

富国纯债债券型发起式证券投资基金
二〇一六年半年度报告
(摘要)

2016年06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

送出日期：2016年08月25日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2016 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | | |
|-----------------|-----------------|-----------------|--------|
| 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 | | |
| 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 | | |
| 报告期末基金份额总额 | 264,693,876.86份 | | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | | |
| 下属两级基金的基金简称 | 富国纯债 A/B | 富国纯债 C | |
| 下属两级基金的交易代码 | 前端 | 后端 | 100068 |
| | 100066 | 100067 | |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 98,540,852.22份 | 166,153,024.64份 | |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 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。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|------------------------|---------------------|
| 名称 | | 富国基金管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 范伟隽 | 洪渊 |
| | 联系电话 | 021-20361818 | 010—66105799 |
| | 电子邮箱 | public@fullgoal.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 95105686、4008880688 | 95588 |
| 传真 | | 021-20361616 | 010—66105798 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|--|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.fullgoal.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 富国基金管理有限公司上海市浦东新区世纪大道8号 上海国金中心二期16-17层中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街55号 |

§3 主要财务指标、基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

(1) 富国纯债 A/B

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2016年01月01日至2016年06月30日) |
|---------------|------------------------------|
| 本期已实现收益 | 2,833,096.45 |
| 本期利润 | 1,865,917.77 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0173 |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.74% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016年06月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0189 |
| 期末基金资产净值 | 102,328,752.94 |
| 期末基金份额净值 | 1.038 |

(2) 富国纯债 C

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2016年01月01日至2016年06月30日) |
|---------------|------------------------------|
| 本期已实现收益 | 3,310,878.34 |
| 本期利润 | 2,754,929.02 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0180 |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.55% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016年06月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0157 |
| 期末基金资产净值 | 171,992,785.34 |
| 期末基金份额净值 | 1.035 |

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 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) 富国纯债 A/B

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 |
|-------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 0.58% | 0.06% | 0.69% | 0.04% | -0.11% | 0.02% |
| 过去三个月 | 0.58% | 0.08% | 0.42% | 0.07% | 0.16% | 0.01% |
| 过去六个月 | 1.74% | 0.08% | 1.57% | 0.07% | 0.17% | 0.01% |
| 过去一年 | 5.21% | 0.08% | 6.54% | 0.07% | -1.33% | 0.01% |
| 过去三年 | 15.97% | 0.11% | 17.89% | 0.09% | -1.92% | 0.02% |
| 自基金合同生效日起至今 | 19.91% | 0.10% | 20.91% | 0.09% | -1.00% | 0.01% |

(2) 富国纯债 C

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 |
|-------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 0.58% | 0.06% | 0.69% | 0.04% | -0.11% | 0.02% |
| 过去三个月 | 0.49% | 0.08% | 0.42% | 0.07% | 0.07% | 0.01% |
| 过去六个月 | 1.55% | 0.08% | 1.57% | 0.07% | -0.02% | 0.01% |
| 过去一年 | 4.82% | 0.08% | 6.54% | 0.07% | -1.72% | 0.01% |
| 过去三年 | 14.70% | 0.11% | 17.89% | 0.09% | -3.19% | 0.02% |
| 自基金合同生效日起至今 | 18.26% | 0.10% | 20.91% | 0.09% | -2.65% | 0.01% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

(1) 自基金合同生效以来富国纯债 A/B 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2016年6月30日。

2、本基金于2012年11月22日成立，建仓期6个月，从2012年11月22日起至2013年5月21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纯债C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 2016 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2012 年 11 月 22 日成立，建仓期 6 个月，从 2012 年 11 月 22 日起至 2013 年 5 月 21 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 基金管理人及基金经理

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富国基金管理有限公司于 1999 年 4 月 13 日获国家工商行政管理局登记注册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一，公司于 2001 年 3 月从北京迁址上海。2003 年 9 月加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。截至 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国消费主题混合型证券投资基金、富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金、富国天利增长债券投资基金、富国天益价值混合型证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国天时货币市场基金、富国天合稳健优选混合型证券投资基金、富国天博创新主题混合型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、富国天丰强化收益债券型证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国优化增强债券型证券投资基金、富国沪深 300 增强证券投资基金、富国通胀通缩主题轮动混合型证券投资基金、富国汇利回报分级债券型证券投资基金、富国全球债券证券投资基金、富国可转换债券证券投资基金、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、富国天盈债券型证券投资基金（LOF）、富国全球顶级消费品混合型证券投资基金、富国低碳环保混合型证券投资基金、富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）、富国产业债债券型证券投资基金、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金、富国高新技术产业混合型证券投资基金、富国中国中小盘（香港上市）混合型证券投资基金、富国纯债债券型发起式证券投资基金、富国强回报定期开放债券型证券投资基金、富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金、富国稳健增强债券型证券投资基金、富国信用债债券型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国医疗保健行业混合型证券投资基金、富国创业板指数分级证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金、富国城镇发展股票型证券投资基金、富国高端制造行业股票型证券投资基金、富国收益增强债券型证券投资基金、富国新回报灵活配置混合型证券投资基金、富国研究精选灵活配置混合型证券投资基金、富国中证军工指数分级证券投资基金、富国中证移动互联网指数分级证券投资基金、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金、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、富国收益宝货币市场基金、富国中小盘精选混合型证券投资基金、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金、富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金、富国中证银行指数分级证券投资基金、富国文体健康股票型证券投资基金、富国国家安全主

题混合型证券投资基金、富国改革动力混合型证券投资基金、富国新收益灵活配置混合型证券投资基金、富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金、富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金、富国中证煤炭指数分级证券投资基金、富国中证体育指数分级证券投资基金、富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金、富国新动力灵活配置混合型证券投资基金、富国收益宝交易型货币市场基金、富国低碳新经济混合型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国研究优选沪港深灵活配置混合型证券投资基金、富国价值优势混合型证券投资基金、富国泰利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国祥利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国美丽中国混合型证券投资基金、富国创新科技混合型证券投资基金等七十四只证券投资基金。

4.1.2 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 | | |
| 朱锐 | 本基金前任基金经理 | 2014-11-17 | 2016-02-01 | 4 年 | 硕士，曾就职于中国农业银行总行资产管理部；2014 年 9 月加入富国基金管理有限公司，2014 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，2014 年 12 月至 2016 年 2 月任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。具有基金从业资格 |
| 王颀亮 | 本基金经理兼任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、富国收益宝交易型货币市场基金、富国祥利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国泰 | 2016-02-05 | — | 6 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 月至 2016 年 6 月任富国收益宝货币市场基金基金经理，2015 年 4 月至 2016 年 1 月起任富国恒利分级债券型证券投资基金基金经理、2015 年 4 月起任富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金基金经理、2015 年 4 月至 2016 年 6 月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；2015 年 11 月起任富国收益宝交易型货币市场基金基金经理；2015 年 12 月起任富国目标收益一年期 |

| | | | | | |
|-----|---|------------|---|-----|---|
| | 利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金 | | | | 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，2016年2月起任富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理，2016年5月起任富国泰利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国祥利定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。 |
| 钟智伦 | 本基金基金经理兼固定收益投资部总经理、富国天丰强化收益债券型证券投资基金、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、富国新收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理 | 2015-03-13 | — | 22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月任富国天时货币市场基金基金经理；2008年10月至今任富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金经理；2009年6月至2012年12月任富国优化增强债券型证券投资基金基金经理；2011年12月至2014年6月任富国产业债债券型证券投资基金基金经理；2015年3月起任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、富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理；2015年5月起任富国新收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理；兼任固定收益投资部总经理。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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国纯债债券型发起式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》、《富国纯债债券型发起式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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 管理人对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

2016年上半年，债券市场也经历了一波过山车。一季度尽管信贷猛增基本面和物价指标显示经济企稳，但在资产荒的资金强大配置力量下，叠合美联储加息后全球风险偏好下降、央行春节后降准，债市收益率特别是信用债仍然出现了较明显的下行。债市在狂欢之余也埋下了收益率不能反映信用资质的隐忧。信用

违约事件频出不断。短端资金成本受到营改增以及季末 MPA 的银行体系考核显得尤为脆弱。二季度，四月份债市价格下调较为明显，因为一季度宏观数据的利好逐步落实，PPI 降幅收窄超预期，货币市场感受偏向紧张，商品价格的剧烈上涨和全球风险资产大涨反映出对通胀的担忧，债务违约的信用风险事件频频爆发。但随着 5 月份权威人士专访的新闻刊出后，对宏观经济的定调以及未来倾向于供给侧改革的导向使得债券市场收益率一度下行；六月随着英国脱欧事件的发酵及对全球经济的悲观预期，使得全球债市都成为避险品种，海外长期债券一度创新低。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金 A/B 级份额净值为 1.038 元，份额累计净值为 1.188 元；本基金 C 级份额净值为 1.035 元，份额累计净值为 1.173 元。本报告期，本基金 A/B 级份额净值增长率为 1.74%，C 级份额净值增长率为 1.55%；A/B 级同期业绩比较基准收益率为 1.57%，C 级同期业绩比较基准收益率为 1.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来下半年经济继续探底震荡，三季度不排除基建和房地产投资数据继续表现比较亮眼，但是到了四季度房地产见顶回落后对经济托底的边际效益递减。债券市场中长期来看收益率会继续下行，但短期由于资产慌而推动的利率过于快速下行会出现震荡行情。下半年随着各类债券资产的陆续集中到期不排除继续会有违约事件的发酵，但影响相比上半年四月份而言，对市场的波动会减小。金融去杠杆的政策不排除会有陆续推出，银行理财增长放缓，资产和负债端的倒挂会倒逼理财降低收益。下半年的资金面继续维持稳健，短端利率走廊底难以突破。未来要密切关注政治事件对债券市场的影响。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司按照相关法律法规的规定成立了估值委员会，并制订了《富国基金管理有限公司估值委员会运作管理办法》。估值委员会是公司基金估值的主要决策机关，由主管运营副总经理负责，成员包括基金清算、监察稽核、金融工程方面的业务骨干以及相关基金经理，所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会负责提出估值意见、提供和评估估值技术、执行估值决策和程序、对外信息披露等工作，保证基金估值的公允性和合理性，维护基金持有人的利益。基金经理是估值委员会的重要成员，必须列席估值委员会的定期会议，提出基金估值流程及估值技术中存在的潜在问题，参与估值程序和估值技术的决策。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于 2016 年 1 月 15 日公告对 2015 年内利润进行第四次收益分配，每 10 份 A/B 级基金份额派发红利 0.24 元，每 10 份 C 级基金份额派发红利 0.20 元，共计派发红利 6972275.51 元。

本基金对本报告期内利润进行的收益分配如下：2016 年 4 月 13 日公告每 10 份 A/B 级基金份额派发红利 0.10 元，每 10 份 C 级基金份额派发红利 0.10 元；2016 年 7 月 14 日公告每 10 份 A/B 级基金份额派发红利 0.10 元，每 10 份 C 级基金份额派发红利 0.10 元。

本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

4.8 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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对富国纯债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，富国纯债债券型证券投资基金的管理人——富国基金管理有限公司在富国纯债债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，富国纯债债券型发起式证券投资基金对基金份额持有人进行了2次利润分配，分配金额为9,167,298.27元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露的富国纯债债券型证券投资基金2016年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行资产托管部
2016年8月23日

§ 6 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：富国纯债债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2016年06月30日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 (2016年06月30日) | 上年度末 (2015年12月31日) |
|---------|----------------------|-----------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 626,590.20 | 15,256,542.11 |
| 结算备付金 | 1,132,711.20 | 2,038,208.56 |
| 存出保证金 | 18,001.67 | 21,935.08 |
| 交易性金融资产 | 266,727,831.99 | 280,086,640.95 |
| 其中：股票投资 | — | — |

| | | |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| 基金投资 | — | — |
| 债券投资 | 266,727,831.99 | 280,086,640.95 |
| 资产支持证券投资 | — | — |
| 贵金属投资 | — | — |
| 衍生金融资产 | — | — |
| 买入返售金融资产 | 5,000,000.00 | — |
| 应收证券清算款 | 25,000,000.00 | — |
| 应收利息 | 6,759,424.65 | 5,412,724.48 |
| 应收股利 | — | — |
| 应收申购款 | 526,347.52 | 1,828,491.88 |
| 递延所得税资产 | — | — |
| 其他资产 | — | — |
| 资产总计 | 305,790,907.23 | 304,644,543.06 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 | 上年度末 |
| | (2016年06月30日) | (2015年12月31日) |
| 负 债: | | |
| 短期借款 | — | — |
| 交易性金融负债 | — | — |
| 衍生金融负债 | — | — |
| 卖出回购金融资产款 | 27,444,000.00 | 30,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | — | — |
| 应付赎回款 | 3,636,343.00 | 175,488.72 |
| 应付管理人报酬 | 162,007.45 | 159,880.78 |
| 应付托管费 | 46,287.85 | 45,680.25 |
| 应付销售服务费 | 59,141.93 | 53,265.92 |
| 应付交易费用 | 15,252.68 | 19,704.10 |
| 应交税费 | — | — |
| 应付利息 | 556.30 | 4,791.66 |
| 应付利润 | — | — |
| 递延所得税负债 | — | — |
| 其他负债 | 105,779.74 | 60,175.04 |
| 负债合计 | 31,469,368.95 | 30,518,986.47 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 264,693,876.86 | 260,850,281.54 |
| 未分配利润 | 9,627,661.42 | 13,275,275.05 |
| 所有者权益合计 | 274,321,538.28 | 274,125,556.59 |
| 负债和所有者权益总计 | 305,790,907.23 | 304,644,543.06 |

注：报告截止日 2016 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.036 元，基金份额总额 264,693,876.86 份。其中：富国纯债 A/B 份额净值 1.038 元，份额总额 98,540,852.22 份；富国纯债 C 份额净值 1.035 元，份额总额 166,153,024.64 份。

6.2 利润表

会计主体：富国纯债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2016年01月01日至2016年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 (2016年01月01日至 2016年06月30日) | 上年度可比期间 (2015年01月01日至 2015年06月30日) |
|----------------------------|-------------------------------------|--|
| 一、收入 | 6,401,205.07 | 17,886,625.71 |
| 1. 利息收入 | 6,173,557.50 | 10,173,532.16 |
| 其中：存款利息收入 | 61,236.09 | 153,395.61 |
| 债券利息收入 | 6,079,650.50 | 10,012,461.76 |
| 资产支持证券利息收入 | — | — |
| 买入返售金融资产收入 | 32,670.91 | 7,674.79 |
| 其他利息收入 | — | — |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | 1,731,517.50 | 3,587,332.79 |
| 其中：股票投资收益 | — | — |
| 基金投资收益 | — | — |
| 债券投资收益 | 1,731,517.50 | 3,587,332.79 |
| 资产支持证券投资收益 | — | — |
| 贵金属投资收益 | — | — |
| 衍生工具投资收益 | — | — |
| 股利收益 | — | — |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -1,523,128.00 | 4,058,034.21 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | — | — |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 19,258.07 | 67,726.55 |
| 减：二、费用 | 1,780,358.28 | 3,168,640.70 |
| 1. 管理人报酬 | 939,573.38 | 1,052,987.50 |
| 2. 托管费 | 268,449.62 | 300,853.62 |
| 3. 销售服务费 | 314,219.63 | 344,304.90 |
| 4. 交易费用 | 19,044.00 | 53,424.05 |
| 5. 利息支出 | 121,313.04 | 1,293,112.28 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 121,313.04 | 1,293,112.28 |
| 6. 其他费用 | 117,758.61 | 123,958.35 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 4,620,846.79 | 14,717,985.01 |
| 减：所得税费用 | — | — |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 4,620,846.79 | 14,717,985.01 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国纯债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2016年01月01日至2016年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 (2016年01月01日至2016年06月30日) | | |
|--|--------------------------------------|----------------|-----------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 260,850,281.54 | 13,275,275.05 | 274,125,556.59 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | — | 4,620,846.79 | 4,620,846.79 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | 3,843,595.32 | 898,837.85 | 4,742,433.17 |
| 其中：1.基金申购款 | 241,536,654.91 | 8,540,830.49 | 250,077,485.40 |
| 2.基金赎回款 | -237,693,059.59 | -7,641,992.64 | -245,335,052.23 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | — | -9,167,298.27 | -9,167,298.27 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 264,693,876.86 | 9,627,661.42 | 274,321,538.28 |
| 项目 | 上年度可比期间 (2015年01月01日至2015年06月30日) | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 306,122,498.54 | 11,629,179.49 | 317,751,678.03 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | — | 14,717,985.01 | 14,717,985.01 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | -98,000,433.73 | -3,657,013.91 | -101,657,447.64 |
| 其中：1.基金申购款 | 425,213,021.10 | 16,973,820.82 | 442,186,841.92 |
| 2.基金赎回款 | -523,213,454.83 | -20,630,834.73 | -543,844,289.56 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | — | -12,073,831.15 | -12,073,831.15 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 208,122,064.81 | 10,616,319.44 | 218,738,384.25 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈戈

林志松

雷青松

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富国纯债债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]1235号文《关于核准富国纯债债券型发起式证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开募集,基金合同于2012年11月22日正式生效,首次设立募集规模为1,860,953,662.41份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为富国基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金根据认购费用、申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取前端认购/申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为A类;在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用,在投资者赎回时收取后端认购/申购费用、赎回费用的基金份额,称为B类。从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用,但对持有期限少于30日的本类别基金份额的赎回收取赎回费的基金份额,称为C类。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券、可分离交易可转债的纯债部分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,可转债仅投资二级市场可分离交易可转债的纯债部分。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

本基金业绩比较基准为:中债综合指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2016年6月30日的财务状况以及2016年1月1日至2016年6月30日止期间的经营

成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

7.4.6.2 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

7.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|----------------------|---------------------|
| 富国基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 海通证券股份有限公司（“海通证券”） | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 申万宏源证券有限公司（“申万宏源”） | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 中国工商银行股份有限公司（“工商银行”） | 基金托管人、基金代销机构 |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期（2016年01月01日至2016年06月30日） | | 上年度可比期间（2015年01月01日至2015年06月30日） | |
|-------|-----------------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例（%） | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例（%） |
| 海通证券 | 100,022,462.91 | 63.51 | 285,976,983.52 | 60.37 |
| 申万宏源 | 57,477,729.72 | 36.49 | 187,754,633.60 | 39.63 |

6.4.8.1.4 回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期（2016年01月01日至2016年06月30日） | | 上年度可比期间（2015年01月01日至2015年06月30日） | |
|-------|-----------------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------|
| | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例（%） | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例（%） |
| 海通证券 | 518,500,000.00 | 57.52 | 5,788,900,000.00 | 65.77 |
| 申万宏源 | 382,944,000.00 | 42.48 | 3,012,200,000.00 | 34.23 |

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期（2016年01月01日至2016年06月30日） |
|-------|-----------------------------|
|-------|-----------------------------|

| | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 (%) |
|-------|-----------------------------------|----------------|-----------|------------------|
| 申万宏源 | 5,386.63 | 32.77 | 3,806.91 | 27.18 |
| 海通证券 | 11,049.81 | 67.23 | 10,197.27 | 72.82 |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 (2015年01月01日至2015年06月30日) | | | |
| | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 (%) |
| 申万宏源 | 16,964.76 | 37.67 | 8,623.98 | 63.07 |
| 海通证券 | 28,066.02 | 62.33 | 5,049.15 | 36.93 |

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 (2016年01月01日至2016年06月30日) | 上年度可比期间 (2015年01月01日至2015年06月30日) |
|-----------------|------------------------------|-----------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 939,573.38 | 1,052,987.50 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 123,121.57 | 122,536.62 |

注：基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.7% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 (2016年01月01日至2016年06月30日) | 上年度可比期间 (2015年01月01日至2015年06月30日) |
|----------------|------------------------------|-----------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 268,449.62 | 300,853.62 |

注：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：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.8.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 (2016年01月01日至2016年06月30日) | | |
|----------------|------------------------------|-----|----|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | A/B 级 | C 级 | 合计 |
| | | | |

| | | | |
|------------|---|------------|------------|
| 富国基金管理有限公司 | — | 226,603.32 | 226,603.32 |
| 海通证券 | — | 107.79 | 107.79 |
| 工商银行 | — | 37,785.41 | 37,785.41 |
| 申万宏源 | — | 128.44 | 128.44 |
| 合计 | — | 264,624.96 | 264,624.96 |

金额单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间（2015年01月01日至2015年06月30日） | | |
|----------------|----------------------------------|------------|------------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | A/B级 | C级 | 合计 |
| 富国基金管理有限公司 | — | 264,643.21 | 264,643.21 |
| 申万宏源 | — | 7,373.18 | 7,373.18 |
| 海通证券 | — | 202.01 | 202.01 |
| 工商银行 | — | 49,474.16 | 49,474.16 |
| 合计 | — | 321,692.56 | 321,692.56 |

注：本基金 A、B 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费将专门用于本基金 C 类基金份额的销售与基金份额持有人服务。

在通常情况下，销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.4% 年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{基金销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期（2016年01月01日至2016年06月30日） | | 上年度可比期间（2015年01月01日至2015年06月30日） | |
|-----------------------------|-----------------------------|--------|----------------------------------|--------|
| | 富国纯债 A/B | 富国纯债 C | 富国纯债 A/B | 富国纯债 C |
| 基金合同生效日(2012年11月22日)持有的基金份额 | 10,000,600.06 | — | 10,000,600.06 | — |
| 期初持有的基金份额 | 10,000,600.06 | — | 10,000,600.06 | — |
| 期间申购/买入总份额 | — | — | — | — |
| 期间因拆分变动份额 | — | — | — | — |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | — | — | — | — |
| 期末持有的基金份额 | 10,000,600.06 | — | 10,000,600.06 | — |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 10.15 | — | 8.89 | — |

注：本基金管理人认购/申购本基金份额的费率按照本基金发售公告的条款执行，不存在费率优惠的情况。本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期（2016年01月01日至2016年06月30日） | | 上年度可比期间（2015年01月01日至2015年06月30日） | |
|--------------|-----------------------------|-----------|----------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 626,590.20 | 40,728.13 | 2,374,691.61 | 43,488.89 |

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间内本基金均无其他关联方交易事项。

6.4.9 利润分配情况

富国纯债 A/B:

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放 | 再投资形式发放 | 利润分配合计 | 备注 |
|----|------------|------------|-------------|--------------|------------|--------------|----|
| 1 | 2016-01-18 | 2016-01-19 | 0.240 | 2,667,227.04 | 323,649.14 | 2,990,876.18 | — |
| 2 | 2016-04-14 | 2016-04-15 | 0.100 | 934,162.50 | 132,012.45 | 1,066,174.95 | — |
| 合计 | | | 0.340 | 3,601,389.54 | 455,661.59 | 4,057,051.13 | — |

富国纯债C:

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放 | 再投资形式发放 | 利润分配合计 | 备注 |
|----|------------|------------|-------------|--------------|------------|--------------|----|
| 1 | 2016-01-18 | 2016-01-19 | 0.200 | 3,431,052.11 | 550,347.22 | 3,981,399.33 | — |

| | | | | | | | |
|----|------------|------------|-------|--------------|------------|--------------|---|
| 2 | 2016-04-14 | 2016-04-15 | 0.100 | 956,198.94 | 172,648.87 | 1,128,847.81 | — |
| 合计 | | | 0.300 | 4,387,251.05 | 722,996.09 | 5,110,247.14 | — |

注：本基金于资产负债表日之后、财务报表批准报出日之前批准、公告或实施的利润分配情况请参见 6.4.8.2 资产负债表日后事项。

6.4.10 期末（2016年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.10.1.1 受限证券类别：债券

金额单位：人民币元

| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位：张) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|----------|------------|------------|------------|--------|--------|--------------|---------------|---------------|----|
| 112389 | 16 华西 02 | 2016-05-17 | 2016-07-06 | 认购新发 证券 | 100.00 | 100.00 | 100,000 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | |
| 136277 | 16 华地 01 | 2016-06-21 | 2016-07-14 | 认购新发 证券 | 100.00 | 100.00 | 100,000 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | |

6.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2016 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 27,444,000.00 元，于 2016 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

6.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 6 月 30 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 0.00 元, 属于第二层次的余额为人民币 266, 727, 831. 99 元, 属于第三层次余额为人民币 0.00 元。

6. 4. 14. 1. 2. 2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况, 本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层次; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6. 4. 14. 1. 2. 3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

6. 4. 14. 2 承诺事项

截至资产负债表日, 本基金无需要说明的承诺事项。

6. 4. 14. 3 其他事项

截至资产负债表日, 本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 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 | 266, 727, 831. 99 | 87. 23 |
| | 其中: 债券 | 266, 727, 831. 99 | 87. 23 |
| | 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 | 5, 000, 000. 00 | 1. 64 |
| | 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 | 1, 759, 301. 40 | 0. 58 |
| 7 | 其他各项资产 | 32, 303, 773. 84 | 10. 56 |
| 8 | 合计 | 305, 790, 907. 23 | 100. 00 |

7.2 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。

7.3 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。

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于富国基金管理有限公司网站的半年度报告正文

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期内无累计买入价值超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期内无累计卖出价值超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期没有买入或卖出股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 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 | 20,012,000.00 | 7.30 |
| 2 | 央行票据 | — | — |
| 3 | 金融债券 | — | — |
| | 其中：政策性金融债 | — | — |
| 4 | 企业债券 | 216,496,831.99 | 78.92 |
| 5 | 企业短期融资券 | 30,219,000.00 | 11.02 |
| 6 | 中期票据 | — | — |
| 7 | 可转债（可交换债） | — | — |
| 8 | 同业存单 | — | — |
| 9 | 其他 | — | — |
| 10 | 合计 | 266,727,831.99 | 97.23 |

7.6 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

金额单位：人民币元

| 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 | 1480527 | 14 京保障房债 | 200,000 | 22,070,000.00 | 8.05 |
| 2 | 112322 | 16 涪陵 01 | 200,000 | 20,296,000.00 | 7.40 |
| 3 | 041561032 | 15 古纤道 CP002 | 200,000 | 20,154,000.00 | 7.35 |
| 4 | 019527 | 15 国债 27 | 200,000 | 20,012,000.00 | 7.30 |
| 5 | 112289 | 15 顺鑫 02 | 180,000 | 17,987,400.00 | 6.56 |

7.7 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。

7.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| | |
|-------------------|---|
| 公允价值变动总额合计(元) | — |
| 股指期货投资本期收益(元) | — |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) | — |

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

| | |
|-------------------|---|
| 公允价值变动总额合计（元） | — |
| 国债期货投资本期收益（元） | — |
| 国债期货投资本期公允价值变动（元） | — |

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 18,001.67 |
| 2 | 应收证券清算款 | 25,000,000.00 |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | 6,759,424.65 |
| 5 | 应收申购款 | 526,347.52 |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 32,303,773.84 |

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|----------|----------|------------|----------------|-----------|---------------|-----------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例(%) | 持有份额 | 占总份额比例(%) |
| 富国纯债 A/B | 1,065 | 92,526.62 | 64,815,592.35 | 65.78 | 33,725,259.87 | 34.22 |
| 富国纯债 C | 855 | 194,331.02 | 128,438,635.66 | 77.30 | 37,714,388.98 | 22.70 |
| 合计 | 1,920 | 137,861.39 | 193,254,228.01 | 73.01 | 71,439,648.85 | 26.99 |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数(份) | 占基金总份额比例(%) |
|----|------|-----------|-------------|
|----|------|-----------|-------------|

| | | | |
|-------------------|----------|---|---|
| 基金管理公司所有从业人员持有本基金 | 富国纯债 A/B | — | — |
| | 富国纯债 C | — | — |
| | 合计 | — | — |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--|----------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基 金 | 富国纯债 A/B | 0 |
| | 富国纯债 C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基 金 | 富国纯债 A/B | 0 |
| | 富国纯债 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数(份) | 持有份额占 基金总份额 比例 (%) | 发起份额总数(份) | 发起份额占 基金总份额 比例 (%) | 发起份额承 诺持有期限 |
|-------------|---------------|--------------------------|---------------|--------------------------|----------------|
| 基金管理人固有资金 | 10,000,600.06 | 3.78 | 10,000,600.06 | 3.78 | 3年 |
| 基金管理人高级管理人员 | — | — | — | — | — |
| 基金经理等人员 | — | — | — | — | — |
| 基金管理人股东 | — | — | — | — | — |
| 其他 | — | — | — | — | — |
| 合计 | 10,000,600.06 | 3.78 | 10,000,600.06 | 3.78 | — |

注：本公司运用固有资金认购富国纯债债券型发起式证券投资基金 A/B 级基金份额 10000600.06 份。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

| | 富国纯债 A/B | 富国纯债 C |
|--------------------------------|----------------|------------------|
| 基金合同生效日(2012年11月22日)基金 份额总额 | 541,034,116.25 | 1,319,919,546.16 |
| 报告期期初基金份额总额 | 111,748,466.80 | 149,101,814.74 |
| 本报告期基金总申购份额 | 33,786,827.48 | 207,749,827.43 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 46,994,442.06 | 190,698,617.53 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | — | — |
| 本报告期期末基金份额总额 | 98,540,852.22 | 166,153,024.64 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2016年6月，针对上海证监局向公司出具的《关于对富国基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，以及对相关负责人的警示，公司高度重视，认真落实整改要求，加强制度和风控措施，着力进一步加强公司内部控制和风险管理能力。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------|------------------|----------------|------------------|----------------|------------------|------|------------------|-----------|----------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | |
| 海通证券 | 2 | — | — | 100,022,462.91 | 63.51 | 518,500,000.00 | 57.52 | — | — | 11,049.81 | 67.23 | — |
| 申万宏源 | 2 | — | — | 57,477,729.72 | 36.49 | 382,944,000.00 | 42.48 | — | — | 5,386.63 | 32.77 | — |

注：1. 我公司对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。

2. 本期内本基金租用的券商交易单元无变更。

