富国低碳环保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:招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。

基金托管人招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:000158
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
报告期末基金份额总额(单位:份)	456,942,137.40
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。
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

§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	3,846,967.41
2.本期利润	87,395,237.05
3.加权平均基金份额本期利润	0.1512
4.期末基金资产净值	512,243,556.89
5.期末基金份额净值	1.121

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	15.69%	1.32%	7.40%	1.15%	8.29%	0.17%

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8月10日成立,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。

§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		
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	-	9年	硕士,曾任华富基金管理有限公司行业研究员,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。

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,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5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

2013年3季度,宏观经济增速平稳,市场预期起伏不大,指数平稳上行,结构继续分化。成长风格继续领涨市场,但是已经出现过度乐观的倾向。本基金在3季度适度的平衡了风格配置,力图规避显著的泡沫风险,同时关注业绩稳定估值合理的公司。在低碳环保方面,本基金主要配置汽车尾气处理、大气处理、固废处理领域的具有竞争力,估值合理的公司。

未来一个季度,本基金将密切关注宏观经济和政策的最新变化以及各个行业的竞争格局变化,适时调整组合适应市场。

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15.69%,业绩比较基准收益率为7.40%。

§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	468,778,425.62	88.28
	其中:股票	468,778,425.62	88.28
2	固定收益投资	19,974,000.00	3.76
	其中:债券	19,974,000.00	3.76
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	15,000,000.00	2.82
	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	26,601,617.97	5.01
6	其他资产	667,128.41	0.13
7	合计	531,021,172.00	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	11,122,776.36	2.17
B	采矿业	-	-
C	制造业	248,043,743.87	48.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,121,241.80	5.88
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	51,444,000.00	10.04
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,219,201.22	6.68
J	金融业	5,778,000.00	1.13
K	房地产业	64,653,982.66	12.62
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	6,512,000.00	1.27
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	16,883,479.71	3.30
S	综合	-	-
	合计	468,778,425.62	91.51

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	600694	大商股份	1,200,000	35,064,000.00	6.85
2	000581	威孚高科	1,300,000	30,667,000.00	5.99
3	600887	伊利股份	600,000	26,808,000.00	5.23
4	600309	万华化学	1,600,000	26,000,000.00	5.08
5	002153	石基信息	580,000	22,040,000.00	4.30
6	002223	鱼跃医疗	745,274	19,049,203.44	3.72
7	300133	华策影视	416,979	16,883,479.71	3.30
8	600048	保利地产	1,685,377	16,651,524.76	3.25
9	600858	银座股份	2,000,000	16,380,000.00	3.20
10	300124	汇川技术	320,000	15,958,400.00	3.12

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	19,974,000.00	3.90
	其中:政策性金融债	19,974,000.00	3.90
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	19,974,000.00	3.90

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	130236	13国开36	200,000	19,974,000.00	3.90

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。

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	440,755.26
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	86,419.45
5	应收申购款	139,953.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	667,128.41

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	718,510,402.10
报告期期间基金总申购份额	37,567,167.63
减:报告期期间基金总赎回份额	299,135,432.33
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	456,942,137.40

§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低碳环保股票型证券投资基金的文件

2、富国低碳环保股票型证券投资基金基金合同

3、富国低碳环保股票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、富国低碳环保股票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

富国强收益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日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国强收益定期开放债券	
基金主代码	100070	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年12月18日	
报告期末基金份额总额(单位:份)	694,696,020.05	
投资目标	本基金投资目标是在追求本金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的稳定收益。	
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、信用风险控制、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。	
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率(税后)+0.5%	
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	
下属两级基金的基金简称	富国强收益A	富国强收益C
下属两级基金的交易代码	100070	100071
报告期末下属两级基金的份额总额(单位:份)	385,803,153.80	308,892,866.25

§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	A级 报告期(2013年07月01日-2013年09月30日)	C级 报告期(2013年07月01日-2013年09月30日)
1.本期已实现收益	5,802,939.56	4,738,184.03
2.本期利润	-305,149.26	-752,909.57
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0008	-0.0021
4.期末基金资产净值	400,632,359.43	319,478,656.58
5.期末基金份额净值	1.038	1.034

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

(1)A级

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	-0.10%	0.07%	0.89%	0.01%	-0.99%	0.06%

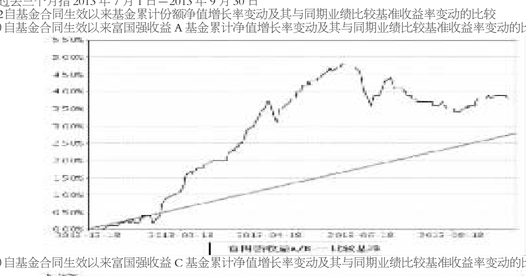
(2)C级

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%	0.89%	0.01%	-1.08%	0.06%

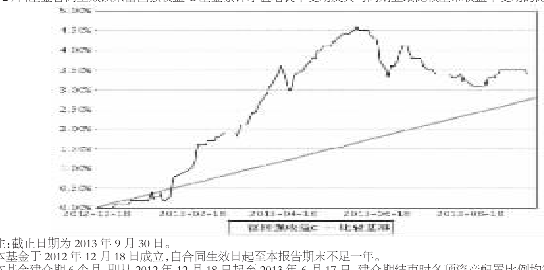
注:过去三个月指2013年7月1日—2013年9月30日

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

(1)自基金合同生效以来富国强收益A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



(2)自基金合同生效以来富国强收益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:截止日期为2013年9月30日。

本基金于2012年12月18日成立,自合同生效日起至本报告期末不足一年。

本基金建仓期6个月,即从2012年12月18日起至2013年6月17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		
冯彬	本基金基金经理兼任富国7天理财宝债券型证券投资基金基金经理、富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理、富国信用增强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基金经理	2012-12-18	-	6年	硕士,曾任平安证券有限责任公司债券交易员;光大证券股份有限公司债券投资经理;2012年7月至2012年11月任富国基金管理有限公司基金经理助理,2012年11月起任富国7天理财宝债券型证券投资基金基金经理,2012年12月起任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基金经理,2013年5月起任富国信用增强债券型证券投资基金基金经理,2013年9月起任富国国有企业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。

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强收益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》、《富国强收益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年一季度国内经济小幅回升,投资出口等数据都较强劲,但CPI仍维持在较低位置。央行在公开市场上持续采用正回购方式调节流动性。货币政策总体较为宽松,加上一季度外汇占款增长较快,银行间资金面呈现宽松格局。但2月末时资金出现小幅紧张。企业债、中票、短融等收益率总体下行为主,但季度中间时收益有所波动。

本季度,基金管理人坚持严格按照基金合同进行投资管理,在利率下行的环境中,维持较高的债券仓位水平。杠杆率从建仓初期上升到约180%的目标水平,且杠杆部分以1到2年期限债券为主,组合内债券的期限分布也较均衡,有效降低了组合波动率。

展望2013年,宏观经济的复苏仍将缓慢,通货膨胀也将在较低水平,债券供给压力可控,整体环境仍将有利于债市。投资的操作仍以较高仓位为主,等待票息积累,同时根据信用状况变化进行个券替换,优化组合,降低组合风险。

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A/B级-0.10%、C级-0.19%;业绩比较基准收益率A/B级0.89%、C级0.89%。

§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	1,286,006,748.72	96.03
	其中:债券	1,256,996,578.86	93.86
	资产支持证券	29,010,169.86	2.17
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	13,701,297.07	1.02
6	其他资产	39,526,657.72	2.95
7	合计	1,339,234,703.51	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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,053,440,089.68	146.29
5	企业短期融资券	130,728,000.00	18.15
6	中期票据	69,829,000.00	9.70
7	可转债	-	-
8	中小企业私募债	2,999,489.18	0.42
9	其他	-	-
10	合计	1,256,996,578.86	174.56

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	122033	09富力债	771,910	78,657,629.00	10.92
2	122904	10长城投	700,000	70,665,000.00	9.81
3	041358003	13广汇汽车CP001	700,000	70,336,000.00	9.77
4	1080026	10广州建投债	600,000	59,652,000.00	8.28
5	122866	10杭交投	500,000	50,400,000.00	7.00

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	119023	侨城01	290,000	29,010,169.86	4.03

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	52,935.48
2	应收证券清算款	330,832.25
3	应收股利	-
4	应收利息	39,142,889.99
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,526,657.72

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

项目	A级	C级
报告期期初基金份额总额	403,156,415.45	368,729,206.87
报告期期间基金总申购份额	261,713.55	453,140.09
减:报告期期间基金总赎回份额	17,614,975.20	60,289,480.71
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	385,803,153.80	308,892,866.25

§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强收益定期开放债券型证券投资基金的文件

2、富国强收益定期开放债券型证券投资基金基金合同

3、富国强收益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、富国强收益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

富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)

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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月21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	富国中证500指数增强(LOF)(场内简称:富国500)
基金主代码	161017
交易代码	前端交易代码:161017 后端交易代码:161021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年10月12日
报告期末基金份额总额(单位:份)	152,032,816.21
投资目标	本基金为增强型股票指数基金,在力求对中证500指数进行有效跟踪的基础上,通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制,力争实现超越目标指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以"指数化投资为主、主动性投资为辅",在复制目标指数的基础上一定程度地调整个股,力求投资收益能够跟踪并适度超越目标指数。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准=95%×中证500指数收益率+1%(指年收益率,评价时按期间折算)。
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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	5,326,334.44
2.本期利润	28,784,576.38
3.加权平均基金份额本期利润	0.1626
4.期末基金资产净值	161,432,730.74
5.期末基金份额净值	1.062

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。

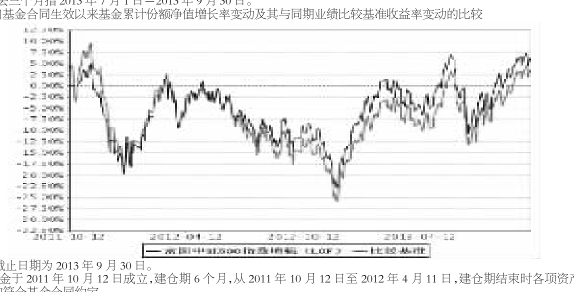
3.2 富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)净值表现

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	17.22%	1.30%	18.95%	1.31%	-1.73%	-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:1.截止日期为2013年9月30日。

2.本基金于2011年10月12日成立,建仓期6个月,从2011年10月12日至2012年4月11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		
李笑薇	本基金基金经理兼任公司总经理助理、量化与海外投资部总经理、富国沪深300增强证券投资基金基金经理	2011-10-12	-	11年	博士,曾任摩根士丹利资本国际Barra公司(MSCIBARRA),BARRA股票风险评估部高级研究员;巴克莱国际投资管理公司(BarclaysGlobal Investors),大中华主动股票投资总监、高级基金经理及高级研究员;2009年6月加入富国基金管理有限公司,2011年1月至2012年5月任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基金经理,2009年12月至今任富国沪深300增强证券投资基金基金经理,2011年10月至今任富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理;兼任富国基金公司总经理助理、量化与海外投资部总经理;具有中国基金从业资格,美国国籍。
徐幼华	本基金基金经理兼任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理	2011-10-12	-	9年	硕士,曾任上海京华创业投资有限公司投资经理助理;2006年7月至2008年12月任富国基金管理有限公司金融工程部数量研究员,2009年1月至2011年5月任富国基金管理有限公司另类投资部数量研究员、基金经理助理,2011年5月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理,2011年10月起任富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)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中证500指数增强型证券投资基金(LOF)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》、《富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)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

回顾2013年三季度,全球制造业复苏加速推动经济回升,汇丰9月PMI指数创下6个月来新高,并且呈现加速上升态势,国内经济企稳回升信号得到进一步确认。投资者普遍认为中国经济正在回暖,并且纷纷上调了三季度经济增长的预期。资本市场也做出了积极的回应,三季度市场呈现上行走势,整个季度中证500指数上涨19.68%。

在投资管理上,我们坚持采取量化策略进行指数增强和风险管理,报告期内,本基金的超额收益为-1.47%。本基金在报告期内遇到多次申购赎回,在一定程度上增加了本基金的交易成本。

展望2013年四季度,国内经济将继续温和复苏,地方融资平台审计报告,以及美联储QE退出政策的走向可能会给市场带来一定的下行风险。综合来看,四季度市场可能呈现震荡走势。

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17.22%,业绩比较基准收益率为18.95%。

§5 富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)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	153,139,195.88	93.94
	其中:股票	153,139,195.88	93.94
2	固定收益投资	76,307.36	0.05
	其中:债券	76,307.36	0.05
	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	9,614,339.92	5.90
6	其他资产	188,216.56	0.12
7	合计	163,018,059.72	100.00

5.2 报告期末积极投资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	7,476.00	0.00
B	采矿业	1,087,148.00	0.67
C	制造业	21,488,307.14	13.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,220.68	0.00
E	建筑业	946,065.10	0.59
F	批发和零售业	1,667,972.68	1.03
G	交通运输、仓储和邮政业	14,094.00	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	335,148.86	0.21
J	金融业	693,832.00	0.43
K	房地产业	1,364,008.00	0.84
L	租赁和商务服务业	150,265.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	153,700.00	0.10
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	27,910,237.46	17.29

5.3 报告期末指数投资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	1,030,872.50	0.64
B	采矿业	3,935,038.00	2.44
C	制造业	75,338,533.29	46.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,272,490.26	3.89
E	建筑业	1,537,742.06	0.95
F	批发和零售业	3,784,130.84	2.34
G	交通运输、仓储和邮政业	4,346,077.34	2.69
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,774,755.80	6.67
J	金融业	348,879.84	0.22
K	房地产业	10,268,711.29	6.36
L	租赁和商务服务业	2,006,377.00	1.24
M	科学研究和技术服务业	132,615.00	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	5,449,596.00	3.38
S	综合	3,139.20	0.00
	合计	125,228,958.42	77.57

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.4.1报告期末指数投资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	000932	华菱钢铁	1,264,600	2,301,572.00	1.43
2	000543	皖能电力	309,400	2,097,732.00	1.30
3	600737	中粮屯河	358,300	1,963,484.00	1.22
4	601339	百隆东方	208,300	1,845,538.00	1.14
5	600596	新安股份	133,000	1,775,550.00	1.10
6	000917	电广传媒	94,860	1,773,882.00	1.10
7	600161	天坛生物	91,000	1,760,850.00	1.09
8	000726	鲁 泰A	196,000	1,611,120.00	1.00
9	601000	唐山港	511,600	1,575,728.00	0.98
10	002230	科大讯飞	32,950	1,569,079.00	0.97

5.4.2报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	000725	京东方A	952,670	2,019,660.40	1.25
2	600252	中恒集团	104,200	1,557,790.00	0.96
3	600332	白云山	34,485	1,226,976.30	0.76
4	600459	贵研铂业	63,600	1,113,636.00	0.69
5	002023	海特高新	70,900	1,086,897.00	0.67

5.5 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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	76,307.36	0.05
8	其他	-	-
9	合计	76,307.36	0.05

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	110024	N隧道转	730	74,306.70	0.05
2	127001	海直转债	17	2,000.66	0.00

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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1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。

5.9.2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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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,本基金持有的皖能电力于2013年3月30日公告《关于财政部驻安徽省财政监察专员办事处对公司会计信息质量检查及整改情况的公告》,因该公司会计信息质量问题,财政部驻安徽省财政监察专员办事处向其送达《会计信息质量检查结论和处理决定》和《行政处罚决定书》。

皖能电力为本基金跟踪标的指数的样本股,基金管理人将密切跟踪相关进展,遵循以最低跟踪误差为主,以价值增强为辅的理念进行投资决策。

5.11.2 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。

本报告期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。

5.11.3 报告期末其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	99,404.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,877.23
5	应收申购款	86,935.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	188,216.56

5.11.4 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	127001	海直转债	2,000.66	0.00

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资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。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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	204,193,700.24
报告期期间基金总申购份额	8,914,450.39
减:报告期期间基金总赎回份额	61,075,334.42
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	152,032,816.21

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

注:本报告期间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中证500指数增强型证券投资基金(LOF)的文件

2、富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同

3、富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)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、富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)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