	
风险收益特征	从基金资产整体运作来看，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	
下属两级基金的基金简称	天盈A	天盈B
下属两级基金的交易代码	161016	150041
报告期末下属两级基金的份额总额(单位:份)	1,584,597,293.38	1,051,479,348.41
下属两级基金的风险收益特征	天盈A份额表现出低风险、收益相对稳定的特征	天盈B份额表现出较高风险、收益相对较高的特征。

§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(2013年07月01日-2013年09月30日)
1.本期已实现收益	39,417,399.92
2.本期利润	-8,875,369.37
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0034
4.期末基金资产净值	3,011,159,201.74
5.期末基金份额净值	1.142

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	-0.35%	0.06%	-1.02%	0.07%	0.67%	-0.01%

注：过去三个月指2013年7月1日-2013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2013年9月30日。

本基金合同生效日为2011年5月23日，本基金建仓期6个月，即从2011年5月23日起至2011年11月22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

单位：人民币元

其他指标	报告期末(2013年09月30日)
富国天盈分级债券A与富国天盈分级债券封闭B基金份额配比	1.50701704:1
期末富国天盈分级债券A份额参考净值	1.015
期末富国天盈分级债券A份额累计参考净值	1.108
期末富国天盈分级债券封闭B份额参考净值	1.334
期末富国天盈分级债券封闭B份额累计参考净值	1.334
富国天盈分级债券A的预计年收益率	4.2%

§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		
刁羽	本基金基金经理兼任富国汇利分级债券型证券投资基金基金经理、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金基金经理	2011-05-23	-	7年	博士，曾任国泰君安证券股份有限公司固定收益部研究员、交易员，浦银安盛基金管理有限公司基金经理助理，2009年6月至2010年6月任富国基金管理有限公司富国天时货币市场基金基金经理助理，2010年6月至2013年3月任富国天时货币市场基金基金经理，2010年11月起兼任富国汇利分级债券型证券投资基金基金经理，2011年5月起兼任富国天盈分级债券型证券投资基金基金经理，2013年6月起任富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金基金经理，2013年9月起任富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。
赵恒毅	本基金前任基金经理	2011-05-24	2013-07-23	9年	硕士，曾任通用技术集团投资管理有限公司研究员，2008年4月至2011年5月任富国基金管理有限公司固定收益部研究员，2011年5月起任富国天盈分级债券型证券投资基金基金经理，2012年5月起任富国新天锋定期开放债券型证券投资基金基金经理，2012年6月起任富国可转换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盈分级债券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》、《富国天盈分级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，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。

4.3 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，亦未受到监管机构的相关调查。

4.4报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

三季度在6月下旬资金收紧，企业债收益率大幅上行后维持高位，因组合事前已经逐渐降低仓位缩短久期，收益率上行对组合冲击相对有限。

报告期内，本基金对持仓品种进行了结构优化，使得组合整体的风险收益属性更加优良。未来，本基金将继续关注通胀水平、经济增长、信贷增长以及货币政策方面的变化对市场可能带来的影响，继续跟踪债券发行人信用状况的变化趋势，积极把握市场中各种交易机会，在控制好信用风险的前提下为持有人争取较高的回报。

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-0.35%，业绩比较基准收益率为-1.02%。

§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	4,167,666,290.83	91.78
	其中:债券	4,167,666,290.83	91.78
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	196,500,494.75	4.33
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	50,212,788.39	1.11
6	其他资产	126,744,678.54	2.79
7	合计	4,541,124,252.51	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投资。

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投资。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	159,792,000.00	5.31
	其中:政策性金融债	159,792,000.00	5.31
4	企业债券	3,952,805,290.83	131.27
5	企业短期融资券	45,048,000.00	1.50
6	中期票据	10,021,000.00	0.33
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	4,167,666,290.83	138.41

5.5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

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	122805	11大同债	1,250,010	126,251,010.00	4.19
2	130418	13农发18	1,200,000	119,892,000.00	3.98
3	122819	11常城建	802,510	80,957,208.80	2.69
4	122846	11渝富债	712,550	74,247,710.00	2.47
5	122808	11黔州债	673,410	69,644,062.20	2.31

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名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.8报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1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。

5.8.2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。

5.9报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1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。

5.9.2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。

5.9.3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。

5.10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。

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。

5.10.2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。

本基金本报告期内投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	529,282.00
2	应收证券清算款	21,138,177.64
3	应收股利	-
4	应收利息	105,077,218.90
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	126,744,678.54

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：本基金本报告期末未持有股票投资。

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

项目	A级	B级
报告期期初基金份额总额	1,584,597,293.38	1,051,479,348.41
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	-	-
报告期期末基金份额总额	1,584,597,293.38	1,051,479,348.41

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

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天盈分级债券型证券投资基金的文件

2、富国天盈分级债券型证券投资基金基金合同

3、富国天盈分级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、富国天盈分级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
2013年10月23日

富国新天锋定期开放债券型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

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：	2013年10月23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2013年10月21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2013年7月1日起至2013年9月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	富国新天锋定期开放债券(场内简称:富国天锋)	
基金主代码	161019	
交易代码	前端交易代码:161019 后端交易代码:161020	
基金运作方式	契约型开放式，本基金以定期开放的方式运作，自基金合同生效日起每三年开放一次。	
基金合同生效日	2012年05月07日	
报告期末基金份额总额(单位:份)	945,778,694.63	
投资目标	本基金在追求基金资产长期安全的基础上，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。	
投资策略	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类属资产进行最优化配置和调整。	
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。	
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(2013年07月01日-2013年09月30日)
1.本期已实现收益	12,453,149.33
2.本期利润	-2,725,018.76
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0029
4.期末基金资产净值	951,935,739.67
5.期末基金份额净值	1.007

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。

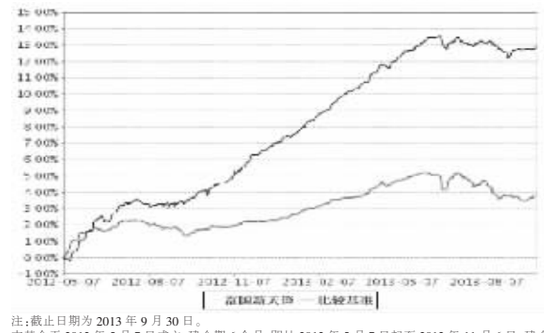
3.2 基金净值表现

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	-0.20%	0.08%	-1.02%	0.07%	0.82%	0.01%

注：过去三个月指2013年7月1日-2013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2013年9月30日。

本基金于2012年5月7日成立，建仓期6个月，即从2012年5月7日起至2012年11月6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		
邹卉	本基金基金经理兼任富国天时货币市场基金基金经理、富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理、富国信用债债券型证券投资基金基金经理	2012-05-07	-	8年	硕士，曾任上海国泰人寿保险有限公司投资部投资助理，东方基金管理有限公司债券研究员，自2008年9月至2011年7月任富国基金管理有限公司债券研究员，自2011年8月起任富国天时货币市场基金基金经理，2012年5月起任富国新天锋定期开放债券型证券投资基金基金经理，2012年11月起任富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理，2013年6月起任富国信用债债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。
赵恒毅	本基金前任基金经理	2012-05-07	2013-07-23	9年	硕士，曾任通用技术集团投资管理有限公司研究员，2008年4月至2011年5月任富国基金管理有限公司固定收益部研究员，2011年5月起任富国天盈分级债券型证券投资基金基金经理，2012年5月起任富国新天锋定期开放债券型证券投资基金基金经理，2012年6月起任富国可转换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新天锋定期开放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》、《富国新天锋定期开放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，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，亦未受到监管机构的相关调查。

4.4报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2013年三季度国内经济继续筑底、平稳中有所回升，CPI仍维持在较低位置。在经历半年末的钱荒后，三季度央行在公开市场上持续进行逆回购方式调节流动性，货币政策维持稳中偏紧的格局，加上财政存款的投放和外汇占款的回升，银行间资金面呈现紧平衡状态。债券市场上，由于资金成本下行幅度有限，利率类债券发行供给量大增，以及监管层对商业银行非标业务的持续清理，中长期限债券收益率易上难下，总体呈现上行态势。

本季度，基金管理人坚持严格按照基金合同进行投资管理，在利率上行的环境中，把风险控制和安全边际放在首位。本季度之初，基金操作上继续减持部分期限较长的债券，增持了部分较短期限高票息债券，以缩短组合久期抵御上行风险，同时保持组合的较高票息收益。同时本基金操作在券种选择继续坚持中高等级为主，以控制信用风险。

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-0.20%，业绩比较基准收益率为-1.02%。

§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	1,541,147,036.92	96.14
	其中:债券	1,541,147,036.92	96.14
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	25,184,275.25	1.57
6	其他资产	36,720,115.52	2.29
7	合计	1,603,051,427.69	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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,552,000.00	4.15
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,322,491,036.92	138.93
5	企业短期融资券	149,662,000.00	15.72
6	中期票据	29,442,000.00	3.09
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,541,147,036.92	161.90

5.5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

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	122761	11菏国资	494,000	51,677,340.00	5.43
2	122968	09杭城投	500,500	50,820,770.00	5.34
3	122839	11鑫泰债	500,000	50,560,000.00	5.31
4	122949	09常投债	500,020	49,981,999.20	5.25
5	041360015	13森工集CP001	500,000	49,955,000.00	5.25

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名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.8报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1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。

5.8.2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。

5.9报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1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。

5.9.2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。

5.9.3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。

5.10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。

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。

5.10.2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	108,236.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	36,606,879.52
5	应收申购款	-
6	其他应收款	5,000.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,720,115.52

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：本基金本报告期末未持有股票资产。

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	945,778,694.63
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)	-
报告期期末基金份额总额	945,778,694.63

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

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新天锋定期开放债券型证券投资基金的文件

2、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金基金合同

3、富国新天锋定期开放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、富国新天锋定期开放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
2013年10月23日

富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

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：	2013年10月23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2013年10月21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2013年7月1日起至2013年9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品概况

基金简称	富国上证综指ETF联接
基金主代码	100053
交易代码	前端交易代码:100053 后端交易代码:-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年01月30日
报告期末基金份额总额(单位:份)	347,386,545.40
投资目标	通过主要投资于目标ETF，即富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为目标ETF(富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金)的联接基金，主要通过投资于目标ETF以达到投资目标。当本基金申购赎回和买卖目标ETF，或基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，本管理人会在10个交易日内对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。
业绩比较基准	95%×上证综合指数收益率+5%×银行活期存款税后利率
风险收益特征	本基金为ETF联接基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金，跟踪上证综合指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	上证综指交易型开放式指数证券投资基金
基金交易代码	510210
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2011年01月30日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011年03月25日
基金管理人名称	富国基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品概况

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	上证综指交易型开放式指数证券投资基金采用最优化抽样复制标的指数、最优化抽样依托富国量化投资平台，利用长期稳定的风险模型，使用"跟踪误差最小化"的最优化方式创建目标组合，从而实现对标的指数的紧密跟踪。
业绩比较基准	上证综合指数
风险收益特征	上证综指交易型开放式指数证券投资基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时上证综指交易型开放式指数证券投资基金为指数型基金，跟踪上证综合指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

§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(2013年07月01日-2013年09月30日)
1.本期已实现收益	-9,551,603.86
2.本期利润	30,848,805.51
3.加权平均基金份额本期利润	0.0830
4.期末基金资产净值	277,419,461.69
5.期末基金份额净值	0.799

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