富国低碳环保股票型证券投资基金

2012 年度报告摘要

2012年12月31日

基金管理人:富国基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
送出日期:2013年03月26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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年3月22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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2012年1月1日起至2012年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	富国低碳环保股票
基金主代码	100056
交易代码	前端交易代码:100056 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08月10日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	593,063,044.75份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于从事或受益于低碳环保主题的上市公司,通过精选个股和风险控制,力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金采取"自上而下"的方式进行大类资产配置,根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究,确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是一只主动投资的股票型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	范伟隽	张燕
	联系电话	021-20361818	0755-83199084
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95555
传真		021-20361616	0755-83195201

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	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 招商银行股份有限公司 深圳市深南大道7088号招商银行大厦

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2012年	2011年08月10日(基金合同生效日)至2011年12月31日
本期已实现收益	-80,703,751.31	-47,545,619.32
本期利润	15,257,238.21	-107,667,471.40
加权平均基金份额本期利润	0.0238	-0.1183
本期基金份额净值增长率	2.63%	-12.70%
3.1.2 期末数据和指标	2012年12月31日	2011年12月31日
期末可供分配基金份额利润	-0.1769	-0.1274
期末基金资产净值	531,651,360.26	645,082,870.59
期末基金份额净值	0.896	0.873

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,封闭式基金交易佣金、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

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
过去三个月	5.79%	1.23%	8.18%	1.02%	-2.39%	0.21%
过去六个月	1.36%	1.23%	2.26%	0.99%	-0.90%	0.24%
过去一年	2.63%	1.24%	7.10%	1.02%	-4.47%	0.22%
自基金合同生效日起至今	-10.40%	1.12%	-6.04%	1.05%	-4.36%	0.07%

注:根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定,本基金业绩比较基准=沪深300指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。

本基金权益类证券投资部分、固定收益类证券投资部分的业绩比较基准分别采用具有代表性的沪深300指数和中债综合指数。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理,1日收益率(benchmarkt)按下列公式计算:

benchmarkt = 80%* [沪深300指数t/(沪深300指数t-1)-1] +20%* [中债综合指数t/(中债综合指数t-1)-1];

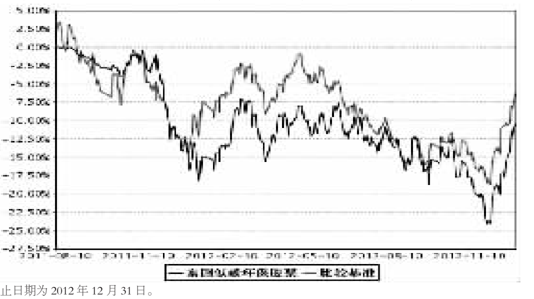
其中,t=1,2,3,···, T,T表示时间截至日;

期间T日收益率(benchmarkT)按下列公式计算:

benchmarkT =[∏Tt=1(1+benchmarkt)]-1

其中,T=2,3,4,···; ∏Tt=1(1+benchmarkt)表示t日至T日的(1+benchmarkt)数学连乘。

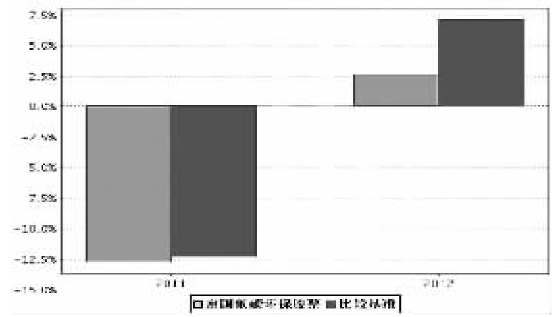
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.截止日期为2012年12月31日。

2.本基金于2011年8月10日成立。本基金建仓期6个月,即从2011年8月10日起至2012年2月9日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.3自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金于2011年8月10日成立,2011年净值增长率数据按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2012年	—	—	—	—	—
2011年	—	—	—	—	—
2010年	—	—	—	—	—
合计	—	—	—	—	—

注:基金自2011年8月10日(基金合同生效日)至2012年12月31日未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

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。截止2012年12月31日,本基金管理人共管理汉盛证券投资基金、汉兴证券投资基金、富国天源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、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、富国天博创新主题股票型证券投资基金、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、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股票型证券投资基金、富国汇利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、富国天盈分级债券型证券投资基金、富国全球顶级消费品股票型证券投资基金、富国低碳环保股票型证券投资基金、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、富国高新技术产业股票型证券投资基金、富国中国中小盘(香港上市)股票型证券投资基金、富国7天理财宝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、富国强收益定期开放债券型证券投资基金三十二只证券投资基金。

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		
李晓铭	本基金基金经理兼任富国天源平衡混合型证券投资基金基金经理	2011-08-10	—	8年	硕士,曾任华富基金管理有限公司研究员,2006年4月至2009年10月任富国基金管理有限公司行业研究部行业研究员,富国天博创新主题股票型证券投资基金基金经理助理,2009年10月至今任富国天源基金经理,2011年8月起任富国低碳环保股票型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格,中国国籍。

注:上述表格内基金经理的任职日期、离任日期均指公司作出决定并公告披露之日。

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低碳环保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》、《富国低碳环保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,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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度和控制方法

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。

4.3.2公平交易制度的执行情况

本报告期,在同向交易价差分析方面,公司采集连续四个季度,不同时间窗口(日内、3日内、5日内)的同向交易样本,在假设同向交易价差为零及95%的置信水平下,对同向交易价差进行t分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

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。

4.3.3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 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

2012年,在欧债危机以及财政悬崖的外围影响下,国内经济增速先抑后扬。A股市场整体波动幅度相对过去几年缩窄,整体走势与经济走势基本匹配,市场存在结构性机会,主要集中在业绩增长确定性高的行业中,临近年底,投资者对经济预期开始积极,同时资金面相对稳定,股票市场整体性上扬,以估值恢复为主。

本基金在2012年配置相对均衡,未能放大结构性机会的收益,在年末整体性上扬市场中获得一定超额收益。

对于低碳环保类股票,一度受到的估值冲击而有较大的下跌,本基金重点在估值合理并且竞争力强大的公司上进行个股配置,主要集中在尾气排放、固废处理以及水处理行业。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2012年12月31日,本基金份额净值为0.896元,份额累计净值为0.896元。报告期内,本基金份额净值增长率为2.63%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013年,伴随城镇化的推进和收入分配制度的完善,本基金认为国内经济温和复苏,企业盈利增速逐步恢复,通胀维持在适度的水平。对应A股市场,伴随经济复苏,投资人的信心在逐步恢复,A股的投资价值在逐步体现,同时外围资金有进入A股市场的倾向。因此本基金认为2013年不乏投资机会,主要集中在估值修复、城镇化以及诸如环保军工等主题性机会。

本基金在2013年,将根据经济情势的变化以及投资人的心理预期变化,进行积极的行业轮动投资,同时仍然一如既往寻找竞争力强大的公司坚定持有。

在低碳环保主体方面,本基金认为,伴随经济发展,环境问题逐步成为民生焦点话题,本基金将在环保方面加大主题配置,分享环保行业的快速增长。

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

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况,2012年报告期末本基金未满足收益分配条件,故不进行收益分配。

§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

托管人声明,在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

招商银行股份有限公司
2013年3月22日

§6 审计报告

本基金审计的注册会计师出具的是无保留意见的审计报告。

投资者可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:富国低碳环保股票型证券投资基金

报告截止日:2012年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末(2012年12月31日)	上年度末(2011年12月31日)
资 产:		
银行存款	26,597,864.27	171,205,009.13
结算备付金	1,831,257.62	2,708,638.74
存出保证金	—	—
交易性金融资产	494,467,906.69	466,490,580.69
其中:股票投资	494,467,906.69	466,490,580.69
基金投资	—	—
债券投资	—	—
资产支持证券投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	11,579,297.34	6,974,853.20
应收利息	10,079.12	38,514.26
应收股利	—	—
应收申购款	91,676.10	40,406.46
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	534,578,081.14	647,458,002.48
负债和所有者权益	本期末(2012年12月31日)	上年度末(2011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	—	—
应付证券清算款	—	—
应付赎回款	988,746.42	577,921.89
应付管理人报酬	608,505.04	895,856.24
应付托管费	101,417.49	149,309.40
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	864,325.57	569,866.34
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	363,726.36	182,178.02
负债合计	2,926,720.88	2,375,131.89
所有者权益:		
实收基金	593,063,044.75	739,306,708.61
未分配利润	-61,411,684.49	-94,223,838.02
所有者权益合计	531,651,360.26	645,082,870.59
负债和所有者权益总计	534,578,081.14	647,458,002.48

注:(1) 报告截止日2012年12月31日,基金份额净值0.896元,基金份额总额593,063,044.75份。

(2) 本基金合同于2011年8月10日生效,上年度可比期间自2011年8月10日至2011年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:富国低碳环保股票型证券投资基金

本报告期:2012年01月01日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期(2012年01月01日至2012年12月31日)	上年度可比期间(2011年08月10日(基金合同生效日)至2011年12月31日)
一、收入	33,455,731.05	-99,985,975.63
1.利息收入	462,432.48	1,905,135.28
其中:存款利息收入	444,419.82	1,686,462.48
债券利息收入	—	—
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	18,012.66	218,672.80
其他利息收入	—	—
2.投资收益(损失以"-"填列)	-63,168,174.09	-42,136,542.02
其中:股票投资收益	-67,269,485.79	-42,253,937.60
基金投资收益	—	—
债券投资收益	—	—
资产支持证券投资收益	—	—
衍生工具投资收益	—	—
股利收益	4,101,311.70	117,395.58
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	95,960,989.52	-60,121,852.08
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	—	—
5.其他收入(损失以"-"号填列)	200,483.14	367,283.19
减:二、费用	18,198,492.84	7,681,495.77
1. 管理人报酬	8,366,371.25	5,234,968.57
2. 托管费	1,394,395.16	872,494.80
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	8,053,815.08	1,389,627.92
5. 利息支出	—	—
其中:卖出回购金融资产支出	—	—
6. 其他费用	383,911.35	184,404.48
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	15,257,238.21	-107,667,471.40
减:所得税费用	—	—
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	15,257,238.21	-107,667,471.40

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:富国低碳环保股票型证券投资基金

本报告期:2012年01月01日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期(2012年01月01日至2012年12月31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)	739,306,708.61	-94,223,838.02	645,082,870.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	15,257,238.21	15,257,238.21
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)	-146,243,663.86	17,554,915.32	-128,688,748.54
其中:1.基金申购款	36,731,588.28	-5,041,583.09	31,690,005.19
2.基金赎回款	-182,975,252.14	22,596,498.41	-160,378,753.73
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)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	593,063,044.75	-61,411,684.49	531,651,360.26

项目	上年度可比期间(2011年08月10日(基金合同生效日)至2011年12月31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)	1,039,738,758.28	—	1,039,738,758.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-107,667,471.40	-107,667,471.40
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)	-300,432,049.67	13,443,633.38	-286,988,416.29
其中:1.基金申购款	7,178,639.66	-342,245.21	6,836,394.45
2.基金赎回款	-307,610,689.33	13,785,878.59	-293,824,810.74
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)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	739,306,708.61	-94,223,838.02	645,082,870.59

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署;

窦玉明	林志松	雷青松
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报告相一致。

7.4.2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。

7.4.3关联方关系

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
申银万国证券股份有限公司("申银万国")	基金管理人的股东、基金代销机构
山东省国际信托有限公司	基金管理人的股东
蒙特利尔银行	基金管理人的股东
招商银行股份有限公司("招商银行")	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。

7.4.4本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期(2012年01月01日至2012年12月31日)		上年度可比期间(2011年08月10日(基金合同生效日)至2011年12月31日)	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
申银万国	955,222,788.28	17.99	104,387,480.81	9.53

7.4.4.1.2 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的权证交易。

7.4.4.1.3 债券交易

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的债券交易。

7.4.4.1.4 回购交易

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的回购交易。

7.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期(2012年01月01日至2012年12月31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(%)
申银万国	810,405.40	17.85	225,159.53	26.05

关联方名称	上年度可比期间(2011年08月10日(基金合同生效日)至2011年12月31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(%)
申银万国	84,815.18	9.29	24,584.59	4.32

注:上述佣金按市场佣金率计算,扣除由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。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期(2012年01月01日至2012年12月31日)	上年度可比期间(2011年08月10日(基金合同生效日)至2011年12月31日)
当期发生的基金应支付的管理费	8,366,371.25	5,234,968.57
其中:支付销售机构的客户维护费	3,710,275.58	2,022,327.53

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.50%/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

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。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期(2012年01月01日至2012年12月31日)	上年度可比期间(2011年08月10日(基金合同生效日)至2011年12月31日)
当期发生的基金应支付的托管费	1,394,395.16	872,494.80

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

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。

7.4.4.3 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均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.4.4.2 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于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.4.5 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(2012年01月01日至2012年12月31日)		上年度可比期间(2011年08月10日(基金合同生效日)至2011年12月31日)	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	26,597,864.27	409,219.59	171,205,009.13	1,676,899.35

7.4.4.6 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的证券。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

7.4.5期末(2012年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.5.2 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股票。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

注:截至本报告期末2012年12月31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。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2012年12月31日止,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.6有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	494,467,906.69	92.50
	其中:股票	494,467,906.69	92.50
2	固定收益投资	—	—
	其中:债券	—	—
	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	28,429,121.89	5.32
6	其他各项资产	11,681,052.56	2.19
7	合计	534,578,081.14	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采掘业	13,026,172.50	2.45
C	制造业	280,612,091.60	52.78
C0	食品、饮料	—	—
C1	纺织、服装、皮毛	—	—
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	—	—
C4	石油、化学、塑胶、塑料	—	—
C5	电子	53,151,636.05	10.00
C6	金属、非金属	47,743,811.50	8.98
C7	机械、设备、仪表	160,626,545.45	30.21
C8	医药、生物制品	19,090,098.60	3.59
C99	其他制造业	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	—	—
E	建筑业	27,186,855.06	5.11
F	交通运输、仓储业	—	—
G	信息技术业	75,564,556.99	14.21
H	批发和零售贸易	55,267,097.54	10.40
I	金融、保险业	—	—
J	房地产业	28,451,559.00	5.35
K	社会服务业	14,359,574.00	2.70
L	传播与文化产业	—	—
M	综合类	—	—
	合计	494,467,906.69	93.01

8.3 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600694	大商股份	1,450,102	51,145,097.54	9.62
2	002153	石基信息	1,560,000	33,883,200.00	6.37
3	000625	长安汽车	5,000,000	33,250,000.00	6.25
4	000581	威孚高科	900,000	28,710,000.00	5.40
5	600060	海信电器	2,499,994	25,274,939.34	4.75
6	600031	三一重工	1,400,000	14,826,000.00	2.79
7	000671	阳光城	945,778	14,659,559.00	2.76
8	002482	广田股份	700,000	14,455,000.00	2.72
9	300124	汇川技术	580,000	13,891,000.00	2.61
10	600208	新湖中宝	3,200,000	13,792,000.00	2.59

注: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年度报告正文

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600060	海信电器	146,955,996.43	22.78
2	601318	中国平安	115,582,175.50	17.92
3	600048	保利地产	84,336,425.24	13.07
4	600694	大商股份	80,726,941.27	12.51
5	601808	中海油服	74,537,445.88	11.55
6	002153	石基信息	62,235,384.77	9.65
7	002028	思源电气	50,851,583.45	7.88
8	601601	中国太保	45,231,711.36	7.01
9	000625	长安汽车	42,443,442.13	6.58
10	000651	格力电器	37,540,435.10	5.82
11	600858	银座股份	36,018,855.38	5.58
12	601699	潞安环能	35,705,655.73	5.54
13	600893	航空动力	35,421,415.37	5.49
14	300300	汉鼎股份	33,310,916.41	5.16
15	600549	厦门钨业	30,922,698.47	4.79
16	002482	广田股份	30,500,712.51	4.73
17	002230	科大讯飞	30,458,026.93	4.72
18	000933	神火股份	30,147,735.56	4.67
19	000581	威孚高科	27,582,235.78	4.28
20	002583	海能达	26,423,823.14	4.10
21	600547	山东黄金	26,092,864.19	4.04
22	002024	苏宁电器	24,541,731.87	3.80
23	000024	招商地产	24,193,299.09	3.75
24	600031	三一重工	24,039,944.79	3.73
25	000725	京东方A	23,888,747.47	3.70
26	600570	恒生电子	23,825,639.74	3.69
27	600521	华海药业	23,674,419.93	3.67
28	601866	中海集运	22,645,010.91	3.51
29	300188	美亚柏科	21,921,702.83	3.40
30	300090	盛运股份	21,236,753.31	3.29
31	600276	恒瑞医药	21,230,069.51	3.29
32	000157	中联重科	20,493,454.70	3.18
33	300070	碧水源	20,334,062.80	3.15
34	300027	华谊兄弟	20,133,913.19	3.12
35	600703	三安光电	19,795,723.51	3.07
36	600315	上海家化	19,428,296.34	3.01
37	002185	华天科技	19,384,937.87	3.01
38	000501	鄂武商A	19,188,680.77	2.97
39	600208	新湖中宝	19,075,481.81	2.96
40	300190	维尔利	19,005,769.78	2.95
41	000718	苏宁环球	18,827,431.27	2.92
42	600778	友好集团	18,640,039.27	2.89
43	300079	数码视讯	18,579,567.02	2.88
44	002422	科伦药业	18,423,141.79	2.86
45	600720	祁连山	17,797,532.25	2.76
46	600481	双良节能	17,796,091.61	2.76
47	600395	盘江股份	17,486,482.07	2.71
48	002309	中利科技	17,295,194.71	2.68
49	000750	国海证券	17,214,582.63	2.67
50	000826	桑德环境	17,044,419.47	2.64
51	601238	广汽集团	16,757,785.88	2.60
52	300339	润和软件	16,316,608.36	2.53
53	000807	云铝股份	16,297,787.94	2.53
54	002385	大北农	15,379,646.46	2.38
55	600406	国电南瑞	15,316,789.75	2.37
56	300187	永清环保	15,311,023.07	2.37
57	002271	东方雨虹	15,228,571.90	2.36
58	000671	阳光城	15,150,396.33	2.35
59	600348	阳泉煤业	15,020,891.22	2.33
60	600104	上汽集团	14,921,483.72	2.31
61	300124	汇川技术	14,242,092.79	2.21
62	000878	云南铜业	14,211,520.03	2.20
63	600111	包钢稀土	14,030,445.57	2.17
64	300156	天立环保	13,872,351.21	2.15
65	000423	东阿阿胶	13,334,448.99	2.07
66	002340	格林美	13,234,008.47	2.05

8.4.2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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601808	中海油服	130,647,466.06	20.25
2	600060	海信电器	124,474,084.01	19.30
3	601318	中国平安	111,115,294.19	17.22
4	600048	保利地产	89,989,853.06	13.95
5	002583	海能达	59,041,735.76	9.15
6	000581	威孚高科	54,159,367.74	8.40
7	002028	思源电气	50,983,437.05	7.90
8	601601	中国太保	44,969,459.63	6.97
9	000651	格力电器	38,785,408.09	6.01
10	600015	华夏银行	35,614,544.17	5.52
11	300300	汉鼎股份	35,456,036.38	5.50
12	600694	大商股份	35,345,381.09	5.48
13	601699	潞安环能	33,523,738.77	5.20
14	600549	厦门钨业	33,294,675.42	5.16
15	600858	银座股份	33,137,532.41	5.14
16	600893	航空动力	31,833,157.35	4.93
17	002230	科大讯飞	30,192,184.01	4.68
18	002153	石基信息	28,546,105.64	4.43
19	600547	山东黄金	27,903,536.86	4.33
20	000024	招商地产	27,760,800.75	4.30
21	000933	神火股份	27,511,479.38	4.26
22	600585	海螺水泥	25,088,161.48	3.89
23	600315	上海家化	24,604,026.89	3.81
24	002340	格林美	24,449,910.09	3.79
25	600521	华海药业	24,273,214.42	3.76
26	002024	苏宁电器	23,548,435.89	3.65
27	300188	美亚柏科	23,263,563.89	3.61
28	000939	凯迪电力	22,649,077.06	3.51
29	600276	恒瑞医药	22,487,913.41	3.49
30	601866	中海集运	22,359,739.80	3.47
31	300124	汇川技术	21,985,467.33	3.41
32	000625	长安汽车	21,595,365.53	3.35
33	600395	盘江股份	21,343,480.04	3.31
34	000656	金科股份	20,662,934.35	3.20
35	002482	广田股份	19,697,633.04	3.05
36	002353	杰瑞股份	19,260,141.17	2.99
37	000157	中联重科	19,167,861.55	2.97
38	600703	三安光电	18,963,277.05	2.94
39	000718	苏宁环球	18,937,495.74	2.94
40	002309	中利科技	18,791,792.93	2.91
41	002185	华天科技	18,593,423.46	2.88
42	300190	维尔利	18,581,521.01	2.88
43	300070	碧水源	18,580,844.45	2.88
44	300253	卫宁软件	18,350,767.00	2.84
45	601166	兴业银行	18,331,157.20	2.84
46	600720	祁连山	18,329,858.16	2.84
47	000750	国海证券	18,269,390.96	2.83
48	600481	双良节能	17,576,177.26	2.72
49	600778	友好集团	17,566,528.43	2.72
50	000826	桑德环境	17,317,179.92	2.68
51	300027	华谊兄弟	17,100,719.99	2.65
52	600077	宋都股份	17,053,554.47	2.64
53	300339	润和软件	16,528,169.95	2.56
54	600348	阳泉煤业	16,116,241.87	2.50
55	002385	大北农	16,088,963.22	2.49
56	002422	科伦药业	15,964,404.69	2.47
57	600570	恒生电子	15,873,567.35	2.46
58	600104	上汽集团	15,854,351.32	2.46
59	600406	国电南瑞	15,194,133.05	2.36
60	000501	鄂武商A	15,139,276.27	2.35
61	300187	永清环保	14,252,078.98	2.21
62	300156	天立环保	13,626,022.30	2.11
63	601238	广汽集团	13,189,432.64	2.04
64	600166	福田汽车	13,154,592.98	2.04
65	600000	浦发银行	12,971,250.96	2.01

8.4.3买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	2,654,804,823.31
卖出股票收入(成交)总额	2,655,519,001.04

注:"买入股票成本(成交)总额" 和"卖出股票收入(成交)总额"按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

8.6 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

注:本基金本报告期末未持有债券资产。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1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。

8.9.2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。

8.9.3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	—
2	应收证券清算款	11,579,297.34
3	应收股利	—
4	应收利息	10,079.12
5	应收申购款	91,676.10
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	11,681,052.56

8.9.4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。

8.9.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.9.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

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(%)
7122	83,271.98	68,446,291.61	11.54	524,616,753.14	88.46

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	642,310.55	0.1083

注:1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

2、本基金的基金经理持有本基金份额总量为50万份至100万份。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2011年08月10日)基金份额总额	1,039,738,758.28
报告期期初基金份额总额	739,306,708.61
本报告期基金总申购份额	36,731,588.28
减:本报告期基金总赎回份额	182,975,252.14
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	593,063,044.75

注:总申购份额含红利再投、转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

本报告期,基金管理人经中国证监会核准聘任范伟隽先生担任公司督察长,李长伟先生不再担任公司督察长。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

11.5 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,本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所的报酬为6万元人民币,其已为本基金管理人提供审计服务的连续年限为10年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 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(%)	
长城证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
广发证券	2	453,133,644.81	8.53	—	—	—	—	—	—	381,794.12	8.41	—
国金证券	2	1,175,359,833.65	22.14	—	—	—	—	—	—	1,000,372.85	22.03	—
国泰君安	1	29,448,539.12	0.55	—	—	—	—	—	—	26,809.73	0.59	—
华泰证券	1	15,707,590.03	0.30	—	—	—	—	—	—	14,300.23	0.31	—
申银万国	1	955,222,788.28	17.99	—	—	—	—	—	—	810,405.40	17.85	—
中金公司	1	266,727,171.29	5.02	—	—	—	—	—	—	231,755.48	5.10	—
中投证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中信建投	1	787,799,648.16	14.84	—	—	—	—	—	—	681,226.84	15.00	—
中信万通	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中信证券	2	1,387,187,699.52	26.12	—	—	—	—	—	—	1,188,352.37	26.17	—
中银国际	1	239,325,069.49	4.51	—	—	—	—	—	—	205,743.39	4.53	—

注: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。本报告期内本基金租用券商交易单元无变更。