富国天博创新主题股票型证券投资基金

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	富国天博创新股票
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)	7,006,745,041.35
投资目标	本基金主要投资于具有良好成长性的创新主题类上市公司,在充分注重投资组合收益性、流动性与安全性的基础上,力争实现资本的长期稳定增值。
投资策略	本基金将采用"自上而下"与"自下而上"相结合的主动投资管理策略,将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、行业细分、个券选择以及组合风险管理全过程中。
业绩比较基准	中信标普300指数×80%+中信标普国债指数×15%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的股票型基金,属于较高预期收益、较高预期风险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	-48,392,388.98
2.本期利润	419,356,004.62
3.加权平均基金份额本期利润	0.0586
4.期末基金资产净值	5,583,355,616.27
5.期末基金份额净值	0.7969

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。

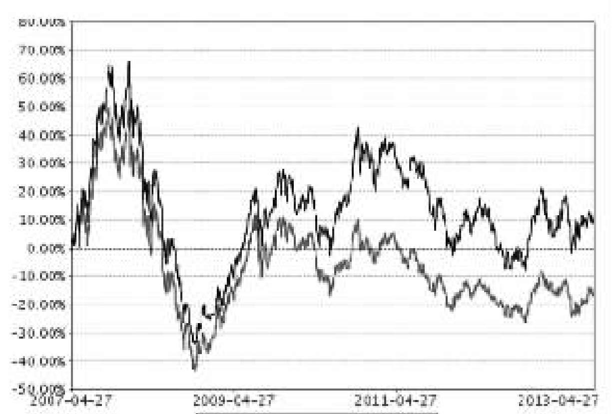
3.2 基金净值表现

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	7.86%	1.42%	8.65%	1.11%	-0.79%	0.31%

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2013年9月30日。

本基金于2007年4月27日由原汉博证券投资基金转型而成,建仓期6个月,从2007年4月27日至2007年10月26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		
毕天宇	本基金基金经理兼任权益投资副总监	2005-11-26	-	14年	硕士,曾任中国燕兴桂林公司汽车经营部经理助理;中国北方工业上海公司经理助理;兴业证券股份有限公司研究员;2002年3月任富国基金管理有限公司行业研究员,2005年11月至今任富国天博基金经理,兼任权益投资副总监。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博创新主题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》、《富国天博创新主题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,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3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 报告期内基金投资策略和运作分析

在6月探底后,三季度市场逐步回升。沪深300指数上涨9.47%。同期净值上涨7.86%。

三季度基金表现不如市场,重仓个股表现一般,地产行业配置较多是主要原因。从操作来看,我们组合变化不大,只是降低了机械行业的配置。

我们认为,房地产股价走势未能反应行业基本面,市场过度纠结于可能的政策变化。而政府更可能采取的是市场化调控措施。四季度随着行业推盘量增加,房价将趋于理性。而市场化调控一旦得到认可,将明显提升行业估值。对于阶段性表现不佳的重仓个股,我们认为行业调整并不影响个股的长期投资价值,我们将紧密跟踪行业的变化,继续持有。

四季度,我们在坚持既定策略同时,将重点关注经济转型期新的行业机会,力争为投资者带来更好回报。

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7.86%,业绩比较基准收益率为8.65%。

§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	5,250,173,232.35	93.62
	其中:股票	5,250,173,232.35	93.62
2	固定收益投资	332,117,000.00	5.92
	其中:债券	332,117,000.00	5.92
	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	9,413,249.70	0.17
6	其他资产	16,376,099.28	0.29
7	合计	5,608,079,581.33	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	21,460,356.00	0.38
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,062,786,681.60	54.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	82,495,369.24	1.48
E	建筑业	83,999,008.75	1.50
F	批发和零售业	39,342,539.92	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	43,751,657.04	0.78
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	452,956,073.21	8.11
J	金融业	519,998,437.12	9.31
K	房地产业	941,853,619.47	16.87
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	1,489,000.00	0.03
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	40,490.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	5,250,173,232.35	94.03

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	000581	威孚高科	22,800,000	537,852,000.00	9.63
2	601166	兴业银行	43,985,536	491,318,437.12	8.80
3	600519	贵州茅台	3,000,000	407,820,000.00	7.30
4	000718	苏宁环球	61,807,000	373,932,350.00	6.70
5	002271	东方雨虹	14,787,157	355,187,511.14	6.36
6	600703	三安光电	14,807,234	300,438,777.86	5.38
7	000024	招商地产	11,006,095	264,146,280.00	4.73
8	600637	百视通	5,002,114	261,860,667.90	4.69
9	000063	中兴通讯	10,815,102	179,530,693.20	3.22
10	600570	恒生电子	7,500,000	161,700,000.00	2.90

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	59,910,000.00	1.07
2	央行票据	-	-
3	金融债券	219,302,000.00	3.93
	其中:政策性金融债	219,302,000.00	3.93
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	52,905,000.00	0.95
8	其他	-	-
9	合计	332,117,000.00	5.95

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	130201	13国开01	900,000	89,775,000.00	1.61
2	130218	13国开18	600,000	59,598,000.00	1.07
3	110023	民生转债	500,000	52,905,000.00	0.95
4	130418	13农发18	500,000	49,955,000.00	0.89
5	130002	13附息国债02	400,000	39,916,000.00	0.71

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。

本期,本基金持有的贵州茅台于2013年2月23日公告其于2013年2月22日收到贵州省物价局《行政处罚决定书》,因其控股子公司贵州茅台酒销售有限公司限定销售茅台酒最低价格,违反《中华人民共和国反垄断法》而被行政处罚。

基金管理人将密切跟踪相关进展,遵循价值投资的理念进行投资决策。

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。

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。

5.10.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	773,694.72
2	应收证券清算款	10,637,475.11
3	应收股利	-
4	应收利息	4,828,273.40
5	应收申购款	136,656.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,376,099.28

5.10.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	52,905,000.00	0.95

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	7,240,244,323.07
报告期期间基金总申购份额	12,755,737.90
减:报告期期间基金总赎回份额	246,255,019.62
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	7,006,745,041.35

§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购及买卖本基金。

§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汉博证券投资基金的文件
2、汉博证券投资基金基金合同
3、汉博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、中国证监会《关于核准汉博证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》
6、富国天博创新主题股票型证券投资基金基金合同
7、富国天博创新主题股票型证券投资基金托管协议
8、汉博证券投资基金财务报表及报表附注
9、富国天博创新主题股票型证券投资基金财务报表及报表附注
10、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

富国天益价值证券投资基金

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:	交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	富国天益价值股票
基金主代码	100020
交易代码	前端交易代码:100020 后端交易代码:100021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年06月15日
报告期末基金份额总额(单位:份)	8,313,987,703.18
投资目标	本基金属价值型基金,主要投资于内在价值被低估的上市公司的股票,或与同类型上市公司相比具有更高相对价值的上市公司的股票。本基金通过对投资组合的动态调整来分散和控制风险,在注重基金资产安全的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采取积极的投资策略。本基金在大类资产配置和行业配置层面,遵循自上而下的积极策略,个股选择层面,遵循自下而上的积极策略。根据基金经理对股票市场变动的趋势的判断,决定基金资产在股票、债券、现金等金融资产上的分布,并进行动态配比以规避系统性风险的影响,最大限度地确保基金资产的安全。
业绩比较基准	95%的中信标普300指数+5%的中信国债指数
风险收益特征	本基金为价值型证券投资基金,属于证券投资基金中的中低风险品种。
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(2013年07月01日-2013年09月30日)
1.本期已实现收益	101,565,846.46
2.本期利润	863,631,942.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.1012
4.期末基金资产净值	7,604,652,806.00
5.期末基金份额净值	0.9147

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。

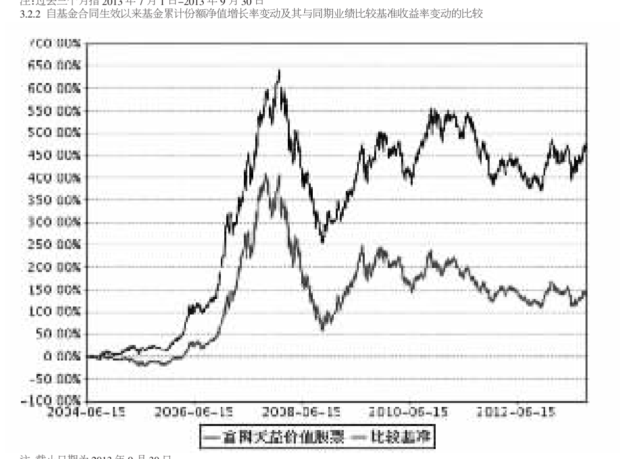
3.2 基金净值表现

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	12.47%	1.18%	10.19%	1.32%	2.28%	-0.14%

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2004年6月15日成立,建仓期6个月,从2004年6月15日至2004年12月14日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。本基金于2007年11月6日大比例分红规模急剧扩大,建仓期3个月,从2007年11月5日至2008年2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。

§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		
陈戈	本基金基金经理兼任公司副总经理	2005-04-13	-	17年	硕士,曾任国泰君安证券有限责任公司研究所研究员;2000年10月任富国基金管理有限公司研究员、行业研究主管、研究策划部经理、总经理助理。2005年4月至今任富国天益基金经理,兼任公司副总经理。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益价值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》、《富国天益价值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,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20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 报告期内基金投资策略和运作分析

随着经济数据的触底回升,2013年三季度A股市场指数出现了一波反弹,同时以创业板为代表的中小市值公司和新兴产业类行业依然呈现强势特征,本基金在三季度坚持既定投资策略,并对组合进行了优化调整,总体取得了较好的效果。

展望未来,本基金仍然对中国经济的长远前景持乐观态度,短期的增速下滑有利于实体经济休养生息和加速企业的优胜劣汰。四季度,本基金仍将坚持积极操作,专注于投资有望在竞争中最终胜出的优质企业,同时也将注重保持投资风格和理性,做好风险防范。

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12.47%,业绩比较基准收益率为10.19%。

§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	6,710,529,951.26	86.83
	其中:股票	6,710,529,951.26	86.83
2	固定收益投资	502,310,697.20	6.50
	其中:债券	502,310,697.20	6.50
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	304,600,549.40	3.94
	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	139,111,610.98	1.80
6	其他资产	71,639,394.25	0.93
7	合计	7,728,192,203.09	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	2,081,376.00	0.03
B	采矿业	3,082,169.68	0.04
C	制造业	4,073,597,542.29	53.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,888,376.28	0.06
E	建筑业	103,236,185.17	1.36
F	批发和零售业	413,288,575.43	5.43
G	交通运输、仓储和邮政业	7,784,758.80	0.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	684,524,579.19	9.00
J	金融业	1,019,158,427.34	13.40
K	房地产业	342,873,195.00	4.51
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	23,318,295.00	0.31
N	水利、环境和公共设施管理业	29,187,931.60	0.38
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	3,508,539.48	0.05
S	综合	-	-
	合计	6,710,529,951.26	88.24

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	000895	双汇发展	13,604,974	631,951,042.30	8.31
2	002422	科伦药业	10,661,918	572,544,996.60	7.53
3	002153	石基信息	13,031,347	495,191,186.00	6.51
4	601166	兴业银行	37,506,166	418,943,874.22	5.51
5	600519	贵州茅台	2,606,699	354,354,662.06	4.66
6	000581	威孚高科	13,445,322	317,175,145.98	4.17
7	600016	民生银行	28,073,318	268,380,920.08	3.53
8	000423	东阿阿胶	6,507,561	262,970,540.01	3.46
9	000538	云南白药	2,130,600	249,408,036.00	3.28
10	002024	苏宁云商	15,507,985	199,277,607.25	2.62

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	318,716,000.00	4.19
	其中:政策性金融债	318,716,000.00	4.19
4	企业债券	4,972,080.20	0.07
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	178,622,617.00	2.35
8	其他	-	-
9	合计	502,310,697.20	6.61

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	130201	13国开01	1,000,000	99,750,000.00	1.31
2	113003	重工转债	667,310	84,841,793.40	1.12
3	130218	13国开18	700,000	69,531,000.00	0.91
4	130236	13国开36	500,000	49,935,000.00	0.66
5	120419	12农发19	500,000	49,905,000.00	0.66

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。

本期,本基金持有的贵州茅台于2013年2月23日公告其于2013年2月22日收到贵州省物价局《行政处罚决定书》,因其控股子公司贵州茅台酒销售有限公司限定销售茅台酒最低价格,违反《中华人民共和国反垄断法》而被行政处罚。本基金持有的科伦药业于2013年5月21日公告其于2013年5月20日收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》(编号:成稽调查通字13139号),因其公司涉嫌信息披露违法违规,故中国证监会对其立案调查。公司于2013年5月31日公告《关于执行落实四川监管局<关于对科伦药业采取责令改正措施的决定>(〔2013〕4号)的整改报告》。基金管理人将密切跟踪相关进展,遵循价值投资的理念进行投资决策。

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。

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。

5.10.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,819,463.98
2	应收证券清算款	62,882,187.07
3	应收股利	-
4	应收利息	6,317,328.36
5	应收申购款	620,414.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	71,639,394.25

5.10.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113003	重工转债	84,841,793.40	1.12
2	113002	工行转债	44,332,000.00	0.58
3	113001	中行转债	30,009,000.00	0.39
4	110020	南山转债	12,201,837.00	0.16
5	110015	石化转债	7,237,986.60	0.10

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	8,672,508,187.72
报告期期间基金总申购份额	55,359,397.40
减:报告期期间基金总赎回份额	413,879,881.94
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	8,313,987,703.18

§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益价值证券投资基金的文件
2、富国天益价值证券投资基金基金合同
3、富国天益价值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、富国天益价值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

富国产业债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	富国产业债券
基金主代码	100058
交易代码	前端交易代码:100058 后端交易代码:100059
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月05日
报告期末基金份额总额(单位:份)	5,646,126,635.35
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。
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(2013年07月01日-2013年09月30日)
1.本期已实现收益	69,685,704.25
2.本期利润	-11,534,004.69
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0020
4.期末基金资产净值	5,783,217,936.77
5.期末基金份额净值	1.024

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	-0.19%	0.07%	-1.02%	0.07%	0.83%	0.00%

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。

§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		
钟智伦	本基金基金经理兼任富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金经理、固定收益投资副总监	2011-12-05	-	20年	硕士,曾任平安证券有限责任公司部门经理;上海新世纪投资服务有限公司研究员;海通证券股份有限公司投资经理;2005年5月任富国基金管理有限公司债券研究员;2006年6月至2009年3月任富国天时基金经理;2008年10月至今任富国天丰基金经理;2009年6月至2012年12月任富国优化增强债券基金基金经理;2011年12月至今任富国产业债债券型证券投资基金基金经理;兼任固定收益投资副总监。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产业债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》、《富国产业债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,管理和运用基金资产,无损害基金份额持有人利益的行为,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

三季度宏观经济数据表明经济正在企稳,但能否企稳还有待持续观察,市场参与者对此的判断出现分歧。在此背景下,债券市场收益率水平上升,信用债券市场也随之出现调整,信用利差分化,个别低信用等级的公司债券收益率水平出现了剧烈的上升。

报告期内本基金坚持以产业债为主要标的的信用债券投资策略,随着信用债券市场信用风险的释放,在报告期的后半期本基金逐步提升了信用债券的投资比例,并且在风险可承受范围内适度配置了个别到期收益率高于2%的具有明显风险收益比的可转债。报告期内信用债券市场整体下跌,基金净值受此影响亦出现小幅回撤。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金份额净值增长率为-0.19%,同期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	8,880,678,527.85	89.67
	其中:债券	8,736,678,527.85	88.22
	资产支持证券	144,000,000.00	1.45
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	378,250,006.17	3.82
6	其他资产	644,515,056.74	6.51
7	合计	9,903,443,590.76	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	198,920,000.00	3.44
	其中:政策性金融债	198,920,000.00	3.44
4	企业债券	7,458,978,212.91	128.98
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	969,093,000.00	16.76
7	可转债	109,687,314.94	1.90
8	其他	-	-
9	合计	8,736,678,527.85	151.07

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	112129	12辽通债	1,720,010	172,001,000.00	2.97
2	122033	09富力债	1,600,000	163,040,000.00	2.82
3	122267	13永泰债	1,600,000	160,000,000.00	2.77
4	112190	11亚迪02	1,500,000	150,000,000.00	2.59
5	130227	13国开27	1,500,000	149,325,000.00	2.58

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

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	41,000,000.00	0.71
2	119026	侨城04	370,000	37,000,000.00	0.64
3	119025	侨城03	340,000	34,000,000.00	0.59
4	119024	侨城02	320,000	32,000,000.00	0.55

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	974,839.72
2	应收证券清算款	413,047,557.17
3	应收股利	-
4	应收利息	230,439,934.06
5	应收申购款	52,725.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	644,515,056.74

5.10.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	109,269,771.10	1.89

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	5,679,050,476.92
报告期期间基金总申购份额	101,007,625.21
减:报告期期间基金总赎回份额	133,931,466.78
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	5,646,126,635.35

§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,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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产业债债券型证券投资基金的文件
2、富国产业债债券型证券投资基金基金合同
3、富国产业债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、富国产业债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