# 富国可转换债券证券投资基金

## 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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业银行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 | 富国可转换债券 |
| 基金主代码 | 100051 |
| 交易代码 | 前端交易代码:100051<br>后端交易代码:100052 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010年12月08日 |
| 报告期末基金份额总额(单位:份) | 748,131,505.00 |
| 投资目标 | 本基金主要利用可转债品种兼具债券和股票的特性,通过将"自上而下"宏观分析与"自下而上"个券选配有效结合,力争在锁定投资组合下方风险的基础上实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金主要投资于可转债品种,一方面通过利用可转债的债券特性,强调收益的安全性与稳定性,另一方面利用可转债的股票特性(内含股票期权),分享股市上涨所产生的较高收益。 |
| 业绩比较基准 | 本基金业绩比较基准=天相转债指数收益率×60%+沪深300指数收益率×20%+中债综合指数收益率×20%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,属于证券投资基金中风险较低的品种,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。本基金主要投资于可转换债券,在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。 |
| 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(2014年10月01日-2014年12月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 255,358,770.83 |
| 2.本期利润 | 495,346,044.55 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.4887 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,083,891,947.25 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.449 |

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。

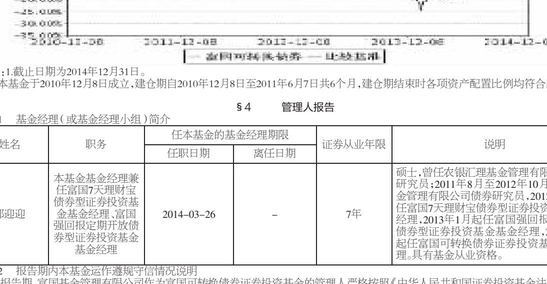
3.2 基金净值表现

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 | 60.64% | 2.42% | 33.84% | 1.43% | 26.80% | 0.99% |

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:1.截止日期为2014年12月31日。

2.本基金于2010年12月8日成立,建仓期自2010年12月8日至2011年6月7日共6个月,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 | | |
| 郑迎迎 | 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、富国强回报定期开放债券型证券投资基金基金经理 | 2014-03-26 | - | 7年 | 硕士,曾任农银汇理基金管理有限公司行业研究员;2011年8月至2012年10月任富国基金管理有限公司债券研究员,2012年10月起任富国7天理财宝债券型证券投资基金基金经理,2013年1月起任富国强回报定期开放债券型证券投资基金基金经理,2014年3月起任富国可转换债券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可转换债券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》、《富国可转换债券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 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度的转债市场主要受股市带动,出现大幅上涨,尤其是金融转债,涨幅较多。债券市场虽然受到了流动性紧张和质押券新规的冲击,但基本没有影响到转债品种的估值溢价,表现出债券投资者对权益市场的强烈看好。

在国庆地产政策出台后,我们认为压制市场估值的风险因素已经消除,各项改革政策的推出也将在拐点于四中全会的时间窗口,推行速度大大超出预期,权益市场存在确定的估值提升动力。在此背景下,本基金果断加仓转债,清除直至完全替代信用债仓位,在整个四季度充分利用了组合的高杠杆优势,成倍的获取权益市场的涨幅。在结构上,四季度前期组合中金融地产转债居多,后期超配交运、机械等其他补涨品种,基本上把握了市场轮动的脉络。

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60.64%,同期业绩比较基准收益率为33.84%。

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 | 206,905,088.93 | 11.78 |
| | 其中:股票 | 206,905,088.93 | 11.78 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,369,128,258.17 | 77.96 |
| | 其中:债券 | 1,369,128,258.17 | 77.96 |
| | 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 | 139,396,761.97 | 7.94 |
| 7 | 其他资产 | 40,780,439.34 | 2.32 |
| 8 | 合计 | 1,756,210,548.41 | 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 | 115,287,186.99 | 10.64 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 45,952,601.94 | 4.24 |
| 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 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 45,665,300.00 | 4.21 |
| 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 | 206,905,088.93 | 19.09 |

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 | 601727 | 上海电气 | 6,300,000 | 51,975,000.00 | 4.80 |
| 2 | 600820 | 隧道股份 | 5,563,269 | 45,952,601.94 | 4.24 |
| 3 | 000425 | 徐工机械 | 2,474,195 | 37,038,699.15 | 3.42 |
| 4 | 000024 | 招商地产 | 1,270,000 | 33,515,300.00 | 3.09 |
| 5 | 002318 | 久立特材 | 728,020 | 21,753,237.60 | 2.01 |
| 6 | 600067 | 冠城大通 | 1,500,000 | 12,150,000.00 | 1.12 |
| 7 | 600623 | 双钱股份 | 311,312 | 4,520,250.24 | 0.42 |

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 | 56,519,427.60 | 5.21 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中:政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 2,021,200.00 | 0.19 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 1,310,587,630.57 | 120.91 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 1,369,128,258.17 | 126.32 |

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 | 110023 | 民生转债 | 1,115,490 | 154,238,802.30 | 14.23 |
| 2 | 132001 | 14宝钢EB | 984,000 | 131,245,920.00 | 12.11 |
| 3 | 110015 | 石化转债 | 872,770 | 117,754,128.40 | 10.86 |
| 4 | 110027 | 东方转债 | 546,340 | 93,538,871.40 | 8.63 |
| 5 | 110029 | 浙能转债 | 659,460 | 92,298,021.60 | 8.52 |

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。

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。

本报告编制日前一年内,本基金持有的石化转债发行主体中国石油化工股份有限公司于2013年11月25日公告其位于青岛经济技术开发区的原油管道发生破裂,在开始抢险处置后,市政排水暗渠发生爆燃,导致周边行人、抢险人员的重大伤亡,中国政府已派出事故调查组进行全面调查。2014年1月13日,中国石油化工股份有限公司公告了国务院事故调查组对上述事故的调查处理结果。

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。

本基金持有的其余九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。

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 | 596,467.46 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,815,901.15 |
| 5 | 应收申购款 | 36,368,070.73 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 40,780,439.34 |

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 | 110023 | 民生转债 | 154,238,802.30 | 14.23 |
| 2 | 110015 | 石化转债 | 117,754,128.40 | 10.86 |
| 3 | 110017 | 中海转债 | 88,746,364.80 | 8.19 |
| 4 | 127002 | 徐工转债 | 85,905,733.45 | 7.93 |
| 5 | 113005 | 平安转债 | 81,421,741.80 | 7.51 |
| 6 | 110020 | 南山转债 | 79,393,414.80 | 7.32 |
| 7 | 110022 | 同仁转债 | 43,208,803.80 | 3.99 |
| 8 | 113001 | 中行转债 | 34,996,299.10 | 3.23 |
| 9 | 125089 | 深机转债 | 30,268,933.40 | 2.79 |
| 10 | 110011 | 歌华转债 | 30,186,405.10 | 2.79 |
| 11 | 128006 | 长青转债 | 23,789,220.78 | 2.19 |
| 12 | 113002 | 工行转债 | 20,876,156.70 | 1.93 |
| 13 | 110012 | 海运转债 | 7,512,252.30 | 0.69 |

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 | 600623 | 双钱股份 | 4,520,250.24 | 0.42 | 筹划重大事项 |

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 | 1,166,602,701.85 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 498,442,086.33 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 916,913,283.18 |
| 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 | 748,131,505.00 |

§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(%) | - |

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可转换债券证券投资基金的文件

2、富国可转换债券证券投资基金基金合同

3、富国可转换债券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、富国可转换债券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

# 富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金

## 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

2.1基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 富国上证综指ETF联接 |
| 基金主代码 | 100053 |
| 交易代码 | 前端交易代码:100053<br>后端交易代码:000164 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2011年01月30日 |
| 报告期末基金份额总额(单位:份) | 192,027,807.03 |
| 投资目标 | 通过主要投资于目标ETF,即富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 |
| 投资策略 | 本基金为目标ETF(富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金)的联接基金,主要通过投资于目标ETF以达到投资目标。当本基金申购赎回和买卖目标ETF,或基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,本管理人会在10个交易日内对投资组合进行适当调整,以便实现对跟踪误差的有效控制。 |
| 业绩比较基准 | 95%×上证综合指数收益率+5%×银行活期存款税后利率 |
| 风险收益特征 | 本基金为ETF联接基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金,跟踪上证综合指数,具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 |
| 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 |

2.1.1 目标基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 上证综指交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金交易代码 | 510210 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式(ETF) |
| 基金合同生效日 | 2011年01月30日 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2011年03月25日 |
| 基金管理人名称 | 富国基金管理有限公司 |
| 基金托管人名称 | 中国工商银行股份有限公司 |

2.1.2 目标基金产品概况

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 |
| 投资策略 | 上证综指交易型开放式指数证券投资基金采用最优化抽样复制标的指数。最优化抽样依托富国量化投资平台,利用长期稳定的风险模型,使用"跟踪误差最小化"的最优化方式创建目标组合,从而实现对标的指数的紧密跟踪。 |
| 业绩比较基准 | 上证综合指数 |
| 风险收益特征 | 上证综指交易型开放式指数证券投资基金属股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时上证综指交易型开放式指数证券投资基金为指数型基金,跟踪上证综合指数,具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 |

§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 | 4,909,256.02 |
| 2.本期利润 | 71,977,945.83 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.3026 |
| 4.期末基金资产净值 | 230,549,530.40 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.201 |

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 | 35.71% | 1.54% | 34.77% | 1.47% | 0.94% | 0.07% |

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。

本基金合同于2011年1月30日生效。本基金建仓期3个月,即从2011年1月30日起至2011年4月29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 | | |
| 王保合 | 本基金基金经理兼任量化投副总监、上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金经理、富国创业板指数分级证券投资基金基金经理、富国中证军工指数分级证券投资基金基金经理 | 2011-03-03 | - | 9年 | 博士,曾任富国基金管理有限公司研究员;富国沪深300增强证券投资基金基金经理助理;2011年3月起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,2013年9月起任富国创业板指数分级证券投资基金基金经理,2014年4月起任富国中证军工指数分级证券投资基金基金经理;兼任量化投资副总监;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上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接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》、《富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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。

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投资者对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。在非银金融等行业带动下,上证综指四季度整体上涨36.84%。

在投资管理上,我们坚持采取量化策略进行指数跟踪,报告期内,本基金的年化跟踪误差为1.60%。

展望2015年一季度,我们预计大类资产配置调整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,本基金份额净值增长率为35.71%,同期业绩比较基准收益率为34.77%。

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 | 454,065.00 | 0.19 |
| | 其中:股票 | 454,065.00 | 0.19 |
| 2 | 基金投资 | 217,347,865.53 | 91.81 |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 15,696,676.89 | 6.63 |
| 8 | 其他资产 | 3,232,925.94 | 1.37 |
| 9 | 合计 | 236,731,533.36 | 100.00 |

5.2 期末投资目标基金明细

金额单位:元

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 富国上证综指ETF | 股票型 | 交易型开放式 | 富国基金管理有限公司 | 217,347,865.53 | 94.27 |

5.3 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 | 193,927.00 | 0.08 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 177,190.00 | 0.08 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 73,980.00 | 0.03 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 8,968.00 | 0.00 |
| 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 | 454,065.00 | 0.20 |

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 | 600236 | 桂冠电力 | 37,700 | 177,190.00 | 0.08 |
| 2 | 600332 | 白云山 | 5,600 | 151,816.00 | 0.07 |
| 3 | 600575 | 皖江物流 | 18,000 | 73,980.00 | 0.03 |
| 4 | 601299 | 中国北车 | 2,000 | 14,200.00 | 0.01 |
| 5 | 601766 | 中国南车 | 2,000 | 12,760.00 | 0.01 |
| 6 | 601727 | 上海电气 | 1,100 | 9,075.00 | 0.00 |
| 7 | 601555 | 东吴证券 | 400 | 8,968.00 | 0.00 |
| 8 | 600664 | 哈药股份 | 700 | 6,076.00 | 0.00 |

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投资贵金属。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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。

本报告期内,本基金持有的"皖江物流"的发行主体——安徽皖江物流(集团)股份有限公司(以下简称"公司")于2014年10月11日公告其于2014年10月9日收到中国证监会《调查通知书》(编号:稽查总队调查通字142526号),公司因涉嫌信息披露违法违规被立案调查。

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。

5.12.2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 | 27,793.42 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,835,441.44 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,255.99 |
| 5 | 应收申购款 | 1,367,435.09 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 3,232,925.94 |

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

| 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 | 600236 | 桂冠电力 | 177,190.00 | 0.08 | 筹划重大事项 |
| 2 | 600332 | 白云山 | 151,816.00 | 0.07 | 筹划重大事项 |
| 3 | 600575 | 皖江物流 | 73,980.00 | 0.03 | 筹划重大事项 |
| 4 | 600664 | 哈药股份 | 6,076.00 | 0.00 | 筹划重大事项 |

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 | 266,191,099.54 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 49,499,769.53 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 123,663,062.04 |
| 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 | 192,027,807.03 |

§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 | 28,999,000.00 |
| 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 | 28,999,000.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 15.10 |

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上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金的文件

2、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合同

3、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议

4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件

5、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接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7天理财宝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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业银行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7天理财宝债券 | |
| 基金主代码 | 100007 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2012年10月19日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 20,060,433.30 | |
| 投资目标 | 本基金在追求本金安全、保持资产流动性的基础上,努力追求绝对收益,为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。 | |
| 投资策略 | 本基金将采用积极管理型的投资策略,将投资组合的平均剩余期限控制在127天以内,在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下,提高基金收益。 | |
| 业绩比较基准 | 七天通知存款利率(税后)。 | |
| 风险收益特征 | 本基金属于债券型证券投资基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场型证券投资基金。 | |
| 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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 富国7天理财宝债券A | 富国7天理财宝债券B |
| 下属分级基金的交易代码 | 100007 | 101007 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额(单位:份) | 20,060,433.30 | 0.00 |

§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级(2014年10月01日-2014年12月31日) | B级(2014年10月01日-2014年12月31日) |
|---|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 138,469.42 | 40,651.68 |
| 2.本期利润 | 138,469.42 | 40,651.68 |
| 3.期末基金资产净值 | 20,060,433.30 | - |

注:所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1)A级

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差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 | 0.5656% | 0.0030% | 0.3450% | 0.0000% | 0.2206% | 0.0030% |

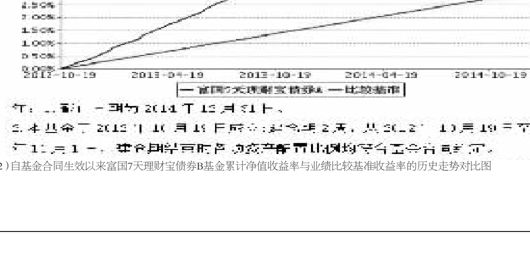
(2)B级

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差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 | 0.2533% | 0.0044% | 0.3450% | 0.0000% | -0.0917% | 0.0044% |

注:过去三个月指2014年10月01日—2014年12月31日

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

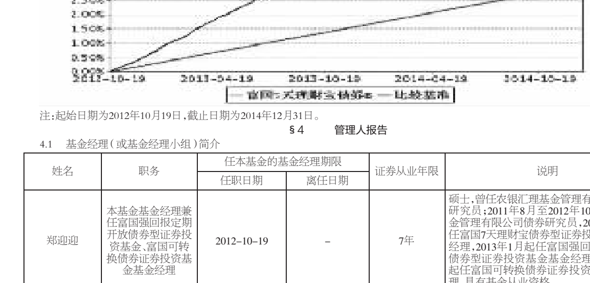
(1)自基金合同生效以来富国7天理财宝债券A基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图




注:1.截止日期为2014年12月31日。

2.本基金于2012年10月19日成立,建仓期2周,从2012年10月19日至2012年11月1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7天理财宝债券B基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图




注:起始日期为2012年10月19日,截止日期为2014年12月31日。

§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 | | |
| 郑迎迎 | 本基金基金经理兼任富国强回报定期开放债券型证券投资基金、富国可转换债券证券投资基金基金经理 | 2012-10-19 | - | 7年 | 硕士,曾任农银汇理基金管理有限公司行业研究员;2011年8月至2012年10月任富国基金管理有限公司债券研究员,2012年10月起任富国7天理财宝债券型证券投资基金基金经理,2013年1月起任富国强回报定期开放债券型证券投资基金基金经理,2014年3月起任富国可转换债券证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。 |
| 王颀亮 | 本基金基金经理兼任富国收益宝货币市场基金基金经理 | 2014-08-26 | - | 5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月起任富国7天理财宝债券型证券投资基金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7天理财宝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7天理财宝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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2014年4季度,宏观经济面仍然存在一定压力,维持着疲弱态势。CPI依旧低位运行,PPI同比已连续34个月为负值。市场处于紧平衡的格局,加之股票在四季度的突然崛起冲高,1个月内冲到了3000点以上开始奠定了股市的初步格局,每个月的新股分流以及年底银行交易清淡和节假日备付等因素,都是对债市的弱化。本季度,基金管理人严格按照基金合同进行投资管理,在确保流动性安全的前提下,积极配置回购与存款等流动性资产,为投资者获取了相应的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期,本基金净值收益率A级0.5656%、B级0.2533%,同期业绩比较基准收益率为A级0.3450%、B级0.3450%。

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

本基金自2014年8月27日至2014年12月8日已连续超过六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形,本基金已于2014年12月12日至2015年1月8日期间以通讯方式召开基金份额持有人大会,审议通过了《关于终止富国7天理财宝债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》,并于2015年1月13日进入财产清算期。

§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 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 10,500,126.00 | 50.66 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 3 | 银行存款和结算备付金合计 | 10,214,382.60 | 49.28 |
| 4 | 其他资产 | 12,895.88 | 0.06 |
| 5 | 合计 | 20,727,404.48 | 100.00 |

5.2 报告期债券回购融资情况

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例(%) |
|---|---|---|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | - |
| | 其中:买断式回购融资 | - |

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金资产净值的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | - | - |
| | 其中:买断式回购融资 | - | - |

注:本报告期内本基金不存在债券正回购。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的40%的说明

注:本报告期内本基金不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值的40%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|---|---|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 5 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 76 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 2 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过127天情况说明

注:本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过127天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例(%) | 各期限负债占基金资产净值的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 30天以内 | 103.29 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30天(含)—60天 | - | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60天(含)—90天 | - | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90天(含)—180天 | - | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 180天(含)—397天(含) | - | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 103.29 | - |

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 | 摊余成本(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 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | - | - |
| 9 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | - | - |

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况 |
|---|---|
| 报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数 | - |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.0065% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0083% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0051% |

注:以上数据按工作日统计

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 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明。

本基金采用固定份额净值,基金份额账面净值始终保持为人民币1.00元。

本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内平均摊销,每日计提收益或损失。

5.8.2 本报告期内基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的声明

本报告期内本基金不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

5.8.3 声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。

本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

5.8.4 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | 5,160.55 |
| 3 | 应收利息 | 7,735.33 |
| 4 | 应收申购款 | - |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 12,895.88 |

5.8.5 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 | B级 |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 25,413,818.18 | 0.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 19,586,284.85 | 59,106,309.06 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 24,939,669.73 | 59,106,309.06 |
| 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 | 20,060,433.30 | 0.00 |

注:红利再投资和基金转换转入作为本期申购资金的来源,统一计入本期总申购份额,基金转换转出作为本期赎回资金的来源,统一计入本期总赎回份额。

§7 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 影响投资者决策的其他重要信息

本基金于2014年12月12日至2015年1月8日期间以通讯方式召开基金份额持有人大会,此次大会审议通过了《关于终止富国7天理财宝债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》,并于2015年1月13日进入财产清算期。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立富国7天理财宝债券型证券投资基金的文件

2、富国7天理财宝债券型证券投资基金基金合同

3、富国7天理财宝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7天理财宝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

9.2 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

9.3 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