富国天合稳健优选股票型证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014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
报告送出日期： 2015年01月21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2015年1月19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2014年10月1日起至2014年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国天合稳健股票
基金主代码	100026
交易代码	前端交易代码：100026 后端交易代码：100027
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月15日
报告期末基金份额总额(单位：份)	2,192,919,508.16
投资目标	本基金主要采用"核心-卫星"总体策略，以优选并复制绩优基金重仓股为基石，有效综合基金管理人的主动投资管理能力，力争投资业绩实现基金行业平均水平之上的二次超越，谋求基金资产的长期最大化增值。
投资策略	本基金诉求"三重优化"概念，通过优选基金、（构建）优选指数，优选个股进行投资操作，将主动管理与被动跟踪有效结合，力争实现稳健投资业绩基础上的"二次超越"。
业绩比较基准	中信标普300指数×80%+中信国债指数×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，力争在稳健投资的基础上实现对基金业平均收益水平的超越，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	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(2014年10月01日-2014年12月31日)
1.本期已实现收益	245,254,694.16
2.本期利润	175,590,795.59
3.加权平均基金份额本期利润	0.0754
4.期末基金资产净值	2,783,553,551.71
5.期末基金份额净值	1.2693

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	6.11%	1.54%	31.71%	1.26%	-25.60%	0.28%

注：过去三个月指2014年10月1日—2014年12月31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2014年12月31日。

本基金于2006年11月15日成立，建仓期6个月，从2006年11月15日至2007年5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。

§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		
尚鹏岳	本基金基金经理兼任富国通胀通缩主题轮动股票型证券投资基金、富国研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2011-01-12	-	12年	硕士，曾任恒生电子股份有限公司软件工程师；汉唐证券研究所投资策略分析师、研究员；银河基金管理有限公司策略分析师、行业研究员、基金经理助理、基金经理；2010年5月至10月任富国基金管理有限公司高级营销策划经理；2010年10月起任富国通胀通缩主题轮动股票型证券投资基金基金经理；2011年1月起任富国天合稳健优选股票型证券投资基金基金经理；2014年12月起任、富国研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

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合稳健优选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》、《富国天合稳健优选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，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，实行事前监控、事中监控、事后评估及反馈的流程化控制。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 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度固定资产投资增速和居民消费价格指数继续下滑，货币政策从结构性放松转型总量放松。上证指数季度上涨36.84%，位居历史季度涨幅前列。钢铁、金融、交通运输、建材行业涨幅巨大，医药生物、食品饮料、轻工制造等行业基本没有收益。本季度基金股票投资维持高仓位，按计划加大了投资品种的覆盖广度，对2015年的投资方向进行了布局。过去10年资本市场结构性牛市特征显著，投资收益率超越实际通货膨胀水平具有一定的挑战性，但是投资收益率战胜指数基本没有难度。展望未来10年，我们看好A股市场的整体性投资机会，投资收益率战胜指数需要面临更大的挑战。我们将一如既往的做好风险管理，谨慎选择投资标的，回报持有人的重托和信任。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期，本基金净值增长率6.11%，同期业绩比较基准收益率为31.71%。

4.6 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 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	2,631,189,171.77	92.41
	其中：股票	2,631,189,171.77	92.41
2	固定收益投资	120,159,000.00	4.22
	其中：债券	120,159,000.00	4.22
	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	-	-
	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	54,099,180.44	1.90
7	其他资产	41,836,095.34	1.47
8	合计	2,847,283,447.55	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	-	-
B	采矿业	2,226.80	0.00
C	制造业	1,403,948,955.75	50.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	357.00	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	373,973,517.67	13.44
G	交通运输、仓储和邮政业	8,495.74	0.00
H	住宿和餐饮业	3,309,849.54	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	470,272,392.62	16.89
J	金融业	285,151,240.99	10.24
K	房地产业	202,615.54	0.01
L	租赁和商务服务业	59,440,383.96	2.14
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	34,879,136.16	1.25
S	综合	-	-
	合计	2,631,189,171.77	94.53

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	002024	苏宁云商	30,660,065	275,940,585.00	9.91
2	600570	恒生电子	4,883,450	267,417,722.00	9.61
3	002293	罗莱家纺	10,203,447	262,840,794.72	9.44
4	000712	锦龙股份	9,088,166	247,198,115.20	8.88
5	002215	诺普信	26,595,069	229,249,494.78	8.24
6	002223	鱼跃医疗	7,898,271	197,140,844.16	7.08
7	000581	威孚高科	5,855,313	157,098,047.79	5.64
8	002466	天齐锂业	2,923,678	113,627,354.42	4.08
9	600563	法拉电子	3,557,692	102,532,683.44	3.68
10	600993	马应龙	4,406,130	89,356,316.40	3.21

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	120,159,000.00	4.32
	其中：政策性金融债	120,159,000.00	4.32
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	120,159,000.00	4.32

5.5 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	140436	14农发36	500,000	50,065,000.00	1.80
2	140223	14国开23	400,000	40,052,000.00	1.44
3	140357	14进出57	300,000	30,042,000.00	1.08

5.6 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。

5.8 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。

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。

5.11.2 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。

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	461,683.66
2	应收证券清算款	37,753,210.88
3	应收股利	-
4	应收利息	2,182,751.45
5	应收申购款	1,438,449.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	41,836,095.34

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002466	天齐锂业	76,320,000.00	2.74	非公开发行股票

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	2,425,702,151.85
报告期期间基金总申购份额	366,517,719.92
减：报告期期间基金总赎回份额	599,300,363.61
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	2,192,919,508.16

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	-
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立富国天合稳健优选股票型证券投资基金的文件
2、富国天合稳健优选股票型证券投资基金基金合同
3、富国天合稳健优选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、富国天合稳健优选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
2015年01月21日

富国中证红利指数增强型证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014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： 中国工商银行股份有限公司
报告送出日期： 2015年01月21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2015年1月19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2014年10月1日起至2014年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国中证红利指数增强
基金主代码	100032
交易代码	前端交易代码：100032 后端交易代码：100033
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年11月20日
报告期末基金份额总额(单位：份)	368,859,620.65
投资目标	本基金为股票指数增强型基金，其在遵循"程序化指数投资、有限度个股调整、精细化风险管理"原则的基础上，实现对中证红利指数的有效跟踪并力争实现超越，分享中国经济长期增长所带来的收益。
投资策略	本基金将采用"指数化投资为主、主动性投资为辅"的投资策略，在完全复制目标指数的基础上有限度地调整个股，从而大限度降低由于交易成本造成的股票投资组合相对于目标指数的偏离，并力求投资收益能够有效跟踪并适度超越目标指数。
业绩比较基准	90%×中证红利指数收益率+10%×一年期银行储蓄存款利率(税后)
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。
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(2014年10月01日-2014年12月31日)
1.本期已实现收益	55,495,701.10
2.本期利润	126,882,970.72
3.加权平均基金份额本期利润	0.3099
4.期末基金资产净值	537,932,832.13
5.期末基金份额净值	1.458

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。

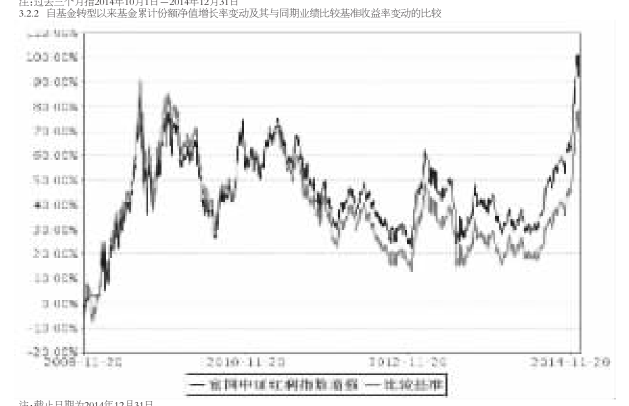
3.2 基金净值表现

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	28.12%	1.31%	27.84%	1.28%	0.28%	0.03%

注：过去三个月指2014年10月1日—2014年12月31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2014年12月31日。

本基金于2008年11月20日成立，建仓期6个月，即从2008年11月20日至2009年5月19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		
徐幼华	本基金基金经理兼任富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理	2011-05-13	-	10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。
方旻	本基金基金经理兼任富国沪深300增强证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金和富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理	2014-11-19	-	5年	硕士， 2010年2月至2014年4月任富国基金管理有限公司定量研究员；2014年4月至2014年11月任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金、富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理助理，2014年11月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金和富国中证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。

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红利指数增强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》、《富国中证红利指数增强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，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，实行事前监控、事中监控、事后评估及反馈的流程化控制。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 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾2014年四季度，A股单季大幅上涨超过35%，领跑全球主要股市，持续超预期的强劲表现。此轮牛市中，经济数据已经成为了一个被投资者所忽略的因素，市场大幅走强的主要的原因是由于改革的成果和流动性改善的乐观预期，以及投资者情绪的转折带来大类资产配置的迅速调整。杠杆类投资产品以及互联网的信息迅速扩散使得资金涌入市场速度大幅加快，促成了四季度市场如此快速迅猛地上涨。中证红利指数四季度整体上涨31.18%。

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，量化增强策略获得了较好的表现，报告期内，本基金的超额收益为0.38%。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2015年一季度，我们预计大类资产配置仍然会获取较大权益类资产收益，但是随着资产配置调整进入中后期，市场上涨幅度会较四季度有明显降低，指数的波动肯定会明显上升。需要密切关注经济数据持续不佳打击投资者情绪的风险，由杠杆带动及投资者行为高度一致的市场中，一旦出现调整，其幅度也会明显放大。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期，本基金净值增长率28.12%，同期业绩比较基准收益率为27.84%。

4.6 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 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	499,941,378.08	92.20
	其中：股票	499,941,378.08	92.20
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-	-
	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	28,550,077.65	5.27
7	其他资产	13,765,808.94	2.54
8	合计	542,257,264.67	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	785,565.00	0.15
B	采矿业	5,756,949.28	1.07
C	制造业	37,465,993.06	6.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,555,945.41	1.03
E	建筑业	886,366.00	0.16
F	批发和零售业	2,297,002.28	0.43
G	交通运输、仓储和邮政业	6,208,175.00	1.15
H	住宿和餐饮业	5,238.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	724,331.00	0.13
J	金融业	5,361,808.00	1.00
K	房地产业	4,499,112.60	0.84
L	租赁和商务服务业	371,316.00	0.07
M	科学研究和技术服务业	680,140.00	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	1,942,970.00	0.36
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	294,785.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	1,264,284.00	0.24
S	综合	-	-
	合计	74,099,980.63	13.77

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	-	-
B	采矿业	22,474,183.40	4.18
C	制造业	180,680,367.51	33.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	53,866,192.26	10.01
E	建筑业	17,738,162.64	3.30
F	批发和零售业	21,540,823.26	4.00
G	交通运输、仓储和邮政业	26,409,323.51	4.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,342,476.99	0.25
J	金融业	90,312,023.91	16.79
K	房地产业	11,477,843.97	2.13
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	-	-
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	425,841,397.45	79.16

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	600507	方大特钢	2,958,400	15,679,520.00	2.91
2	000987	广州友谊	533,000	10,793,250.00	2.01
3	600000	浦发银行	616,670	9,675,552.30	1.80
4	601288	农业银行	2,585,090	9,590,683.90	1.78
5	600036	招商银行	544,534	9,033,819.06	1.68
6	601006	大秦铁路	781,753	8,333,486.98	1.55
7	601800	中国交建	591,900	8,221,491.00	1.53
8	601988	中国银行	1,869,419	7,758,088.85	1.44
9	601939	建设银行	1,148,898	7,732,083.54	1.44
10	601009	南京银行	518,900	7,601,885.00	1.41

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	600188	兖州煤业	167,870	2,212,526.60	0.41
2	601872	招商轮船	226,400	1,424,056.00	0.26
3	600369	西南证券	57,400	1,279,446.00	0.24
4	000776	广发证券	49,200	1,276,740.00	0.24
5	000540	中天城投	106,400	1,253,392.00	0.23

5.5 报告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资产。

5.6 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券资产。

5.7 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。

5.9 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 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。

5.12.2 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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	41,841.00
2	应收证券清算款	13,005,948.13
3	应收股利	-
4	应收利息	8,698.34
5	应收申购款	709,321.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,765,808.94

5.12.4 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。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.12.5.1 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。

5.12.5.2 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。

5.12.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	438,360,097.22
报告期期间基金总申购份额	32,068,109.15
减：报告期期间基金总赎回份额	101,568,585.72
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	368,859,620.65

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	-
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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汉鼎证券投资基金的文件
2、汉鼎证券投资基金基金合同
3、汉鼎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、汉鼎证券投资基金财务报表及报表附注
6、中国证监会《关于核准汉鼎证券投资基金基金份额持有人大会有关转换基金运作方式决议的批复》
7、富国中证红利指数增强型证券投资基金基金合同
8、富国中证红利指数增强型证券投资基金托管协议
9、富国中证红利指数增强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
2015年01月21日

富国信用增强债券型证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014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： 中国工商银行股份有限公司
报告送出日期： 2015年01月21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2015年1月19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2014年10月1日起至2014年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国信用增强债券	
基金主代码	000107	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年05月21日	
报告期末基金份额总额	192,685,672.80	
投资目标	本基金以信用债券为主要投资对象，合理控制信用风险，在追求本金安全的基础上谨慎投资，力争实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金将采用自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置。在认真研判宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，根据整体资产配置策略动态调整大类金融资产的比例；在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上，根据类属资产配置策略对投资组合类属资产进行最优化配置和调整。	
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为：中证信用债指数	
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	
下属分级基金的基金简称	富国信用增强债券A/B	富国信用增强债券C
下属分级基金的交易代码	000107	000109
报告期末下属分级基金的份额总额(单位：份)	102,336,187.80	90,349,485.00

§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/B级 报告期(2014年10月01日-2014年12月31日)	C级 报告期(2014年10月01日-2014年12月31日)
1.本期已实现收益	8,884,615.43	12,755,162.38
2.本期利润	7,882,362.98	11,836,030.97
3.加权平均基金份额本期利润	0.0597	0.0641
4.期末基金资产净值	109,926,588.34	96,339,000.04
5.期末基金份额净值	1.074	1.066

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/B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	5.62%	0.31%	2.25%	0.16%	3.37%	0.15%

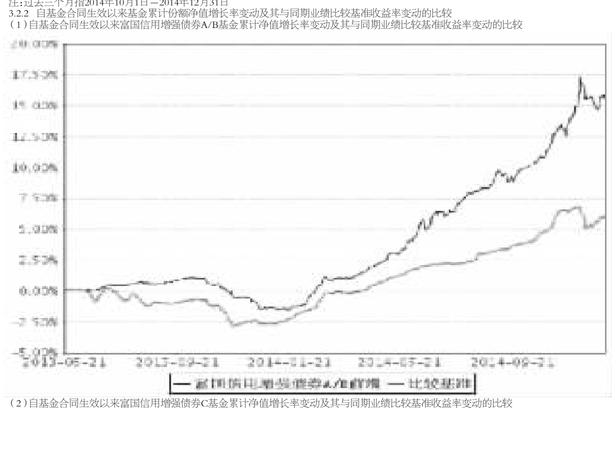
（2）C级

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	5.45%	0.31%	2.25%	0.16%	3.20%	0.15%

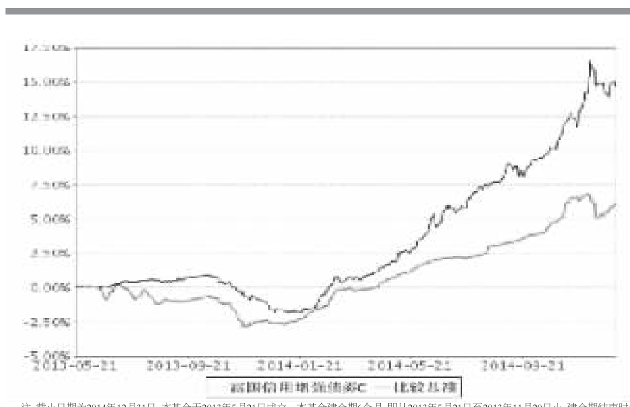
注：过去三个月指2014年10月1日—2014年12月31日

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信用增强债券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



（2）自基金合同生效以来富国信用增强债券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2014年12月31日，本基金于2013年5月21日成立。本基金建仓期6个月，即从2013年5月21日至2013年11月20日止，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		
张钫	本基金基金经理兼任富国优化增强债券型证券投资基金基金经理，富国天盈债券型证券投资基金(LOF)，富国产业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、富国新回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2014-10-25	-	6年	硕士，曾任华富基金管理有限公司债券研究员、基金经理助理、基金经理；自2014年3月至2014年7月在富国基金管理有限公司人力资源部工作，自2014年7月起在富国基金管理有限公司固定收益投资部工作，并自2014年7月起任富国天盈债券型证券投资基金(LOF)、富国产业债债券型证券投资基金、富国优化增强债券型证券投资基金基金经理，2014年10月起任富国国有企业债债券型证券投资基金和富国信用增强债券型证券投资基金基金经理，2014年11月起任富国新回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。
冯彬	本基金前任基金经理	2013-05-21	2014-10-25	7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月至2014年7月任富国7天理财宝债券型证券投资基金基金经理，2012年12月至2014年10月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月至2014年10月任富国信用增强债券型证券投资基金基金经理，2013年9月至2014年10月任富国国有企业债券型证券投资基金基金经理，2014年5月至2014年10月任富国富钱包货币市场基金基金经理和富国收益宝货币市场基金基金经理。具有基金从业资格。

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信用增强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》、《富国信用增强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，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，实行事前监控、事中监控、事后评估及反馈的流程化控制。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 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度债券收益率见底回升，基本面的利好因素在钝化，交易情绪主导市场，市场波动较大。转债市场行情上涨，为债券基金分享收益提供了机会。报告期内，本基金调整组合结构应对市场波动和赎回，获得相应回报。展望下一季度，政策取向在逐步转向宽信用，地产成交量能否持续并带动地产投资增长仍有待观察。四季度信用利差扩大后，收益率水平一定程度上隐含了上述基本面的预期。整体来看，债市收益率小幅波动的概率大，交易可以带来相对收益。权益市场的波动性加大，需要加强风险控制。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期，本基金A/B级份额净值增长率为5.62%，C级份额净值增长率为5.45%；A/B级同期业绩比较基准收益率为2.25%，C级同期业绩比较基准收益率为2.25%。

4.6 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 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	7,820,319.08	2.23
	其中：股票	7,820,319.08	2.23
2	固定收益投资	312,116,164.19	89.02
	其中：债券	302,241,682.00	86.20
	资产支持证券	9,874,482.19	2.82
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	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	22,386,835.75	6.38
7	其他资产	8,305,880.93	2.37
8	合计	350,629,199.95	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,629,919.08	2.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	2,190,400.00	1.06
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
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	7,820,319.08	3.79

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	002318	久立特材	150,091	4,484,719.08	2.17
2	600570	恒生电子	40,000	2,190,400.00	1.06
3	600887	伊利股份	40,000	1,145,200.00	0.56

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	36,698,000.00	17.79
	其中：政策性金融债	20,026,000.00	9.71
4	企业债券	230,071,245.00	111.54
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	19,614,000.00	9.51
7	可转债	2,858,437.00	1.39
8	中小企业私募债	13,000,000.00	6.30
9	其他	-	-
10	合计	302,241,682.00	146.53

5.5 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	122075	11柳钢债	311,770	31,173,882.30	15.11
2	140436	14农发36	200,000	20,026,000.00	9.71
3	122675	12杭城投	194,900	19,782,350.00	9.59
4	101461036	14鲁信创投MTN001	200,000	19,614,000.00	9.51
5	122292	13兴业01	160,000	16,672,000.00	8.08

5.6 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	119031	澜沧江3	100,000	9,874,482.19	4.79

5.7 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：本基金本报告期末投资贵金属。

5.8 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。

本报告编制日前一年内，中国银行间市场交易商协会发布了《交易商协会自律处分信息——2014.02.07》，本基金持有的"12杭城投"的发行主体——杭州市城市建设投资集团有限公司作为债务融资工具发行人，"12杭城投MTN1"13亿元募集资金共有5.73亿元未按募集说明书约定用途使用，且未提前披露。根据相关自律规定，经交易商协会秘书处专题办公会审议，给予杭州城投通报批评处分，并处责令改正。

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。

本基金持有的其余9名证券的发行主体本期未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。

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 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	178,014.76
2	应收证券清算款	140,386.95
3	应收股利	-
4	应收利息	7,309,326.68
5	应收申购款	678,152.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,305,880.93

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	128005	齐翔转债	2,594,960.00	1.26
2	110022	同仁转债	263,477.00	0.13

5.11.5 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。

5.11.6 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

项目	A/B级	C级
报告期期初基金份额总额	151,628,988.38	196,803,304.01
报告期期间基金总申购份额	17,812,377.75	107,337,197.68
减：报告期期间基金总赎回份额	67,105,178.33	213,791,016.69
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	102,336,187.80	90,349,485.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	-
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	-

注：买入/申购含红利再投资、转换入份额；卖出/赎回含转换出份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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信用增强债券型证券投资基金的文件
2、富国信用增强债券型证券投资基金基金合同
3、富国信用增强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、富国信用增强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
2015年01月21日